

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2023.3.25

つみたて全世界株式

追加型投信／内外／株式／インデックス型

この目論見書により行う「つみたて全世界株式」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2022年9月26日に関東財務局長に提出しており、2022年9月27日に効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

| | |
|----------|----------------------|
| 発行者名 | : 三菱UFJ国際投信株式会社 |
| 代表者の役職氏名 | : 取締役社長 横川 直 |
| 本店の所在の場所 | : 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号 |
| 縦覧に供する場所 | : 該当事項はありません。 |

目次

| | |
|---------------------|-----|
| 第一部【証券情報】 | 1 |
| (1)【ファンドの名称】 | 1 |
| (2)【内国投資信託受益証券の形態等】 | 1 |
| (3)【発行(売出)価額の総額】 | 1 |
| (4)【発行(売出)価格】 | 1 |
| (5)【申込手数料】 | 1 |
| (6)【申込単位】 | 1 |
| (7)【申込期間】 | 1 |
| (8)【申込取扱場所】 | 1 |
| (9)【払込期日】 | 2 |
| (10)【払込取扱場所】 | 2 |
| (11)【振替機関に関する事項】 | 2 |
| (12)【その他】 | 2 |
| 第二部【ファンド情報】 | 3 |
| 第1【ファンドの状況】 | 3 |
| 第2【管理及び運営】 | 40 |
| 第3【ファンドの経理状況】 | 46 |
| 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 | 168 |
| 第三部【委託会社等の情報】 | 169 |
| 第1【委託会社等の概況】 | 169 |
| 約款 | 211 |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

つみたて全世界株式（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位とします。

(7)【申込期間】

2022年9月27日から2023年9月25日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

(10)【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11)【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000 億円です。

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

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

商品分類表

| 単体型・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 |
|---------|--------|-------------------|-------|------------|
| 単体型 | 国内 | 株式 | MMF | インデックス型 |
| | 海外 | 債券 不動産投信 | | |
| 追加型 | 内外 | その他資産 () | E T F | 特殊型 () |
| | | 資産複合 | | |

属性区分表

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替 ヘッジ | 対象 インデックス | 特殊型 |
|---|----------------------------------|--------------------------------------|----------------------|-----------|---|-------------------------------|
| 株式 | 年1回 | グローバル (日本を含む) | ファミリー ファンド | あり () | 日経225 | ブル・ベア型 |
| 一般 大型株 中小型株 | 年2回 年4回 年6回 | 日本 北米 | ファンド・ オブ・ ファンズ | なし | TOPIX | 条件付運用型 |
| 債券 | (隔月) | 欧州 アジア オセアニア | | | その他 (MSCI オール・ カンントリー・ ワールド・ インデックス (配当込み、円 換算ベース)) | ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 |
| 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 () | 年12回 (毎月) 日々 その他 () | 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング | | | | その他 () |
| 不動産投信 | | | | | | |
| その他資産 (投資信託証券 (株式 一般)) | | | | | | |
| 資産複合 () | | | | | | |

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

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

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

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

属性区分の定義

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

| | | | |
|--------|----------|--|---|
| | | 中小型株 | 信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | 債券 | 一般 | 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。 |
| | | 公債 | 信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | | 社債 | 信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | | その他債券 | 信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 |
| | | クレジット属性 | 目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（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

日本を含む先進国および新興国の株式市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

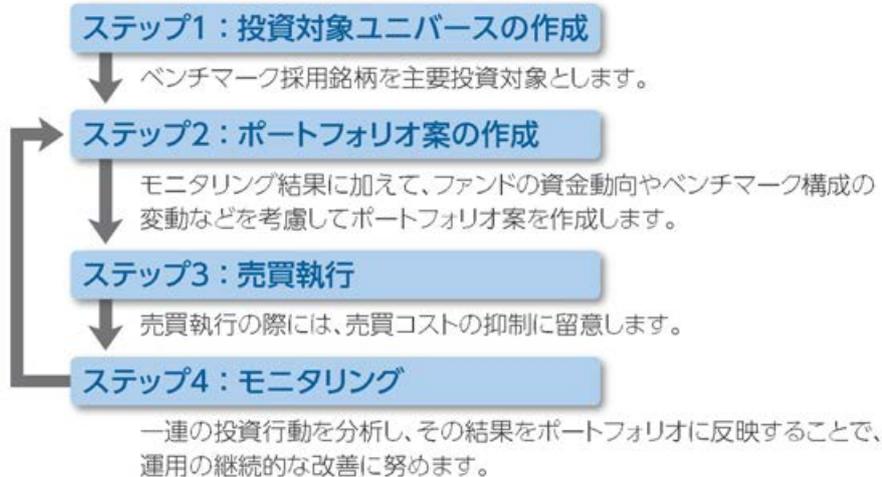
ファンドの特色

特色 1

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

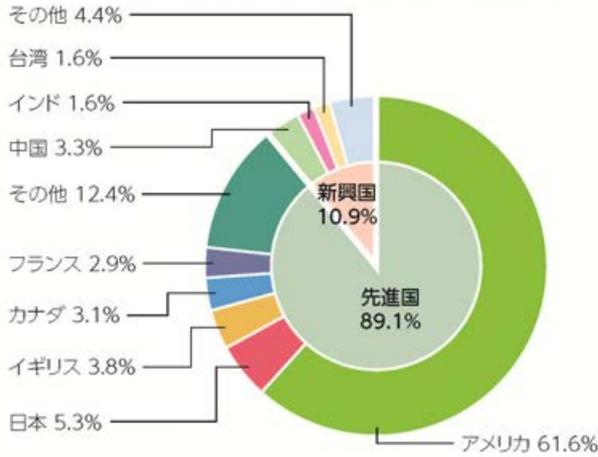
- MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。
 - ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。
-  MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の先進国・新興国の株式で構成されています。
- MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。
- MSCI オール・カントリー・ワールド・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。

<運用プロセスのイメージ>



-  上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。
-  委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

<対象インデックスの国・地域別構成比率>



先進国・地域 (23カ国・地域)

| | | |
|---------|--------|----------|
| アメリカ | オランダ | ベルギー |
| 日本 | スウェーデン | ノルウェー |
| イギリス | 香港 | イスラエル |
| カナダ | デンマーク | アイルランド |
| フランス | スペイン | ポルトガル |
| スイス | イタリア | オーストリア |
| ドイツ | シンガポール | ニュージーランド |
| オーストラリア | フィンランド | |

新興国・地域 (24カ国・地域)

| | | |
|---------|----------|-------|
| 中国 | タイ | チリ |
| インド | インドネシア | トルコ |
| 台湾 | マレーシア | ギリシャ |
| 韓国 | アラブ首長国連邦 | ペルー |
| ブラジル | カタール | ハンガリー |
| サウジアラビア | クウェート | コロンビア |
| 南アフリカ | フィリピン | チェコ |
| メキシコ | ポーランド | エジプト |

- 表示桁未満の数値がある場合、四捨五入しています。
- MSCI Inc.のデータを基に三菱UFJ国際投信作成(2022年11月末現在)

特色2

主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国および新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)への投資を行います。

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



特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。



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

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

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。

■ 主な投資制限

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

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

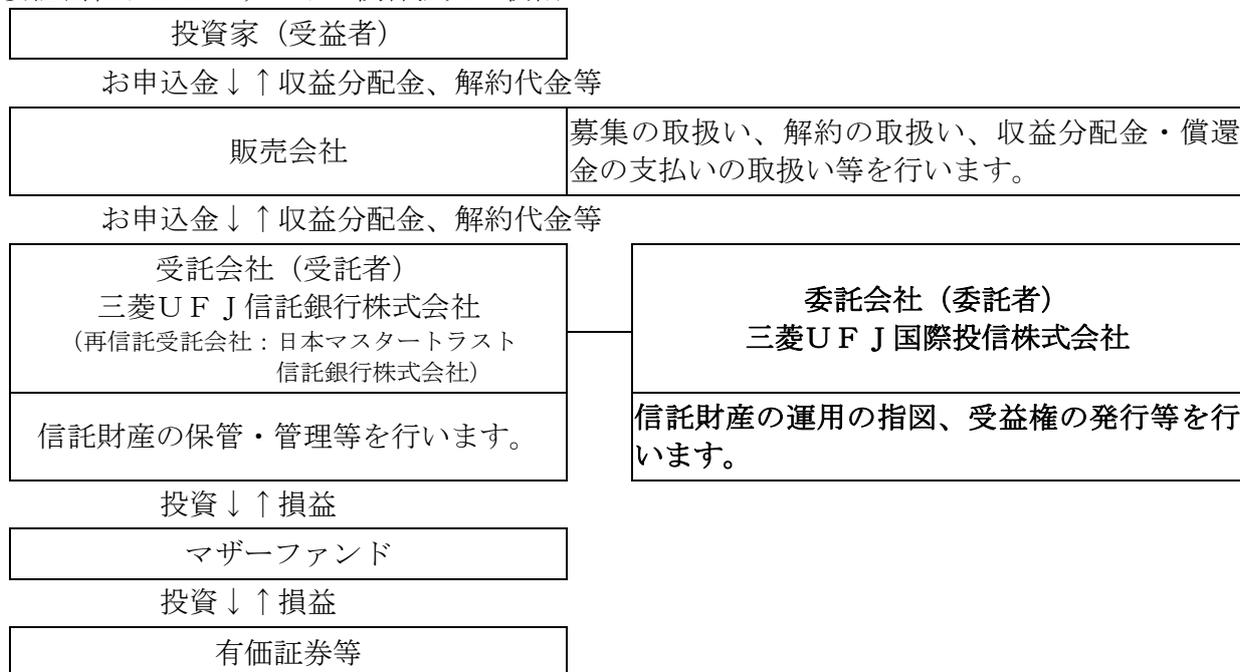
(2) 【ファンドの沿革】

2020年3月6日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況（2022年12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變更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券、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、主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国および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。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から 12. の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で 16. で定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下 16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 22. 外国の者に対する権利で 21. の有価証券の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、1. の証券または証書ならびに 13. および 19. の証券または証書のうち 1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から 6. までの証券ならびに 16. の証券ならびに 13. および 19. の証券または証書のうち 2. から 6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および 15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

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

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<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)

①投資対象

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

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

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

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

⑧外国為替予約取引を行うことができます。

⑨デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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、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）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)

①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。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている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)

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

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)

①投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の 1 口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

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。

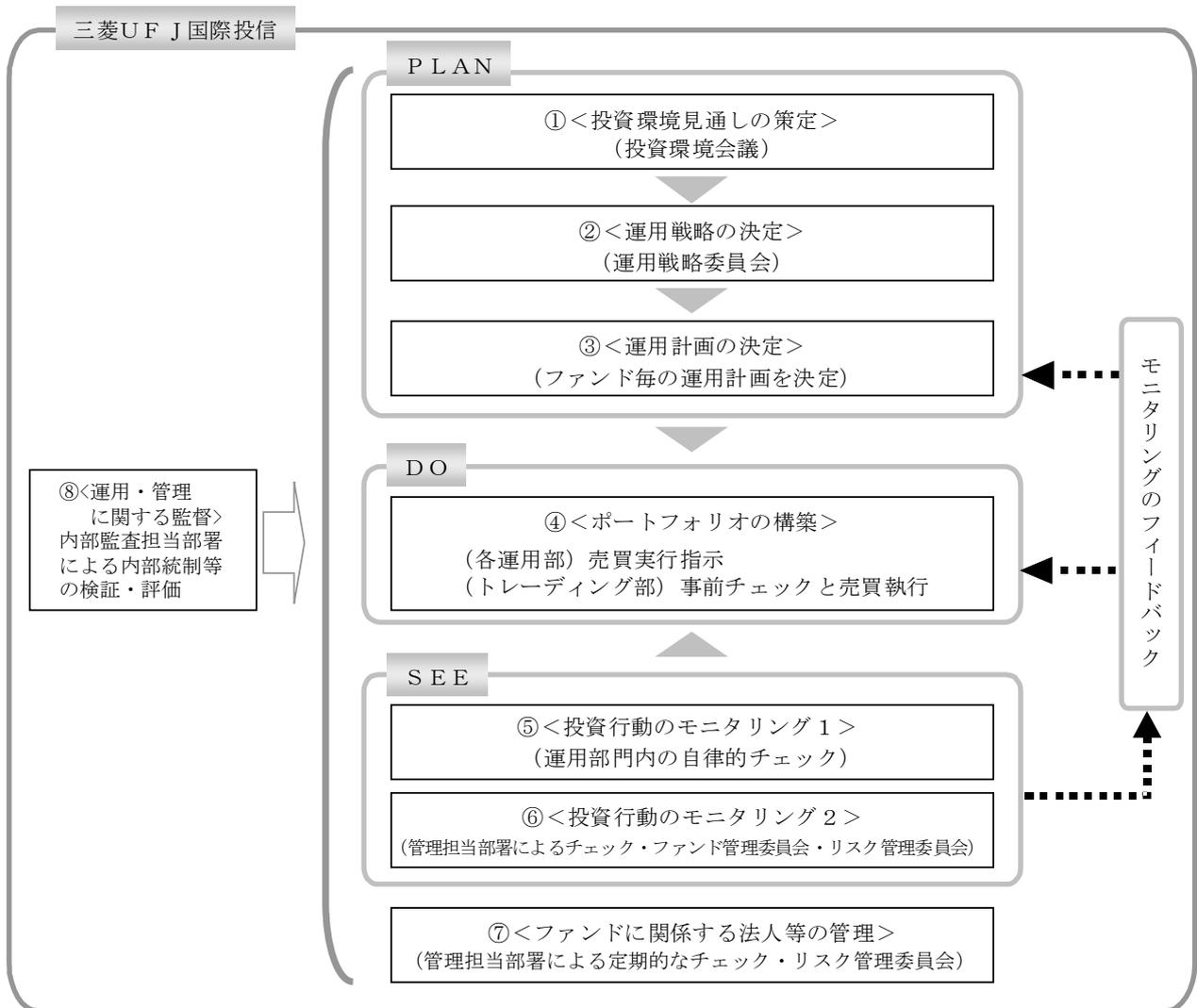
株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の 50%以下とします。

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)

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

(3) 【運用体制】



①投資環境見通しの策定

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

②運用戦略の決定

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

③運用計画の決定

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

④ポートフォリオの構築

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

⑤投資行動のモニタリング1

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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

⑥投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、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、ファンド管理委員会および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、必要に応じて是正を指示します。

⑦ファンドに関する法人等の管理

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

⑧運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②投資信託証券

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

③同一銘柄の転換社債等

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

型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

④スワップ取引

- a. 委託会社は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑤信用取引

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

⑥外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産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。

⑦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るときは、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。

⑧資金の借入れ

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

とします。

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

⑨投資する株式等の範囲

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑪有価証券の貸付

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

⑫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⑦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。

⑬特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑭デリバティブ取引等

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

⑮信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則とし

て、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3 【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動 リスク

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。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりは小さかった場合も同様です。

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

- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、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の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

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

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

②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、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

③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。

④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。

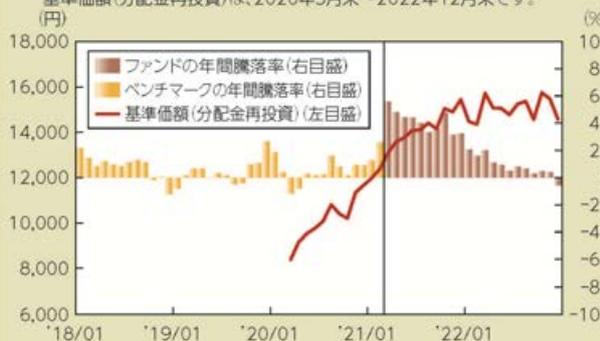
*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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3月～2022年12月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2018年1月～2021年2月です。
基準価額(分配金再投資)は、2020年3月末～2022年12月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018年1月末～2022年12月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2021年2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範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。 |
| 先進国株 | MSCIコクサイ・インデックス (配当込み) | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。 |
| 新興国株 | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。 |
| 日本国債 | NOMURA-BPI(国債) | NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。 |
| 先進国債 | FTSE世界国債インデックス (除く日本) | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。 |

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

(3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 0.22%（税抜 0.20%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

| 支払先 | 配分（税抜） | 対価として提供する役務の内容 |
|------|--------|---|
| 委託会社 | 0.09% | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等 |
| 販売会社 | 0.09% | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等 |
| 受託会社 | 0.02% | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等 |

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド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。

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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

1. 収益分配金の課税

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

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

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

②法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

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

◇個別元本について

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

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

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

◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は 2022 年 12 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】

【つみたて全世界株式】

(1)【投資状況】

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|------|-------------|----------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 834,313,484 | 99.50 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 4,202,229 | 0.50 |
| 純資産総額 | | 838,515,713 | 100.00 |

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|------|-----------|--------------------|-------------|----------|-------------|----------|-------------|----------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックスマザーファンド | 155,569,923 | 4.5839 | 713,131,704 | 4.4629 | 694,293,009 | 82.80 |
| 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 | 32,105,928 | 3.0444 | 97,745,034 | 2.9240 | 93,877,733 | 11.20 |
| 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 | 35,744,630 | 1.3084 | 46,771,127 | 1.2909 | 46,142,742 | 5.50 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4 年 12 月 30 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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年12月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

| | 純資産総額 | | 基準価額 (1万口当たりの純資産価額) | |
|----------------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第1計算期間末日 (令和2年6月25日) | 3,144,556 | 3,144,556 | 9,714 | 9,714 |
| 第2計算期間末日 (令和3年6月25日) | 98,244,642 | 98,244,642 | 14,089 | 14,089 |
| 第3計算期間末日 (令和4年6月27日) | 471,731,038 | 471,731,038 | 14,795 | 14,795 |
| 令和3年12月末日 | 250,877,172 | — | 15,447 | — |
| 令和4年1月末日 | 267,396,049 | — | 14,473 | — |
| 2月末日 | 293,781,704 | — | 14,355 | — |
| 3月末日 | 377,179,317 | — | 15,721 | — |
| 4月末日 | 399,890,264 | — | 15,066 | — |
| 5月末日 | 444,782,067 | — | 15,059 | — |
| 6月末日 | 483,211,692 | — | 14,772 | — |
| 7月末日 | 551,339,391 | — | 15,238 | — |
| 8月末日 | 610,685,535 | — | 15,373 | — |
| 9月末日 | 637,633,971 | — | 14,564 | — |
| 10月末日 | 755,321,324 | — | 15,748 | — |
| 11月末日 | 810,398,169 | — | 15,471 | — |
| 12月末日 | 838,515,713 | — | 14,571 | — |

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

| | 収益率 (%) |
|-----------|---------|
| 第1 計算期間 | △2.86 |
| 第2 計算期間 | 45.03 |
| 第3 計算期間 | 5.01 |
| 第4 中間計算期間 | △1.32 |

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配の額）を控除した額を当該基準価額（分配の額）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 | 3,414,888 | 177,744 | 3,237,144 |
| 第2 計算期間 | 72,559,406 | 6,064,495 | 69,732,055 |
| 第3 計算期間 | 277,554,459 | 28,433,848 | 318,852,666 |
| 第4 中間計算期間 | 262,849,663 | 18,490,171 | 563,212,158 |

(参考)

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和4年12月30日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|-------|---------------|-------------------|----------|
| 株式 | アメリカ | 1,321,810,149,314 | 68.37 |
| | イギリス | 86,734,371,302 | 4.49 |
| | カナダ | 68,582,893,702 | 3.55 |
| | フランス | 62,440,058,301 | 3.23 |
| | スイス | 58,305,696,855 | 3.02 |
| | ドイツ | 46,113,185,212 | 2.39 |
| | オーストラリア | 42,371,764,194 | 2.19 |
| | オランダ | 32,349,592,204 | 1.67 |
| | スウェーデン | 19,161,340,738 | 0.99 |
| | デンマーク | 16,846,906,503 | 0.87 |
| | 香港 | 15,836,737,820 | 0.82 |
| | スペイン | 14,141,830,916 | 0.73 |
| | イタリア | 9,993,317,338 | 0.52 |
| | シンガポール | 6,776,273,032 | 0.35 |
| | フィンランド | 5,876,927,170 | 0.30 |
| | ベルギー | 4,874,553,688 | 0.25 |
| ノルウェー | 4,436,681,814 | 0.23 | |

| | | | |
|--------------------------|----------|-------------------|--------|
| | アイルランド | 3,931,989,556 | 0.20 |
| | イスラエル | 2,778,562,559 | 0.14 |
| | ルクセンブルグ | 1,324,297,937 | 0.07 |
| | ポルトガル | 1,118,035,768 | 0.06 |
| | オーストリア | 1,112,306,784 | 0.06 |
| | ニュージーランド | 1,096,832,613 | 0.06 |
| | 小計 | 1,828,014,305,320 | 94.55 |
| 投資証券 | アメリカ | 36,999,756,794 | 1.91 |
| | オーストラリア | 2,282,000,696 | 0.12 |
| | シンガポール | 821,559,367 | 0.04 |
| | イギリス | 799,455,006 | 0.04 |
| | フランス | 744,485,699 | 0.04 |
| | 香港 | 580,814,988 | 0.03 |
| | カナダ | 218,175,861 | 0.01 |
| | ベルギー | 194,645,834 | 0.01 |
| | 小計 | 42,640,894,245 | 2.21 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 62,700,014,115 | 3.24 |
| 純資産総額 | | 1,933,355,213,680 | 100.00 |

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

その他の資産の投資状況

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|----------|----|---------|----------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 48,038,544,537 | 2.48 |
| | 買建 | カナダ | 2,561,284,018 | 0.13 |
| | 買建 | ドイツ | 7,936,421,729 | 0.41 |
| | 買建 | オーストラリア | 2,478,399,660 | 0.13 |
| | 買建 | イギリス | 3,060,816,000 | 0.16 |
| | 買建 | スイス | 2,044,414,020 | 0.11 |

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|----|-----------|----------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハ | 4,823,452 | 19,389.84 | 93,526,001,199 | 17,199.24 | 82,959,742,341 | 4.29 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|-----------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| | | | ードウェアおよび機器 | | | | | | |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 2,126,697 | 34,303.24 | 72,952,601,811 | 31,982.02 | 68,016,080,875 | 3.52 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 2,751,822 | 14,071.53 | 38,722,368,960 | 11,170.68 | 30,739,739,490 | 1.59 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 1,797,610 | 14,722.71 | 26,465,705,576 | 11,737.31 | 21,099,114,817 | 1.09 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 280,686 | 65,491.87 | 18,382,651,349 | 70,315.07 | 19,736,457,422 | 1.02 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 1,666,634 | 14,434.86 | 24,057,639,512 | 11,803.66 | 19,672,389,414 | 1.02 |
| 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 | 789,462 | 23,293.87 | 18,389,630,102 | 23,562.21 | 18,601,471,010 | 0.96 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 1,250,490 | 11,806.39 | 14,763,779,149 | 14,490.84 | 18,120,650,512 | 0.94 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 390,517 | 40,712.04 | 15,898,746,866 | 41,012.26 | 16,015,985,519 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 879,945 | 15,782.27 | 13,887,530,401 | 17,678.29 | 15,555,926,414 | 0.80 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 家庭用品・パーソナル用品 | 716,438 | 19,932.89 | 14,280,686,920 | 20,248.69 | 14,506,933,116 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 747,266 | 21,789.00 | 16,282,183,152 | 19,378.18 | 14,480,655,803 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 490,850 | 26,271.49 | 12,895,365,071 | 27,609.56 | 13,552,153,508 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 557,963 | 21,608.27 | 12,056,617,877 | 23,663.06 | 13,203,114,179 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 307,210 | 37,879.77 | 11,637,046,013 | 42,518.40 | 13,062,079,814 | 0.68 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 799,357 | 31,847.11 | 25,457,210,659 | 16,165.51 | 12,922,016,774 | 0.67 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 825,613 | 17,174.17 | 14,179,218,071 | 15,561.29 | 12,847,605,302 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A | ソフトウェア・サービス | 259,022 | 43,337.32 | 11,225,320,669 | 46,207.46 | 11,968,750,517 | 0.62 |
| 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 | 242,430 | 39,474.23 | 9,569,739,743 | 48,703.55 | 11,807,202,596 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,684,871 | 6,567.07 | 11,064,671,665 | 6,811.49 | 11,476,483,653 | 0.59 |
| 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 | 530,424 | 20,135.30 | 10,680,250,224 | 21,571.71 | 11,442,153,766 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・ | 760,423 | 12,063.13 | 9,173,082,367 | 14,705.81 | 11,182,639,199 | 0.58 |

| | | | | | | | | | |
|-------|----|------------------------------|------------------------|-----------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| | | | バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | | | | | |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 684,475 | 23,771.39 | 16,270,925,467 | 15,958.50 | 10,923,195,656 | 0.56 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 1,233,343 | 8,436.83 | 10,405,510,511 | 8,486.16 | 10,466,352,200 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 414,280 | 22,715.87 | 9,410,731,134 | 24,148.74 | 10,004,342,493 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 2,169,602 | 4,662.00 | 10,114,697,393 | 4,397.67 | 9,541,210,984 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半導体製造装置 | 121,187 | 73,551.21 | 8,913,450,644 | 74,021.38 | 8,970,429,826 | 0.46 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 121,959 | 72,170.40 | 8,801,830,909 | 73,097.54 | 8,914,903,978 | 0.46 |
| 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 | 497,370 | 14,559.33 | 7,241,375,679 | 17,895.91 | 8,900,892,736 | 0.46 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 210,688 | 46,746.44 | 9,848,915,053 | 42,094.25 | 8,868,755,240 | 0.46 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|------------------------|----------|
| 株式 | エネルギー | 5.75 |
| | 素材 | 4.35 |
| | 資本財 | 6.56 |
| | 商業・専門サービス | 1.20 |
| | 運輸 | 1.85 |
| | 自動車・自動車部品 | 1.48 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.60 |
| | 消費者サービス | 1.84 |
| | メディア・娯楽 | 4.61 |
| | 小売 | 4.25 |
| | 食品・生活必需品小売り | 1.49 |
| | 食品・飲料・タバコ | 4.39 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.86 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 4.96 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.42 |
| 銀行 | 5.91 | |

| | | |
|------|--------------------|-------|
| | 各種金融 | 4.71 |
| | 保険 | 3.38 |
| | 不動産 | 0.35 |
| | ソフトウェア・サービス | 10.11 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.72 |
| | 電気通信サービス | 1.41 |
| | 公益事業 | 3.25 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.10 |
| | 小計 | 94.55 |
| 投資証券 | — | 2.21 |
| 合計 | | 96.76 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 資産の種類 | 地域 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 | 簿価金額 (円) | 評価金額 | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|---------|-------------------|--------------|----|-------|-----------|---------------|----------------|-------------|----------------|----------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所 | SP EMINI2303 | 買建 | 1,870 | アメリカドル | 369,222,248.6 | 48,995,792,389 | 362,008,625 | 48,038,544,537 | 2.48 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | SP/TSE602303 | 買建 | 111 | カナダドル | 26,519,309.25 | 2,595,975,182 | 26,164,920 | 2,561,284,018 | 0.13 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO ST 2303 | 買建 | 1,456 | ユーロ | 56,872,438.4 | 8,045,743,860 | 56,099,680 | 7,936,421,729 | 0.41 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 2303 | 買建 | 159 | オーストラリアドル | 28,261,762.25 | 2,531,406,044 | 27,669,975 | 2,478,399,660 | 0.13 |
| | イギリス | インターコンチネンタル取引所 | FTSE100 2303 | 買建 | 255 | イギリスポンド | 19,058,703.75 | 3,049,392,600 | 19,130,100 | 3,060,816,000 | 0.16 |
| | スイス | ユーレックス・チューリッヒ取引所 | SWISS IX2303 | 買建 | 132 | スイスフラン | 14,372,084.2 | 2,065,843,383 | 14,223,000 | 2,044,414,020 | 0.11 |

(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

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|-------|------|----------------|----------|
| 株式 | 香港 | 84,481,005,075 | 23.25 |

| | | | |
|--------------------------|----------|-----------------|--------|
| | インド | 50,224,976,243 | 13.82 |
| | 台湾 | 47,478,404,849 | 13.06 |
| | 韓国 | 39,319,934,050 | 10.82 |
| | ブラジル | 18,089,418,864 | 4.98 |
| | 中国 | 17,588,074,450 | 4.84 |
| | サウジアラビア | 14,230,751,967 | 3.92 |
| | 南アフリカ | 12,719,409,856 | 3.50 |
| | アメリカ | 10,416,278,350 | 2.87 |
| | メキシコ | 7,837,373,324 | 2.16 |
| | タイ | 7,700,351,762 | 2.12 |
| | インドネシア | 6,515,234,331 | 1.79 |
| | マレーシア | 5,391,244,546 | 1.48 |
| | アラブ首長国連邦 | 4,612,009,899 | 1.27 |
| | カタール | 3,465,807,255 | 0.95 |
| | クウェート | 3,254,806,550 | 0.90 |
| | フィリピン | 2,530,527,448 | 0.70 |
| | ポーランド | 2,472,560,481 | 0.68 |
| | トルコ | 2,294,662,872 | 0.63 |
| | チリ | 1,904,918,129 | 0.52 |
| | ギリシャ | 1,093,399,522 | 0.30 |
| | ハンガリー | 683,985,818 | 0.19 |
| | チェコ | 492,763,345 | 0.14 |
| | コロンビア | 411,738,063 | 0.11 |
| | 小計 | 345,209,637,049 | 94.99 |
| 投資証券 | メキシコ | 229,041,517 | 0.06 |
| | 南アフリカ | 190,620,619 | 0.05 |
| | 小計 | 419,662,136 | 0.12 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 17,789,194,695 | 4.89 |
| 純資産総額 | | 363,418,493,880 | 100.00 |

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

その他の資産の投資状況

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 建別 | 国／地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|----------|----|------|----------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 17,791,087,009 | 4.90 |

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和4年12月30日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---------|----|------------------------------|--------------------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|---------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 10,146,000 | 2,212.10 | 22,444,047,996 | 1,924.80 | 19,529,043,121 | 5.37 |
| 香港 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 2,577,200 | 5,864.36 | 15,113,646,024 | 5,705.10 | 14,703,194,029 | 4.05 |
| 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 | 1,969,037 | 6,814.05 | 13,417,133,272 | 5,834.15 | 11,487,657,214 | 3.16 |
| 香港 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 小売 | 6,113,300 | 1,473.88 | 9,010,309,319 | 1,456.06 | 8,901,337,711 | 2.45 |
| 香港 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 小売 | 1,820,600 | 2,822.35 | 5,138,387,146 | 3,128.27 | 5,695,339,286 | 1.57 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 1,256,655 | 3,997.58 | 5,023,583,490 | 4,094.71 | 5,145,641,565 | 1.42 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 1,588,429 | 1,954.66 | 3,104,854,226 | 2,229.48 | 3,541,376,558 | 0.97 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 1,392,150 | 2,449.88 | 3,410,601,368 | 2,443.25 | 3,401,378,144 | 0.94 |
| 香港 | 株式 | JD.COM INC - CL A | 小売 | 892,983 | 3,641.31 | 3,251,634,463 | 3,710.36 | 3,313,288,404 | 0.91 |
| 香港 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 39,666,550 | 91.83 | 3,642,842,410 | 83.05 | 3,294,608,443 | 0.91 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 2,125,559 | 1,190.98 | 2,531,510,124 | 1,461.96 | 3,107,483,298 | 0.86 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 各種金融 | 712,673 | 3,634.12 | 2,589,943,109 | 4,307.39 | 3,069,763,404 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | PINDUODUO INC-ADR | 小売 | 209,284 | 5,871.93 | 1,228,903,015 | 10,935.80 | 2,288,689,432 | 0.63 |
| 香港 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 2,614,000 | 805.93 | 2,106,712,878 | 862.91 | 2,255,657,196 | 0.62 |
| 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 | 5,103,272 | 447.69 | 2,284,692,821 | 430.27 | 2,195,811,840 | 0.60 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 810,799 | 3,646.28 | 2,956,407,122 | 2,659.82 | 2,156,582,639 | 0.59 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 小売 | 90,265 | 13,285.41 | 1,199,208,259 | 22,326.10 | 2,015,265,417 | 0.55 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 377,224 | 5,423.11 | 2,045,728,593 | 5,262.68 | 1,985,212,029 | 0.55 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 339,760 | 6,040.38 | 2,052,282,236 | 5,327.75 | 1,810,156,340 | 0.50 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 226,760 | 11,314.55 | 2,565,688,817 | 7,912.50 | 1,794,238,500 | 0.49 |
| 香港 | 株式 | BAIDU INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 918,174 | 1,872.79 | 1,719,550,748 | 1,872.20 | 1,719,005,363 | 0.47 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 632,236 | 3,406.86 | 2,153,941,347 | 2,714.57 | 1,716,252,229 | 0.47 |
| インドネシア | 株式 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 銀行 | 22,897,800 | 66.07 | 1,513,023,883 | 72.88 | 1,668,963,398 | 0.46 |
| サウジアラビア | 株式 | THE SAUDI NATIONAL BANK | 銀行 | 909,717 | 2,619.07 | 2,382,618,077 | 1,786.18 | 1,624,922,860 | 0.45 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|------------------------------|------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 香港 | 株式 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 23,478,350 | 75.17 | 1,764,999,696 | 68.25 | 1,602,402,083 | 0.44 |
| 香港 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 32,644,000 | 50.77 | 1,657,641,402 | 48.33 | 1,577,906,499 | 0.43 |
| 香港 | 株式 | NETEASE INC | メディア・娯楽 | 816,695 | 2,432.40 | 1,986,532,721 | 1,894.32 | 1,547,086,573 | 0.43 |
| 香港 | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1,465,000 | 922.64 | 1,351,669,340 | 1,013.54 | 1,484,837,565 | 0.41 |
| メキシコ | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 電気通信サービス | 11,733,400 | 128.42 | 1,506,816,295 | 122.13 | 1,433,107,620 | 0.39 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG SDI CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 22,978 | 61,701.29 | 1,417,772,402 | 62,350.50 | 1,432,689,789 | 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

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------------------|------------------------|----------|
| 株式 | エネルギー | 4.65 |
| | 素材 | 8.42 |
| | 資本財 | 3.71 |
| | 商業・専門サービス | 0.08 |
| | 運輸 | 2.02 |
| | 自動車・自動車部品 | 3.02 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.56 |
| | 消費者サービス | 1.38 |
| | メディア・娯楽 | 6.54 |
| | 小売 | 7.51 |
| | 食品・生活必需品小売り | 1.35 |
| | 食品・飲料・タバコ | 3.87 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.85 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 1.04 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.83 |
| | 銀行 | 15.15 |
| | 各種金融 | 3.21 |
| | 保険 | 2.62 |
| | 不動産 | 1.73 |
| | ソフトウェア・サービス | 2.46 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.37 | |
| 電気通信サービス | 2.88 | |
| 公益事業 | 2.89 | |
| 半導体・半導体製造装置 | 7.85 | |

| | | |
|------|---|-------|
| 小計 | | 94.99 |
| 投資証券 | — | 0.12 |
| 合計 | | 95.11 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 資産の種類 | 地域 | 取引所名 | 資産の名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 | 簿価金額 (円) | 評価金額 | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|------|-------------|--------------|----|-------|--------|---------------|----------------|-------------|----------------|----------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | ニューヨーク証券取引所 | MINI MS 2303 | 買建 | 2,751 | アメリカドル | 133,228,547.1 | 17,679,428,200 | 134,069,985 | 17,791,087,009 | 4.90 |

(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

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|--------------------------|------|----------------|----------|
| 株式 | 日本 | 43,034,428,000 | 97.60 |
| 投資証券 | 日本 | 528,032,100 | 1.20 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | — | 529,056,892 | 1.20 |
| 純資産総額 | | 44,091,516,992 | 100.00 |

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

その他の資産の投資状況

令和 4 年 12 月 30 日現在

(単位：円)

| 資産の種類 | 建別 | 国/地域 | 時価合計 | 投資比率 (%) |
|----------|----|------|-------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 605,280,000 | 1.37 |

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

令和 4 年 12 月 30 日現在

| 国/ | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 | 簿価 | 評価 | 評価 | 投資 |
|----|----|-----|----|----|----|----|----|----|----|
|----|----|-----|----|----|----|----|----|----|----|

| 地域 | | | | | 単価 (円) | 金額 (円) | 単価 (円) | 金額 (円) | 比率 (%) |
|----|----|-------------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 1,120,400 | 2,058.53 | 2,306,381,841 | 1,812.50 | 2,030,725,000 | 4.61 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 133,200 | 10,806.21 | 1,439,387,379 | 10,035.00 | 1,336,662,000 | 3.03 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 1,262,900 | 731.89 | 924,308,125 | 889.00 | 1,122,718,100 | 2.55 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 20,600 | 52,429.23 | 1,080,042,293 | 51,420.00 | 1,059,252,000 | 2.40 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 185,100 | 3,856.74 | 713,883,040 | 4,250.00 | 786,675,000 | 1.78 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 138,000 | 4,219.61 | 582,306,688 | 5,296.00 | 730,848,000 | 1.66 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 127,400 | 5,569.28 | 709,527,365 | 5,644.00 | 719,045,600 | 1.63 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 102,300 | 6,604.52 | 675,642,436 | 6,691.00 | 684,489,300 | 1.55 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 170,400 | 4,243.70 | 723,128,045 | 3,982.00 | 678,532,800 | 1.54 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 158,800 | 3,834.79 | 608,966,110 | 4,111.00 | 652,826,800 | 1.48 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 116,600 | 5,958.99 | 694,818,481 | 5,532.00 | 645,031,200 | 1.46 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 39,600 | 16,618.48 | 658,092,081 | 16,225.00 | 642,510,000 | 1.46 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 152,300 | 4,493.84 | 684,412,036 | 4,177.00 | 636,157,100 | 1.44 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 15,800 | 45,660.19 | 721,431,031 | 38,880.00 | 614,304,000 | 1.39 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 151,400 | 3,370.51 | 510,296,677 | 3,853.00 | 583,344,200 | 1.32 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 133,400 | 4,278.38 | 570,736,452 | 4,283.00 | 571,352,200 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 194,000 | 2,573.78 | 499,313,646 | 2,827.50 | 548,535,000 | 1.24 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 26,300 | 21,837.76 | 574,333,314 | 20,200.00 | 531,260,000 | 1.20 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 172,200 | 3,346.73 | 576,307,218 | 3,032.00 | 522,110,400 | 1.18 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 125,600 | 3,929.20 | 493,508,571 | 4,146.00 | 520,737,600 | 1.18 |
| 日本 | 株式 | ファーストリテイリング | 小売業 | 6,200 | 75,465.06 | 467,883,420 | 80,530.00 | 499,286,000 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 38,100 | 13,516.71 | 514,986,864 | 12,705.00 | 484,060,500 | 1.10 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 126,300 | 3,855.53 | 486,954,657 | 3,762.00 | 475,140,600 | 1.08 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 254,900 | 1,612.80 | 411,102,997 | 1,856.00 | 473,094,400 | 1.07 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 303,500 | 1,486.79 | 451,242,337 | 1,488.00 | 451,608,000 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 79,600 | 5,581.53 | 444,290,327 | 5,660.00 | 450,536,000 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 21,100 | 20,153.59 | 425,240,782 | 19,160.00 | 404,276,000 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 20,300 | 20,929.63 | 424,871,550 | 19,835.00 | 402,650,500 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 60,700 | 7,464.17 | 453,075,352 | 6,588.00 | 399,891,600 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 194,000 | 2,041.00 | 395,954,792 | 2,006.50 | 389,261,000 | 0.88 |

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

令和4年12月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-----|----------|
| 株式 | 鉱業 | 0.35 |
| | 建設業 | 1.37 |

| | | |
|------|------------|-------|
| | 食料品 | 3.19 |
| | 繊維製品 | 0.24 |
| | パルプ・紙 | 0.10 |
| | 化学 | 5.86 |
| | 医薬品 | 6.59 |
| | 石油・石炭製品 | 0.48 |
| | ゴム製品 | 0.64 |
| | ガラス・土石製品 | 0.45 |
| | 鉄鋼 | 0.62 |
| | 非鉄金属 | 0.53 |
| | 金属製品 | 0.28 |
| | 機械 | 4.36 |
| | 電気機器 | 18.93 |
| | 輸送用機器 | 8.69 |
| | 精密機器 | 2.69 |
| | その他製品 | 2.29 |
| | 電気・ガス業 | 1.03 |
| | 陸運業 | 2.91 |
| | 海運業 | 0.63 |
| | 空運業 | 0.20 |
| | 情報・通信業 | 8.30 |
| | 卸売業 | 5.54 |
| | 小売業 | 3.52 |
| | 銀行業 | 6.51 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.67 |
| | 保険業 | 3.19 |
| | その他金融業 | 0.94 |
| | 不動産業 | 1.78 |
| | サービス業 | 4.69 |
| | 小計 | 97.60 |
| 投資証券 | — | 1.20 |
| 合計 | | 98.80 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

令和 4 年 12 月 30 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 23年03月限 | 買建 | 32 | 円 | 623,537,600 | 605,280,000 | 1.37 |
|----------|-------|---------------|----|----|---|-------------|-------------|------|

(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》

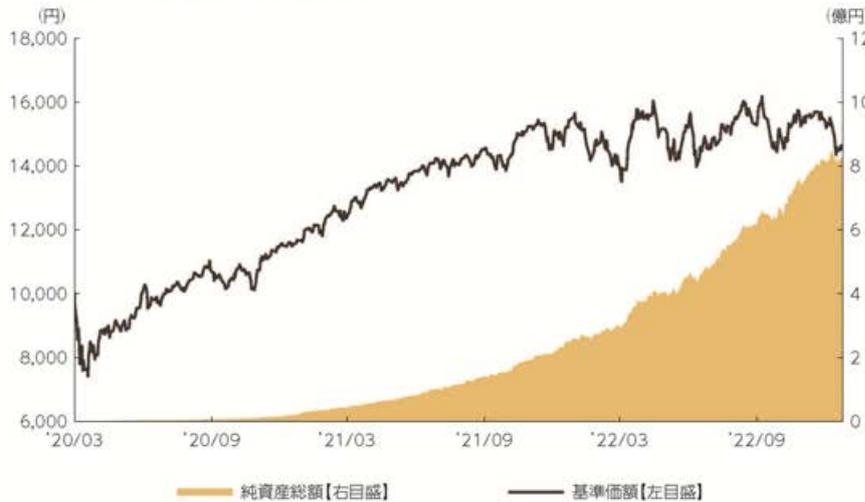


運用実績



2022年12月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2020年3月6日(設定日)～2022年12月30日



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

■基準価額・純資産

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 14,571円 |
| 純資産総額 | 8.3億円 |

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

| | |
|---------|----|
| 2022年6月 | 0円 |
| 2021年6月 | 0円 |
| 2020年6月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

•分配金は1万円当たり、税引前

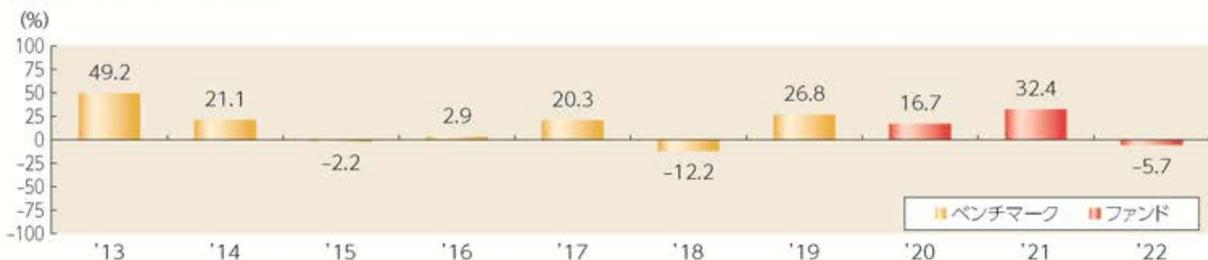
■主要な資産の状況

| 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 | 61.1% | 1 APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | アメリカ | 3.6% |
| 2 ユーロ | 8.2% | 2 MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | アメリカ | 2.9% |
| 3 円 | 5.8% | 3 AMAZON.COM INC | 小売 | アメリカ | 1.3% |
| 4 イギリスポンド | 3.9% | 4 ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | アメリカ | 0.9% |
| 5 香港ドル | 3.3% | 5 UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスクエア機器・サービス | アメリカ | 0.8% |
| 6 カナダドル | 3.1% | 6 ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | アメリカ | 0.8% |
| 7 スイスフラン | 2.6% | 7 JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | アメリカ | 0.8% |
| 8 オーストラリアドル | 2.0% | 8 EXXON MOBIL CORP | エネルギー | アメリカ | 0.8% |
| 9 インドルピー | 1.6% | 9 BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | アメリカ | 0.7% |
| 10 ニュー台湾ドル | 1.5% | 10 JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | アメリカ | 0.7% |

| その他資産の状況 | 比率 |
|---------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建) | 3.5% |

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2020年は設定日から年末までの収益率を表示
- 2019年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。
ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

⑧申込受付時間

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

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があります。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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、取得申込みの受け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け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、取得申込みの受け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】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

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

②解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

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

⑧解約請求受付時間

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

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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、解約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解約請求を取り消すことができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

- ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。
- ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。
- ・公社債等
原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。
残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。
- ・マザーファンド
計算日における基準価額で評価します。
- ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）
原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産
原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。
- ・外国為替予約取引
原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。
- ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限(2020年3月6日設定)

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

(4)【計算期間】

毎年6月26日から翌年6月25日まで

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

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

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

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

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

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

②信託約款の変更等

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

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

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還(信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている

場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。)、信託約款の変更または併合(変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。)をしようとする場合には、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。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。

④ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

⑤ 関係法人との契約の更改

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

⑥ 運用報告書

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

⑦ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

⑧ 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

⑨ 信託事務の再信託

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

⑩ 公告

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

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

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

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

②分配金再投資コース（累積投資コース）

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、当期（令和 3 年 6 月 26 日から令和 4 年 6 月 27 日まで）の財務諸表について、PwC あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和4年8月31日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉

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」に掲げられているつみたて全世界株式の令和3年6月26日から令和4年6月27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、つみたて全世界株式の令和4年6月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【つみたて全世界株式】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第2期 [令和3年6月25日現在] | 第3期 [令和4年6月27日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 464,449 | 2,056,021 |
| 親投資信託受益証券 | 97,751,639 | 469,401,641 |
| 未収入金 | 117,882 | 1,633,470 |
| 流動資産合計 | 98,333,970 | 473,091,132 |
| 資産合計 | 98,333,970 | 473,091,132 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 30,023 | 969,333 |
| 未払受託者報酬 | 5,851 | 38,492 |
| 未払委託者報酬 | 52,606 | 346,357 |
| 未払利息 | - | 2 |
| その他未払費用 | 848 | 5,910 |
| 流動負債合計 | 89,328 | 1,360,094 |
| 負債合計 | 89,328 | 1,360,094 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 69,732,055 | 318,852,666 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 28,512,587 | 152,878,372 |
| (分配準備積立金) | 11,107,140 | 14,958,299 |
| 元本等合計 | 98,244,642 | 471,731,038 |
| 純資産合計 | 98,244,642 | 471,731,038 |
| 負債純資産合計 | 98,333,970 | 473,091,132 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第2期 自 令和2年6月26日 至 令和3年6月25日 | 第3期 自 令和3年6月26日 至 令和4年6月27日 |
|-------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | - | 1 |
| 有価証券売買等損益 | 11,599,682 | 7,030,887 |
| 営業収益合計 | 11,599,682 | 7,030,888 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 1 | 137 |
| 受託者報酬 | 6,750 | 55,800 |

| | | |
|---|------------|-------------|
| 委託者報酬 | 60,598 | 502,062 |
| その他費用 | 920 | 8,529 |
| 営業費用合計 | 68,269 | 566,528 |
| 営業利益又は営業損失(△) | 11,531,413 | 6,464,360 |
| 経常利益又は経常損失(△) | 11,531,413 | 6,464,360 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) | 11,531,413 | 6,464,360 |
| 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(△) | 501,668 | 705,126 |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△) | △92,588 | 28,512,587 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 18,089,349 | 131,117,653 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 18,089,349 | 131,117,653 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 513,919 | 12,511,102 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 513,919 | 12,511,102 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 28,512,587 | 152,878,372 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
| 2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和3年6月26日から令和4年6月27日までとなっております。 |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | 第2期 [令和3年6月25日現在] | 第3期 [令和4年6月27日現在] |
|-----------|----------------------|----------------------|
| 1. 期首元本額 | 3,237,144円 | 69,732,055円 |
| 期中追加設定元本額 | 72,559,406円 | 277,554,459円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,064,495円 | 28,433,848円 |
| 2. 受益権の総数 | 69,732,055口 | 318,852,666口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第2期 自 令和2年6月26日 至 令和3年6月25日 | | | 第3期 自 令和3年6月26日 至 令和4年6月27日 | | |
|-----------------------------------|-----------|-------------|-----------------------------------|-----------|--------------|
| 1. 分配金の計算過程 | | | 1. 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 582,198円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 4,504,019円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 10,447,547円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 1,255,215円 |
| 収益調整金額 | C | 17,405,447円 | 収益調整金額 | C | 137,920,073円 |
| 分配準備積立金額 | D | 77,395円 | 分配準備積立金額 | D | 9,199,065円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 28,512,587円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 152,878,372円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 69,732,055口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 318,852,666口 |

| | | |
|----------------|--------------|---------|
| 1 万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 4,088 円 |
| 1 万口当たり分配金額 | H | —円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | —円 |

| | | |
|----------------|--------------|---------|
| 1 万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 4,794 円 |
| 1 万口当たり分配金額 | H | —円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | —円 |

(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 2 期 自 令和 2 年 6 月 26 日 至 令和 3 年 6 月 25 日 | 第 3 期 自 令和 3 年 6 月 26 日 至 令和 4 年 6 月 27 日 |
|--------------------------|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号) 第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 | 同左 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 第 2 期 [令和 3 年 6 月 25 日現在] | 第 3 期 [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|----------------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 第2期 [令和3年6月25日現在] | 第3期 [令和4年6月27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 | 11,362,515 | 7,340,320 |
| 合計 | 11,362,515 | 7,340,320 |

(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2期 [令和3年6月25日現在] | 第3期 [令和4年6月27日現在] |
|--------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,4089円 | 1,4795円 |
| (1万口当たり純資産額) | (14,089円) | (14,795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 | 17,356,536 | 53,626,489 | |
| | 日本株式インデックスマザーファンド | 19,789,618 | 25,354,458 | |
| | 外国株式インデックスマザーファンド | 86,608,109 | 390,420,694 | |
| 合計 | | 123,754,263 | 469,401,641 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 4 年 6 月 27 日現在]

| | |
|--------------|-------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 34,885,473,454 |
| コール・ローン | 960,293,282 |
| 株式 | 1,518,656,312,087 |
| 投資証券 | 38,453,875,116 |
| 派生商品評価勘定 | 1,668,288,920 |
| 未収入金 | 14,832,584 |
| 未収配当金 | 1,511,875,310 |
| 差入委託証拠金 | 14,212,888,273 |
| 流動資産合計 | 1,610,363,839,026 |
| 資産合計 | 1,610,363,839,026 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 57,912,462 |
| 未払金 | 105,673,215 |
| 未払解約金 | 481,098,942 |
| 未払利息 | 1,187 |
| 流動負債合計 | 644,685,806 |
| 負債合計 | 644,685,806 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 357,084,936,417 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金 (△) | 1,252,634,216,803 |
| 元本等合計 | 1,609,719,153,220 |
| 純資産合計 | 1,609,719,153,220 |
| 負債純資産合計 | 1,610,363,839,026 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|----------------------------------|---------------------|
| 1. 期首 | 令和 3 年 6 月 26 日 |
| 期首元本額 | 257,000,932,329 円 |
| 期中追加設定元本額 | 211,169,688,829 円 |
| 期中一部解約元本額 | 111,085,684,741 円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 220,315,767 円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 957,951,350 円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 827,017,899 円 |
| MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信 | 3,078,941,558 円 |
| MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信 | 2,904,258,619 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 1,680,134,797 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 9,397,317,680 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 9,592,498,908 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 58,486,344 円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 142,151,170 円 |
| ファンド・マネジャー(海外株式) | 7,305,376 円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス | 13,077,145,373 円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,115,728,356 円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 41,305,570 円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 1,619,619,200 円 |
| コアバランス | 138,462 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 129,095,974 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金) | 176,767,211 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金) | 130,668,773 円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス | 73,250,816,449 円 |
| 海外株式セレクション(ラップ向け) | 1,838,666,995 円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 4,136,132,506 円 |
| つみたて先進国株式 | 15,775,743,033 円 |
| つみたて8資産均等バランス | 1,886,285,247 円 |
| つみたて4資産均等バランス | 594,487,409 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,692,117 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 2,773,148 円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 3,783,046 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金) | 121,884,980 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金) | 102,036,069 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金) | 58,713,290 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式15) | 41,582,342 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40) | 305,336,188 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65) | 645,626,562 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本) | 28,560,857,717 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型) | 405,011,578 円 |

| | |
|--|-------------------|
| 三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式) | 1,987,773,417 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー) | 102,740,239,743 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 67,883,024 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 33,297,951 円 |
| 先進国株式インデックスファンド (ラップ向け) | 107,563,595 円 |
| つみたて全世界株式 | 86,608,109 円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 23,073,624 円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式 | 3,214,259,091 円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 2,161,005 円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 2,520,873,355 円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 1,884,066 円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド | 25,901,974,577 円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 3,801,608,859 円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 290,432,717 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 85,147,462 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 102,183,222 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 366,981,944 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 287,760,036 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 559,647,650 円 |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定) | 1,890,726,611 円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定) | 15,017 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 9,527,397 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 4,920,467,497 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定) | 62,524,077 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 920,502,134 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) | 11,837,366,030 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 646,265 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 716,385,390 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) | 6,113,361,942 円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 10,457,821 円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 64,872,362 円 |
| MUKAM 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) | 460,879,156 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 53,488,078 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) | 2,244,145,328 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) | 433,764,174 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) | 20,559 円 |
| 外国株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定) | 2,095,753,410 円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド | 2,402,007,224 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 887,328 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 2,941,538 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 1,544,953 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 2,251,780 円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA | 30,814,140 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 1,656,096 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 12,834,425 円 |

| | |
|--|-------------------|
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 1,861,919 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 20,055,403 円 |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド | 6,303,177,046 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) | 105,414,346 円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 420,221,863 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) | 447,011,970 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) | 427,722,628 円 |
| 合計 | 357,084,936,417 円 |
| 2. 受益権の総数 | 357,084,936,417 口 |

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 令和 3 年 6 月 26 日 至 令和 4 年 6 月 27 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、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | [令和 4 年 6 月 27 日現在] | |
|------|---------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額 (円) | |
| 株式 | △19,750,771,248 | |
| 投資証券 | 30,589,074 | |
| 合計 | △19,720,182,174 | |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 6 月 27 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 | 52,379,600,333 | — | 53,991,646,593 | 1,612,046,260 |
| 合計 | | 52,379,600,333 | — | 53,991,646,593 | 1,612,046,260 |

(注) 時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 4 年 6 月 27 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 | 1,576,464,194 | — | 1,574,919,089 | △1,545,105 |
| | カナダドル | 62,942,840 | — | 62,942,417 | △423 |
| | オーストラリアドル | 21,639,475 | — | 21,563,402 | △76,073 |
| | イギリスポンド | 102,042,924 | — | 102,042,491 | △433 |
| | スイスフラン | 71,835,491 | — | 71,830,978 | △4,513 |
| | スウェーデンクローネ | 15,882,880 | — | 15,882,042 | △838 |
| デンマーククローネ | 14,450,675 | — | 14,451,130 | 455 | |

| | | | |
|---------------|---------------|---------------|------------|
| ユーロ 売建 | 171,477,946 | 171,433,703 | △44,243 |
| オーストラリア ドル | 80,023,923 | 80,022,459 | 1,464 |
| ノルウェークロ ーネ | 12,628,780 | 12,628,873 | △93 |
| 合計 | 2,129,389,128 | 2,127,716,584 | △1,669,802 |

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | |
|--------------|---------------|
| | [令和4年6月27日現在] |
| 1口当たり純資産額 | 4.5079円 |
| (1万口当たり純資産額) | (45,079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 | 82,110 | 36.45 | 2,992,909.50 | |
| | BAKER HUGHES CO | 237,241 | 28.47 | 6,754,251.27 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 57,273 | 126.58 | 7,249,616.34 | |
| | CHEVRON CORP | 475,406 | 144.77 | 68,824,526.62 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 317,834 | 90.91 | 28,894,288.94 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 193,234 | 26.35 | 5,091,715.90 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 155,340 | 53.77 | 8,352,631.80 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 40,334 | 119.70 | 4,827,979.80 | |
| | EOG RESOURCES INC | 143,509 | 110.59 | 15,870,660.31 | |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| EQT CORP | 80,682 | 35.09 | 2,831,131.38 |
| EXXON MOBIL CORP | 1,033,701 | 86.90 | 89,828,616.90 |
| HALLIBURTON CO | 223,914 | 30.95 | 6,930,138.30 |
| HESS CORP | 69,279 | 101.69 | 7,044,981.51 |
| KINDER MORGAN INC | 506,051 | 16.48 | 8,339,720.48 |
| MARATHON OIL CORP | 170,430 | 22.05 | 3,757,981.50 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 139,640 | 85.68 | 11,964,355.20 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 229,149 | 57.52 | 13,180,650.48 |
| ONEOK INC | 105,835 | 54.57 | 5,775,415.95 |
| PHILLIPS 66 | 115,314 | 84.20 | 9,709,438.80 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 56,646 | 223.48 | 12,659,248.08 |
| SCHLUMBERGER LTD | 346,021 | 35.06 | 12,131,496.26 |
| TARGA RESOURCES CORP | 51,193 | 58.14 | 2,976,361.02 |
| VALERO ENERGY CORP | 100,783 | 103.93 | 10,474,377.19 |
| WILLIAMS COS INC | 289,869 | 30.05 | 8,710,563.45 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 54,362 | 252.08 | 13,703,572.96 |
| ALBEMARLE CORP | 28,026 | 224.79 | 6,299,964.54 |
| ALCOA CORP | 43,716 | 49.36 | 2,157,821.76 |
| AMCOR PLC | 367,251 | 12.41 | 4,557,584.91 |
| AVERY DENNISON CORP | 20,392 | 165.35 | 3,371,817.20 |
| BALL CORP | 79,941 | 71.59 | 5,722,976.19 |
| CELANESE CORP | 25,081 | 127.57 | 3,199,583.17 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 52,171 | 83.32 | 4,346,887.72 |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 124,241 | 16.48 | 2,047,491.68 |
| CORTEVA INC | 175,039 | 53.56 | 9,375,088.84 |
| CROWN HOLDINGS INC | 32,322 | 95.43 | 3,084,488.46 |
| DOW INC | 175,565 | 53.14 | 9,329,524.10 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 127,407 | 58.55 | 7,459,679.85 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 31,050 | 92.45 | 2,870,572.50 |
| ECOLAB INC | 62,097 | 159.65 | 9,913,786.05 |
| FMC CORP | 29,295 | 108.23 | 3,170,597.85 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 360,074 | 30.99 | 11,158,693.26 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 88,514 | 42.84 | 3,791,939.76 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 60,556 | 121.41 | 7,352,103.96 |
| LINDE PLC | 125,271 | 303.23 | 37,985,925.33 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 65,536 | 89.24 | 5,848,432.64 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 15,659 | 309.68 | 4,849,279.12 |
| MOSAIC CO/THE | 87,832 | 46.61 | 4,093,849.52 |
| NEWMONT CORP | 196,359 | 64.18 | 12,602,320.62 |
| NUCOR CORP | 64,254 | 111.06 | 7,136,049.24 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 21,722 | 140.60 | 3,054,113.20 |
| PPG INDUSTRIES INC | 58,642 | 121.01 | 7,096,268.42 |
| RPM INTERNATIONAL INC | 31,480 | 81.61 | 2,569,082.80 |
| SEALED AIR CORP | 35,102 | 59.65 | 2,093,834.30 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 60,769 | 231.25 | 14,052,831.25 |
| STEEL DYNAMICS INC | 47,078 | 68.89 | 3,243,203.42 |
| VULCAN MATERIALS CO | 33,410 | 145.82 | 4,871,846.20 |
| WESTLAKE CORP | 9,056 | 99.60 | 901,977.60 |
| WESTROCK CO | 61,030 | 40.64 | 2,480,259.20 |
| 3M CO | 139,472 | 134.33 | 18,735,273.76 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 29,314 | 40.99 | 1,201,580.86 |
| ALLEGION PLC | 22,461 | 99.60 | 2,237,115.60 |
| AMETEK INC | 55,164 | 113.50 | 6,261,114.00 |
| BOEING CO/THE | 135,653 | 141.53 | 19,198,969.09 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 212,464 | 36.30 | 7,712,443.20 |
| CATERPILLAR INC | 130,896 | 185.49 | 24,279,899.04 |
| CUMMINS INC | 34,467 | 195.02 | 6,721,754.34 |
| DEERE & CO | 71,217 | 310.87 | 22,139,228.79 |
| DOVER CORP | 33,686 | 123.22 | 4,150,788.92 |
| EATON CORP PLC | 97,946 | 131.83 | 12,912,221.18 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 145,751 | 82.03 | 11,955,954.53 |
| FASTENAL CO | 143,160 | 51.90 | 7,430,004.00 |
| FORTIVE CORP | 80,203 | 56.28 | 4,513,824.84 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 31,825 | 63.24 | 2,012,613.00 |
| GENERAC HOLDINGS INC | 16,113 | 224.55 | 3,618,174.15 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 57,721 | 222.33 | 12,833,109.93 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 269,378 | 67.08 | 18,069,876.24 |
| HEICO CORP | 9,664 | 132.00 | 1,275,648.00 |
| HEICO CORP-CLASS A | 19,653 | 106.34 | 2,089,900.02 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 167,313 | 180.02 | 30,119,686.26 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 90,824 | 32.18 | 2,922,716.32 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 9,743 | 215.34 | 2,098,057.62 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| IDEX CORP | 18,742 | 185.56 | 3,477,765.52 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 76,693 | 187.92 | 14,412,148.56 |
| INGERSOLL-RAND INC | 96,128 | 43.33 | 4,165,226.24 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 51,600 | 52.07 | 2,686,812.00 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 173,294 | 48.95 | 8,482,741.30 |
| KORNIT DIGITAL LTD | 10,100 | 36.40 | 367,640.00 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 47,327 | 233.55 | 11,053,220.85 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 7,651 | 203.64 | 1,558,049.64 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 59,655 | 419.04 | 24,997,831.20 |
| MASCO CORP | 59,841 | 51.80 | 3,099,763.80 |
| NORDSON CORP | 13,049 | 204.94 | 2,674,262.06 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 36,181 | 463.70 | 16,777,129.70 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 105,610 | 70.86 | 7,483,524.60 |
| OWENS CORNING | 25,278 | 75.60 | 1,911,016.80 |
| PACCAR INC | 82,504 | 84.21 | 6,947,661.84 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 30,884 | 253.10 | 7,816,740.40 |
| PENTAIR PLC | 36,371 | 47.03 | 1,710,528.13 |
| PLUG POWER INC | 122,839 | 18.23 | 2,239,354.97 |
| QUANTA SERVICES INC | 34,200 | 125.98 | 4,308,516.00 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 364,006 | 94.20 | 34,289,365.20 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 29,125 | 201.06 | 5,855,872.50 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 37,891 | 43.19 | 1,636,512.29 |
| SMITH (A. O.) CORP | 33,632 | 55.82 | 1,877,338.24 |
| SNAP-ON INC | 12,812 | 201.87 | 2,586,358.44 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 39,755 | 111.16 | 4,419,165.80 |
| TEXTRON INC | 50,012 | 60.62 | 3,031,727.44 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 57,934 | 131.49 | 7,617,741.66 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 13,010 | 538.75 | 7,009,137.50 |
| UNITED RENTALS INC | 18,307 | 248.29 | 4,545,445.03 |
| WABTEC CORP | 44,906 | 85.05 | 3,819,255.30 |
| WW GRAINGER INC | 11,110 | 460.95 | 5,121,154.50 |
| XYLEM INC | 43,041 | 79.61 | 3,426,494.01 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 33,017 | 89.54 | 2,956,342.18 |
| CINTAS CORP | 23,145 | 379.18 | 8,776,121.10 |
| CLARIVATE PLC | 68,250 | 14.65 | 999,862.50 |
| COPART INC | 51,121 | 112.88 | 5,770,538.48 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| COSTAR GROUP INC | 94,190 | 62.85 | 5,919,841.50 |
| EQUIFAX INC | 28,965 | 184.83 | 5,353,600.95 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 31,161 | 125.42 | 3,908,212.62 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 31,306 | 101.57 | 3,179,750.42 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 53,013 | 129.90 | 6,886,388.70 |
| ROBERT HALF INTL INC | 27,424 | 77.90 | 2,136,329.60 |
| ROLLINS INC | 55,465 | 35.11 | 1,947,376.15 |
| TRANSUNION | 45,499 | 81.83 | 3,723,183.17 |
| VERISK ANALYTICS INC | 40,449 | 172.99 | 6,997,272.51 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 63,891 | 122.73 | 7,841,342.43 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 101,699 | 150.31 | 15,286,376.69 |
| AMERCO | 2,336 | 481.86 | 1,125,624.96 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 31,813 | 103.86 | 3,304,098.18 |
| CSX CORP | 536,655 | 29.57 | 15,868,888.35 |
| DELTA AIR LINES INC | 42,210 | 31.20 | 1,316,952.00 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 40,057 | 100.49 | 4,025,327.93 |
| FEDEX CORP | 61,647 | 243.24 | 14,995,016.28 |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 237,326 | 2.89 | 685,872.14 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 21,082 | 162.15 | 3,418,446.30 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 41,449 | 47.07 | 1,951,004.43 |
| LYFT INC-A | 77,282 | 16.34 | 1,262,787.88 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 58,894 | 230.43 | 13,570,944.42 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 23,467 | 257.72 | 6,047,915.24 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 38,892 | 37.73 | 1,467,395.16 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 356,119 | 23.03 | 8,201,420.57 |
| UNION PACIFIC CORP | 155,339 | 215.78 | 33,519,049.42 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 178,868 | 183.30 | 32,786,504.40 |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV | 19,700 | 46.35 | 913,095.00 |
| APTIV PLC | 65,784 | 97.09 | 6,386,968.56 |
| BORGWARNER INC | 54,492 | 35.69 | 1,944,819.48 |
| FORD MOTOR CO | 967,413 | 12.01 | 11,618,630.13 |
| GENERAL MOTORS CO | 339,802 | 34.82 | 11,831,905.64 |
| LEAR CORP | 13,406 | 134.21 | 1,799,219.26 |
| LUCID GROUP INC | 108,300 | 19.21 | 2,080,443.00 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 49,200 | 29.50 | 1,451,400.00 |
| TESLA INC | 214,574 | 737.12 | 158,166,786.88 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| DR HORTON INC | 82,227 | 67.69 | 5,565,945.63 |
| GARMIN LTD | 36,286 | 100.13 | 3,633,317.18 |
| HASBRO INC | 30,940 | 85.74 | 2,652,795.60 |
| LENNAR CORP-A | 63,351 | 71.93 | 4,556,837.43 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 28,332 | 293.36 | 8,311,475.52 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 12,415 | 127.95 | 1,588,499.25 |
| NEWELL BRANDS INC | 98,791 | 20.03 | 1,978,783.73 |
| NIKE INC -CL B | 312,341 | 112.91 | 35,266,422.31 |
| NVR INC | 770 | 4,049.72 | 3,118,284.40 |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A | 64,154 | 11.01 | 706,335.54 |
| PULTEGROUP INC | 61,042 | 40.39 | 2,465,486.38 |
| VF CORP | 78,227 | 48.01 | 3,755,678.27 |
| WHIRLPOOL CORP | 14,396 | 166.35 | 2,394,774.60 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 82,686 | 103.51 | 8,558,827.86 |
| ARAMARK | 62,712 | 31.16 | 1,954,105.92 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 9,987 | 1,931.05 | 19,285,396.35 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 49,601 | 44.47 | 2,205,756.47 |
| CARNIVAL CORP | 202,337 | 10.85 | 2,195,356.45 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 6,897 | 1,329.02 | 9,166,250.94 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 32,684 | 119.81 | 3,915,870.04 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 8,842 | 396.54 | 3,506,206.68 |
| EXPEDIA GROUP INC | 35,855 | 102.34 | 3,669,400.70 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 69,485 | 116.71 | 8,109,594.35 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 80,504 | 33.43 | 2,691,248.72 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 68,469 | 139.39 | 9,543,893.91 |
| MCDONALD'S CORP | 181,143 | 247.90 | 44,905,349.70 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 91,154 | 30.24 | 2,756,496.96 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 54,909 | 41.76 | 2,292,999.84 |
| STARBUCKS CORP | 281,659 | 78.11 | 22,000,384.49 |
| VAIL RESORTS INC | 9,387 | 232.34 | 2,180,975.58 |
| WYNN RESORTS LTD | 28,208 | 58.29 | 1,644,244.32 |
| YUM! BRANDS INC | 69,007 | 114.42 | 7,895,780.94 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 190,607 | 77.94 | 14,855,909.58 |
| ALPHABET INC-CL A | 73,488 | 2,359.50 | 173,394,936.00 |
| ALPHABET INC-CL C | 69,325 | 2,370.76 | 164,352,937.00 |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | 136,748 | 12.47 | 1,705,247.56 |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|----------|----------------|
| CABLE ONE INC | 1,419 | 1,266.56 | 1,797,248.64 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 29,662 | 463.12 | 13,737,065.44 |
| COMCAST CORP-CLASS A | 1,104,077 | 39.57 | 43,688,326.89 |
| DISH NETWORK CORP-A | 57,866 | 18.85 | 1,090,774.10 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 69,169 | 130.20 | 9,005,803.80 |
| FOX CORP - CLASS A | 81,297 | 32.80 | 2,666,541.60 |
| FOX CORP - CLASS B | 35,796 | 30.35 | 1,086,408.60 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 21,966 | 83.90 | 1,842,947.40 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 91,882 | 27.98 | 2,570,858.36 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 33,065 | 115.27 | 3,811,402.55 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 22,942 | 36.07 | 827,517.94 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 41,179 | 36.09 | 1,486,150.11 |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 45,962 | 63.87 | 2,935,592.94 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 41,257 | 86.80 | 3,581,107.60 |
| MATCH GROUP INC | 71,910 | 78.45 | 5,641,339.50 |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 564,152 | 170.16 | 95,996,104.32 |
| NETFLIX INC | 108,871 | 190.85 | 20,778,030.35 |
| NEWS CORP - CLASS A | 87,126 | 15.78 | 1,374,848.28 |
| OMNICOM GROUP | 52,842 | 64.60 | 3,413,593.20 |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 154,043 | 25.76 | 3,968,147.68 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 146,888 | 21.47 | 3,153,685.36 |
| ROBLOX CORP -CLASS A | 83,500 | 36.42 | 3,041,070.00 |
| ROKU INC | 27,205 | 98.77 | 2,687,037.85 |
| SEA LTD-ADR | 90,204 | 80.47 | 7,258,715.88 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 173,279 | 6.19 | 1,072,597.01 |
| SNAP INC - A | 269,807 | 14.70 | 3,966,162.90 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 40,089 | 133.62 | 5,356,692.18 |
| TWITTER INC | 193,858 | 39.41 | 7,639,943.78 |
| WALT DISNEY CO/THE | 445,035 | 97.78 | 43,515,522.30 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 536,372 | 14.28 | 7,659,392.16 |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 61,345 | 37.71 | 2,313,319.95 |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 14,047 | 183.10 | 2,572,005.70 |
| AMAZON.COM INC | 2,236,460 | 116.46 | 260,458,131.60 |
| AUTOZONE INC | 4,955 | 2,158.91 | 10,697,399.05 |
| BATH & BODY WORKS INC | 58,134 | 30.95 | 1,799,247.30 |
| BEST BUY CO INC | 52,109 | 74.69 | 3,892,021.21 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| BURLINGTON STORES INC | 16,965 | 159.98 | 2,714,060.70 |
| CARMAX INC | 39,009 | 98.36 | 3,836,925.24 |
| CARVANA CO | 23,450 | 31.52 | 739,144.00 |
| CHEWY INC - CLASS A | 20,927 | 38.16 | 798,574.32 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 57,012 | 247.90 | 14,133,274.80 |
| DOLLAR TREE INC | 55,466 | 157.21 | 8,719,809.86 |
| DOORDASH INC - A | 45,386 | 74.11 | 3,363,556.46 |
| EBAY INC | 141,751 | 45.67 | 6,473,768.17 |
| ETSY INC | 29,639 | 83.62 | 2,478,413.18 |
| GENUINE PARTS CO | 34,403 | 136.75 | 4,704,610.25 |
| HOME DEPOT INC | 255,080 | 283.00 | 72,187,640.00 |
| LKQ CORP | 65,826 | 49.92 | 3,286,033.92 |
| LOWE'S COS INC | 163,851 | 182.84 | 29,958,516.84 |
| MERCADOLIBRE INC | 11,339 | 739.46 | 8,384,736.94 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 16,611 | 639.06 | 10,615,425.66 |
| POOL CORP | 9,564 | 356.94 | 3,413,774.16 |
| ROSS STORES INC | 88,524 | 77.53 | 6,863,265.72 |
| TARGET CORP | 117,592 | 150.42 | 17,688,188.64 |
| TJX COMPANIES INC | 292,550 | 60.24 | 17,623,212.00 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 28,253 | 202.97 | 5,734,511.41 |
| ULTA BEAUTY INC | 13,207 | 410.54 | 5,422,001.78 |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 16,269 | 59.35 | 965,565.15 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 108,328 | 484.37 | 52,470,833.36 |
| KROGER CO | 165,724 | 48.45 | 8,029,327.80 |
| SYSCO CORP | 125,502 | 85.57 | 10,739,206.14 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 182,088 | 41.65 | 7,583,965.20 |
| WALMART INC | 371,791 | 123.72 | 45,997,982.52 |
| ALTRIA GROUP INC | 444,156 | 43.40 | 19,276,370.40 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 138,237 | 74.52 | 10,301,421.24 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 73,367 | 71.51 | 5,246,474.17 |
| BUNGE LTD | 35,705 | 88.39 | 3,155,964.95 |
| CAMPBELL SOUP CO | 51,415 | 48.44 | 2,490,542.60 |
| COCA-COLA CO/THE | 1,004,482 | 63.04 | 63,322,545.28 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 50,652 | 53.02 | 2,685,569.04 |
| CONAGRA BRANDS INC | 118,356 | 34.10 | 4,035,939.60 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 38,904 | 245.50 | 9,550,932.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| GENERAL MILLS INC | 148,498 | 70.63 | 10,488,413.74 |
| HERSHEY CO/THE | 34,710 | 220.96 | 7,669,521.60 |
| HORMEL FOODS CORP | 75,667 | 47.37 | 3,584,345.79 |
| JM SMUCKER CO/THE | 26,018 | 128.88 | 3,353,199.84 |
| KELLOGG CO | 61,911 | 70.72 | 4,378,345.92 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 193,902 | 35.76 | 6,933,935.52 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 182,809 | 38.40 | 7,019,865.60 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 62,264 | 87.84 | 5,469,269.76 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 46,434 | 55.77 | 2,589,624.18 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 338,582 | 62.65 | 21,212,162.30 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 97,674 | 94.58 | 9,238,006.92 |
| PEPSICO INC | 337,254 | 166.13 | 56,028,007.02 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 378,072 | 103.40 | 39,092,644.80 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 72,322 | 85.80 | 6,205,227.60 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 57,647 | 91.61 | 5,281,041.67 |
| CLOROX COMPANY | 29,372 | 140.75 | 4,134,109.00 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 195,452 | 80.38 | 15,710,431.76 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 57,186 | 270.20 | 15,451,657.20 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 80,722 | 134.46 | 10,853,880.12 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 584,864 | 144.35 | 84,425,118.40 |
| ABBOTT LABORATORIES | 430,672 | 109.45 | 47,137,050.40 |
| ABIOMED INC | 10,508 | 255.32 | 2,682,902.56 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 18,871 | 258.75 | 4,882,871.25 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 37,157 | 148.46 | 5,516,328.22 |
| ANTHEM INC | 58,955 | 469.87 | 27,701,185.85 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 124,038 | 66.78 | 8,283,257.64 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 69,686 | 250.92 | 17,485,611.12 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 351,215 | 38.02 | 13,353,194.30 |
| CARDINAL HEALTH INC | 65,261 | 54.45 | 3,553,461.45 |
| CENTENE CORP | 143,502 | 82.95 | 11,903,490.90 |
| CIGNA CORP | 78,639 | 265.13 | 20,849,558.07 |
| COOPER COS INC/THE | 11,736 | 323.49 | 3,796,478.64 |
| CVS HEALTH CORP | 320,623 | 94.52 | 30,305,285.96 |
| DAVITA INC | 12,559 | 77.50 | 973,322.50 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 51,832 | 36.76 | 1,905,344.32 |
| DEXCOM INC | 96,668 | 77.67 | 7,508,203.56 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 153,714 | 96.98 | 14,907,183.72 |
| HCA HEALTHCARE INC | 59,726 | 182.33 | 10,889,841.58 |
| HENRY SCHEIN INC | 31,351 | 77.29 | 2,423,118.79 |
| HOLOGIC INC | 60,771 | 70.93 | 4,310,487.03 |
| HUMANA INC | 31,016 | 456.81 | 14,168,418.96 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 20,979 | 361.48 | 7,583,488.92 |
| INSULET CORP | 16,073 | 227.73 | 3,660,304.29 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 88,146 | 209.67 | 18,481,571.82 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 22,268 | 242.56 | 5,401,326.08 |
| MASIMO CORP | 13,519 | 138.60 | 1,873,733.40 |
| MCKESSON CORP | 36,991 | 321.55 | 11,894,456.05 |
| MEDTRONIC PLC | 327,727 | 90.22 | 29,567,529.94 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 14,017 | 267.13 | 3,744,361.21 |
| NOVOCURE LTD | 21,179 | 75.60 | 1,601,132.40 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 28,721 | 140.31 | 4,029,843.51 |
| RESMED INC | 36,217 | 211.50 | 7,659,895.50 |
| STERIS PLC | 25,292 | 207.89 | 5,257,953.88 |
| STRYKER CORP | 83,417 | 204.43 | 17,052,937.31 |
| TELADOC HEALTH INC | 41,844 | 37.17 | 1,555,341.48 |
| TELEFLEX INC | 11,656 | 258.05 | 3,007,830.80 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 229,614 | 495.64 | 113,805,882.96 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 17,045 | 108.77 | 1,853,984.65 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 34,437 | 207.04 | 7,129,836.48 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 50,201 | 108.87 | 5,465,382.87 |
| ABBVIE INC | 432,130 | 152.34 | 65,830,684.20 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 72,262 | 121.29 | 8,764,657.98 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 30,067 | 147.50 | 4,434,882.50 |
| AMGEN INC | 136,035 | 245.37 | 33,378,907.95 |
| AVANTOR INC | 144,516 | 31.60 | 4,566,705.60 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 5,226 | 507.84 | 2,653,971.84 |
| BIO-TECHNE CORP | 9,424 | 352.76 | 3,324,410.24 |
| BIOGEN INC | 35,130 | 211.93 | 7,445,100.90 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 45,412 | 86.85 | 3,944,032.20 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 533,034 | 78.96 | 42,088,364.64 |
| CATALENT INC | 40,421 | 109.61 | 4,430,545.81 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 12,352 | 226.32 | 2,795,504.64 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| DANAHER CORP | 166,236 | 256.83 | 42,694,391.88 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 96,813 | 20.61 | 1,995,315.93 |
| ELI LILLY & CO | 197,753 | 325.62 | 64,392,331.86 |
| EXACT SCIENCES CORP | 38,473 | 45.15 | 1,737,055.95 |
| GILEAD SCIENCES INC | 306,732 | 63.08 | 19,348,654.56 |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | 54,102 | 85.13 | 4,605,703.26 |
| ILLUMINA INC | 39,024 | 193.93 | 7,567,924.32 |
| INCYTE CORP | 44,272 | 78.19 | 3,461,627.68 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 47,331 | 213.80 | 10,119,367.80 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 15,237 | 153.49 | 2,338,727.13 |
| JOHNSON & JOHNSON | 641,260 | 182.29 | 116,895,285.40 |
| MERCK & CO. INC. | 617,191 | 93.13 | 57,478,997.83 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 5,465 | 1,146.90 | 6,267,808.50 |
| MODERNA INC | 82,175 | 144.27 | 11,855,387.25 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 24,326 | 98.24 | 2,389,786.24 |
| PERKINELMER INC | 29,906 | 145.53 | 4,352,220.18 |
| PFIZER INC | 1,373,529 | 51.59 | 70,860,361.11 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 26,189 | 612.49 | 16,040,500.61 |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 83,388 | 43.20 | 3,602,361.60 |
| SEAGEN INC | 34,386 | 179.33 | 6,166,441.38 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 274,131 | 7.74 | 2,121,773.94 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 95,694 | 544.81 | 52,135,048.14 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 62,471 | 292.55 | 18,275,891.05 |
| VIATRIS INC | 299,768 | 10.96 | 3,285,457.28 |
| WATERS CORP | 14,543 | 328.58 | 4,778,538.94 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 17,792 | 301.18 | 5,358,594.56 |
| ZOETIS INC | 115,935 | 174.61 | 20,243,410.35 |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,772,248 | 32.31 | 57,261,332.88 |
| CITIGROUP INC | 484,687 | 47.86 | 23,197,119.82 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 120,515 | 37.03 | 4,462,670.45 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 171,123 | 35.22 | 6,026,952.06 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 3,206 | 668.84 | 2,144,301.04 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 42,223 | 146.91 | 6,202,980.93 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 344,495 | 12.51 | 4,309,632.45 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 720,422 | 117.32 | 84,519,909.04 |
| KEYCORP | 235,516 | 17.83 | 4,199,250.28 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| M & T BANK CORP | 44,336 | 166.64 | 7,388,151.04 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 102,059 | 162.84 | 16,619,287.56 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 226,363 | 19.49 | 4,411,814.87 |
| SIGNATURE BANK | 14,713 | 192.14 | 2,826,955.82 |
| SVB FINANCIAL GROUP | 14,236 | 415.52 | 5,915,342.72 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 325,268 | 49.22 | 16,009,690.96 |
| US BANCORP | 344,733 | 47.52 | 16,381,712.16 |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 40,000 | 44.88 | 1,795,200.00 |
| WELLS FARGO & CO | 931,156 | 40.76 | 37,953,918.56 |
| ALLY FINANCIAL INC | 80,905 | 35.15 | 2,843,810.75 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 157,543 | 146.15 | 23,024,909.45 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 27,749 | 249.29 | 6,917,548.21 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 366,489 | 6.33 | 2,319,875.37 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 94,826 | 52.00 | 4,930,952.00 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 184,007 | 43.60 | 8,022,705.20 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 314,925 | 278.28 | 87,637,329.00 |
| BLACKROCK INC | 37,159 | 647.78 | 24,070,857.02 |
| BLACKSTONE INC | 171,710 | 98.87 | 16,976,967.70 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 101,513 | 110.09 | 11,175,566.17 |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 46,998 | 34.11 | 1,603,101.78 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 25,674 | 114.94 | 2,950,969.56 |
| CME GROUP INC | 87,773 | 210.00 | 18,432,330.00 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 28,500 | 62.71 | 1,787,235.00 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 70,898 | 99.17 | 7,030,954.66 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 102,159 | 27.25 | 2,783,832.75 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 9,321 | 392.52 | 3,658,678.92 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 79,623 | 25.34 | 2,017,646.82 |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 12,000 | 52.94 | 635,280.00 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 82,480 | 302.75 | 24,970,820.00 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 137,649 | 97.91 | 13,477,213.59 |
| INVESCO LTD | 93,982 | 17.36 | 1,631,527.52 |
| KKR & CO INC | 131,902 | 48.57 | 6,406,480.14 |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 19,032 | 188.82 | 3,593,622.24 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 9,774 | 277.64 | 2,713,653.36 |
| MOODY'S CORP | 39,820 | 277.50 | 11,050,050.00 |
| MORGAN STANLEY | 326,196 | 77.82 | 25,384,572.72 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| MSCI INC | 19,411 | 432.06 | 8,386,716.66 |
| NASDAQ INC | 28,974 | 159.28 | 4,614,978.72 |
| NORTHERN TRUST CORP | 49,548 | 97.12 | 4,812,101.76 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 45,687 | 92.50 | 4,226,047.50 |
| S&P GLOBAL INC | 86,494 | 341.66 | 29,551,540.04 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 354,386 | 64.43 | 22,833,089.98 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 25,390 | 55.38 | 1,406,098.20 |
| STATE STREET CORP | 90,746 | 66.27 | 6,013,737.42 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 125,944 | 29.54 | 3,720,385.76 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 54,917 | 121.50 | 6,672,415.50 |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 25,266 | 74.08 | 1,871,705.28 |
| UPSTART HOLDINGS INC | 18,239 | 40.95 | 746,887.05 |
| AFLAC INC | 148,121 | 55.79 | 8,263,670.59 |
| ALLEGHANY CORP | 3,270 | 833.50 | 2,725,545.00 |
| ALLSTATE CORP | 66,810 | 127.16 | 8,495,559.60 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 17,214 | 137.53 | 2,367,441.42 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 200,262 | 52.77 | 10,567,825.74 |
| AON PLC-CLASS A | 52,322 | 271.74 | 14,217,980.28 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 89,540 | 44.86 | 4,016,764.40 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 50,314 | 165.25 | 8,314,388.50 |
| ASSURANT INC | 12,691 | 172.86 | 2,193,766.26 |
| BROWN & BROWN INC | 61,145 | 59.06 | 3,611,223.70 |
| CHUBB LTD | 103,644 | 194.53 | 20,161,867.32 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 36,446 | 116.50 | 4,245,959.00 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 5,829 | 190.96 | 1,113,105.84 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 8,861 | 283.19 | 2,509,346.59 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 65,607 | 37.59 | 2,466,167.13 |
| GLOBE LIFE INC | 22,587 | 99.16 | 2,239,726.92 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 81,930 | 65.69 | 5,381,981.70 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 44,118 | 48.98 | 2,160,899.64 |
| LOEWS CORP | 51,190 | 59.77 | 3,059,626.30 |
| MARKEL CORP | 3,293 | 1,292.86 | 4,257,387.98 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 122,931 | 158.83 | 19,525,130.73 |
| METLIFE INC | 166,799 | 64.22 | 10,711,831.78 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 66,392 | 68.55 | 4,551,171.60 |
| PROGRESSIVE CORP | 142,781 | 115.99 | 16,561,168.19 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 92,654 | 97.41 | 9,025,426.14 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 59,054 | 166.72 | 9,845,482.88 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 27,396 | 204.95 | 5,614,810.20 |
| WR BERKLEY CORP | 53,359 | 68.03 | 3,630,012.77 |
| CBRE GROUP INC - A | 79,667 | 73.13 | 5,826,047.71 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 271,100 | 4.90 | 1,328,390.00 |
| ZILLOW GROUP INC - C | 39,739 | 35.46 | 1,409,144.94 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 154,379 | 299.37 | 46,216,441.23 |
| ADOBE INC | 115,353 | 387.72 | 44,724,665.16 |
| AFFIRM HOLDINGS INC | 52,787 | 23.28 | 1,228,881.36 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 39,401 | 94.46 | 3,721,818.46 |
| ANSYS INC | 20,960 | 256.95 | 5,385,672.00 |
| APPROVIN CORP-CLASS A | 28,300 | 39.63 | 1,121,529.00 |
| AUTODESK INC | 52,937 | 192.48 | 10,189,313.76 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 102,703 | 218.79 | 22,470,389.37 |
| AVALARA INC | 22,505 | 84.35 | 1,898,296.75 |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 50,800 | 35.58 | 1,807,464.00 |
| BILL. COM HOLDINGS INC | 22,147 | 130.48 | 2,889,740.56 |
| BLACK KNIGHT INC | 39,574 | 66.21 | 2,620,194.54 |
| BLOCK INC | 129,093 | 71.00 | 9,165,603.00 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 27,657 | 145.59 | 4,026,582.63 |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 68,700 | 157.62 | 10,828,494.00 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 32,480 | 51.59 | 1,675,643.20 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 26,281 | 124.10 | 3,261,472.10 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 29,822 | 96.59 | 2,880,506.98 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 60,035 | 51.84 | 3,112,214.40 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 129,492 | 70.26 | 9,098,107.92 |
| COUPA SOFTWARE INC | 16,876 | 65.84 | 1,111,115.84 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 47,763 | 184.99 | 8,835,677.37 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 8,285 | 142.80 | 1,183,098.00 |
| DATADOG INC - CLASS A | 53,889 | 107.48 | 5,791,989.72 |
| DOCUSIGN INC | 46,940 | 68.75 | 3,227,125.00 |
| DROPBOX INC-CLASS A | 64,861 | 22.62 | 1,467,155.82 |
| DYNATRACE INC | 47,932 | 44.08 | 2,112,842.56 |
| EPAM SYSTEMS INC | 13,556 | 326.01 | 4,419,391.56 |
| FAIR ISAAC CORP | 6,056 | 416.15 | 2,520,204.40 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|--------|----------------|
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 149,610 | 98.63 | 14,756,034.30 |
| FISERV INC | 152,362 | 94.19 | 14,350,976.78 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 18,640 | 217.50 | 4,054,200.00 |
| FORTINET INC | 163,420 | 59.13 | 9,663,024.60 |
| GARTNER INC | 19,745 | 251.29 | 4,961,721.05 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 68,132 | 118.86 | 8,098,169.52 |
| GODADDY INC - CLASS A | 39,402 | 70.97 | 2,796,359.94 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 19,911 | 77.92 | 1,551,465.12 |
| HUBSPOT INC | 10,766 | 343.71 | 3,700,381.86 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 219,550 | 142.06 | 31,189,273.00 |
| INTUIT INC | 65,920 | 417.62 | 27,529,510.40 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 17,504 | 182.90 | 3,201,481.60 |
| MASTERCARD INC - A | 213,150 | 330.50 | 70,446,075.00 |
| MICROSOFT CORP | 1,738,670 | 267.70 | 465,441,959.00 |
| MONGODB INC | 15,804 | 303.09 | 4,790,034.36 |
| NORTONLIFELOCK INC | 130,402 | 22.46 | 2,928,828.92 |
| OKTA INC | 35,505 | 101.26 | 3,595,236.30 |
| ORACLE CORP | 391,378 | 70.70 | 27,670,424.60 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 417,668 | 10.19 | 4,256,036.92 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 24,252 | 510.71 | 12,385,738.92 |
| PAYCHEX INC | 77,442 | 122.43 | 9,481,224.06 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 11,956 | 306.53 | 3,664,872.68 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 271,510 | 77.68 | 21,090,896.80 |
| PTC INC | 26,176 | 112.44 | 2,943,229.44 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 17,130 | 61.80 | 1,058,634.00 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 25,244 | 407.71 | 10,292,231.24 |
| SALESFORCE INC | 240,988 | 185.92 | 44,804,488.96 |
| SERVICENOW INC | 49,164 | 504.09 | 24,783,080.76 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 52,053 | 151.53 | 7,887,591.09 |
| SPLUNK INC | 38,273 | 97.86 | 3,745,395.78 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 56,424 | 60.66 | 3,422,679.84 |
| SYNOPSYS INC | 37,776 | 317.47 | 11,992,746.72 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 108,173 | 49.49 | 5,353,481.77 |
| TWILIO INC - A | 44,801 | 99.12 | 4,440,675.12 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 9,781 | 345.33 | 3,377,672.73 |
| UNITY SOFTWARE INC | 45,519 | 46.81 | 2,130,744.39 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| VERISIGN INC | 23,912 | 169.27 | 4,047,584.24 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 404,947 | 205.51 | 83,220,657.97 |
| VMWARE INC-CLASS A | 52,298 | 117.96 | 6,169,072.08 |
| WESTERN UNION CO | 104,323 | 16.69 | 1,741,150.87 |
| WIX.COM LTD | 11,770 | 68.89 | 810,835.30 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 47,221 | 152.05 | 7,179,953.05 |
| ZENDESK INC | 27,274 | 74.17 | 2,022,912.58 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 52,668 | 122.64 | 6,459,203.52 |
| ZSCALER INC | 21,849 | 170.82 | 3,732,246.18 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 148,853 | 65.85 | 9,801,970.05 |
| APPLE INC | 3,983,668 | 141.66 | 564,326,408.88 |
| ARISTA NETWORKS INC | 61,582 | 99.82 | 6,147,115.24 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 18,289 | 111.06 | 2,031,176.34 |
| CDW CORP/DE | 32,068 | 164.34 | 5,270,055.12 |
| CISCO SYSTEMS INC | 1,015,578 | 44.10 | 44,786,989.80 |
| COGNEX CORP | 40,676 | 45.38 | 1,845,876.88 |
| CORNING INC | 193,798 | 32.76 | 6,348,822.48 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 72,510 | 50.25 | 3,643,627.50 |
| F5 INC | 14,949 | 158.47 | 2,368,968.03 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 312,915 | 14.06 | 4,399,584.90 |
| HP INC | 249,356 | 35.23 | 8,784,811.88 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 77,736 | 29.15 | 2,266,004.40 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 43,791 | 140.48 | 6,151,759.68 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 40,442 | 217.33 | 8,789,259.86 |
| NETAPP INC | 53,287 | 66.81 | 3,560,104.47 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 49,338 | 74.15 | 3,658,412.70 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 80,541 | 118.39 | 9,535,248.99 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 11,935 | 378.02 | 4,511,668.70 |
| TRIMBLE INC | 59,985 | 61.01 | 3,659,684.85 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 73,981 | 47.07 | 3,482,285.67 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 13,465 | 308.91 | 4,159,473.15 |
| AT&T INC | 1,742,735 | 20.99 | 36,580,007.65 |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C | 82,999 | 23.17 | 1,923,086.83 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 34,462 | 22.08 | 760,920.96 |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 226,522 | 11.27 | 2,552,902.94 |
| T-MOBILE US INC | 153,037 | 137.08 | 20,978,311.96 |

| | | | |
|------------------------------|-------------|--------|------------------|
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 1, 023, 974 | 50.96 | 52, 181, 715. 04 |
| AES CORP | 168, 992 | 21.42 | 3, 619, 808. 64 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 58, 572 | 57.32 | 3, 357, 347. 04 |
| AMEREN CORPORATION | 64, 003 | 87.91 | 5, 626, 503. 73 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 123, 856 | 93.60 | 11, 592, 921. 60 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 43, 239 | 148.34 | 6, 414, 073. 26 |
| ATMOS ENERGY CORP | 33, 463 | 109.24 | 3, 655, 498. 12 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 153, 868 | 28.85 | 4, 439, 091. 80 |
| CMS ENERGY CORP | 70, 574 | 65.19 | 4, 600, 719. 06 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 86, 926 | 92.93 | 8, 078, 033. 18 |
| CONSTELLATION ENERGY | 81, 876 | 59.28 | 4, 853, 609. 28 |
| DOMINION ENERGY INC | 197, 535 | 78.14 | 15, 435, 384. 90 |
| DTE ENERGY COMPANY | 48, 159 | 122.91 | 5, 919, 222. 69 |
| DUKE ENERGY CORP | 186, 459 | 104.53 | 19, 490, 559. 27 |
| EDISON INTERNATIONAL | 92, 352 | 62.79 | 5, 798, 782. 08 |
| ENTERGY CORP | 50, 406 | 110.55 | 5, 572, 383. 30 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 57, 690 | 45.96 | 2, 651, 432. 40 |
| EVERGY INC | 56, 569 | 64.11 | 3, 626, 638. 59 |
| EVERSOURCE ENERGY | 81, 495 | 83.35 | 6, 792, 608. 25 |
| EXELON CORP | 234, 486 | 43.29 | 10, 150, 898. 94 |
| FIRSTENERGY CORP | 135, 996 | 37.29 | 5, 071, 290. 84 |
| NEXTERA ENERGY INC | 478, 893 | 78.02 | 37, 363, 231. 86 |
| NISOURCE INC | 95, 648 | 28.62 | 2, 737, 445. 76 |
| NRG ENERGY INC | 54, 979 | 38.32 | 2, 106, 795. 28 |
| P G & E CORP | 358, 125 | 10.25 | 3, 670, 781. 25 |
| PPL CORP | 179, 283 | 27.08 | 4, 854, 983. 64 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 123, 871 | 62.51 | 7, 743, 176. 21 |
| SEMPRA ENERGY | 77, 255 | 149.44 | 11, 544, 987. 20 |
| SOUTHERN CO/THE | 257, 680 | 69.83 | 17, 993, 794. 40 |
| UGI CORP | 51, 639 | 39.47 | 2, 038, 191. 33 |
| VISTRA CORP | 103, 343 | 23.39 | 2, 417, 192. 77 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 74, 627 | 97.16 | 7, 250, 759. 32 |
| XCEL ENERGY INC | 133, 823 | 68.56 | 9, 174, 904. 88 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 399, 868 | 87.08 | 34, 820, 505. 44 |
| ANALOG DEVICES INC | 127, 922 | 149.69 | 19, 148, 644. 18 |
| APPLIED MATERIALS INC | 215, 538 | 97.36 | 20, 984, 779. 68 |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|------------------|---------------------|
| | BROADCOM INC | 100,002 | 509.09 | 50,910,018.18 | |
| | ENPHASE ENERGY INC | 32,091 | 198.39 | 6,366,533.49 | |
| | ENTEGRIS INC | 33,219 | 103.90 | 3,451,454.10 | |
| | INTEL CORP | 993,716 | 38.61 | 38,367,374.76 | |
| | KLA CORP | 36,972 | 339.50 | 12,551,994.00 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 34,036 | 450.19 | 15,322,666.84 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY INC | 208,066 | 48.22 | 10,032,942.52 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 137,909 | 60.58 | 8,354,527.22 | |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 274,043 | 58.44 | 16,015,072.92 | |
| | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 11,118 | 419.41 | 4,663,000.38 | |
| | NVIDIA CORP | 610,645 | 171.26 | 104,579,062.70 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 64,427 | 159.32 | 10,264,509.64 | |
| | ON SEMICONDUCTOR | 104,419 | 52.97 | 5,531,074.43 | |
| | QORVO INC | 24,967 | 97.87 | 2,443,520.29 | |
| | QUALCOMM INC | 275,090 | 125.10 | 34,413,759.00 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 38,102 | 98.03 | 3,735,139.06 | |
| | SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | 12,983 | 286.34 | 3,717,552.22 | |
| | TERADYNE INC | 39,895 | 97.12 | 3,874,602.40 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 225,059 | 155.95 | 35,097,951.05 | |
| | アメリカドル 小計 | 80,643,059 | | 8,300,687,671.65 | (1,117,355,567,480) |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD | 162,900 | 15.00 | 2,443,500.00 | |
| | CAMECO CORP | 94,400 | 29.01 | 2,738,544.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 289,500 | 65.14 | 18,858,030.00 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 348,200 | 24.29 | 8,457,778.00 | |
| | ENBRIDGE INC | 497,500 | 53.85 | 26,790,375.00 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 57,000 | 60.42 | 3,443,940.00 | |
| | KEYERA CORP | 56,500 | 29.00 | 1,638,500.00 | |
| | PARKLAND CORP | 37,300 | 33.11 | 1,235,003.00 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 131,232 | 44.28 | 5,810,952.96 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 351,600 | 44.55 | 15,663,780.00 | |
| | TC ENERGY CORP | 241,700 | 66.81 | 16,147,977.00 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 74,400 | 63.88 | 4,752,672.00 | |
| | AGNICO EAGLE MINES LTD | 114,640 | 63.44 | 7,272,761.60 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 429,500 | 24.23 | 10,406,785.00 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 35,100 | 60.48 | 2,122,848.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 136,400 | 25.88 | 3,530,032.00 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 45,900 | 178.62 | 8,198,658.00 |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | 142,900 | 7.49 | 1,070,321.00 |
| KINROSS GOLD CORP | 284,300 | 5.16 | 1,466,988.00 |
| LUNDIN MINING CORP | 154,200 | 8.48 | 1,307,616.00 |
| NUTRIEN LTD | 136,059 | 103.45 | 14,075,303.55 |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 50,100 | 27.18 | 1,361,718.00 |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 115,600 | 40.86 | 4,723,416.00 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 18,200 | 97.63 | 1,776,866.00 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 109,700 | 49.27 | 5,404,919.00 |
| CAE INC | 74,900 | 32.14 | 2,407,286.00 |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 22,400 | 100.95 | 2,261,280.00 |
| WSP GLOBAL INC | 29,300 | 141.86 | 4,156,498.00 |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 38,500 | 35.27 | 1,357,895.00 |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 27,000 | 79.60 | 2,149,200.00 |
| THOMSON REUTERS CORP | 41,332 | 134.19 | 5,546,341.08 |
| AIR CANADA | 34,500 | 17.42 | 600,990.00 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 145,400 | 146.75 | 21,337,450.00 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 227,800 | 90.95 | 20,718,410.00 |
| TFI INTERNATIONAL INC | 18,500 | 101.34 | 1,874,790.00 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 67,900 | 74.61 | 5,066,019.00 |
| BRP INC/CA- SUB VOTING | 9,100 | 83.98 | 764,218.00 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 42,800 | 36.95 | 1,581,460.00 |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 71,210 | 64.16 | 4,568,833.60 |
| QUEBECOR INC -CL B | 39,300 | 28.65 | 1,125,945.00 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 115,200 | 38.25 | 4,406,400.00 |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 12,900 | 166.29 | 2,145,141.00 |
| DOLLARAMA INC | 66,900 | 74.95 | 5,014,155.00 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 209,100 | 55.17 | 11,536,047.00 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 41,700 | 39.89 | 1,663,413.00 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 41,500 | 114.71 | 4,760,465.00 |
| METRO INC/CN | 59,100 | 68.88 | 4,070,808.00 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 18,511 | 147.41 | 2,728,706.51 |
| SAPUTO INC | 61,500 | 28.76 | 1,768,740.00 |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 63,100 | 11.28 | 711,768.00 |
| BANK OF MONTREAL | 158,700 | 123.16 | 19,545,492.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| BANK OF NOVA SCOTIA | 296,600 | 75.56 | 22,411,096.00 |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 221,900 | 63.25 | 14,035,175.00 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 81,300 | 83.60 | 6,796,680.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 344,800 | 124.34 | 42,872,432.00 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 444,000 | 83.74 | 37,180,560.00 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 346,250 | 58.87 | 20,383,737.50 |
| IGM FINANCIAL INC | 20,700 | 35.93 | 743,751.00 |
| ONEX CORPORATION | 16,300 | 65.70 | 1,070,910.00 |
| TMX GROUP LTD | 12,500 | 133.37 | 1,667,125.00 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 6,200 | 636.77 | 3,947,974.00 |
| GREAT-WEST LIFE CO INC | 68,400 | 31.14 | 2,129,976.00 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 26,500 | 61.45 | 1,628,425.00 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 44,100 | 180.42 | 7,956,522.00 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 464,300 | 21.92 | 10,177,456.00 |
| POWER CORP OF CANADA | 138,100 | 33.69 | 4,652,589.00 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 138,000 | 59.05 | 8,148,900.00 |
| FIRSTSERVICE CORP | 10,500 | 159.20 | 1,671,600.00 |
| BLACKBERRY LTD | 121,600 | 7.40 | 899,840.00 |
| CGI INC | 55,400 | 103.73 | 5,746,642.00 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 5,000 | 1,948.66 | 9,743,300.00 |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC | 39,300 | 32.82 | 1,289,826.00 |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | 17,800 | 51.18 | 911,004.00 |
| OPEN TEXT CORP | 66,100 | 51.10 | 3,377,710.00 |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 27,500 | 497.09 | 13,669,975.00 |
| BCE INC | 15,400 | 63.28 | 974,512.00 |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 86,000 | 62.43 | 5,368,980.00 |
| TELUS CORP | 115,100 | 28.89 | 3,325,239.00 |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 161,800 | 17.86 | 2,889,748.00 |
| ALTAGAS LTD | 70,200 | 26.84 | 1,884,168.00 |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 29,450 | 47.03 | 1,385,033.50 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 38,000 | 37.70 | 1,432,600.00 |
| EMERA INC | 60,500 | 59.80 | 3,617,900.00 |
| FORTIS INC | 119,200 | 59.77 | 7,124,584.00 |
| HYDRO ONE LTD | 81,500 | 33.87 | 2,760,405.00 |
| NORTHLAND POWER INC | 51,900 | 38.55 | 2,000,745.00 |
| カナダドル 小計 | 9,695,184 | | 560,444,155.30 |

| | | | | |
|------------------------|------------------------------|-----------|---------------|------------------|
| | | | | (58,409,489,865) |
| オーストラリア ドル | AMPOL LTD | 59,251 | 33.15 | 1,964,170.65 |
| | SANTOS LTD | 816,847 | 7.22 | 5,897,635.34 |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 43,399 | 23.23 | 1,008,158.77 |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 463,465 | 30.61 | 14,186,663.65 |
| | BHP GROUP LTD | 1,239,769 | 40.02 | 49,615,555.38 |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 121,636 | 15.63 | 1,901,170.68 |
| | EVOLUTION MINING LTD | 376,840 | 3.38 | 1,273,719.20 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 397,946 | 17.28 | 6,876,506.88 |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 111,548 | 32.18 | 3,589,614.64 |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 37,998 | 48.20 | 1,831,503.60 |
| | NEWCREST MINING LTD | 227,137 | 23.04 | 5,233,236.48 |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 310,405 | 7.99 | 2,480,135.95 |
| | ORICA LTD | 114,215 | 15.47 | 1,766,906.05 |
| | RIO TINTO LTD | 92,784 | 101.40 | 9,408,297.60 |
| | SOUTH32 LTD | 1,100,693 | 3.99 | 4,391,765.07 |
| | REECE LTD | 53,600 | 14.19 | 760,584.00 |
| | BRAMBLES LTD | 352,559 | 10.88 | 3,835,841.92 |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 438,172 | 3.74 | 1,638,763.28 |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 240,658 | 4.45 | 1,070,928.10 |
| | TRANSURBAN GROUP | 763,167 | 14.23 | 10,859,866.41 |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 146,003 | 33.52 | 4,894,020.56 |
| | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 12,910 | 66.15 | 853,996.50 |
| | IDP EDUCATION LTD | 45,653 | 23.89 | 1,090,650.17 |
| | LOTTERY CORP LTD/THE | 542,277 | 4.58 | 2,483,628.66 |
| | REA GROUP LTD | 11,423 | 114.07 | 1,303,021.61 |
| | SEEK LTD | 81,745 | 21.35 | 1,745,255.75 |
| | WESFARMERS LTD | 281,075 | 43.81 | 12,313,895.75 |
| | COLES GROUP LTD | 322,075 | 17.81 | 5,736,155.75 |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 350,360 | 7.46 | 2,613,685.60 |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 291,895 | 35.46 | 10,350,596.70 |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 161,259 | 11.30 | 1,822,226.70 |
| | COCHLEAR LTD | 16,354 | 195.16 | 3,191,646.64 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 46,057 | 71.52 | 3,293,996.64 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 106,962 | 33.31 | 3,562,904.22 | |
| CSL LTD | 117,993 | 271.25 | 32,005,601.25 | |

| | | | | |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 671,744 | 21.91 | 14,717,911.04 |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 416,626 | 90.16 | 37,563,000.16 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 794,821 | 27.02 | 21,476,063.42 |
| | WESTPAC BANKING CORP | 859,869 | 19.48 | 16,750,248.12 |
| | ASX LTD | 44,474 | 82.04 | 3,648,646.96 |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 90,322 | 165.33 | 14,932,936.26 |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 633,183 | 4.36 | 2,760,677.88 |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 722,151 | 3.23 | 2,332,547.73 |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 353,556 | 12.05 | 4,260,349.80 |
| | SUNCORP GROUP LTD | 302,547 | 10.84 | 3,279,609.48 |
| | LENLEASE GROUP | 163,134 | 9.21 | 1,502,464.14 |
| | COMPUTERSHARE LTD | 125,767 | 23.65 | 2,974,389.55 |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 30,612 | 39.00 | 1,193,868.00 |
| | XERO LTD | 33,577 | 82.15 | 2,758,350.55 |
| | TELSTRA CORP LTD | 1,030,544 | 3.89 | 4,008,816.16 |
| | APA GROUP | 286,888 | 11.50 | 3,299,212.00 |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 435,777 | 5.55 | 2,418,562.35 |
| | オーストラリアドル 小計 | 16,891,722 | | 356,729,959.75 (33,158,049,758) |
| イギリスポンド | BP PLC | 4,626,613 | 3.86 | 17,881,859.24 |
| | SHELL PLC | 1,804,357 | 20.87 | 37,665,952.37 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 301,309 | 30.66 | 9,238,133.94 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 97,854 | 11.84 | 1,159,080.63 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 34,786 | 63.04 | 2,192,909.44 |
| | GLENCORE PLC | 2,340,955 | 4.46 | 10,446,511.68 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 40,850 | 19.85 | 811,076.75 |
| | MONDI PLC | 117,505 | 14.76 | 1,734,961.32 |
| | RIO TINTO PLC | 265,734 | 49.79 | 13,230,895.86 |
| | ASHTREAD GROUP PLC | 105,990 | 35.51 | 3,763,704.90 |
| | BAE SYSTEMS PLC | 746,111 | 7.83 | 5,842,049.13 |
| | BUNZL PLC | 80,770 | 26.44 | 2,135,558.80 |
| | DCC PLC | 23,269 | 50.02 | 1,163,915.38 |
| | FERGUSON PLC | 51,993 | 92.00 | 4,783,356.00 |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 971,774 | 1.51 | 1,475,638.81 |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 1,875,280 | 0.80 | 1,517,851.63 |
| | SMITHS GROUP PLC | 91,485 | 13.99 | 1,279,875.15 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 19,121 | 97.00 | 1,854,737.00 |
| EXPERIAN PLC | 219,631 | 23.90 | 5,249,180.90 |
| INTERTEK GROUP PLC | 38,833 | 43.25 | 1,679,527.25 |
| RELX PLC | 459,303 | 22.05 | 10,127,631.15 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 417,058 | 4.82 | 2,013,138.96 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 220,084 | 4.72 | 1,039,016.56 |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 25,023 | 37.36 | 934,859.28 |
| BURBERRY GROUP PLC | 90,880 | 16.98 | 1,543,142.40 |
| PERSIMMON PLC | 77,282 | 18.71 | 1,446,332.63 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 842,559 | 1.18 | 997,589.85 |
| COMPASS GROUP PLC | 423,453 | 16.97 | 7,185,997.41 |
| ENTAIN PLC | 139,711 | 13.36 | 1,866,538.96 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 42,043 | 44.04 | 1,851,573.72 |
| WHITBREAD PLC | 51,832 | 25.56 | 1,324,825.92 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 201,068 | 5.50 | 1,105,874.00 |
| INFORMA PLC | 359,575 | 5.42 | 1,951,053.95 |
| PEARSON PLC | 156,686 | 7.80 | 1,223,404.28 |
| WPP PLC | 281,680 | 8.10 | 2,281,608.00 |
| JD SPORTS FASHION PLC | 728,558 | 1.19 | 867,712.57 |
| KINGFISHER PLC | 450,309 | 2.43 | 1,095,601.79 |
| NEXT PLC | 30,253 | 59.82 | 1,809,734.46 |
| OCADO GROUP PLC | 106,238 | 8.70 | 924,908.02 |
| SAINSBURY (J) PLC | 469,737 | 2.10 | 990,205.59 |
| TESCO PLC | 1,813,097 | 2.55 | 4,630,649.73 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 80,908 | 16.36 | 1,323,654.88 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 515,585 | 35.30 | 18,202,728.42 |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 44,409 | 18.15 | 806,023.35 |
| DIAGEO PLC | 548,716 | 36.58 | 20,074,774.86 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 207,965 | 18.38 | 3,823,436.52 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 169,592 | 62.46 | 10,592,716.32 |
| UNILEVER PLC | 606,919 | 37.37 | 22,680,563.03 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 218,758 | 11.65 | 2,548,530.70 |
| ASTRAZENECA PLC | 367,271 | 107.76 | 39,577,122.96 |
| GSK PLC | 1,203,687 | 17.56 | 21,139,151.09 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 33,592 | 16.37 | 549,901.04 |
| BARCLAYS PLC | 3,960,955 | 1.58 | 6,295,541.87 |

| | | | | | |
|--------|-----------------------------|------------|----------|------------------------------------|--|
| | HSBC HOLDINGS PLC | 4,800,120 | 5.37 | 25,791,044.76 | |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 16,823,850 | 0.43 | 7,300,709.70 | |
| | NATWEST GROUP PLC | 1,334,029 | 2.21 | 2,954,874.23 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 618,245 | 5.89 | 3,643,936.03 | |
| | 3I GROUP PLC | 237,189 | 11.22 | 2,662,446.52 | |
| | ABRDN PLC | 590,816 | 1.70 | 1,009,999.95 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 82,621 | 8.04 | 664,768.56 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 78,170 | 76.00 | 5,940,920.00 | |
| | M&G PLC | 557,560 | 1.98 | 1,107,314.16 | |
| | SCHRODERS PLC | 29,015 | 27.68 | 803,135.20 | |
| | ST JAMES' S PLACE PLC | 135,736 | 11.49 | 1,559,606.64 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 46,669 | 22.19 | 1,035,585.11 | |
| | AVIVA PLC | 673,904 | 4.11 | 2,773,114.96 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 1,417,356 | 2.44 | 3,466,852.77 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 165,125 | 6.20 | 1,025,096.00 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 650,465 | 9.86 | 6,414,885.83 | |
| | AVEVA GROUP PLC | 26,671 | 24.63 | 656,906.73 | |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 260,928 | 6.46 | 1,686,638.59 | |
| | HALMA PLC | 84,949 | 19.96 | 1,696,006.78 | |
| | BT GROUP PLC | 1,649,594 | 1.88 | 3,109,484.69 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 6,386,492 | 1.26 | 8,078,912.38 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 863,996 | 10.51 | 9,080,597.96 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 55,574 | 27.89 | 1,549,958.86 | |
| | SSE PLC | 252,205 | 16.49 | 4,160,121.47 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 171,891 | 10.12 | 1,739,536.92 | |
| | イギリスポンド 小計 | 67,192,176 | | 419,844,775.25 (69,328,967,737) | |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 60,430 | 17.72 | 1,070,819.60 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 1,775 | 723.00 | 1,283,325.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 2,200 | 3,310.00 | 7,282,000.00 | |
| | HOLCIM LTD | 138,706 | 43.72 | 6,064,226.32 | |
| | SIKA AG-REG | 36,057 | 227.30 | 8,195,756.10 | |
| | ABB LTD-REG | 403,187 | 25.46 | 10,265,141.02 | |
| | GEBERIT AG-REG | 8,573 | 477.00 | 4,089,321.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 5,116 | 169.00 | 864,604.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 10,424 | 172.05 | 1,793,449.20 | |

| | | | | |
|------|------------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|
| | VAT GROUP AG | 7,342 | 243.20 | 1,785,574.40 |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 43,353 | 33.86 | 1,467,932.58 |
| | SGS SA-REG | 1,515 | 2,205.00 | 3,340,575.00 |
| | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 12,470 | 226.10 | 2,819,467.00 |
| | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 128,484 | 102.15 | 13,124,640.60 |
| | SWATCH GROUP AG/THE-BR | 7,873 | 232.40 | 1,829,685.20 |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 11,657 | 43.34 | 505,214.38 |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 875 | 2,146.00 | 1,877,750.00 |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 256 | 9,600.00 | 2,457,600.00 |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 26 | 99,500.00 | 2,587,000.00 |
| | NESTLE SA-REG | 686,427 | 111.64 | 76,632,710.28 |
| | ALCON INC | 119,784 | 66.14 | 7,922,513.76 |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 12,893 | 309.00 | 3,983,937.00 |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 26,528 | 110.15 | 2,922,059.20 |
| | BACHEM HOLDING AG-REG B | 6,885 | 71.90 | 495,031.50 |
| | LONZA GROUP AG-REG | 18,499 | 512.80 | 9,486,287.20 |
| | NOVARTIS AG-REG | 534,356 | 80.60 | 43,069,093.60 |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 6,284 | 361.80 | 2,273,551.20 |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 171,786 | 318.80 | 54,765,376.80 |
| | VIFOR PHARMA AG-NEW | 11,245 | 164.50 | 1,849,802.50 |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 636,447 | 5.72 | 3,640,476.84 |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 51,473 | 45.26 | 2,329,667.98 |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 5,755 | 895.00 | 5,150,725.00 |
| | UBS GROUP AG-REG | 861,476 | 15.99 | 13,779,308.62 |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 10,786 | 155.70 | 1,679,380.20 |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 8,005 | 472.00 | 3,778,360.00 |
| | SWISS RE AG | 73,201 | 75.12 | 5,498,859.12 |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 36,609 | 418.00 | 15,302,562.00 |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 18,333 | 85.45 | 1,566,554.85 |
| | TEMENOS AG - REG | 15,481 | 84.84 | 1,313,408.04 |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 40,153 | 53.38 | 2,143,367.14 |
| | SWISSCOM AG-REG | 6,023 | 522.40 | 3,146,415.20 |
| | スイスフラン 小計 | 4,238,748 | | 335,433,529.43 (47,151,891,231) |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 669,868 | 52.85 | 35,402,523.80 |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 347,500 | 84.65 | 29,415,875.00 |

| | | | | | |
|--------------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
| | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | 428,000 | 18.20 | 7,789,600.00 | |
| | MTR CORP | 376,500 | 41.00 | 15,436,500.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 352,000 | 22.80 | 8,025,600.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 521,000 | 42.00 | 21,882,000.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 503,200 | 15.10 | 7,598,320.00 | |
| | CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 471,200 | 14.14 | 6,662,768.00 | |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 424,400 | 22.60 | 9,591,440.00 | |
| | WH GROUP LTD | 2,099,000 | 5.60 | 11,754,400.00 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 900,000 | 31.00 | 27,900,000.00 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 179,100 | 138.00 | 24,715,800.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 295,900 | 374.20 | 110,725,780.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 2,959,200 | 80.60 | 238,511,520.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 469,868 | 54.60 | 25,654,792.80 | |
| | ESR GROUP LTD | 496,800 | 20.20 | 10,035,360.00 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 494,000 | 14.40 | 7,113,600.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 319,641 | 29.00 | 9,269,589.00 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 362,250 | 28.15 | 10,197,337.50 | |
| | SINO LAND CO | 913,400 | 11.22 | 10,248,348.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 364,000 | 92.00 | 33,488,000.00 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 145,000 | 46.20 | 6,699,000.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 305,600 | 19.00 | 5,806,400.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 441,000 | 35.35 | 15,589,350.00 | |
| | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 891,000 | 10.52 | 9,373,320.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 160,500 | 48.45 | 7,776,225.00 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 386,000 | 65.20 | 25,167,200.00 | |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 501,500 | 7.23 | 3,625,845.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 2,748,348 | 8.37 | 23,003,672.76 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 342,500 | 48.60 | 16,645,500.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 19,868,275 | | 775,105,666.86 (13,293,062,186) | |
| シンガポールド ル | KEPPEL CORP LTD | 323,200 | 6.56 | 2,120,192.00 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 390,400 | 4.01 | 1,565,504.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 282,840 | 5.15 | 1,456,626.00 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 1,234,500 | 0.72 | 895,012.50 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 404,300 | 4.05 | 1,637,415.00 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 446,100 | 29.81 | 13,298,241.00 | |

| | | | | | |
|------------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 837,700 | 11.33 | 9,491,141.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 285,000 | 26.40 | 7,524,000.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 236,500 | 9.47 | 2,239,655.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 640,800 | 3.85 | 2,467,080.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 118,100 | 8.16 | 963,696.00 | |
| | UOL GROUP LTD | 104,000 | 7.34 | 763,360.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 76,900 | 16.71 | 1,284,999.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 2,024,160 | 2.58 | 5,222,332.80 | |
| | シンガポールドル 小計 | 7,404,500 | | 50,929,254.30 (4,946,758,470) | |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 264,685 | 7.32 | 1,938,817.62 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 140,716 | 19.73 | 2,776,326.68 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 496,619 | 4.78 | 2,373,838.82 | |
| | MERCURY NZ LTD | 216,705 | 5.59 | 1,211,380.95 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 310,651 | 4.42 | 1,373,077.42 | |
| | ニュージーランドドル 小計 | 1,429,376 | | 9,673,441.49 (819,824,166) | |
| スウェーデンクローネ | BOLIDEN AB | 66,747 | 330.50 | 22,059,883.50 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 22,549 | 422.20 | 9,520,187.80 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 157,878 | 153.30 | 24,202,697.40 | |
| | ALFA LAVAL AB | 78,335 | 246.30 | 19,293,910.50 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 240,358 | 212.50 | 51,076,075.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 677,208 | 94.33 | 63,881,030.64 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 378,913 | 83.96 | 31,813,535.48 | |
| | EPIROC AB-A | 160,218 | 159.00 | 25,474,662.00 | |
| | EPIROC AB-B | 107,310 | 136.20 | 14,615,622.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 100,182 | 75.34 | 7,547,711.88 | |
| | INDUTRADE AB | 65,800 | 183.30 | 12,061,140.00 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 35,887 | 198.70 | 7,130,746.90 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 51,400 | 160.15 | 8,231,710.00 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 360,523 | 72.28 | 26,058,602.44 | |
| | SANDVIK AB | 257,846 | 167.50 | 43,189,205.00 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 80,533 | 150.50 | 12,120,216.50 | |
| | SKF AB-B SHARES | 87,271 | 149.45 | 13,042,650.95 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 40,985 | 163.30 | 6,692,850.50 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 384,686 | 157.28 | 60,503,414.08 | |

| | | | | | |
|-----------|------------------------------|-----------|--------|--------------------------------------|--|
| | SECURITAS AB-B SHS | 63,836 | 87.04 | 5,556,285.44 | |
| | VOLVO CAR AB-B | 142,600 | 78.00 | 11,122,800.00 | |
| | ELECTROLUX AB-B | 54,636 | 134.64 | 7,356,191.04 | |
| | EVOLUTION AB | 43,381 | 961.30 | 41,702,155.30 | |
| | EMBRACER GROUP AB | 170,300 | 79.44 | 13,528,632.00 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 182,789 | 121.48 | 22,205,207.72 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 370,792 | 100.90 | 37,412,912.80 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 146,789 | 262.20 | 38,488,075.80 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 49,890 | 230.40 | 11,494,656.00 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 40,401 | 217.30 | 8,779,137.30 | |
| | NORDEA BANK ABP | 821,029 | 93.30 | 76,602,005.70 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 383,004 | 101.60 | 38,913,206.40 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 370,450 | 87.00 | 32,229,150.00 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 221,019 | 130.85 | 28,920,336.15 | |
| | EQT AB | 68,671 | 215.60 | 14,805,467.60 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 33,271 | 228.10 | 7,589,115.10 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 34,500 | 226.00 | 7,797,000.00 | |
| | INVESTOR AB-A SHS | 122,200 | 182.80 | 22,338,160.00 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 456,798 | 165.60 | 75,645,748.80 | |
| | KINNEVIK AB - B | 54,482 | 162.45 | 8,850,600.90 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 24,225 | 416.00 | 10,077,600.00 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 147,348 | 51.75 | 7,625,259.00 | |
| | SAGAX AB-B | 47,300 | 194.00 | 9,176,200.00 | |
| | SINCH AB | 111,000 | 38.43 | 4,265,730.00 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 704,743 | 78.19 | 55,103,855.17 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 473,279 | 105.70 | 50,025,590.30 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 126,229 | 114.10 | 14,402,728.90 | |
| | TELIA CO AB | 635,848 | 39.08 | 24,848,939.84 | |
| | スウェーデンクローネ 小計 | 9,455,439 | | 1,145,378,599.83 (15,210,627,805) | |
| ノルウェークローネ | AKER BP ASA | 76,978 | 331.70 | 25,533,602.60 | |
| | EQUINOR ASA | 240,790 | 324.25 | 78,076,157.50 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 311,715 | 60.38 | 18,821,351.70 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 40,074 | 428.00 | 17,151,672.00 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 22,000 | 324.40 | 7,136,800.00 | |
| | ADEVINTA ASA | 55,857 | 76.55 | 4,275,853.35 | |

| | | | | | |
|-----------|---------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|--|
| | MOWI ASA | 94,231 | 225.80 | 21,277,359.80 | |
| | ORKLA ASA | 202,392 | 75.34 | 15,248,213.28 | |
| | SALMAR ASA | 14,333 | 659.50 | 9,452,613.50 | |
| | DNB BANK ASA | 237,780 | 176.00 | 41,849,280.00 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 50,151 | 188.20 | 9,438,418.20 | |
| | TELENOR ASA | 175,177 | 130.95 | 22,939,428.15 | |
| | ノルウェークローネ 小計 | 1,521,478 | | 271,200,750.08 (3,691,042,208) | |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 27,638 | 526.20 | 14,543,115.60 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 48,791 | 418.10 | 20,399,517.10 | |
| | ROCKWOOL A/S-B SHS | 1,690 | 1,667.50 | 2,818,075.00 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 237,822 | 164.50 | 39,121,719.00 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 828 | 16,840.00 | 13,943,520.00 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 1,173 | 17,105.00 | 20,064,165.00 | |
| | DSV A/S | 48,574 | 1,027.00 | 49,885,498.00 | |
| | PANDORA A/S | 26,106 | 469.70 | 12,261,988.20 | |
| | CARLSBERG AS-B | 25,068 | 897.60 | 22,501,036.80 | |
| | COLOPLAST-B | 28,607 | 810.60 | 23,188,834.20 | |
| | DEMANT A/S | 21,128 | 288.80 | 6,101,766.40 | |
| | GN STORE NORD A/S | 31,620 | 244.20 | 7,721,604.00 | |
| | GENMAB A/S | 16,016 | 2,232.00 | 35,747,712.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 412,598 | 786.30 | 324,425,807.40 | |
| | DANSKE BANK A/S | 170,723 | 107.45 | 18,344,186.35 | |
| | TRYG A/S | 80,244 | 156.40 | 12,550,161.60 | |
| | ORSTED A/S | 47,370 | 734.60 | 34,798,002.00 | |
| | デンマーククローネ 小計 | 1,225,996 | | 658,416,708.65 (12,569,174,968) | |
| イスラエルシエケル | ICL GROUP LTD | 169,185 | 32.35 | 5,473,134.75 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 5,590 | 706.00 | 3,946,540.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 298,914 | 29.10 | 8,698,397.40 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 362,511 | 31.35 | 11,364,719.85 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 326,884 | 18.62 | 6,086,580.08 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 36,998 | 113.50 | 4,199,273.00 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 9,206 | 257.10 | 2,366,862.60 | |
| | NICE LTD | 15,467 | 706.70 | 10,930,528.90 | |
| | TOWER SEMICONDUCTOR LTD | 26,100 | 160.20 | 4,181,220.00 | |

| | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | イスラエルシエケル 小計 | 1,250,855 | | 57,247,256.58 (2,262,875,282) |
| ユーロ | ENI SPA | 620,938 | 11.66 | 7,243,862.70 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 112,235 | 11.28 | 1,266,010.80 |
| | NESTE OYJ | 106,487 | 41.53 | 4,422,405.11 |
| | OMV AG | 36,303 | 44.62 | 1,619,839.86 |
| | REPSOL SA | 339,527 | 13.75 | 4,668,496.25 |
| | TENARIS SA | 107,421 | 12.45 | 1,337,391.45 |
| | TOTALENERGIES SE | 604,441 | 49.55 | 29,953,073.75 |
| | AIR LIQUIDE SA | 127,565 | 134.90 | 17,208,518.50 |
| | AKZO NOBEL N.V. | 46,307 | 64.48 | 2,985,875.36 |
| | ARCELORMITTAL | 157,243 | 22.50 | 3,537,967.50 |
| | ARKEMA | 14,240 | 89.62 | 1,276,188.80 |
| | BASF SE | 226,869 | 42.21 | 9,577,274.83 |
| | COVESTRO AG | 44,321 | 34.48 | 1,528,188.08 |
| | CRH PLC | 183,637 | 33.03 | 6,065,530.11 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 55,181 | 21.41 | 1,181,425.21 |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 32,708 | 48.49 | 1,586,010.92 |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 43,355 | 137.75 | 5,972,151.25 |
| | OCI NV | 24,712 | 30.38 | 750,750.56 |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 60,469 | 32.90 | 1,989,430.10 |
| | SOLVAY SA | 20,005 | 79.76 | 1,595,598.80 |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 126,844 | 15.20 | 1,928,028.80 |
| | SYMRISE AG | 31,654 | 106.20 | 3,361,654.80 |
| | UMICORE | 49,949 | 32.54 | 1,625,340.46 |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 126,686 | 29.17 | 3,695,430.62 |
| | VOESTALPINE AG | 22,917 | 21.10 | 483,548.70 |
| | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 49,107 | 23.80 | 1,168,746.60 |
| | AIRBUS SE | 143,967 | 92.50 | 13,316,947.50 |
| | ALSTOM | 79,699 | 23.52 | 1,874,520.48 |
| | BOUYGUES SA | 56,405 | 30.84 | 1,739,530.20 |
| | BRENTAG SE | 36,173 | 60.80 | 2,199,318.40 |
| | CNH INDUSTRIAL NV | 236,988 | 11.42 | 2,706,402.96 |
| | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 118,419 | 43.24 | 5,121,029.65 |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 107,361 | 25.73 | 2,762,398.53 |
| | DASSAULT AVIATION SA | 6,763 | 147.00 | 994,161.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| EIFFAGE | 19,782 | 88.96 | 1,759,806.72 |
| FERROVIAL SA | 125,888 | 24.48 | 3,081,738.24 |
| GEA GROUP AG | 42,462 | 33.19 | 1,409,313.78 |
| IMCD NV | 15,287 | 128.65 | 1,966,672.55 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 39,132 | 59.18 | 2,315,831.76 |
| KION GROUP AG | 16,163 | 40.11 | 648,297.93 |
| KNORR-BREMSE AG | 18,716 | 57.22 | 1,070,929.52 |
| KONE OYJ-B | 80,811 | 42.77 | 3,456,286.47 |
| LEGRAND SA | 64,936 | 71.68 | 4,654,612.48 |
| MTU AERO ENGINES AG | 12,232 | 173.60 | 2,123,475.20 |
| PRYSMIAN SPA | 57,118 | 27.31 | 1,559,892.58 |
| RATIONAL AG | 1,276 | 554.00 | 706,904.00 |
| RHEINMETALL AG | 10,339 | 206.40 | 2,133,969.60 |
| SAFRAN SA | 82,301 | 95.00 | 7,818,595.00 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 132,219 | 116.74 | 15,435,246.06 |
| SIEMENS AG-REG | 187,219 | 102.62 | 19,212,413.78 |
| SIEMENS ENERGY AG | 103,904 | 15.70 | 1,631,292.80 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 63,080 | 17.85 | 1,125,978.00 |
| THALES SA | 26,504 | 113.55 | 3,009,529.20 |
| VINCI SA | 126,791 | 87.75 | 11,125,910.25 |
| WARTSILA OYJ ABP | 111,799 | 7.44 | 832,678.95 |
| BUREAU VERITAS SA | 78,565 | 25.39 | 1,994,765.35 |
| RANDSTAD NV | 27,042 | 47.37 | 1,280,979.54 |
| TELEPERFORMANCE | 14,899 | 294.20 | 4,383,285.80 |
| WOLTERS KLUWER | 65,436 | 90.26 | 5,906,253.36 |
| ADP | 7,502 | 128.10 | 961,006.20 |
| AENA SME SA | 17,626 | 129.80 | 2,287,854.80 |
| ATLANTIA SPA | 118,623 | 22.20 | 2,633,430.60 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 120,311 | 5.96 | 717,775.42 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 238,994 | 35.90 | 8,581,079.57 |
| GETLINK SE | 108,240 | 17.50 | 1,894,200.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 84,377 | 74.94 | 6,323,212.38 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 11,827 | 69.40 | 820,793.80 |
| CONTINENTAL AG | 26,825 | 66.62 | 1,787,081.50 |
| FERRARI NV | 30,464 | 179.70 | 5,474,380.80 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 197,374 | 58.56 | 11,558,221.44 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| MICHELIN (CGDE) | 157,128 | 26.24 | 4,123,824.36 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 39,420 | 64.80 | 2,554,416.00 |
| RENAULT SA | 45,587 | 24.71 | 1,126,454.77 |
| STELLANTIS NV | 524,532 | 12.42 | 6,518,883.69 |
| VALEO | 48,595 | 18.81 | 914,071.95 |
| VOLKSWAGEN AG | 7,018 | 180.95 | 1,269,907.10 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 44,863 | 139.18 | 6,244,032.34 |
| ADIDAS AG | 43,151 | 170.36 | 7,351,204.36 |
| ESSILORLUXOTTICA | 68,522 | 146.55 | 10,041,899.10 |
| HERMES INTERNATIONAL | 7,573 | 1,067.50 | 8,084,177.50 |
| KERING | 18,415 | 502.50 | 9,253,537.50 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 67,837 | 587.40 | 39,847,453.80 |
| MONCLER SPA | 55,281 | 39.70 | 2,194,655.70 |
| PUMA SE | 25,641 | 66.88 | 1,714,870.08 |
| SEB SA | 5,031 | 93.65 | 471,153.15 |
| ACCOR SA | 40,565 | 28.20 | 1,143,933.00 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 39,963 | 101.95 | 4,074,227.85 |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 27,020 | 33.90 | 915,978.00 |
| SODEXO SA | 22,438 | 66.88 | 1,500,653.44 |
| BOLLORE SE | 192,893 | 4.90 | 946,333.05 |
| PUBLICIS GROUPE | 56,461 | 46.61 | 2,631,647.21 |
| SCOUT24 SE | 19,461 | 51.50 | 1,002,241.50 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 20,939 | 44.98 | 941,836.22 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 173,037 | 20.00 | 3,460,740.00 |
| VIVENDI SE | 154,775 | 10.06 | 1,557,810.37 |
| D'IETEREN GROUP | 5,975 | 135.30 | 808,417.50 |
| DELIVERY HERO SE | 35,184 | 39.59 | 1,392,934.56 |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 270,864 | 21.93 | 5,940,047.52 |
| JUST EAT TAKEAWAY | 38,653 | 18.32 | 708,200.26 |
| PROSUS NV | 204,240 | 53.07 | 10,839,016.80 |
| ZALANDO SE | 58,216 | 25.14 | 1,463,550.24 |
| CARREFOUR SA | 150,323 | 17.07 | 2,566,765.22 |
| HELLOFRESH SE | 45,738 | 30.70 | 1,404,156.60 |
| JERONIMO MARTINS | 75,670 | 19.56 | 1,480,105.20 |
| KESKO OYJ-B SHS | 73,664 | 21.47 | 1,581,566.08 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 248,787 | 24.91 | 6,198,528.10 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 213,722 | 50.81 | 10,859,214.82 |
| DANONE | 156,095 | 52.59 | 8,209,036.05 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 114,974 | 10.02 | 1,152,614.35 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 24,952 | 70.60 | 1,761,611.20 |
| HEINEKEN NV | 63,091 | 89.04 | 5,617,622.64 |
| JDE PEET' S NV | 24,300 | 25.90 | 629,370.00 |
| KERRY GROUP PLC-A | 38,331 | 91.66 | 3,513,419.46 |
| PERNOD RICARD SA | 49,978 | 179.90 | 8,991,042.20 |
| REMY COINTREAU | 4,720 | 169.00 | 797,680.00 |
| BEIERSDORF AG | 26,061 | 97.98 | 2,553,456.78 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 22,589 | 59.05 | 1,333,880.45 |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 45,340 | 60.36 | 2,736,722.40 |
| L' OREAL | 58,865 | 336.85 | 19,828,675.25 |
| AMPLIFON SPA | 28,180 | 29.80 | 839,764.00 |
| BIOMERIEUX | 9,711 | 91.40 | 887,585.40 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 8,610 | 114.15 | 982,831.50 |
| DIASORIN SPA | 6,146 | 127.75 | 785,151.50 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 47,268 | 47.09 | 2,225,850.12 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 100,903 | 28.10 | 2,835,374.30 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 214,640 | 20.61 | 4,423,730.40 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 6,294 | 328.20 | 2,065,690.80 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 68,019 | 46.83 | 3,185,329.77 |
| ARGENX SE | 11,586 | 336.30 | 3,896,371.80 |
| BAYER AG-REG | 241,336 | 57.79 | 13,946,807.44 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 33,636 | 78.80 | 2,650,516.80 |
| GRIFOLS SA | 63,628 | 18.53 | 1,179,026.84 |
| IPSEN | 9,843 | 87.90 | 865,199.70 |
| MERCK KGAA | 31,163 | 164.80 | 5,135,662.40 |
| ORION OYJ-CLASS B | 26,484 | 37.73 | 999,241.32 |
| QIAGEN N. V. | 55,231 | 43.50 | 2,402,548.50 |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 23,003 | 41.86 | 962,905.58 |
| SANOFI | 277,731 | 100.56 | 27,928,629.36 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 6,259 | 305.30 | 1,910,872.70 |
| UCB SA | 29,134 | 80.94 | 2,358,105.96 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 99,792 | 11.37 | 1,135,134.00 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 1,602,976 | 4.34 | 6,961,724.76 |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|------------|------------------|
| BANCO SANTANDER SA | 4, 265, 983 | 2. 76 | 11, 774, 113. 08 |
| BNP PARIBAS | 264, 240 | 47. 93 | 12, 666, 344. 40 |
| CAIXABANK SA | 1, 086, 917 | 3. 39 | 3, 693, 343. 96 |
| COMMERZBANK AG | 259, 290 | 7. 32 | 1, 900, 077. 12 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 292, 185 | 9. 17 | 2, 681, 966. 11 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 82, 077 | 26. 11 | 2, 143, 030. 47 |
| FINECOBANK SPA | 159, 436 | 12. 02 | 1, 916, 420. 72 |
| ING GROEP NV | 964, 164 | 9. 77 | 9, 428, 559. 75 |
| INTESA SANPAOLO | 4, 128, 120 | 1. 88 | 7, 769, 947. 46 |
| KBC GROUP NV | 58, 770 | 55. 92 | 3, 286, 418. 40 |
| MEDIOBANCA SPA | 133, 581 | 8. 62 | 1, 152, 536. 86 |
| SOCIETE GENERALE SA | 191, 967 | 22. 80 | 4, 376, 847. 60 |
| UNICREDIT SPA | 524, 940 | 9. 82 | 5, 157, 010. 56 |
| AMUNDI SA | 14, 529 | 52. 15 | 757, 687. 35 |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 502, 816 | 8. 91 | 4, 484, 615. 90 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 46, 790 | 157. 30 | 7, 360, 067. 00 |
| EURAZEO SE | 11, 669 | 62. 60 | 730, 479. 40 |
| EURONEXT NV | 22, 771 | 77. 60 | 1, 767, 029. 60 |
| EXOR NV | 24, 087 | 62. 42 | 1, 503, 510. 54 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 26, 602 | 80. 62 | 2, 144, 653. 24 |
| SOFINA | 3, 472 | 200. 80 | 697, 177. 60 |
| WENDEL | 4, 862 | 81. 60 | 396, 739. 20 |
| AEGON NV | 420, 133 | 4. 25 | 1, 786, 405. 51 |
| AGEAS | 41, 152 | 41. 88 | 1, 723, 445. 76 |
| ALLIANZ SE-REG | 99, 817 | 181. 20 | 18, 086, 840. 40 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 276, 459 | 16. 02 | 4, 428, 873. 18 |
| AXA SA | 462, 090 | 22. 46 | 10, 380, 851. 85 |
| HANNOVER RUECK SE | 15, 616 | 136. 85 | 2, 137, 049. 60 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 33, 773 | 222. 60 | 7, 517, 869. 80 |
| NN GROUP NV | 70, 175 | 42. 70 | 2, 996, 472. 50 |
| POSTE ITALIANE SPA | 144, 825 | 8. 94 | 1, 295, 604. 45 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 121, 476 | 40. 26 | 4, 890, 623. 76 |
| AROUNDTOWN SA | 217, 874 | 3. 61 | 786, 525. 14 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 16, 515 | 84. 66 | 1, 398, 159. 90 |
| VONOVIA SE | 167, 735 | 31. 70 | 5, 317, 199. 50 |
| ADYEN NV | 5, 442 | 1, 413. 20 | 7, 690, 634. 40 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| AMADEUS IT GROUP SA | 107,137 | 53.26 | 5,706,116.62 |
| BECHTLE AG | 16,599 | 39.19 | 650,514.81 |
| CAPGEMINI SE | 40,836 | 178.35 | 7,283,100.60 |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 162,161 | 36.63 | 5,940,768.23 |
| EDENRED | 57,660 | 45.01 | 2,595,276.60 |
| NEMETSCHEK SE | 12,512 | 59.92 | 749,719.04 |
| NEXI SPA | 117,100 | 8.28 | 969,588.00 |
| SAP SE | 255,078 | 92.33 | 23,551,351.74 |
| WORLDLINE SA | 56,144 | 38.53 | 2,163,228.32 |
| NOKIA OYJ | 1,286,027 | 4.45 | 5,722,820.15 |
| CELLNEX TELECOM SA | 129,553 | 38.95 | 5,046,089.35 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 795,722 | 18.88 | 15,023,231.36 |
| ELISA OYJ | 35,016 | 52.00 | 1,820,832.00 |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 71,656 | 9.97 | 714,696.94 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 790,408 | 3.37 | 2,666,046.18 |
| ORANGE | 464,184 | 11.10 | 5,155,227.50 |
| PROXIMUS | 45,991 | 14.04 | 645,713.64 |
| TELECOM ITALIA SPA | 1,943,722 | 0.26 | 507,117.06 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 297,838 | 2.75 | 819,054.50 |
| TELEFONICA SA | 1,339,470 | 4.73 | 6,341,050.98 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 30,096 | 27.98 | 842,086.08 |
| ACCIONA SA | 6,084 | 177.50 | 1,079,910.00 |
| E.ON SE | 542,467 | 8.60 | 4,666,301.13 |
| EDF | 142,706 | 7.72 | 1,102,546.55 |
| EDP RENOVAVEIS SA | 76,529 | 22.85 | 1,748,687.65 |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 670,325 | 4.49 | 3,010,429.57 |
| ELIA GROUP SA/NV | 7,849 | 133.60 | 1,048,626.40 |
| ENAGAS SA | 58,025 | 20.71 | 1,201,697.75 |
| ENDESA SA | 68,075 | 18.94 | 1,289,680.87 |
| ENEL SPA | 2,003,436 | 5.51 | 11,044,942.66 |
| ENGIE | 423,182 | 11.34 | 4,801,422.97 |
| FORTUM OYJ | 109,087 | 15.95 | 1,740,483.08 |
| IBERDROLA SA | 1,416,629 | 10.05 | 14,244,204.59 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 30,692 | 26.85 | 824,080.20 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 107,402 | 18.41 | 1,977,270.82 |
| RWE AG | 154,791 | 37.42 | 5,792,279.22 |

| | | | | | |
|--|------------------------------|-------------|--------|--|--|
| | SNAM SPA | 511,534 | 4.96 | 2,537,208.64 | |
| | TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 355,992 | 7.45 | 2,652,140.40 | |
| | UNIPER SE | 24,220 | 17.80 | 431,116.00 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 155,272 | 23.91 | 3,712,553.52 | |
| | VERBUND AG | 17,785 | 94.55 | 1,681,571.75 | |
| | ASM INTERNATIONAL NV | 11,484 | 246.90 | 2,835,399.60 | |
| | ASML HOLDING NV | 99,260 | 484.85 | 48,126,211.00 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 315,978 | 24.06 | 7,602,430.68 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 170,006 | 31.79 | 5,404,490.74 | |
| | ユーロ 小計 | 44,297,081 | | 988,938,822.30 (140,458,980,931) | |
| | 合 計 | 265,113,889 | | 1,518,656,312,087 (1,518,656,312,087) | |

(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 | 35,961 | 5,161,482.33 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 73,695 | 2,596,274.85 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 111,317 | 29,126,093.05 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 34,573 | 6,746,920.95 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 35,954 | 3,307,768.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 25,138 | 3,396,395.18 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 105,663 | 18,489,968.37 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 70,071 | 9,725,854.80 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 95,130 | 5,465,218.50 | |
| | | EQUINIX INC | 22,296 | 15,365,734.32 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 45,002 | 3,305,396.90 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 88,969 | 6,389,753.58 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 15,344 | 4,015,678.24 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 32,590 | 5,617,538.30 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 137,987 | 3,601,460.70 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 170,092 | 2,736,780.28 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 152,519 | 5,415,949.69 | |

| | | | | | |
|-------------|------|------------------------------|-----------|----------------|------------------|
| | | IRON MOUNTAIN INC | 69,114 | 3,418,378.44 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 150,513 | 3,031,331.82 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 144,787 | 2,241,302.76 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 28,311 | 4,884,496.83 | |
| | | PROLOGIS INC | 181,060 | 22,196,145.40 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 38,651 | 12,143,757.69 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 139,365 | 9,642,664.35 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 34,913 | 2,146,451.24 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 26,255 | 8,604,551.15 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 81,113 | 8,080,477.06 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 28,471 | 4,635,078.80 | |
| | | UDR INC | 81,494 | 3,760,948.10 | |
| | | VENTAS INC | 97,631 | 5,001,636.13 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 239,682 | 7,267,158.24 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 45,746 | 1,366,890.48 | |
| | | WELLTOWER INC | 109,835 | 9,155,845.60 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 178,691 | 6,134,462.03 | |
| | | WP CAREY INC | 45,569 | 3,908,908.82 | |
| アメリカドル合計 | | | 2,973,502 | 248,084,752.98 | (33,394,688,598) |
| カナダドル | 投資証券 | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 23,300 | 1,047,568.00 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 30,800 | 628,012.00 | |
| カナダドル合計 | | | 54,100 | 1,675,580.00 | (174,628,947) |
| オーストラリアドル | 投資証券 | DEXUS/AU | 256,609 | 2,396,728.06 | |
| | | GOODMAN GROUP | 402,659 | 7,521,670.12 | |
| | | GPT GROUP | 503,454 | 2,230,301.22 | |
| | | MIRVAC GROUP | 900,300 | 1,917,639.00 | |
| | | SCENTRE GROUP | 1,280,066 | 3,430,576.88 | |
| | | STOCKLAND | 543,065 | 2,090,800.25 | |
| | | VICINITY CENTRES | 995,999 | 1,852,558.14 | |
| オーストラリアドル合計 | | | 4,882,152 | 21,440,273.67 | (1,992,873,437) |
| イギリス ポンド | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC | 226,495 | 1,118,885.30 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 155,633 | 1,114,643.54 | |
| | | SEGREO PLC | 285,655 | 2,933,676.85 | |

| | | | | |
|------------|------|------------------------------|-----------|------------------------------------|
| イギリスポンド合計 | | | 667,783 | 5,167,205.69 (853,260,675) |
| 香港ドル | 投資証券 | LINK REIT | 501,400 | 31,964,250.00 |
| 香港ドル合計 | | | 501,400 | 31,964,250.00 (548,186,887) |
| シンガポールドル | 投資証券 | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 742,800 | 2,094,696.00 |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 1,266,771 | 2,774,228.49 |
| | | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 650,700 | 1,203,795.00 |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 704,700 | 1,197,990.00 |
| シンガポールドル合計 | | | 3,364,971 | 7,270,709.49 (706,204,012) |
| ユーロ | 投資証券 | COVIVIO | 13,302 | 757,548.90 |
| | | GECINA SA | 12,159 | 1,136,258.55 |
| | | KLEPIERRE | 53,185 | 1,101,461.35 |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 27,221 | 1,416,036.42 |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 35,405 | 1,108,884.60 |
| ユーロ合計 | | | 141,272 | 5,520,189.82 (784,032,560) |
| 合計 | | | | 38,453,875,116 (38,453,875,116) |

(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 604 銘柄 | 97.10% | — | 71.76% |
| | 投資証券 35 銘柄 | — | 2.90% | 2.14% |
| カナダドル | 株式 86 銘柄 | 99.70% | — | 3.75% |
| | 投資証券 2 銘柄 | — | 0.30% | 0.01% |
| オーストラリアドル | 株式 52 銘柄 | 94.33% | — | 2.13% |
| | 投資証券 7 銘柄 | — | 5.67% | 0.13% |
| イギリスポンド | 株式 78 銘柄 | 98.78% | — | 4.45% |
| | 投資証券 3 銘柄 | — | 1.22% | 0.05% |
| スイスフラン | 株式 41 銘柄 | 100.00% | — | 3.03% |
| 香港ドル | 株式 30 銘柄 | 96.04% | — | 0.85% |
| | 投資証券 1 銘柄 | — | 3.96% | 0.04% |

| | | | | | |
|------------|------|--------|---------|--------|-------|
| シンガポールドル | 株式 | 14 銘柄 | 87.51% | — | 0.32% |
| | 投資証券 | 4 銘柄 | — | 12.49% | 0.05% |
| 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 | 47 銘柄 | 100.00% | — | 0.98% |
| ノルウェークローネ | 株式 | 12 銘柄 | 100.00% | — | 0.24% |
| デンマーククローネ | 株式 | 17 銘柄 | 100.00% | — | 0.81% |
| イスラエルシェケル | 株式 | 9 銘柄 | 100.00% | — | 0.15% |
| ユーロ | 株式 | 223 銘柄 | 99.44% | — | 9.02% |
| | 投資証券 | 5 銘柄 | — | 0.56% | 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)

[令和4年6月27日現在]

| | |
|-------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,626,623,928 |
| コール・ローン | 619,461,577 |
| 株式 | 311,872,425,893 |
| 投資証券 | 319,254,917 |
| 派生商品評価勘定 | 124,738,520 |
| 未収入金 | 163,486,465 |
| 未収配当金 | 992,735,976 |
| 差入委託証拠金 | 2,182,477,054 |
| 流動資産合計 | 320,901,204,330 |
| 資産合計 | 320,901,204,330 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 567,914 |
| 未払解約金 | 445,173,469 |
| 未払利息 | 766 |
| 流動負債合計 | 445,742,149 |
| 負債合計 | 445,742,149 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 103,718,140,955 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 216,737,321,226 |

| | |
|---------|-----------------|
| 元本等合計 | 320,455,462,181 |
| 純資産合計 | 320,455,462,181 |
| 負債純資産合計 | 320,901,204,330 |

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 | <p>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。</p> <p>新株予約権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。</p> <p>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。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項 | <p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「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。</p> |

(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 (令和4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

① 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

令和4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SWIFT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、令和4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、令和4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。

② 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)

| | [令和4年6月27日現在] |
|---------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 令和3年6月26日 |
| 期首元本額 | 72,969,315,261円 |
| 期中追加設定元本額 | 44,715,217,143円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,966,391,449円 |
| 元本の内訳※ | |
| MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信 | 581,508,572円 |
| eMAXIS 新興国株式インデックス | 10,974,509,169円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型） | 1,618,088,698円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型） | 257,988,532円 |

| | |
|----------------------------------|------------------|
| 三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金） | 483,734,656円 |
| コアバランス | 68,923円 |
| eMAXIS Slim バランス（8資産均等型） | 5,981,072,310円 |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス | 27,895,608,101円 |
| つみたて新興国株式 | 5,426,871,793円 |
| つみたて8資産均等バランス | 2,698,175,773円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 702,408円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,645,516円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 4,707,448円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本） | 5,744,739,143円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型） | 570,947,504円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カンントリー） | 20,735,378,841円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け） | 2,262,534,579円 |
| つみたて全世界株式 | 17,356,536円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式 | 642,959,779円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型） | 15,254,163円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型） | 141,395,767円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型） | 173,790,630円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 13,599,872,347円 |
| 新興国株式インデックスオープン | 460,059,062円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 764,695,200円 |
| 新興国株式インデックスファンド（ラップ向け） | 447,936円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー） | 36,189,643円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー） | 197,498,568円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード） | 183,063,481円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー） | 695,416,191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） | 1,234,251,455円 |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定） | 15,975,364円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定） | 61,930,413円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 60,731,444円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定） | 60,437,882円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 59,469,053円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定） | 59,064,075円 |
| 合計 | 103,718,140,955円 |
| 2. 受益権の総数 | 103,718,140,955口 |

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 令和 3年 6月 26日 至 令和 4年 6月 27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。 |

| | |
|-------------------|---|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>す。</p> <p>当ファンドは、新株予約権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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> |
|-------------------|---|

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和 4 年 6 月 27 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 | <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> |
| 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 | [令和 4 年 6 月 27 日現在] | |
|------|---------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額 (円) | |
| 株式 | 1,364,597,333 | |
| 投資証券 | △24,509,738 | |
| 合計 | 1,340,087,595 | |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 6 月 27 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 | 8,292,251,951 | — | 8,416,980,903 | 124,728,952 |
| | 合計 | 8,292,251,951 | — | 8,416,980,903 | 124,728,952 |

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[令和 4 年 6 月 27 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 | 347,198,434 | — | 346,630,520 | △567,914 |
| | 売建 | | | | |
| | オフショア元 | 3,411,674 | — | 3,402,106 | 9,568 |
| | 合計 | 350,610,108 | — | 350,032,626 | △558,346 |

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|--------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.0897円 |
| (1万口当たり純資産額) | (30,897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-SPON ADR | 1,793,679 | — | — | |
| | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 535,200 | 1.55 | 831,700.80 | |
| | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 122,600 | — | — | |
| | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 28,270 | — | — | |
| | 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 | 68,283 | 7.10 | 484,809.30 | |
| | MMC NORILSK NICKEL PJSC | 19,483 | — | — | |
| | NOVOLIPETSK STEEL PJSC | 439,080 | — | — | |
| | PHOSAGRO PJSC-GDR REG S | 53,979 | — | — | |
| | POLYUS PJSC-REG S-GDR | 21,742 | — | — | |
| | SEVERSTAL PJSC | 62,882 | — | — | |
| | SOUTHERN COPPER CORP | 33,330 | 51.50 | 1,716,495.00 | |
| | UNITED CO RUSAL INTERNATIONA | 1,071,810 | — | — | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 141,991 | 26.75 | 3,798,259.25 | |
| | LI AUTO INC - ADR | 184,522 | 40.79 | 7,526,652.38 | |
| | NIO INC - ADR | 468,693 | 24.08 | 11,286,127.44 | |
| | XPENG INC - ADR | 151,712 | 35.29 | 5,353,916.48 | |
| | HUAZHU GROUP LTD-ADR | 72,502 | 35.56 | 2,578,171.12 | |
| | TAL EDUCATION GROUP- ADR | 180,671 | 4.94 | 892,514.74 | |
| | TRIP.COM GROUP LTD-ADR | 194,741 | 23.65 | 4,605,624.65 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 151,016 | 43.84 | 6,620,541.44 | |
| | AUTOHOME INC-ADR | 29,375 | 35.08 | 1,030,475.00 | |
| | IQIYI INC-ADR | 124,649 | 4.73 | 589,589.77 | |
| | JOYY INC-ADR | 20,462 | 32.62 | 667,470.44 | |
| | KANZHUN LTD - ADR | 29,500 | 27.34 | 806,530.00 | |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 227,772 | 4.96 | 1,129,749.12 | |
| VK CO LTD | 34,689 | — | — | | |

| | | | | |
|------|------------------------------|---------------|--------|-----------------------------------|
| | WEIBO CORP-SPON ADR | 19,774 | 23.82 | 471,016.68 |
| | YANDEX NV-A | 92,564 | — | — |
| | OZON HOLDINGS PLC - ADR | 20,405 | — | — |
| | PINDUODUO INC-ADR | 156,755 | 65.96 | 10,339,559.80 |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 156,165 | 11.11 | 1,734,993.15 |
| | MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 117,782 | — | — |
| | X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 34,286 | — | — |
| | RLX TECHNOLOGY INC-ADR | 229,815 | 2.32 | 533,170.80 |
| | BEIGENE LTD-ADR | 16,071 | 177.99 | 2,860,477.29 |
| | HUTCHMED CHINA-ADR | 30,584 | 13.01 | 397,897.84 |
| | LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 20,300 | 52.86 | 1,073,058.00 |
| | ZAI LAB LTD-ADR | 29,682 | 34.22 | 1,015,718.04 |
| | COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 660,616 | 1.77 | 1,169,290.32 |
| | CREDICORP LTD | 25,682 | 124.91 | 3,207,938.62 |
| | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 796,628 | — | — |
| | TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | 38,258 | — | — |
| | VTB BANK PJSC | 1,305,990,000 | — | — |
| | 360 DIGITECH INC | 27,200 | 17.24 | 468,928.00 |
| | LUFAX HOLDING LTD-ADR | 316,868 | 6.34 | 2,008,943.12 |
| | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 425,170 | — | — |
| | KE HOLDINGS INC-ADR | 122,975 | 18.82 | 2,314,389.50 |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 402,594 | 0.85 | 345,023.05 |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 143,700 | 4.21 | 605,551.80 |
| | MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO | 172,850 | — | — |
| | INTER RAO UES PJSC | 12,239,000 | — | — |
| | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 17,420 | 67.21 | 1,170,798.20 |
| | アメリカドル 小計 | 1,334,872,758 | | 79,635,381.14 (10,719,718,655) |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO-H | 819,000 | 6.29 | 5,151,510.00 |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 602,000 | 7.33 | 4,412,660.00 |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 9,246,000 | 3.48 | 32,176,080.00 |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 1,135,000 | 24.50 | 27,807,500.00 |
| | CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H | 428,000 | 4.01 | 1,716,280.00 |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 7,681,000 | 3.67 | 28,189,270.00 |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-H | 428,000 | 22.85 | 9,779,800.00 |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 1,352,000 | 2.94 | 3,974,880.00 |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|-------|---------------|--|
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 477,000 | 32.70 | 15,597,900.00 | |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 861,000 | 8.48 | 7,301,280.00 | |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 1,402,000 | 8.00 | 11,216,000.00 | |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 914,000 | 5.09 | 4,652,260.00 | |
| CMOC GROUP LTD-H | 960,000 | 4.32 | 4,147,200.00 | |
| DONGYUE GROUP | 534,000 | 10.56 | 5,639,040.00 | |
| GANFENG LITHIUM CO LTD-H | 128,520 | 81.30 | 10,448,676.00 | |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H | 460,000 | 10.54 | 4,848,400.00 | |
| MMG LTD | 1,024,000 | 2.84 | 2,908,160.00 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 722,000 | 6.50 | 4,693,000.00 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 155,250 | 13.54 | 2,102,085.00 | |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 660,000 | 6.86 | 4,527,600.00 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 1,970,000 | 9.32 | 18,360,400.00 | |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 1,247,000 | 4.49 | 5,599,030.00 | |
| BOC AVIATION LTD | 70,400 | 64.15 | 4,516,160.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 654,000 | 3.45 | 2,256,300.00 | |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 519,000 | 17.24 | 8,947,560.00 | |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 309,000 | 10.62 | 3,281,580.00 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 1,586,000 | 4.77 | 7,565,220.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 570,000 | 8.16 | 4,651,200.00 | |
| CITIC LTD | 1,892,000 | 7.84 | 14,833,280.00 | |
| CRRC CORP LTD - H | 1,227,000 | 2.88 | 3,533,760.00 | |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 682,500 | 6.97 | 4,757,025.00 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 200,000 | 20.20 | 4,040,000.00 | |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL | 500,000 | 7.63 | 3,815,000.00 | |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 253,000 | 10.90 | 2,757,700.00 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 756,800 | 12.28 | 9,293,504.00 | |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 158,200 | 13.82 | 2,186,324.00 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC | 162,000 | 35.70 | 5,783,400.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H | 322,400 | 4.10 | 1,321,840.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 1,158,111 | 4.58 | 5,304,148.38 | |
| AIR CHINA LTD-H | 466,000 | 5.85 | 2,726,100.00 | |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 656,000 | 4.64 | 3,043,840.00 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 474,000 | 13.24 | 6,275,760.00 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 618,000 | 4.23 | 2,614,140.00 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 1,084,100 | 10.88 | 11,795,008.00 | |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 630,000 | 5.75 | 3,622,500.00 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 268,000 | 7.81 | 2,093,080.00 |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 49,500 | 217.00 | 10,741,500.00 |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS | 391,500 | 7.97 | 3,120,255.00 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 606,000 | 7.07 | 4,284,420.00 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 708,000 | 7.30 | 5,168,400.00 |
| BYD CO LTD-H | 293,000 | 310.20 | 90,888,600.00 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 814,000 | 5.96 | 4,851,440.00 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 194,400 | 41.65 | 8,096,760.00 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 2,176,000 | 17.94 | 39,037,440.00 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 1,170,500 | 16.78 | 19,640,990.00 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 888,945 | 7.86 | 6,987,107.70 |
| MINTH GROUP LTD | 222,000 | 22.30 | 4,950,600.00 |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 340,000 | 15.64 | 5,317,600.00 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 443,800 | 88.80 | 39,409,440.00 |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 1,002,000 | 4.37 | 4,378,740.00 |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 786,000 | 27.90 | 21,929,400.00 |
| LI NING CO LTD | 800,000 | 67.70 | 54,160,000.00 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 284,600 | 96.50 | 27,463,900.00 |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS | 549,000 | 13.52 | 7,422,480.00 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 402,000 | 16.06 | 6,456,120.00 |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 202,000 | 18.66 | 3,769,320.00 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 523,880 | 15.98 | 8,371,602.40 |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 498,800 | 15.80 | 7,881,040.00 |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 4,350,000 | 0.76 | 3,306,000.00 |
| BAIDU INC-CLASS A | 792,224 | 147.80 | 117,090,707.20 |
| BILIBILI INC-CLASS Z | 60,135 | 224.20 | 13,482,267.00 |
| CHINA LITERATURE LTD | 116,000 | 36.80 | 4,268,800.00 |
| KINGSOFT CORP LTD | 320,000 | 32.25 | 10,320,000.00 |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 620,300 | 87.35 | 54,183,205.00 |
| NETEASE INC | 725,495 | 147.30 | 106,865,413.50 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 2,197,900 | 384.20 | 844,433,180.00 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 5,350,800 | 113.90 | 609,456,120.00 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 1,448,000 | 5.21 | 7,544,080.00 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS | 234,000 | 26.40 | 6,177,600.00 |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 644,000 | 3.03 | 1,951,320.00 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 423,350 | 59.55 | 25,210,492.50 |
| JD.COM INC - CL A | 711,783 | 249.80 | 177,803,393.40 |
| MEITUAN-CLASS B | 1,445,400 | 198.10 | 286,333,740.00 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 187,100 | 21.80 | 4,078,780.00 |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 231,000 | 36.55 | 8,443,050.00 |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 434,000 | 6.69 | 2,903,460.00 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 231,000 | 56.65 | 13,086,150.00 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 47,100 | 119.06 | 5,607,726.00 |
| CHINA FEIHE LTD | 1,183,000 | 8.54 | 10,102,820.00 |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS | 372,000 | — | — |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 1,070,000 | 38.05 | 40,713,500.00 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 606,000 | 54.20 | 32,845,200.00 |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 927,500 | 4.08 | 3,784,200.00 |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 576,200 | 44.30 | 25,525,660.00 |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 606,000 | 23.35 | 14,150,100.00 |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 738,000 | 13.18 | 9,726,840.00 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 214,000 | 72.80 | 15,579,200.00 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 561,000 | 6.55 | 3,674,550.00 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 1,706,000 | 7.35 | 12,539,100.00 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING | 143,000 | 23.65 | 3,381,950.00 |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 243,500 | 35.75 | 8,705,125.00 |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 101,000 | 18.86 | 1,904,860.00 |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 93,400 | 51.05 | 4,768,070.00 |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | 338,000 | 6.89 | 2,328,820.00 |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 173,000 | 23.15 | 4,004,950.00 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 752,000 | 9.24 | 6,948,480.00 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 265,300 | 13.18 | 3,496,654.00 |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 492,400 | 19.36 | 9,532,864.00 |
| 3SBIO INC | 333,500 | 6.68 | 2,227,780.00 |
| CANSINO BIOLOGICS INC-H | 19,600 | 83.75 | 1,641,500.00 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 499,000 | 12.48 | 6,227,520.00 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 924,000 | 4.60 | 4,250,400.00 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 3,067,840 | 7.81 | 23,959,830.40 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 392,000 | 28.65 | 11,230,800.00 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 36,100 | 90.00 | 3,249,000.00 |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 362,000 | 15.40 | 5,574,800.00 |

| | | | |
|------------------------------|------------|--------|----------------|
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 383,500 | 36.15 | 13,863,525.00 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H | 56,400 | 76.45 | 4,311,780.00 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 171,500 | 30.10 | 5,162,150.00 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 4,099,500 | 4.72 | 19,349,640.00 |
| WUXI APPTTEC CO LTD-H | 122,340 | 107.90 | 13,200,486.00 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 1,288,500 | 77.20 | 99,472,200.00 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 9,437,000 | 2.91 | 27,461,670.00 |
| BANK OF CHINA LTD-H | 27,592,000 | 3.09 | 85,259,280.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 2,843,900 | 5.24 | 14,902,036.00 |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 2,756,000 | 3.78 | 10,417,680.00 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 33,898,550 | 5.59 | 189,492,894.50 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 1,189,000 | 2.54 | 3,020,060.00 |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 1,276,050 | 49.60 | 63,292,080.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 2,103,320 | 2.77 | 5,826,196.40 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 19,985,350 | 4.53 | 90,533,635.50 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 2,803,000 | 5.91 | 16,565,730.00 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 2,271,000 | 1.32 | 2,997,720.00 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 1,093,500 | 4.45 | 4,866,075.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 634,000 | 16.48 | 10,448,320.00 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 907,000 | 17.90 | 16,235,300.00 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 513,000 | 6.70 | 3,437,100.00 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 442,400 | 10.42 | 4,609,808.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 919,200 | 5.66 | 5,202,672.00 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 459,800 | 11.86 | 5,453,228.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 2,481,000 | 13.42 | 33,295,020.00 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 989,000 | 18.78 | 18,573,420.00 |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 486,800 | 9.62 | 4,683,016.00 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 324,800 | 21.95 | 7,129,360.00 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 3,392,000 | 2.38 | 8,072,960.00 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 2,228,000 | 7.76 | 17,289,280.00 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 2,251,500 | 53.60 | 120,680,400.00 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 306,800 | 24.50 | 7,516,600.00 |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES | 180,000 | 12.46 | 2,242,800.00 |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 1,588,000 | 1.99 | 3,160,120.00 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 1,319,000 | 23.15 | 30,534,850.00 |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 390,000 | 8.26 | 3,221,400.00 |

| | | | | |
|------------------------------|------------|--------|---------------|--|
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 1,094,000 | 35.40 | 38,727,600.00 | |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 192,200 | 37.80 | 7,265,160.00 | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 566,051 | 18.14 | 10,268,165.14 | |
| CIFI EVER SUNSHINE SERVICES | 386,000 | 9.65 | 3,724,900.00 | |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 1,281,280 | 3.68 | 4,715,110.40 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 2,797,232 | 4.61 | 12,895,239.52 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 712,000 | 32.50 | 23,140,000.00 | |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 299,000 | 14.66 | 4,383,340.00 | |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 480,000 | 8.67 | 4,161,600.00 | |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS | 309,800 | 12.54 | 3,884,892.00 | |
| LOGAN GROUP CO LTD | 430,000 | 2.18 | 937,400.00 | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 635,500 | 34.00 | 21,607,000.00 | |
| SEAZEN GROUP LTD | 698,000 | 3.66 | 2,554,680.00 | |
| WHARF HOLDINGS LTD | 452,000 | 26.60 | 12,023,200.00 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 768,000 | 9.45 | 7,257,600.00 | |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 786,000 | 7.58 | 5,957,880.00 | |
| GDS HOLDINGS LTD-CL A | 351,476 | 33.50 | 11,774,446.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 926,000 | 18.64 | 17,260,640.00 | |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN | 202,000 | 12.86 | 2,597,720.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 307,000 | 13.80 | 4,236,600.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 250,500 | 17.00 | 4,258,500.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 251,000 | 20.20 | 5,070,200.00 | |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 242,000 | 29.80 | 7,211,600.00 | |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 232,500 | 9.61 | 2,234,325.00 | |
| LENOVO GROUP LTD | 2,322,000 | 7.43 | 17,252,460.00 | |
| SUNNY OPTICAL TECH | 268,400 | 118.30 | 31,751,720.00 | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 5,412,600 | 12.22 | 66,141,972.00 | |
| ZTE CORP-H | 267,131 | 17.32 | 4,626,708.92 | |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 17,376,000 | 0.95 | 16,507,200.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 206,000 | 27.65 | 5,695,900.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,488,000 | 2.33 | 3,467,040.00 | |
| CGN POWER CO LTD-H | 4,100,000 | 1.89 | 7,749,000.00 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 1,010,000 | 11.68 | 11,796,800.00 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 1,171,000 | 15.00 | 17,565,000.00 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 1,702,000 | 4.86 | 8,271,720.00 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 364,000 | 35.80 | 13,031,200.00 | |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-------------|--------|--------------------------------------|--|
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 682,000 | 14.90 | 10,161,800.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 286,700 | 125.30 | 35,923,510.00 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT LTD | 1,024,000 | 8.86 | 9,072,640.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 1,164,000 | 3.91 | 4,551,240.00 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 1,366,000 | 6.27 | 8,564,820.00 | |
| | FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 146,000 | 29.30 | 4,277,800.00 | |
| | HANERGY THIN FILM POWER GROU | 960,000 | 3.91 | 3,753,600.00 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 251,000 | 26.35 | 6,613,850.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 1,794,000 | 13.12 | 23,537,280.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 290,326,213 | | 4,795,452,204.86 (82,242,005,313) | |
| マレーシアリン ギット | DIALOG GROUP BHD | 1,231,180 | 2.10 | 2,585,478.00 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 94,300 | 20.78 | 1,959,554.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 801,200 | 9.25 | 7,411,100.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 1,121,000 | 4.77 | 5,347,170.00 | |
| | HAP SENG CONSOLIDATED | 221,400 | 7.17 | 1,587,438.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 1,129,200 | 2.11 | 2,382,612.00 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 349,900 | 6.45 | 2,256,855.00 | |
| | MISC BHD | 522,300 | 6.94 | 3,624,762.00 | |
| | GENTING BHD | 916,400 | 4.58 | 4,197,112.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 1,221,400 | 2.82 | 3,444,348.00 | |
| | MR DIY GROUP M BHD | 978,000 | 1.97 | 1,926,660.00 | |
| | IOI CORP BHD | 768,200 | 3.84 | 2,949,888.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 136,000 | 22.38 | 3,043,680.00 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 30,900 | 132.60 | 4,097,340.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 232,240 | 15.00 | 3,483,600.00 | |
| | QL RESOURCES BHD | 305,250 | 5.15 | 1,572,037.50 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 710,000 | 4.22 | 2,996,200.00 | |
| | HARTELEGA HOLDINGS BHD | 620,500 | 2.78 | 1,724,990.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 518,300 | 6.42 | 3,327,486.00 | |
| | TOP GLOVE CORP BHD | 1,607,000 | 1.05 | 1,687,350.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 617,300 | 3.73 | 2,302,529.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 2,470,000 | 4.90 | 12,103,000.00 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 231,800 | 20.16 | 4,673,088.00 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 66,500 | 18.38 | 1,222,270.00 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 1,589,900 | 8.60 | 13,673,140.00 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
| | PUBLIC BANK BERHAD | 5,127,200 | 4.43 | 22,713,496.00 | |
| | RHB BANK BHD | 682,449 | 5.66 | 3,862,661.34 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 1,195,000 | 2.74 | 3,274,300.00 | |
| | DIGI.COM BHD | 1,087,100 | 3.21 | 3,489,591.00 | |
| | MAXIS BHD | 875,400 | 3.22 | 2,818,788.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 294,900 | 5.15 | 1,518,735.00 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 232,000 | 16.20 | 3,758,400.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 939,800 | 8.19 | 7,696,962.00 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 900,000 | 2.60 | 2,340,000.00 | |
| | マレーシアリングット 小計 | 29,824,019 | | 147,052,620.84 (4,499,648,439) | |
| タイパーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 487,000 | 153.50 | 74,754,500.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 3,358,800 | 33.25 | 111,680,100.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 360,100 | 49.75 | 17,914,975.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 587,200 | 47.50 | 27,892,000.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,048,461 | 44.75 | 46,918,629.75 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 390,100 | 55.00 | 21,455,500.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 290,450 | 379.00 | 110,080,550.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 1,377,200 | 69.75 | 96,059,700.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR | 2,547,100 | 8.80 | 22,414,480.00 | |
| | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 2,999,900 | 8.45 | 25,349,155.00 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 2,111,500 | 4.90 | 10,346,350.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 943,000 | 34.00 | 32,062,000.00 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 559,517 | 34.50 | 19,303,336.50 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 1,999,001 | 13.00 | 25,987,013.00 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 854,200 | 26.00 | 22,209,200.00 | |
| | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR | 593,600 | 33.00 | 19,588,800.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 1,931,900 | 59.50 | 114,948,050.00 | |
| | CARABAO GROUP PCL-NVDR | 139,600 | 109.00 | 15,216,400.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 1,174,100 | 26.00 | 30,526,600.00 | |
| | OSOTSPA PCL-NVDR | 283,900 | 34.00 | 9,652,600.00 | |
| | THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 727,600 | 17.50 | 12,733,000.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 3,301,100 | 24.90 | 82,197,390.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 143,300 | 177.50 | 25,435,750.00 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 1,246,400 | 15.40 | 19,194,560.00 | |
| | SCB X PCL-NVDR | 370,400 | 104.00 | 38,521,600.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|------------|----------|-------------------------------------|--|
| | BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR | 595,000 | 17.40 | 10,353,000.00 | |
| | JMT NETWORK SERVICES-NVDR | 398,400 | 74.25 | 29,581,200.00 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 264,500 | 58.25 | 15,407,125.00 | |
| | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 402,800 | 43.50 | 17,521,800.00 | |
| | SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 213,200 | 50.00 | 10,660,000.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 809,100 | 60.00 | 48,546,000.00 | |
| | LAND & HOUSES PUB - NVDR | 2,908,400 | 8.25 | 23,994,300.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 105,500 | 323.00 | 34,076,500.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 455,600 | 202.00 | 92,031,200.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 391,700 | 68.25 | 26,733,525.00 | |
| | TRUE CORP PCL-NVDR | 3,793,576 | 4.74 | 17,981,550.24 | |
| | B GRIMM POWER PCL-NVDR | 167,500 | 36.50 | 6,113,750.00 | |
| | ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR | 90,600 | 175.00 | 15,855,000.00 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 751,800 | 83.00 | 62,399,400.00 | |
| | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 226,600 | 66.75 | 15,125,550.00 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 996,000 | 47.25 | 47,061,000.00 | |
| | RATCH GROUP PCL-NVDR | 274,000 | 37.00 | 10,138,000.00 | |
| | タイパーツ 小計 | 42,669,705 | | 1,516,021,139.49 (5,760,880,330) | |
| フィリピンペン | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 641,380 | 51.50 | 33,031,070.00 | |
| | AYALA CORPORATION | 103,755 | 625.00 | 64,846,875.00 | |
| | GT CAPITAL HOLDINGS INC | 21,594 | 473.00 | 10,213,962.00 | |
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 1,017,239 | 48.75 | 49,590,401.25 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 82,335 | 801.50 | 65,991,502.50 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 355,880 | 185.00 | 65,837,800.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORP | 134,100 | 200.00 | 26,820,000.00 | |
| | MONDE NISSIN CORP | 2,742,200 | 12.84 | 35,209,848.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 244,100 | 95.30 | 23,262,730.00 | |
| | BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 503,321 | 88.00 | 44,292,248.00 | |
| | BDO UNIBANK INC | 590,830 | 117.80 | 69,599,774.00 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 627,656 | 49.95 | 31,351,417.20 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 3,662,500 | 3.61 | 13,221,625.00 | |
| | AYALA LAND INC | 2,754,720 | 26.85 | 73,964,232.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 3,710,100 | 36.35 | 134,862,135.00 | |
| | CONVERGE INFORMATION AND COM | 1,083,600 | 18.50 | 20,046,600.00 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 9,035 | 2,150.00 | 19,425,250.00 | |

| | | | | | |
|------------------------------|-------------------------------|-------------|-------------------|---------------------------------------|--|
| | PLDT INC | 26,325 | 1,700.00 | 44,752,500.00 | |
| | AC ENERGY CORP | 3,785,365 | 7.37 | 27,898,140.05 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 113,060 | 357.00 | 40,362,420.00 | |
| | フィリピンペソ 小計 | 22,209,095 | | 894,580,530.00 (2,190,827,717) | |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 5,123,900 | 2,970.00 | 15,217,983,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 582,400 | 29,275.00 | 17,049,760,000.00 | |
| | ADARO MINERALS INDONESIA TBK | 3,213,900 | 1,785.00 | 5,736,811,500.00 | |
| | ANEKA TAMBANG TBK | 3,302,400 | 1,970.00 | 6,505,728,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 9,016,300 | 750.00 | 6,762,225,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 863,900 | 7,725.00 | 6,673,627,500.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 4,423,100 | 4,440.00 | 19,638,564,000.00 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK | 979,600 | 7,625.00 | 7,469,450,000.00 | |
| | VALE INDONESIA TBK | 995,100 | 6,300.00 | 6,269,130,000.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 6,882,200 | 6,675.00 | 45,938,685,000.00 | |
| | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 7,091,700 | 1,990.00 | 14,112,483,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 3,067,700 | 5,750.00 | 17,639,275,000.00 | |
| | GUDANG GARAM TBK PT | 161,400 | 31,175.00 | 5,031,645,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 1,010,700 | 9,425.00 | 9,525,847,500.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 1,457,100 | 7,075.00 | 10,308,982,500.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 2,166,000 | 4,990.00 | 10,808,340,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 7,286,400 | 1,710.00 | 12,459,744,000.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 20,631,500 | 7,475.00 | 154,220,462,500.00 | |
| | BANK JAGO TBK PT | 1,279,700 | 9,000.00 | 11,517,300,000.00 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 6,544,000 | 8,300.00 | 54,315,200,000.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 2,477,400 | 8,150.00 | 20,190,810,000.00 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 23,646,700 | 4,340.00 | 102,626,678,000.00 | |
| | SARANA MENARA NUSANTARA PT | 7,334,800 | 990.00 | 7,261,452,000.00 | |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 17,146,200 | 4,150.00 | 71,156,730,000.00 | | |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 2,635,900 | 2,890.00 | 7,617,751,000.00 | | |
| | インドネシアルピア 小計 | 139,320,000 | | 646,054,664,500.00 (5,879,097,446) | |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-CPO | 5,817,568 | 7.83 | 45,551,557.44 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 1,043,670 | 84.75 | 88,451,032.50 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 43,505 | 187.70 | 8,165,888.50 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 313,598 | 46.92 | 14,714,018.16 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|------------|--------|-----------------------------------|--|
| | ALFA S. A. B. -A | 1,094,600 | 13.67 | 14,963,182.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 145,000 | 74.73 | 10,835,850.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 108,500 | 289.85 | 31,448,725.00 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 70,155 | 421.20 | 29,549,286.00 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 118,725 | 145.81 | 17,311,292.25 | |
| | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | 800,400 | 34.75 | 27,813,900.00 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 1,851,000 | 66.60 | 123,276,600.00 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 127,966 | 131.64 | 16,845,444.24 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 187,300 | 115.42 | 21,618,166.00 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 708,400 | 135.84 | 96,229,056.00 | |
| | GRUMA S. A. B. -B | 65,175 | 215.82 | 14,066,068.50 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 566,500 | 63.81 | 36,148,365.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 546,900 | 27.64 | 15,116,316.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 923,400 | 114.59 | 105,812,406.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 706,800 | 31.70 | 22,405,560.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 10,065,600 | 20.48 | 206,143,488.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | 25,304,762 | | 946,466,201.59 (6,399,909,808) | |
| ブラジルリアル | COSAN SA | 470,400 | 18.39 | 8,650,656.00 | |
| | PETRO RIO SA | 220,800 | 21.53 | 4,753,824.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 1,464,200 | 28.91 | 42,330,022.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 1,494,900 | 26.29 | 39,300,921.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 208,100 | 12.17 | 2,532,577.00 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 68,300 | 37.85 | 2,585,155.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 246,600 | 16.46 | 4,059,036.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 368,100 | 23.15 | 8,521,515.00 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 256,600 | 19.80 | 5,080,680.00 | |
| | SUZANO SA | 261,022 | 47.85 | 12,489,902.70 | |
| | VALE SA | 1,414,729 | 74.62 | 105,567,077.98 | |
| | WEG SA | 619,988 | 26.46 | 16,404,882.48 | |
| | CCR SA | 339,300 | 12.72 | 4,315,896.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 198,213 | 50.31 | 9,972,096.03 | |
| | RUMO SA | 426,300 | 16.63 | 7,089,369.00 | |
| | AMERICANAS SA | 230,578 | 13.73 | 3,165,835.94 | |
| | LOJAS RENNER S. A. | 326,122 | 23.15 | 7,549,724.30 | |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 1,065,200 | 2.47 | 2,631,044.00 | |

| | | | | | |
|------|------------------------------|------------|-----------|------------------------------------|--|
| | VIBRA ENERGIA SA | 397,200 | 16.70 | 6,633,240.00 | |
| | ATACADAO SA | 123,600 | 16.23 | 2,006,028.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 420,200 | 19.85 | 8,340,970.00 | |
| | AMBEV SA | 1,558,200 | 13.67 | 21,300,594.00 | |
| | BRF SA | 201,700 | 14.54 | 2,932,718.00 | |
| | JBS SA | 273,000 | 33.04 | 9,019,920.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 315,100 | 14.86 | 4,682,386.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 1,464,471 | 5.56 | 8,142,458.76 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 141,600 | 29.60 | 4,191,360.00 | |
| | HYPERA SA | 205,800 | 37.95 | 7,810,110.00 | |
| | BANCO BRADESCO S. A. | 619,437 | 14.95 | 9,260,583.15 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 1,764,886 | 17.92 | 31,626,757.12 | |
| | BANCO DO BRASIL S. A. | 280,200 | 32.46 | 9,095,292.00 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 177,400 | 29.39 | 5,213,786.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 1,732,430 | 23.44 | 40,608,159.20 | |
| | ITAUSA SA | 1,462,632 | 8.63 | 12,622,514.16 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 2,250,825 | 11.60 | 26,109,570.00 | |
| | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 582,500 | 22.39 | 13,042,175.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 193,800 | 24.75 | 4,796,550.00 | |
| | TOTVS SA | 187,100 | 23.98 | 4,486,658.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S. A. | 167,375 | 46.55 | 7,791,306.25 | |
| | TIM SA | 279,677 | 12.57 | 3,515,539.89 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 103,700 | 44.30 | 4,593,910.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 369,600 | 44.25 | 16,354,800.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 498,390 | 10.62 | 5,292,901.80 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 124,900 | 41.82 | 5,223,318.00 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 104,700 | 30.60 | 3,203,820.00 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 86,100 | 40.75 | 3,508,575.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 65,950 | 41.01 | 2,704,609.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 368,400 | 22.87 | 8,425,308.00 | |
| | ブラジルリアル 小計 | 26,200,325 | | 579,536,132.26 (14,880,807,221) | |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 115,641 | 6,425.00 | 742,993,425.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 299,994 | 1,430.00 | 428,991,420.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 51,557 | 82,000.00 | 4,227,674,000.00 | |
| | CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | 6,502,900 | 83.91 | 545,658,339.00 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|------------|------------|--------------------------------------|--|
| | FALABELLA SA | 290,088 | 2,075.00 | 601,932,600.00 | |
| | CENCOSUD SA | 549,556 | 1,200.00 | 659,467,200.00 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 37,740 | 5,800.00 | 218,892,000.00 | |
| | BANCO DE CHILE | 13,479,794 | 83.00 | 1,118,822,902.00 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 20,548 | 26,850.00 | 551,713,800.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 19,724,549 | 37.30 | 735,725,677.00 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 8,527,077 | 86.80 | 740,150,283.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 12,211,839 | 20.80 | 254,006,251.00 | |
| | チリペソ 小計 | 61,811,283 | | 10,826,027,897.00 (1,587,853,511) | |
| 韓国ウォン | HD HYUNDAI | 13,686 | 59,000.00 | 807,474,000.00 | |
| | S-OIL CORP | 13,702 | 103,500.00 | 1,418,157,000.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 20,035 | 198,000.00 | 3,966,930,000.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORP | 44,037 | 36,450.00 | 1,605,148,650.00 | |
| | HYUNDAI STEEL CO | 29,150 | 32,800.00 | 956,120,000.00 | |
| | KOREA ZINC CO LTD | 3,246 | 493,000.00 | 1,600,278,000.00 | |
| | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 5,281 | 144,000.00 | 760,464,000.00 | |
| | LG CHEM LTD | 17,896 | 543,000.00 | 9,717,528,000.00 | |
| | LG CHEM LTD-PREFERENCE | 2,387 | 256,000.00 | 611,072,000.00 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORP | 5,569 | 187,000.00 | 1,041,403,000.00 | |
| | POSCO CHEMICAL CO LTD | 10,834 | 114,500.00 | 1,240,493,000.00 | |
| | POSCO HOLDINGS INC | 29,126 | 238,000.00 | 6,931,988,000.00 | |
| | SK CHEMICALS CO LTD | 3,621 | 93,300.00 | 337,839,300.00 | |
| | SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 8,200 | 105,000.00 | 861,000,000.00 | |
| | SKC CO LTD | 8,074 | 151,500.00 | 1,223,211,000.00 | |
| | CJ CORP | 6,002 | 77,800.00 | 466,955,600.00 | |
| | DOOSAN BOBCAT INC | 16,789 | 28,900.00 | 485,202,100.00 | |
| | DOOSAN ENERBILITY CO LTD | 146,361 | 16,950.00 | 2,480,818,950.00 | |
| | ECOPRO BM CO LTD | 4,500 | 497,400.00 | 2,238,300,000.00 | |
| | GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 18,167 | 31,400.00 | 570,443,800.00 | |
| | GS HOLDINGS | 14,782 | 41,350.00 | 611,235,700.00 | |
| | HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 26,761 | 37,300.00 | 998,185,300.00 | |
| | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO | 9,100 | 132,000.00 | 1,201,200,000.00 | |
| | KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 32,869 | 50,800.00 | 1,669,745,200.00 | |
| | KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 11,992 | 88,100.00 | 1,056,495,200.00 | |
| | LG CORP | 28,476 | 76,700.00 | 2,184,109,200.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| LG ENERGY SOLUTION | 7,188 | 405,000.00 | 2,911,140,000.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 28,775 | 111,500.00 | 3,208,412,500.00 | |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 46,094 | 20,100.00 | 926,489,400.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 235,703 | 5,810.00 | 1,369,434,430.00 | |
| SK INC | 14,596 | 222,000.00 | 3,240,312,000.00 | |
| S-1 CORPORATION | 3,622 | 63,300.00 | 229,272,600.00 | |
| CJ LOGISTICS | 3,267 | 112,500.00 | 367,537,500.00 | |
| HMM CO LTD | 95,440 | 24,100.00 | 2,300,104,000.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 5,359 | 176,500.00 | 945,863,500.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 60,959 | 25,000.00 | 1,523,975,000.00 | |
| PAN OCEAN CO LTD | 86,872 | 5,950.00 | 516,888,400.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 27,855 | 33,250.00 | 926,178,750.00 | |
| HANON SYSTEMS | 51,109 | 9,580.00 | 489,624,220.00 | |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD | 21,175 | 197,500.00 | 4,182,062,500.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 48,896 | 173,000.00 | 8,459,008,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 14,465 | 84,200.00 | 1,217,953,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 7,269 | 85,000.00 | 617,865,000.00 | |
| KIA CORP | 92,914 | 77,500.00 | 7,200,835,000.00 | |
| COWAY CO LTD | 16,456 | 63,500.00 | 1,044,956,000.00 | |
| F&F CO LTD / NEW | 6,500 | 137,500.00 | 893,750,000.00 | |
| HLB INC | 33,016 | 33,600.00 | 1,109,337,600.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 34,750 | 89,000.00 | 3,092,750,000.00 | |
| KANGWON LAND INC | 29,678 | 25,650.00 | 761,240,700.00 | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 30,006 | 24,100.00 | 723,144,600.00 | |
| CJ ENM CO LTD | 2,684 | 95,900.00 | 257,395,600.00 | |
| HYBE CO LTD | 5,533 | 148,000.00 | 818,884,000.00 | |
| KAKAO CORP | 110,654 | 71,500.00 | 7,911,761,000.00 | |
| KAKAO GAMES CORP | 8,300 | 49,400.00 | 410,020,000.00 | |
| KRAFTON INC | 7,666 | 273,500.00 | 2,096,651,000.00 | |
| NAVER CORP | 47,071 | 247,500.00 | 11,650,072,500.00 | |
| NCSOFT CORP | 5,797 | 435,000.00 | 2,521,695,000.00 | |
| NETMARBLE CORP | 6,554 | 72,800.00 | 477,131,200.00 | |
| PEARL ABYSS CORP | 8,795 | 53,900.00 | 474,050,500.00 | |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 12,861 | 68,900.00 | 886,122,900.00 | |
| LOTTE SHOPPING CO | 5,734 | 101,000.00 | 579,134,000.00 | |
| BGF RETAIL CO LTD | 2,676 | 174,500.00 | 466,962,000.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|------------|------------------|--|
| E-MART INC | 5,755 | 102,500.00 | 589,887,500.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 3,067 | 382,500.00 | 1,173,127,500.00 | |
| KT&G CORP | 39,492 | 83,000.00 | 3,277,836,000.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 9,688 | 104,500.00 | 1,012,396,000.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 11,679 | 129,500.00 | 1,512,430,500.00 | |
| AMOREPACIFIC GROUP | 11,803 | 37,750.00 | 445,563,250.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 3,236 | 622,000.00 | 2,012,792,000.00 | |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF | 464 | 313,000.00 | 145,232,000.00 | |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 33,633 | 67,900.00 | 2,283,680,700.00 | |
| SD BIOSENSOR INC | 10,000 | 39,100.00 | 391,000,000.00 | |
| ALTEOGEN INC | 8,400 | 63,700.00 | 535,080,000.00 | |
| CELLTRION INC | 36,121 | 171,500.00 | 6,194,751,500.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 5,244 | 77,100.00 | 404,312,400.00 | |
| GREEN CROSS CORP | 2,100 | 167,000.00 | 350,700,000.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 2,390 | 301,000.00 | 719,390,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 5,956 | 831,000.00 | 4,949,436,000.00 | |
| SEEGENE INC | 12,200 | 37,450.00 | 456,890,000.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 8,476 | 73,000.00 | 618,748,000.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 8,100 | 102,500.00 | 830,250,000.00 | |
| YUHAN CORP | 21,248 | 55,700.00 | 1,183,513,600.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 102,165 | 40,300.00 | 4,117,249,500.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 100,284 | 10,000.00 | 1,002,840,000.00 | |
| KAKAOBANK CORP | 44,900 | 34,800.00 | 1,562,520,000.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 133,146 | 49,000.00 | 6,524,154,000.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 166,052 | 38,700.00 | 6,426,212,400.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 167,624 | 12,850.00 | 2,153,968,400.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 14,802 | 61,100.00 | 904,402,200.00 | |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 10,000 | 26,600.00 | 266,000,000.00 | |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 108,063 | 4,780.00 | 516,541,140.00 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 119,622 | 6,830.00 | 817,018,260.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 60,045 | 9,390.00 | 563,822,550.00 | |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 23,495 | 34,450.00 | 809,402,750.00 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 14,186 | 59,800.00 | 848,322,800.00 | |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURAN | 12,500 | 34,500.00 | 431,250,000.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 10,065 | 196,500.00 | 1,977,772,500.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 29,905 | 64,400.00 | 1,925,882,000.00 | |

| | | | | | |
|---------|------------------------------|-----------|------------|--|--|
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 11,453 | 130,500.00 | 1,494,616,500.00 | |
| | ILJIN MATERIALS CO LTD | 6,354 | 78,400.00 | 498,153,600.00 | |
| | L&F CO LTD | 7,493 | 236,100.00 | 1,769,097,300.00 | |
| | LG DISPLAY CO LTD | 85,443 | 15,200.00 | 1,298,733,600.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 5,003 | 345,000.00 | 1,726,035,000.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 21,794 | 131,000.00 | 2,855,014,000.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 1,688,427 | 58,400.00 | 98,604,136,800.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 274,922 | 53,400.00 | 14,680,834,800.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 19,524 | 550,000.00 | 10,738,200,000.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 63,215 | 13,500.00 | 853,402,500.00 | |
| | SK TELECOM | 11,317 | 54,400.00 | 615,644,800.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORP | 86,604 | 22,500.00 | 1,948,590,000.00 | |
| | SK HYNIX INC | 192,568 | 91,600.00 | 17,639,228,800.00 | |
| | SK SQUARE CO LTD | 31,340 | 40,950.00 | 1,283,373,000.00 | |
| | 韓国ウォン 小計 | 5,618,295 | | 339,789,247,550.00 (35,406,039,594) | |
| ニュー台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 459,150 | 95.00 | 43,619,250.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 732,281 | 43.60 | 31,927,451.60 | |
| | CHINA STEEL CORP | 4,101,947 | 29.00 | 118,956,463.00 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 1,168,430 | 81.40 | 95,110,202.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 1,487,600 | 109.00 | 162,148,400.00 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 1,723,557 | 84.70 | 145,985,277.90 | |
| | TAIWAN CEMENT | 2,074,405 | 39.50 | 81,938,997.50 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 46,000 | 1,025.00 | 47,150,000.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 1,011,138 | 31.30 | 31,648,619.40 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 21,000 | 1,485.00 | 31,185,000.00 | |
| | WALSIN LIHWA CORP | 952,000 | 37.00 | 35,224,000.00 | |
| | CHINA AIRLINES LTD | 1,131,000 | 22.35 | 25,277,850.00 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 1,061,000 | 30.30 | 32,148,300.00 | |
| | EVERGREEN MARINE CORP LTD | 925,883 | 98.70 | 91,384,652.10 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 746,000 | 28.15 | 20,999,900.00 | |
| | WAN HAI LINES LTD | 210,300 | 116.50 | 24,499,950.00 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 579,000 | 98.30 | 56,915,700.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 668,413 | 35.45 | 23,695,240.85 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 62,728 | 473.00 | 29,670,344.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 133,981 | 200.00 | 26,796,200.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| GIANT MANUFACTURING | 99,000 | 255.00 | 25,245,000.00 | |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 49,000 | 324.00 | 15,876,000.00 | |
| POU CHEN | 658,500 | 30.80 | 20,281,800.00 | |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 103,000 | 619.00 | 63,757,000.00 | |
| MOMO.COM INC | 18,000 | 802.00 | 14,436,000.00 | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 197,000 | 273.50 | 53,879,500.00 | |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 1,644,624 | 66.40 | 109,203,033.60 | |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 1,308,586 | 17.75 | 23,227,401.50 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 5,962,955 | 26.30 | 156,825,716.50 | |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO | 4,375,369 | 29.65 | 129,729,690.85 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 3,705,063 | 26.40 | 97,813,663.20 | |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 3,036,856 | 23.15 | 70,303,216.40 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 4,051,754 | 36.15 | 146,470,907.10 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 3,387,018 | 17.15 | 58,087,358.70 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 3,366,063 | 16.95 | 57,054,767.85 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 3,347,918 | 27.35 | 91,565,557.30 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 1,283,000 | 53.90 | 69,153,700.00 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 470,270 | 205.00 | 96,405,350.00 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 3,500,213 | 23.45 | 82,079,994.85 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 2,815,366 | 53.40 | 150,340,544.40 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 4,982,255 | 15.25 | 75,979,388.75 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 2,439,295 | 61.90 | 150,992,360.50 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 3,963,852 | 9.17 | 36,348,522.84 | |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 379,512 | 74.50 | 28,273,644.00 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 167,000 | 242.50 | 40,497,500.00 | |
| ACER INC | 1,115,168 | 26.00 | 28,994,368.00 | |
| ADVANTECH CO LTD | 162,134 | 346.00 | 56,098,364.00 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 242,774 | 326.00 | 79,144,324.00 | |
| AUO CORP | 2,871,000 | 16.10 | 46,223,100.00 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 239,000 | 166.00 | 39,674,000.00 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 1,402,775 | 22.75 | 31,913,131.25 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 705,220 | 239.00 | 168,547,580.00 | |
| E INK HOLDINGS INC | 313,000 | 196.00 | 61,348,000.00 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 4,405,272 | 110.00 | 484,579,920.00 | |
| INNOLUX CORP | 3,342,112 | 12.30 | 41,107,977.60 | |
| INVENTEC CORP | 1,291,429 | 25.15 | 32,479,439.35 | |

| | | | | | |
|--------|------------------------------|-------------|----------|---------------------------------------|--|
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 35,820 | 1,660.00 | 59,461,200.00 | |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 763,160 | 56.80 | 43,347,488.00 | |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 207,000 | 127.00 | 26,289,000.00 | |
| | NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 82,000 | 284.50 | 23,329,000.00 | |
| | PEGATRON CORP | 693,976 | 68.50 | 47,537,356.00 | |
| | QUANTA COMPUTER INC | 940,150 | 80.40 | 75,588,060.00 | |
| | SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 483,193 | 54.30 | 26,237,379.90 | |
| | UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 408,000 | 160.50 | 65,484,000.00 | |
| | WIWYNN CORP | 25,000 | 752.00 | 18,800,000.00 | |
| | WPG HOLDINGS LTD | 658,168 | 55.30 | 36,396,690.40 | |
| | YAGEO CORPORATION | 151,952 | 328.00 | 49,840,256.00 | |
| | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 270,000 | 102.00 | 27,540,000.00 | |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 1,293,000 | 129.00 | 166,797,000.00 | |
| | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 580,000 | 84.70 | 49,126,000.00 | |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 603,400 | 110.50 | 66,675,700.00 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 1,209,294 | 92.00 | 111,255,048.00 | |
| | ASMEDIA TECHNOLOGY INC | 8,000 | 1,200.00 | 9,600,000.00 | |
| | EEMORY TECHNOLOGY INC | 22,000 | 1,160.00 | 25,520,000.00 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 81,000 | 492.00 | 39,852,000.00 | |
| | MEDIATEK INC | 538,236 | 670.00 | 360,618,120.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 432,000 | 58.90 | 25,444,800.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 202,000 | 325.00 | 65,650,000.00 | |
| | PARADE TECHNOLOGIES LTD | 25,000 | 1,215.00 | 30,375,000.00 | |
| | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU | 990,000 | 43.00 | 42,570,000.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 164,703 | 375.00 | 61,763,625.00 | |
| | SILERGY CORP | 27,000 | 2,430.00 | 65,610,000.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 8,651,000 | 486.50 | 4,208,711,500.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 4,248,000 | 41.60 | 176,716,800.00 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 374,000 | 83.10 | 31,079,400.00 | |
| | WIN SEMICONDUCTORS CORP | 127,000 | 204.00 | 25,908,000.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 1,082,000 | 23.05 | 24,940,100.00 | |
| | ニュー台湾ドル 小計 | 116,073,218 | | 10,178,283,144.19 (46,079,123,450) | |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 299,668 | 307.55 | 92,162,893.40 | |
| | COAL INDIA LTD | 645,260 | 176.55 | 113,920,653.00 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 193,412 | 219.85 | 42,521,628.20 | |

| | | | |
|------------------------------|-----------|-----------|------------------|
| INDIAN OIL CORP LTD | 800,621 | 108.50 | 86,867,378.50 |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 1,031,742 | 137.35 | 141,709,763.70 |
| PETRONET LNG LTD | 235,486 | 206.50 | 48,627,859.00 |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | 1,068,603 | 2,500.05 | 2,671,560,930.15 |
| ACC LTD | 29,062 | 2,098.20 | 60,977,888.40 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 287,173 | 360.60 | 103,554,583.80 |
| ASIAN PAINTS LTD | 137,038 | 2,760.90 | 378,348,214.20 |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 71,672 | 594.10 | 42,580,335.20 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 97,381 | 1,323.25 | 128,859,408.25 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 533,602 | 322.30 | 171,979,924.60 |
| JINDAL STEEL & POWER LTD | 179,644 | 317.60 | 57,054,934.40 |
| JSW STEEL LTD | 289,822 | 567.80 | 164,560,931.60 |
| PI INDUSTRIES LTD | 30,631 | 2,548.25 | 78,055,445.75 |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 48,030 | 2,169.25 | 104,189,077.50 |
| SHREE CEMENT LTD | 4,303 | 18,793.65 | 80,869,075.95 |
| SRF LTD | 47,700 | 2,277.95 | 108,658,215.00 |
| TATA STEEL LTD | 242,488 | 852.85 | 206,805,890.80 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 36,438 | 5,468.30 | 199,253,915.40 |
| UPL LTD | 174,128 | 640.85 | 111,589,928.80 |
| VEDANTA LTD | 364,582 | 221.45 | 80,736,683.90 |
| ADANI ENTERPRISES LTD | 91,905 | 2,161.45 | 198,648,062.25 |
| BHARAT ELECTRONICS LTD | 450,816 | 233.50 | 105,265,536.00 |
| HAVELLS INDIA LTD | 88,825 | 1,106.85 | 98,315,951.25 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 223,272 | 1,494.85 | 333,758,149.20 |
| SIEMENS LTD | 22,493 | 2,343.85 | 52,720,218.05 |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 64,800 | 596.50 | 38,653,200.00 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 188,222 | 686.40 | 129,195,580.80 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 76,894 | 622.10 | 47,835,757.40 |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 28,411 | 1,630.75 | 46,331,238.25 |
| BAJAJ AUTO LTD | 20,104 | 3,813.35 | 76,663,588.40 |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 24,768 | 2,132.00 | 52,805,376.00 |
| BHARAT FORGE LTD | 81,165 | 645.15 | 52,363,599.75 |
| EICHER MOTORS LTD | 44,963 | 2,877.90 | 129,399,017.70 |
| HERO MOTOCORP LTD | 39,062 | 2,759.95 | 107,809,166.90 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 311,486 | 1,072.05 | 333,928,566.30 |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 44,264 | 8,363.20 | 370,188,684.80 |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|-----------|------------------|--|
| MRF LTD | 469 | 70,553.00 | 33,089,357.00 | |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 456,934 | 122.30 | 55,883,028.20 | |
| TATA MOTORS LTD | 549,115 | 409.30 | 224,752,769.50 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 1,689 | 40,026.80 | 67,605,265.20 | |
| TITAN CO LTD | 116,517 | 2,045.60 | 238,347,175.20 | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 111,760 | 533.60 | 59,635,136.00 | |
| INFO EDGE INDIA LTD | 25,428 | 3,919.60 | 99,667,588.80 | |
| TRENT LTD | 54,816 | 1,058.70 | 58,033,699.20 | |
| ZOMATO LTD | 633,500 | 70.50 | 44,661,750.00 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 53,703 | 3,412.00 | 183,234,636.00 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 39,379 | 3,469.35 | 136,619,533.65 | |
| ITC LTD | 1,001,000 | 265.85 | 266,115,850.00 | |
| MARICO LTD | 182,517 | 482.20 | 88,009,697.40 | |
| NESTLE INDIA LTD | 12,070 | 17,231.65 | 207,986,015.50 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 191,104 | 729.00 | 139,314,816.00 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 104,276 | 761.35 | 79,390,532.60 | |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA) | 49,765 | 1,513.75 | 75,331,768.75 | |
| DABUR INDIA LTD | 195,135 | 509.75 | 99,470,066.25 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 121,056 | 794.55 | 96,185,044.80 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 291,813 | 2,303.90 | 672,307,970.70 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 35,757 | 3,838.40 | 137,249,668.80 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 104,437 | 526.50 | 54,986,080.50 | |
| BIOCON LTD | 147,697 | 326.95 | 48,289,534.15 | |
| CIPLA LTD | 158,591 | 933.70 | 148,076,416.70 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 41,759 | 3,681.00 | 153,714,879.00 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 45,070 | 4,309.65 | 194,235,925.50 | |
| LUPIN LTD | 81,026 | 629.40 | 50,997,764.40 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 346,766 | 824.60 | 285,943,243.60 | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 16,439 | 2,869.25 | 47,167,600.75 | |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD | 33,200 | 614.45 | 20,399,740.00 | |
| AXIS BANK LTD | 802,870 | 634.00 | 509,019,580.00 | |
| BANDHAN BANK LTD | 194,745 | 286.30 | 55,755,493.50 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 600,665 | 2,189.00 | 1,314,855,685.00 | |
| ICICI BANK LTD | 1,796,592 | 713.45 | 1,281,778,562.40 | |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 188,200 | 1,698.40 | 319,638,880.00 | |
| STATE BANK OF INDIA | 626,860 | 454.25 | 284,751,155.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|------------|-----------|---------------------------------------|--|
| YES BANK LTD | 4,242,068 | 12.75 | 54,086,367.00 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 90,467 | 5,587.75 | 505,506,979.25 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 12,211 | 11,582.95 | 141,439,402.45 | |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 151,200 | 647.75 | 97,939,800.00 | |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 48,400 | 985.30 | 47,688,520.00 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 39,647 | 1,650.65 | 65,443,320.55 | |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 84,000 | 760.00 | 63,840,000.00 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 58,620 | 1,245.30 | 72,999,486.00 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 354,909 | 561.45 | 199,263,658.05 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 94,410 | 1,120.35 | 105,772,243.50 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 104,818 | 492.85 | 51,659,551.30 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 164,214 | 1,078.55 | 177,113,009.70 | |
| DLF LTD | 228,304 | 315.80 | 72,098,403.20 | |
| GODREJ PROPERTIES LTD | 35,431 | 1,200.25 | 42,526,057.75 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 385,940 | 966.70 | 373,088,198.00 | |
| INFOSYS LTD | 1,182,759 | 1,441.10 | 1,704,473,994.90 | |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | 18,000 | 4,033.75 | 72,607,500.00 | |
| MINDTREE LTD | 23,800 | 2,831.90 | 67,399,220.00 | |
| MPHASIS LTD | 28,725 | 2,260.65 | 64,937,171.25 | |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 322,273 | 3,293.10 | 1,061,277,216.30 | |
| TATA ELXSI LTD | 13,000 | 7,794.35 | 101,326,550.00 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 208,120 | 981.20 | 204,207,344.00 | |
| WIPRO LTD | 461,393 | 418.75 | 193,208,318.75 | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 802,600 | 671.20 | 538,705,120.00 | |
| INDUS TOWERS LTD | 270,878 | 216.10 | 58,536,735.80 | |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | 130,888 | 1,857.60 | 243,137,548.80 | |
| ADANI POWER LTD | 283,920 | 264.45 | 75,082,644.00 | |
| ADANI TOTAL GAS LTD | 93,284 | 2,291.60 | 213,769,614.40 | |
| ADANI TRANSMISSION LTD | 93,144 | 2,152.10 | 200,455,202.40 | |
| GAIL INDIA LTD | 553,350 | 132.45 | 73,291,207.50 | |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | 135,251 | 369.40 | 49,961,719.40 | |
| NTPC LTD | 1,645,606 | 136.60 | 224,789,779.60 | |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 1,086,623 | 208.95 | 227,049,875.85 | |
| TATA POWER CO LTD | 473,889 | 207.90 | 98,521,523.10 | |
| インドルピー 小計 | 31,984,798 | | 22,825,032,445.40 (39,487,306,130) | |

| | | | | | |
|---------------|------------------------------|------------|-----------|-------------------|-----------------|
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 42,411 | 690.00 | 29,263,590.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 145,308 | 78.50 | 11,406,678.00 | |
| | CEZ AS | 51,853 | 1,173.00 | 60,823,569.00 | |
| チェココルナ 小計 | | 239,572 | | 101,493,837.00 | (583,488,068) |
| クウェートディナール | AGILITY | 535,846 | 0.81 | 438,857.87 | |
| | BOUBYAN BANK K.S.C | 339,193 | 0.77 | 263,892.15 | |
| | GULF BANK | 816,898 | 0.31 | 258,139.76 | |
| | KUWAIT FINANCE HOUSE | 1,850,722 | 0.83 | 1,545,352.87 | |
| | NATIONAL BANK OF KUWAIT | 2,499,109 | 1.03 | 2,574,082.27 | |
| | MABANEE CO KPSC | 197,406 | 0.75 | 148,449.31 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 810,760 | 0.59 | 484,023.72 | |
| クウェートディナール 小計 | | 7,049,934 | | 5,712,797.95 | (2,514,716,529) |
| コロンビアペソ | ECOPETROL SA | 1,503,029 | 2,139.00 | 3,214,979,031.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 84,654 | 37,000.00 | 3,132,198,000.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 190,643 | 34,420.00 | 6,561,932,060.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 129,758 | 20,420.00 | 2,649,658,360.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 1,908,084 | | 15,558,767,451.00 | (506,235,616) |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 136,418 | 2,926.00 | 399,159,068.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 45,206 | 6,850.00 | 309,661,100.00 | |
| | OTP BANK PLC | 79,588 | 8,400.00 | 668,539,200.00 | |
| ハンガリーフォリント 小計 | | 261,212 | | 1,377,359,368.00 | (487,969,499) |
| アラブディルハム | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 1,323,475 | 4.18 | 5,532,125.50 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 964,465 | 8.85 | 8,535,515.25 | |
| | ABU DHABI ISLAMIC BANK | 533,706 | 7.11 | 3,794,649.66 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK | 1,085,501 | 5.74 | 6,230,775.74 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 1,630,216 | 18.42 | 30,028,578.72 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 1,767,691 | 4.34 | 7,671,778.94 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 1,649,640 | 5.15 | 8,495,646.00 | |
| | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 1,221,087 | 27.10 | 33,091,457.70 | |
| アラブディルハム 小計 | | 10,175,781 | | 103,380,527.51 | (3,795,099,164) |
| ポーランドズロ | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 113,008 | 64.70 | 7,311,617.60 | |

| | | | | |
|------------------|------------------------------|-----------|---------------|----------------------------------|
| チ | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 730,464 | 5.52 | 4,032,161.28 |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 40,255 | 117.30 | 4,721,911.50 |
| | LPP SA | 460 | 8,635.00 | 3,972,100.00 |
| | CD PROJEKT SA | 20,231 | 94.41 | 1,910,008.71 |
| | CYFROWY POLSAT SA | 84,090 | 20.22 | 1,700,299.80 |
| | ALLEGRO.EU SA | 145,456 | 23.45 | 3,411,670.48 |
| | DINO POLSKA SA | 15,670 | 309.20 | 4,845,164.00 |
| | BANK PEKAO SA | 84,233 | 84.16 | 7,089,049.28 |
| | MBANK SA | 10,734 | 239.40 | 2,569,719.60 |
| | PKO BANK POLSKI SA | 288,426 | 28.91 | 8,338,395.66 |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 8,341 | 248.00 | 2,068,568.00 |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 230,064 | 29.70 | 6,832,900.80 |
| | ORANGE POLSKA SA | 216,864 | 5.97 | 1,295,545.53 |
| | PGE SA | 258,050 | 10.93 | 2,820,486.50 |
| | ポーランドズロチ 小計 | 2,246,346 | | 62,919,598.74 (1,906,180,703) |
| 南アフリカランド | EXXARO RESOURCES LTD | 101,347 | 194.68 | 19,730,233.96 |
| | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 27,534 | 210.87 | 5,806,094.58 |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 18,553 | 1,433.18 | 26,589,788.54 |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 138,077 | 243.85 | 33,670,076.45 |
| | GOLD FIELDS LTD | 292,364 | 150.02 | 43,860,447.28 |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 193,027 | 50.78 | 9,801,911.06 |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 305,431 | 179.46 | 54,812,647.26 |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 23,695 | 507.22 | 12,018,577.90 |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 103,580 | 167.97 | 17,398,332.60 |
| | SASOL LTD | 201,979 | 368.35 | 74,398,964.65 |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 1,121,622 | 42.02 | 47,130,556.44 |
| | BIDVEST GROUP LTD | 116,525 | 215.93 | 25,161,243.25 |
| | MULTICHOICE GROUP LTD | 132,010 | 114.77 | 15,150,787.70 |
| | MR PRICE GROUP LTD | 78,119 | 196.55 | 15,354,289.45 |
| | NASPERS LTD-N SHS | 77,932 | 1,912.77 | 149,065,991.64 |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 512,188 | 21.04 | 10,776,435.52 |
| | THE FOSCHINI GROUP LTD | 131,787 | 129.14 | 17,018,973.18 |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 335,360 | 57.19 | 19,179,238.40 |
| | BID CORP LTD | 122,807 | 308.92 | 37,937,538.44 |
| CLICKS GROUP LTD | 77,821 | 291.75 | 22,704,276.75 | |

| | | | | | |
|--------|-------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 158,366 | 212.46 | 33,646,440.36 | |
| | SPAR GROUP LIMITED/THE | 56,561 | 142.10 | 8,037,318.10 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 126,983 | 137.83 | 17,502,066.89 | |
| | ABSA GROUP LTD | 313,481 | 164.59 | 51,595,837.79 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 31,376 | 2,102.39 | 65,964,588.64 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 156,109 | 223.98 | 34,965,293.82 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 459,099 | 165.11 | 75,801,835.89 | |
| | FIRSTRAND LTD | 1,830,267 | 68.83 | 125,977,277.61 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 47,485 | 281.34 | 13,359,429.90 | |
| | REMGRO LTD | 155,996 | 135.40 | 21,121,858.40 | |
| | DISCOVERY LTD | 148,217 | 137.05 | 20,313,139.85 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 1,698,336 | 11.62 | 19,734,664.32 | |
| | SANLAM LTD | 641,477 | 54.94 | 35,242,746.38 | |
| | NEPI ROCKCASTLE S. A. | 148,196 | 91.33 | 13,534,740.68 | |
| | MTN GROUP LTD | 604,989 | 141.82 | 85,799,539.98 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 234,105 | 135.11 | 31,629,926.55 | |
| | 南アフリカランド 小計 | 10,922,801 | | 1,311,793,110.21 (11,150,241,436) | |
| オフショア元 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 724,325 | 4.08 | 2,955,246.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 155,628 | 31.20 | 4,855,593.60 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 26,000 | 9.61 | 249,860.00 | |
| | GUANGHUI ENERGY CO LTD-A | 235,000 | 9.65 | 2,267,750.00 | |
| | OFFSHORE OIL ENGINEERING-A | 42,000 | 4.15 | 174,300.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 308,400 | 5.34 | 1,646,856.00 | |
| | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 201,900 | 19.82 | 4,001,658.00 | |
| | SHANXI COKING COAL ENERGY-A | 38,870 | 12.32 | 478,878.40 | |
| | SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A | 28,400 | 13.68 | 388,512.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-A | 100,055 | 35.53 | 3,554,954.15 | |
| | YANTAI JEREH OILFIELD-A | 9,100 | 40.08 | 364,728.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 350,000 | 4.74 | 1,659,000.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 79,700 | 33.96 | 2,706,612.00 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 435,096 | 6.28 | 2,732,402.88 | |
| | BBMG CORPORATION-A | 79,100 | 2.75 | 217,525.00 | |
| | BEIJING EASPRING MATERIAL-A | 14,200 | 95.50 | 1,356,100.00 | |
| | CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A | 27,200 | 58.65 | 1,595,280.00 | |
| | CHIFENG JILONG GOLD MINING-A | 56,700 | 16.03 | 908,901.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| CHINA JUSHI CO LTD -A | 110,447 | 16.89 | 1,865,449.83 |
| CHINA MINMETALS RARE EARTH-A | 32,500 | 31.25 | 1,015,625.00 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 68,500 | 35.21 | 2,411,885.00 |
| CMOC GROUP LTD-A | 515,101 | 5.75 | 2,961,830.75 |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 9,100 | 129.48 | 1,178,268.00 |
| GANFENG LITHIUM CO LTD-A | 21,808 | 136.51 | 2,977,010.08 |
| GEM CO LTD-A | 131,700 | 9.41 | 1,239,297.00 |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 39,780 | 62.89 | 2,501,764.20 |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 96,900 | 21.96 | 2,127,924.00 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A | 35,148 | 10.76 | 378,192.48 |
| HESTEEL CO LTD-A | 100,800 | 2.27 | 228,816.00 |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A | 9,600 | 124.14 | 1,191,744.00 |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD -A | 106,636 | 7.90 | 842,424.40 |
| HUAXIN CEMENT CO LTD-A | 12,900 | 18.17 | 234,393.00 |
| HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A | 38,600 | 40.78 | 1,574,108.00 |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A | 185,200 | 5.09 | 942,668.00 |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 951,300 | 2.64 | 2,511,432.00 |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 80,316 | 5.37 | 431,296.92 |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 72,300 | 18.58 | 1,343,334.00 |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 2,900 | 136.74 | 396,546.00 |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A | 99,100 | 17.49 | 1,733,259.00 |
| KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A | 59,800 | 9.58 | 572,884.00 |
| LB GROUP CO LTD-A | 59,600 | 20.37 | 1,214,052.00 |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD-A | 41,100 | 28.32 | 1,163,952.00 |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 116,800 | 14.63 | 1,708,784.00 |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 81,700 | 3.59 | 293,303.00 |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 191,671 | 15.48 | 2,967,067.08 |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 60,529 | 25.96 | 1,571,332.84 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 90,424 | 18.63 | 1,684,599.12 |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A | 49,850 | 29.27 | 1,459,109.50 |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A | 336,100 | 3.47 | 1,166,267.00 |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A | 24,600 | 12.00 | 295,200.00 |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 24,080 | 86.72 | 2,088,217.60 |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 145,500 | 12.29 | 1,788,195.00 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A | 145,000 | 5.54 | 803,300.00 |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 20,880 | 51.14 | 1,067,803.20 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| SHEZHEN DYNANONIC CO LTD-A | 11,900 | 410.66 | 4,886,854.00 |
| SHEZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A | 17,980 | 30.82 | 554,143.60 |
| SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL-A | 12,000 | 31.40 | 376,800.00 |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 47,100 | 27.24 | 1,283,004.00 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A | 58,100 | 3.21 | 186,501.00 |
| SKSHU PAINT CO LTD-A | 9,660 | 117.76 | 1,137,561.60 |
| SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A | 15,800 | 80.62 | 1,273,796.00 |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A | 100,000 | 6.53 | 653,000.00 |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A | 60,900 | 16.05 | 977,445.00 |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 510,800 | 3.27 | 1,670,316.00 |
| TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A | 30,906 | 6.19 | 191,308.14 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 87,500 | 93.42 | 8,174,250.00 |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 4,900 | 57.45 | 281,505.00 |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A | 16,600 | 96.40 | 1,600,240.00 |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A | 13,400 | 21.83 | 292,522.00 |
| YINTAI GOLD CO LTD-A | 26,460 | 9.81 | 259,572.60 |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS-A | 11,200 | 143.11 | 1,602,832.00 |
| YOUNGY CO LTD-A | 10,000 | 152.25 | 1,522,500.00 |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 15,500 | 261.87 | 4,058,985.00 |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 28,015 | 89.61 | 2,510,424.15 |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A | 26,100 | 12.89 | 336,429.00 |
| ZHEJIANG YONGTAI TECH-A | 25,300 | 32.41 | 819,973.00 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 422,400 | 9.20 | 3,886,080.00 |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A | 78,931 | 28.60 | 2,257,426.60 |
| AECC AVIATION POWER CO-A | 79,200 | 45.11 | 3,572,712.00 |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A | 181,400 | 12.36 | 2,242,104.00 |
| AVICOPTER PLC-A | 37,400 | 46.91 | 1,754,434.00 |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 16,100 | 32.40 | 521,640.00 |
| BEIJING UNITED INFORMATION-A | 17,255 | 89.55 | 1,545,185.25 |
| CHINA BAOAN GROUP-A | 49,260 | 14.13 | 696,043.80 |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A | 73,000 | 19.63 | 1,432,990.00 |
| CHINA ENERGY ENGINEERING COR | 543,500 | 2.37 | 1,288,095.00 |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A | 98,000 | 9.36 | 917,280.00 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | 291,100 | 6.08 | 1,769,888.00 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 856,180 | 5.43 | 4,649,057.40 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 53,008 | 563.50 | 29,870,008.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| CRRC CORP LTD-A | 410,000 | 5.17 | 2,119,700.00 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 144,760 | 16.77 | 2,427,625.20 |
| EVE ENERGY CO LTD-A | 35,088 | 107.30 | 3,764,942.40 |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A | 36,143 | 7.49 | 270,711.07 |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A | 9,750 | 204.10 | 1,989,975.00 |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A | 35,700 | 46.49 | 1,659,693.00 |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 7,800 | 107.00 | 834,600.00 |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A | 7,100 | 59.83 | 424,793.00 |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 26,032 | 57.76 | 1,503,608.32 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 29,200 | 22.34 | 652,328.00 |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 47,400 | 17.19 | 814,806.00 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 527,534 | 3.43 | 1,809,441.62 |
| MING YANG SMART ENERGY GRO-A | 47,900 | 31.30 | 1,499,270.00 |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 109,008 | 28.36 | 3,091,466.88 |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A | 8,300 | 134.06 | 1,112,698.00 |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A | 49,900 | 28.00 | 1,397,200.00 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 293,400 | 7.83 | 2,297,322.00 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 160,216 | 18.11 | 2,901,511.76 |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 84,500 | 3.02 | 255,190.00 |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 407,700 | 4.09 | 1,667,493.00 |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 50,851 | 69.80 | 3,549,399.80 |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A | 132,600 | 10.56 | 1,400,256.00 |
| SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A | 12,000 | 35.88 | 430,560.00 |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 38,400 | 95.41 | 3,663,744.00 |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A | 37,600 | 34.44 | 1,294,944.00 |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 3,520 | 479.00 | 1,686,080.00 |
| TBEA CO LTD-A | 81,400 | 26.71 | 2,174,194.00 |
| TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A | 12,000 | 17.69 | 212,280.00 |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 103,651 | 12.59 | 1,304,966.09 |
| WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A | 13,440 | 68.34 | 918,489.60 |
| WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A | 9,240 | 136.50 | 1,261,260.00 |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A | 363,600 | 5.33 | 1,937,988.00 |
| XIAMEN C & D INC-A | 26,900 | 11.76 | 316,344.00 |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A | 129,800 | 14.24 | 1,848,352.00 |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 36,000 | 37.28 | 1,342,080.00 |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 4,620 | 48.43 | 223,746.60 |

| | | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A | 12,000 | 74.96 | 899,520.00 | |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 15,000 | 22.32 | 334,800.00 | |
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A | 90,500 | 12.24 | 1,107,720.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 143,900 | 5.97 | 859,083.00 | |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A | 336,637 | 4.90 | 1,649,521.30 | |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 8,800 | 50.77 | 446,776.00 | |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A | 44,700 | 31.52 | 1,408,944.00 | |
| AIR CHINA LTD-A | 142,600 | 10.24 | 1,460,224.00 | |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A | 1,359,355 | 4.89 | 6,647,245.95 | |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 88,800 | 4.92 | 436,896.00 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 205,800 | 6.85 | 1,409,730.00 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 269,330 | 13.67 | 3,681,741.10 | |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A | 874,000 | 6.56 | 5,733,440.00 | |
| S F HOLDING CO LTD-A | 142,200 | 52.62 | 7,482,564.00 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 9,100 | 49.99 | 454,909.00 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 139,900 | 5.90 | 825,410.00 | |
| SINOTRANS LIMITED-A | 41,600 | 3.87 | 160,992.00 | |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A | 75,200 | 20.18 | 1,517,536.00 | |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A | 78,060 | 15.84 | 1,236,470.40 | |
| BYD CO LTD -A | 37,300 | 351.05 | 13,094,165.00 | |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 2,600 | 172.09 | 447,434.00 | |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A | 116,300 | 22.35 | 2,599,305.00 | |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A | 73,700 | 9.50 | 700,150.00 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 46,838 | 44.09 | 2,065,087.42 | |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 34,900 | 39.91 | 1,392,859.00 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 348,900 | 17.46 | 6,091,794.00 | |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A | 68,200 | 25.40 | 1,732,280.00 | |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 12,000 | 158.56 | 1,902,720.00 | |
| MIANYANG FULIN PRECISION C-A | 6,000 | 23.52 | 141,120.00 | |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A | 12,360 | 15.56 | 192,321.60 | |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A | 10,000 | 70.50 | 705,000.00 | |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 159,244 | 18.19 | 2,896,648.36 | |
| SAILUN GROUP CO LTD-A | 107,100 | 11.99 | 1,284,129.00 | |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 11,400 | 26.66 | 303,924.00 | |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A | 8,700 | 173.00 | 1,505,100.00 | |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A | 1,100 | 641.00 | 705,100.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A | 11,400 | 111.39 | 1,269,846.00 |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 199,753 | 33.90 | 6,771,626.70 |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A | 208,929 | 26.62 | 5,561,689.98 |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A | 9,000 | 33.84 | 304,560.00 |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 12,400 | 72.00 | 892,800.00 |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A | 12,917 | 137.95 | 1,781,900.15 |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A | 310,000 | 4.48 | 1,388,800.00 |
| XIAMEN INTRETECH INC-A | 38,432 | 21.29 | 818,217.28 |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A | 17,100 | 5.81 | 99,351.00 |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A | 5,200 | 56.50 | 293,800.00 |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 27,000 | 56.35 | 1,521,450.00 |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A | 268,100 | 5.73 | 1,536,213.00 |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 24,843 | 13.80 | 342,833.40 |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A | 75,300 | 21.43 | 1,613,679.00 |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 27,900 | 8.76 | 244,404.00 |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 280,502 | 6.35 | 1,781,187.70 |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A | 700 | 383.24 | 268,268.00 |
| GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A | 12,800 | 9.03 | 115,584.00 |
| KUNLUN TECH CO LTD-A | 31,200 | 15.58 | 486,096.00 |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 25,280 | 33.55 | 848,144.00 |
| PERFECT WORLD CO LTD-A | 18,300 | 13.96 | 255,468.00 |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A | 126,520 | 4.77 | 603,500.40 |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 40,499 | 201.12 | 8,145,158.88 |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 30,800 | 8.90 | 274,120.00 |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A | 48,200 | 5.03 | 242,446.00 |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 16,420 | 30.87 | 506,885.40 |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 6,552 | 53.18 | 348,435.36 |
| ANGEL YEAST CO LTD-A | 7,800 | 47.75 | 372,450.00 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 10,200 | 230.37 | 2,349,774.00 |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 5,625 | 55.50 | 312,187.50 |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A | 21,800 | 61.06 | 1,331,108.00 |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A | 5,900 | 150.45 | 887,655.00 |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 40,300 | 7.83 | 315,549.00 |
| BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A | 7,000 | 26.10 | 182,700.00 |
| CHACHA FOOD CO LTD-A | 2,000 | 55.25 | 110,500.00 |
| CHONGQING BREWERY CO-A | 4,600 | 132.90 | 611,340.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| CHONGQING FULING ZHACAI-A | 7,500 | 33.43 | 250,725.00 |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 71,578 | 84.18 | 6,025,436.04 |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A | 9,800 | 19.28 | 188,944.00 |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A | 25,019 | 59.64 | 1,492,133.16 |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A | 118,600 | 14.88 | 1,764,768.00 |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 87,500 | 29.20 | 2,555,000.00 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 161,700 | 38.00 | 6,144,600.00 |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 32,590 | 49.65 | 1,618,093.50 |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 26,281 | 173.20 | 4,551,869.20 |
| JIANGXI ZHENGBANG TECH -A | 23,200 | 6.27 | 145,464.00 |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A | 3,600 | 184.98 | 665,928.00 |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 7,600 | 31.33 | 238,108.00 |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A | 5,500 | 49.38 | 271,590.00 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 27,182 | 2,009.01 | 54,608,909.82 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 37,800 | 230.00 | 8,694,000.00 |
| MUYUAN FOODS CO LTD-A | 110,880 | 56.90 | 6,309,072.00 |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 59,400 | 15.78 | 937,332.00 |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 24,705 | 27.84 | 687,787.20 |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 27,760 | 302.80 | 8,405,728.00 |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A | 12,600 | 85.30 | 1,074,780.00 |
| TOLY BREAD CO LTD-A | 10,192 | 15.20 | 154,918.40 |
| TONGWEI CO LTD-A | 109,600 | 57.96 | 6,352,416.00 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A | 6,600 | 95.59 | 630,894.00 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 89,540 | 21.93 | 1,963,612.20 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 93,900 | 185.00 | 17,371,500.00 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 23,700 | 49.21 | 1,166,277.00 |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 12,500 | 16.76 | 209,500.00 |
| BY-HEALTH CO LTD-A | 15,000 | 20.93 | 313,950.00 |
| PROYA COSMETICS CO LTD-A | 6,300 | 156.77 | 987,651.00 |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 163,883 | 41.86 | 6,860,142.38 |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 4,400 | 77.15 | 339,460.00 |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 57,140 | 42.29 | 2,416,450.60 |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A | 13,320 | 24.05 | 320,346.00 |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A | 7,600 | 49.80 | 378,480.00 |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A | 64,300 | 26.67 | 1,714,881.00 |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A | 17,800 | 12.11 | 215,558.00 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|--------------|
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A | 95,160 | 18.40 | 1,750,944.00 |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 35,560 | 5.23 | 185,978.80 |
| OVCTEK CHINA INC-A | 17,260 | 53.34 | 920,648.40 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A | 18,300 | 18.25 | 333,975.00 |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 26,300 | 319.30 | 8,397,590.00 |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A | 10,000 | 43.07 | 430,700.00 |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 7,000 | 158.96 | 1,112,720.00 |
| WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A | 184,520 | 8.80 | 1,623,776.00 |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A | 15,000 | 20.44 | 306,600.00 |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 2,600 | 281.12 | 730,912.00 |
| BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A | 11,880 | 24.17 | 287,139.60 |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A | 9,860 | 150.28 | 1,481,760.80 |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 3,800 | 61.65 | 234,270.00 |
| BGI GENOMICS CO LTD-A | 17,000 | 68.11 | 1,157,870.00 |
| CANSINO BIOLOGICS INC-A | 2,600 | 199.00 | 517,400.00 |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A | 8,700 | 211.15 | 1,837,005.00 |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 9,300 | 45.71 | 425,103.00 |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 28,898 | 100.69 | 2,909,739.62 |
| DAAN GENE CO LTD-A | 19,360 | 17.48 | 338,412.80 |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A | 6,200 | 36.10 | 223,820.00 |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 128,900 | 31.37 | 4,043,593.00 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 7,089 | 104.46 | 740,516.94 |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 54,190 | 21.81 | 1,181,883.90 |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 29,900 | 16.27 | 486,473.00 |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 3,400 | 564.00 | 1,917,600.00 |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 234,143 | 33.52 | 7,848,473.36 |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 18,400 | 12.14 | 223,376.00 |
| JOINN LABORATORIES CHINA C-A | 10,600 | 112.47 | 1,192,182.00 |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A | 5,800 | 34.47 | 199,926.00 |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 9,633 | 29.45 | 283,691.85 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A | 18,750 | 93.01 | 1,743,937.50 |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 10,780 | 19.74 | 212,797.20 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 48,600 | 43.20 | 2,099,520.00 |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A | 24,600 | 78.60 | 1,933,560.00 |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 240,500 | 5.95 | 1,430,975.00 |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 15,425 | 42.34 | 653,094.50 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A | 8,200 | 26.97 | 221,154.00 |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 16,100 | 24.96 | 401,856.00 |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 13,600 | 19.42 | 264,112.00 |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A | 32,480 | 47.89 | 1,555,467.20 |
| WUXI APPTec CO LTD-A | 49,771 | 102.67 | 5,109,988.57 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 26,460 | 58.14 | 1,538,384.40 |
| ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A | 9,200 | 342.29 | 3,149,068.00 |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 13,860 | 21.37 | 296,188.20 |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A | 25,700 | 50.30 | 1,292,710.00 |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A | 85,176 | 22.55 | 1,920,718.80 |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A | 5,000 | 48.72 | 243,600.00 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 3,906,800 | 3.01 | 11,759,468.00 |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 346,600 | 4.53 | 1,570,098.00 |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A | 34,393 | 16.35 | 562,325.55 |
| BANK OF CHINA LTD-A | 772,400 | 3.25 | 2,510,300.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 792,233 | 4.95 | 3,921,553.35 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A | 151,000 | 13.96 | 2,107,960.00 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 324,350 | 6.53 | 2,118,005.50 |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 159,900 | 10.59 | 1,693,341.00 |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 115,011 | 33.32 | 3,832,166.52 |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 207,711 | 6.50 | 1,350,121.50 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 91,200 | 6.01 | 548,112.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 956,010 | 3.21 | 3,068,792.10 |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 565,699 | 40.20 | 22,741,099.80 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 746,028 | 3.70 | 2,760,303.60 |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 241,200 | 3.32 | 800,784.00 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 56,500 | 3.97 | 224,305.00 |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 198,750 | 5.14 | 1,021,575.00 |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 1,164,728 | 4.74 | 5,520,810.72 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 413,374 | 19.19 | 7,932,647.06 |
| PING AN BANK CO LTD-A | 413,561 | 14.23 | 5,884,973.03 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 526,500 | 5.15 | 2,711,475.00 |
| QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A | 30,300 | 3.33 | 100,899.00 |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 884,337 | 7.95 | 7,030,479.15 |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A | 461,900 | 3.49 | 1,612,031.00 |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 34,125 | 7.99 | 272,658.75 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|-------|--------------|
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 52,500 | 5.98 | 313,950.00 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 70,200 | 9.66 | 678,132.00 |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 58,000 | 10.27 | 595,660.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A | 32,692 | 44.20 | 1,444,986.40 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 159,900 | 14.54 | 2,324,946.00 |
| CITIC SECURITIES CO-A | 198,845 | 21.63 | 4,301,017.35 |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A | 79,800 | 28.65 | 2,286,270.00 |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A | 26,200 | 8.96 | 234,752.00 |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 227,059 | 25.15 | 5,710,533.85 |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A | 101,600 | 16.62 | 1,688,592.00 |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 97,100 | 6.18 | 600,078.00 |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A | 231,200 | 6.80 | 1,572,160.00 |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 101,100 | 18.75 | 1,895,625.00 |
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A | 110,261 | 6.87 | 757,493.07 |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A | 51,600 | 11.95 | 616,620.00 |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A | 73,100 | 9.56 | 698,836.00 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 173,625 | 15.20 | 2,639,100.00 |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A | 31,900 | 6.28 | 200,332.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A | 242,979 | 9.76 | 2,371,475.04 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 13,530 | 97.06 | 1,313,221.80 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 115,240 | 14.48 | 1,668,675.20 |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A | 24,900 | 7.65 | 190,485.00 |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A | 180,700 | 7.13 | 1,288,391.00 |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A | 31,300 | 8.45 | 264,485.00 |
| NORTHEAST SECURITIES CO LT-A | 22,200 | 6.96 | 154,512.00 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 139,500 | 10.49 | 1,463,355.00 |
| SEALAND SECURITIES CO LTD -A | 40,000 | 3.69 | 147,600.00 |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A | 26,900 | 5.67 | 152,523.00 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 339,514 | 4.26 | 1,446,329.64 |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | 28,700 | 9.12 | 261,744.00 |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A | 28,500 | 6.89 | 196,365.00 |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 53,700 | 4.02 | 215,874.00 |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A | 247,600 | 6.66 | 1,649,016.00 |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 74,000 | 11.27 | 833,980.00 |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A | 132,200 | 7.76 | 1,025,872.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A | 85,400 | 31.77 | 2,713,158.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 153,200 | 23.44 | 3,591,008.00 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 31,386 | 32.51 | 1,020,358.86 |
| PICC HOLDING CO-A | 81,000 | 5.20 | 421,200.00 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 290,422 | 46.76 | 13,580,132.72 |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 137,922 | 12.55 | 1,730,921.10 |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 194,956 | 18.34 | 3,575,493.04 |
| GEMDALE CORP-A | 42,900 | 12.38 | 531,102.00 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 246,800 | 16.23 | 4,005,564.00 |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A | 58,700 | 24.79 | 1,455,173.00 |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A | 160,740 | 13.52 | 2,173,204.80 |
| SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A | 125,500 | 12.64 | 1,586,320.00 |
| YOUNGOR GROUP CO-A | 106,400 | 6.53 | 694,792.00 |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 319,600 | 8.40 | 2,684,640.00 |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 6,100 | 196.27 | 1,197,247.00 |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 16,464 | 15.25 | 251,076.00 |
| BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A | 131,600 | 10.66 | 1,402,856.00 |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A | 281,500 | 6.16 | 1,734,040.00 |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 38,768 | 45.25 | 1,754,252.00 |
| IFLYTEK CO LTD - A | 48,285 | 41.75 | 2,015,898.75 |
| NAVINFO CO LTD-A | 18,600 | 14.37 | 267,282.00 |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A | 8,500 | 103.93 | 883,405.00 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 27,100 | 55.63 | 1,507,573.00 |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 12,400 | 140.04 | 1,736,496.00 |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 87,015 | 20.14 | 1,752,482.10 |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 36,700 | 28.68 | 1,052,556.00 |
| BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A | 8,200 | 138.50 | 1,135,700.00 |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 672,300 | 3.89 | 2,615,247.00 |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 48,197 | 29.62 | 1,427,595.14 |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 164,000 | 10.72 | 1,758,080.00 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A | 296,998 | 4.58 | 1,360,250.84 |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A | 13,700 | 138.73 | 1,900,601.00 |
| FIBERHOME TELECOM TECH CO-A | 11,100 | 14.29 | 158,619.00 |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 222,100 | 9.75 | 2,165,475.00 |
| GOERTEK INC -A | 71,400 | 33.47 | 2,389,758.00 |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A | 166,500 | 9.21 | 1,533,465.00 |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A | 21,800 | 9.10 | 198,380.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 8,400 | 75.09 | 630,756.00 |
| HUAGONG TECH CO LTD-A | 33,500 | 23.20 | 777,200.00 |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 54,900 | 26.11 | 1,433,439.00 |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A | 109,400 | 10.75 | 1,176,050.00 |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 217,700 | 4.84 | 1,053,668.00 |
| LUXSHARE PRECISIONIndustr-A | 149,112 | 32.41 | 4,832,719.92 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 6,720 | 203.12 | 1,364,966.40 |
| NINESTAR CORP-A | 39,700 | 52.16 | 2,070,752.00 |
| OFILM GROUP CO LTD-A | 25,700 | 5.94 | 152,658.00 |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 21,600 | 17.02 | 367,632.00 |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A | 4,480 | 94.64 | 423,987.20 |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 12,000 | 89.80 | 1,077,600.00 |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A | 15,300 | 23.63 | 361,539.00 |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 9,000 | 31.75 | 285,750.00 |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A | 111,100 | 9.86 | 1,095,446.00 |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A | 38,248 | 18.85 | 720,974.80 |
| WESTONE INFORMATION INDUST-A | 26,600 | 40.13 | 1,067,458.00 |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 25,000 | 70.83 | 1,770,750.00 |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 120,794 | 12.96 | 1,565,490.24 |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 18,040 | 15.89 | 286,655.60 |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A | 6,300 | 187.05 | 1,178,415.00 |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 22,450 | 74.75 | 1,678,137.50 |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 75,700 | 16.28 | 1,232,396.00 |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A | 5,700 | 30.50 | 173,850.00 |
| ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A | 10,000 | 63.49 | 634,900.00 |
| ZTE CORP-A | 81,600 | 24.90 | 2,031,840.00 |
| CHINA UNITED NETWORK-A | 520,000 | 3.48 | 1,809,600.00 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 240,000 | 6.70 | 1,608,000.00 |
| CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 661,300 | 6.27 | 4,146,351.00 |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 506,540 | 23.37 | 11,837,839.80 |
| ENN NATURAL GAS CO LTD-A | 73,600 | 18.49 | 1,360,864.00 |
| GD POWER DEVELOPMENT CO -A | 570,400 | 3.74 | 2,133,296.00 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A | 64,400 | 3.93 | 253,092.00 |
| HUANENG POWER INTL INC-A | 157,200 | 7.39 | 1,161,708.00 |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 174,000 | 10.35 | 1,800,900.00 |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 37,560 | 6.28 | 235,876.80 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
| | SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 180,400 | 11.85 | 2,137,740.00 | |
| | ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 9,900 | 117.20 | 1,160,280.00 | |
| | CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 21,000 | 57.32 | 1,203,720.00 | |
| | FLAT GLASS GROUP CO LTD-A | 25,100 | 41.36 | 1,038,136.00 | |
| | GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A | 48,300 | 4.17 | 201,411.00 | |
| | GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A | 13,556 | 132.00 | 1,789,392.00 | |
| | HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 23,016 | 77.78 | 1,790,184.48 | |
| | HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 33,200 | 46.39 | 1,540,148.00 | |
| | INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A | 10,100 | 96.51 | 974,751.00 | |
| | JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 40,600 | 76.36 | 3,100,216.00 | |
| | JCET GROUP CO LTD-A | 47,200 | 25.24 | 1,191,328.00 | |
| | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 149,389 | 64.35 | 9,613,182.15 | |
| | MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A | 18,400 | 56.88 | 1,046,592.00 | |
| | NATIONAL SILICON INDUSTRY -A | 42,700 | 22.77 | 972,279.00 | |
| | NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A | 8,100 | 268.40 | 2,174,040.00 | |
| | SG MICRO CORP-A | 6,075 | 172.88 | 1,050,246.00 | |
| | SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 8,600 | 105.99 | 911,514.00 | |
| | STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A | 3,500 | 374.92 | 1,312,220.00 | |
| | TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A | 56,200 | 46.78 | 2,629,036.00 | |
| | TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 201,300 | 9.34 | 1,880,142.00 | |
| | TONGFU MICROELECTRONIC CO-A | 29,100 | 14.63 | 425,733.00 | |
| | TRINA SOLAR CO LTD-A | 30,100 | 67.92 | 2,044,392.00 | |
| | UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 13,000 | 184.35 | 2,396,550.00 | |
| | WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A | 14,800 | 159.58 | 2,361,784.00 | |
| | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 29,700 | 66.50 | 1,975,050.00 | |
| | オフショア元 小計 | 51,901,761 | | 876,410,660.55 (17,639,780,288) | |
| サウジアラビア リヤル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 54,323 | 17.60 | 956,084.80 | |
| | SAUDI ARABIAN OIL CO | 883,118 | 37.65 | 33,249,392.70 | |
| | ADVANCED PETROCHEMICALS CO | 37,920 | 50.90 | 1,930,128.00 | |
| | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 122,759 | 16.10 | 1,976,419.90 | |
| | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 72,760 | 141.00 | 10,259,160.00 | |
| | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 124,734 | 48.45 | 6,043,362.30 | |
| | SAUDI ARABIAN MINING CO | 310,765 | 51.40 | 15,973,321.00 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 320,274 | 101.60 | 32,539,838.40 | |
| | SAUDI IND INVESTMENT GROUP | 111,575 | 27.75 | 3,096,206.25 | |

| | | | | | |
|-------|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|--|
| | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 258,586 | 15.52 | 4,013,254.72 | |
| | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 86,363 | 50.80 | 4,387,240.40 | |
| | SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 11,285 | 201.00 | 2,268,285.00 | |
| | JARIR MARKETING CO | 24,000 | 161.40 | 3,873,600.00 | |
| | ALMARAI CO | 70,302 | 52.50 | 3,690,855.00 | |
| | SAVOLA | 72,389 | 35.90 | 2,598,765.10 | |
| | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 31,852 | 198.80 | 6,332,177.60 | |
| | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 19,343 | 216.60 | 4,189,693.80 | |
| | AL RAJHI BANK | 682,063 | 84.60 | 57,702,529.80 | |
| | ALINMA BANK | 389,122 | 33.90 | 13,191,235.80 | |
| | ARAB NATIONAL BANK | 193,088 | 30.85 | 5,956,764.80 | |
| | BANK AL-JAZIRA | 114,405 | 23.14 | 2,647,331.70 | |
| | BANK ALBILAD | 162,381 | 43.60 | 7,079,811.60 | |
| | BANQUE SAUDI FRANSI | 202,855 | 46.70 | 9,473,328.50 | |
| | RIYAD BANK | 459,199 | 32.50 | 14,923,967.50 | |
| | SAUDI BRITISH BANK | 340,925 | 38.65 | 13,176,751.25 | |
| | SAUDI INVESTMENT BANK/THE | 205,040 | 19.50 | 3,998,280.00 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 773,206 | 63.90 | 49,407,863.40 | |
| | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING | 16,046 | 171.00 | 2,743,866.00 | |
| | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | 18,393 | 157.40 | 2,895,058.20 | |
| | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 180,939 | 12.40 | 2,243,643.60 | |
| | EMAAR ECONOMIC CITY | 162,006 | 10.12 | 1,639,500.72 | |
| | ELM CO | 10,228 | 259.40 | 2,653,143.20 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 108,973 | 36.10 | 3,933,925.30 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 142,448 | 11.52 | 1,641,000.96 | |
| | SAUDI TELECOM CO | 216,776 | 99.00 | 21,460,824.00 | |
| | ACWA POWER CO | 30,596 | 146.00 | 4,467,016.00 | |
| | SAUDI ELECTRICITY CO | 302,586 | 23.38 | 7,074,460.68 | |
| | サウジアラビアリアル 小計 | 7,323,623 | | 365,688,087.98 (13,135,516,120) | |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 59,228 | 266.90 | 15,807,953.20 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 486,774 | 27.86 | 13,561,523.64 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 166,850 | 24.56 | 4,097,836.00 | |
| | KOC HOLDING AS | 330,276 | 40.90 | 13,508,288.40 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 457,917 | 21.76 | 9,964,273.92 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 257,239 | 50.25 | 12,926,259.75 | |

| | | | | | |
|---------|-------------------------------|---------------|--------|--------------------------------------|--|
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 24,370 | 299.00 | 7,286,630.00 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 164,559 | 84.40 | 13,888,779.60 | |
| | AKBANK T. A. S. | 865,040 | 8.77 | 7,586,400.80 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 350,000 | 20.62 | 7,217,000.00 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 596,394 | 4.70 | 2,803,051.80 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 496,142 | 17.80 | 8,831,327.60 | |
| | トルコリラ 小計 | 4,254,789 | | 117,479,324.71 (953,156,753) | |
| ユーロ | MYTILINEOS S. A. | 65,300 | 14.53 | 948,809.00 | |
| | FF GROUP | 5,889 | 4.80 | 28,267.20 | |
| | OPAP SA | 53,528 | 13.93 | 745,645.04 | |
| | JUMBO SA | 33,461 | 14.54 | 486,522.94 | |
| | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 974,172 | 0.85 | 835,449.90 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 1,015,188 | 0.89 | 909,608.44 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 111,893 | 2.95 | 330,196.24 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 76,208 | 16.37 | 1,247,524.96 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 59,582 | 5.45 | 324,721.90 | |
| | ユーロ 小計 | 2,395,221 | | 5,856,745.62 (831,833,580) | |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC | 198,447 | 17.90 | 3,552,201.30 | |
| | QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT) | 970,867 | 3.67 | 3,565,023.62 | |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 1,634,477 | 2.51 | 4,102,537.27 | |
| | INDUSTRIES QATAR | 464,461 | 15.69 | 7,287,393.09 | |
| | COMMERCIAL BANK PSQC | 586,027 | 6.89 | 4,037,726.03 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 2,032,329 | 4.18 | 8,511,393.85 | |
| | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 191,996 | 10.70 | 2,054,357.20 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK | 611,198 | 22.25 | 13,599,155.50 | |
| | QATAR NATIONAL BANK | 1,617,125 | 19.74 | 31,922,047.50 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 892,615 | 3.30 | 2,950,092.57 | |
| | OOREDOO QPSC | 248,987 | 7.59 | 1,889,811.33 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 266,231 | 17.20 | 4,579,173.20 | |
| | カタールリアル 小計 | 9,714,760 | | 88,050,912.46 (3,234,990,523) | |
| | 合 計 | 2,234,608,355 | | 311,872,425,893 (311,872,425,893) | |

(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 SITES MEX- A-1 | 434,300 | 9,975,871.00 | |
| | | TRUST FIBRA UNO | 1,072,900 | 21,093,214.00 | |
| メキシコペソ合計 | | | 1,507,200 | 31,069,085.00 (210,086,045) | |
| 南アフリカランド | 投資証券 | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 986,436 | 12,843,396.72 | |
| 南アフリカランド合計 | | | 986,436 | 12,843,396.72 (109,168,872) | |
| 合計 | | | | 319,254,917 (319,254,917) | |

(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 57 銘柄 | 100.00% | — | 3.43% |
| 香港ドル | 株式 197 銘柄 | 100.00% | — | 26.34% |
| マレーシアリングgit | 株式 34 銘柄 | 100.00% | — | 1.44% |
| タイバーツ | 株式 42 銘柄 | 100.00% | — | 1.85% |
| フィリピンペソ | 株式 20 銘柄 | 100.00% | — | 0.70% |
| インドネシアルピア | 株式 25 銘柄 | 100.00% | — | 1.88% |
| メキシコペソ | 株式 20 銘柄 | 96.82% | — | 2.05% |
| | 投資証券 2 銘柄 | — | 3.18% | 0.07% |
| ブラジルリアル | 株式 48 銘柄 | 100.00% | — | 4.77% |
| チリペソ | 株式 12 銘柄 | 100.00% | — | 0.51% |
| 韓国ウォン | 株式 112 銘柄 | 100.00% | — | 11.34% |
| ニュー台湾ドル | 株式 87 銘柄 | 100.00% | — | 14.76% |
| インドルピー | 株式 109 銘柄 | 100.00% | — | 12.65% |
| チェココルナ | 株式 3 銘柄 | 100.00% | — | 0.19% |
| クウェートディナール | 株式 7 銘柄 | 100.00% | — | 0.81% |
| コロンビアペソ | 株式 4 銘柄 | 100.00% | — | 0.16% |
| ハンガリーフォリント | 株式 3 銘柄 | 100.00% | — | 0.16% |
| アラブディルハム | 株式 8 銘柄 | 100.00% | — | 1.22% |

| | | | | | |
|------------|------|--------|---------|-------|-------|
| ポーランドズロチ | 株式 | 15 銘柄 | 100.00% | — | 0.61% |
| 南アフリカランド | 株式 | 36 銘柄 | 99.03% | — | 3.57% |
| | 投資証券 | 1 銘柄 | — | 0.97% | 0.03% |
| オフショア元 | 株式 | 439 銘柄 | 100.00% | — | 5.65% |
| サウジアラビアリアル | 株式 | 37 銘柄 | 100.00% | — | 4.21% |
| トルコリラ | 株式 | 12 銘柄 | 100.00% | — | 0.31% |
| ユーロ | 株式 | 9 銘柄 | 100.00% | — | 0.27% |
| カタールリアル | 株式 | 12 銘柄 | 100.00% | — | 1.04% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

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)

[令和4年6月27日現在]

| | |
|-------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 704,504,055 |
| 株式 | 30,233,256,110 |
| 投資証券 | 389,934,700 |
| 未収配当金 | 103,745,353 |
| 前払金 | 24,500,000 |
| 差入委託証拠金 | 22,500,000 |
| 流動資産合計 | 31,478,440,218 |
| 資産合計 | 31,478,440,218 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 20,888,750 |
| 未払金 | 365,022,450 |
| 未払利息 | 871 |
| 流動負債合計 | 385,912,071 |
| 負債合計 | 385,912,071 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 24,268,433,100 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 6,824,095,047 |
| 元本等合計 | 31,092,528,147 |
| 純資産合計 | 31,092,528,147 |
| 負債純資産合計 | 31,478,440,218 |

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)

| | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|------------------------------------|---------------------|
| 1. 期首 | 令和 3 年 6 月 26 日 |
| 期首元本額 | 10,192,100,461 円 |
| 期中追加設定元本額 | 33,479,965,808 円 |
| 期中一部解約元本額 | 19,403,633,169 円 |
| 元本の内訳※ | |
| MAX I S 全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信 | 662,067,588 円 |
| eMAX I S S l i m 全世界株式 (オール・カントリー) | 23,586,575,894 円 |
| つみたて全世界株式 | 19,789,618 円 |
| 合計 | 24,268,433,100 円 |
| 2. 受益権の総数 | 24,268,433,100 口 |

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 令和 3 年 6 月 26 日 至 令和 4 年 6 月 27 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。 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、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|---------------------|------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |

| | |
|----------------------------|---|
| 額 | |
| 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 | [令和 4 年 6 月 27 日現在] | |
|------|---------------------|-------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額 (円) | |
| 株式 | | 31,468,888 |
| 投資証券 | | △11,390,875 |
| 合計 | | 20,078,013 |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 6 月 27 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 | 490,750,000 | — | 469,875,000 | △20,875,000 |
| 合計 | | 490,750,000 | — | 469,875,000 | △20,875,000 |

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| | [令和 4 年 6 月 27 日現在] |
|--------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.2812円 |
| (1万口当たり純資産額) | (12,812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 | 76,500 | 1,496.00 | 114,444,000 | |
| 1801 | 大成建設 | 14,000 | 4,130.00 | 57,820,000 | |
| 1802 | 大林組 | 47,800 | 962.00 | 45,983,600 | |
| 1803 | 清水建設 | 40,600 | 731.00 | 29,678,600 | |
| 1812 | 鹿島建設 | 31,100 | 1,494.00 | 46,463,400 | |
| 1878 | 大東建託 | 4,600 | 11,450.00 | 52,670,000 | |
| 1925 | 大和ハウス工業 | 44,100 | 3,122.00 | 137,680,200 | |
| 1928 | 積水ハウス | 45,300 | 2,341.00 | 106,047,300 | |
| 2002 | 日清製粉グループ本社 | 14,600 | 1,576.00 | 23,009,600 | |
| 2267 | ヤクルト本社 | 9,400 | 7,680.00 | 72,192,000 | |
| 2269 | 明治ホールディングス | 8,400 | 6,590.00 | 55,356,000 | |
| 2502 | アサヒグループホールディングス | 33,600 | 4,493.00 | 150,964,800 | |
| 2503 | キリンホールディングス | 60,500 | 2,172.00 | 131,406,000 | |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル | 10,200 | 5,140.00 | 52,428,000 | |
| 2593 | 伊藤園 | 3,900 | 5,590.00 | 21,801,000 | |
| 2801 | キッコーマン | 10,700 | 7,080.00 | 75,756,000 | |
| 2802 | 味の素 | 34,400 | 3,270.00 | 112,488,000 | |
| 2897 | 日清食品ホールディングス | 4,600 | 9,060.00 | 41,676,000 | |
| 2914 | 日本たばこ産業 | 88,300 | 2,416.00 | 213,332,800 | |
| 3402 | 東レ | 102,100 | 741.80 | 75,737,780 | |
| 3861 | 王子ホールディングス | 59,700 | 588.00 | 35,103,600 | |
| 3407 | 旭化成 | 92,300 | 1,055.50 | 97,422,650 | |
| 4005 | 住友化学 | 109,600 | 535.00 | 58,636,000 | |
| 4021 | 日産化学 | 9,500 | 6,340.00 | 60,230,000 | |
| 4042 | 東ソー | 19,100 | 1,713.00 | 32,718,300 | |
| 4063 | 信越化学工業 | 27,600 | 15,700.00 | 433,320,000 | |
| 4091 | 日本酸素ホールディングス | 12,700 | 2,251.00 | 28,587,700 | |
| 4183 | 三井化学 | 13,600 | 2,947.00 | 40,079,200 | |
| 4185 | J S R | 13,300 | 3,620.00 | 48,146,000 | |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 94,200 | 751.90 | 70,828,980 | |
| 4204 | 積水化学工業 | 27,800 | 1,884.00 | 52,375,200 | |

| | | | | | |
|------|-------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 4452 | 花王 | 35,000 | 5,583.00 | 195,405,000 | |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス | 61,100 | 1,060.00 | 64,766,000 | |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス | 26,500 | 7,299.00 | 193,423,500 | |
| 4911 | 資生堂 | 29,400 | 5,401.00 | 158,789,400 | |
| 4922 | コーセー | 2,500 | 12,170.00 | 30,425,000 | |
| 4967 | 小林製薬 | 3,900 | 8,430.00 | 32,877,000 | |
| 6988 | 日東電工 | 10,500 | 9,100.00 | 95,550,000 | |
| 8113 | ユニ・チャーム | 29,700 | 4,647.00 | 138,015,900 | |
| 4151 | 協和キリン | 19,900 | 3,080.00 | 61,292,000 | |
| 4502 | 武田薬品工業 | 110,600 | 3,776.00 | 417,625,600 | |
| 4503 | アステラス製薬 | 137,000 | 2,163.00 | 296,331,000 | |
| 4507 | 塩野義製薬 | 19,500 | 6,758.00 | 131,781,000 | |
| 4516 | 日本新薬 | 3,600 | 8,000.00 | 28,800,000 | |
| 4519 | 中外製薬 | 49,400 | 3,576.00 | 176,654,400 | |
| 4523 | エーザイ | 18,600 | 5,620.00 | 104,532,000 | |
| 4528 | 小野薬品工業 | 27,200 | 3,315.00 | 90,168,000 | |
| 4568 | 第一三共 | 129,000 | 3,323.00 | 428,667,000 | |
| 4578 | 大塚ホールディングス | 28,700 | 4,797.00 | 137,673,900 | |
| 5019 | 出光興産 | 15,300 | 3,210.00 | 49,113,000 | |
| 5020 | E N E O Sホールディングス | 225,800 | 508.20 | 114,751,560 | |
| 5108 | ブリヂストン | 42,000 | 5,163.00 | 216,846,000 | |
| 5201 | A G C | 14,200 | 4,990.00 | 70,858,000 | |
| 5332 | T O T O | 10,400 | 4,580.00 | 47,632,000 | |
| 5333 | 日本碍子 | 17,500 | 1,853.00 | 32,427,500 | |
| 5401 | 日本製鉄 | 59,400 | 1,907.00 | 113,275,800 | |
| 5411 | J F Eホールディングス | 36,200 | 1,433.00 | 51,874,600 | |
| 5486 | 日立金属 | 15,800 | 2,065.00 | 32,627,000 | |
| 5713 | 住友金属鉱山 | 18,200 | 4,326.00 | 78,733,200 | |
| 5802 | 住友電気工業 | 52,600 | 1,518.00 | 79,846,800 | |
| 3436 | S U M C O | 25,800 | 1,891.00 | 48,787,800 | |
| 5938 | L I X I L | 21,900 | 2,567.00 | 56,217,300 | |
| 6146 | ディスコ | 2,100 | 32,950.00 | 69,195,000 | |
| 6273 | S M C | 4,200 | 62,570.00 | 262,794,000 | |
| 6301 | 小松製作所 | 68,000 | 2,973.00 | 202,164,000 | |
| 6305 | 日立建機 | 7,900 | 2,963.00 | 23,407,700 | |
| 6326 | クボタ | 75,100 | 2,090.00 | 156,959,000 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|---------|-----------|---------------|--|
| 6367 | ダイキン工業 | 18,300 | 21,850.00 | 399,855,000 | |
| 6370 | 栗田工業 | 7,700 | 4,915.00 | 37,845,500 | |
| 6383 | ダイフク | 7,500 | 7,840.00 | 58,800,000 | |
| 6465 | ホシザキ | 4,000 | 8,200.00 | 32,800,000 | |
| 6586 | マキタ | 16,500 | 3,454.00 | 56,991,000 | |
| 7011 | 三菱重工業 | 23,600 | 4,769.00 | 112,548,400 | |
| 4062 | イビデン | 8,300 | 4,005.00 | 33,241,500 | |
| 6448 | ブラザー工業 | 17,400 | 2,403.00 | 41,812,200 | |
| 6479 | ミネベアミツミ | 26,700 | 2,408.00 | 64,293,600 | |
| 6501 | 日立製作所 | 71,300 | 6,597.00 | 470,366,100 | |
| 6502 | 東芝 | 28,700 | 5,707.00 | 163,790,900 | |
| 6503 | 三菱電機 | 142,200 | 1,474.50 | 209,673,900 | |
| 6504 | 富士電機 | 9,300 | 5,740.00 | 53,382,000 | |
| 6506 | 安川電機 | 17,700 | 4,510.00 | 79,827,000 | |
| 6594 | 日本電産 | 32,900 | 8,640.00 | 284,256,000 | |
| 6645 | オムロン | 13,700 | 7,105.00 | 97,338,500 | |
| 6701 | 日本電気 | 18,100 | 5,250.00 | 95,025,000 | |
| 6702 | 富士通 | 14,500 | 17,125.00 | 248,312,500 | |
| 6723 | ルネサスエレクトロニクス | 85,800 | 1,325.00 | 113,685,000 | |
| 6724 | セイコーエプソン | 20,600 | 2,012.00 | 41,447,200 | |
| 6752 | パナソニック ホールディングス | 162,500 | 1,117.00 | 181,512,500 | |
| 6753 | シャープ | 18,000 | 1,062.00 | 19,116,000 | |
| 6758 | ソニーグループ | 92,800 | 11,505.00 | 1,067,664,000 | |
| 6762 | TDK | 28,600 | 4,360.00 | 124,696,000 | |
| 6806 | ヒロセ電機 | 2,200 | 17,670.00 | 38,874,000 | |
| 6841 | 横河電機 | 16,800 | 2,212.00 | 37,161,600 | |
| 6845 | アズビル | 8,500 | 3,565.00 | 30,302,500 | |
| 6857 | アドバンテスト | 13,900 | 7,670.00 | 106,613,000 | |
| 6861 | キーエンス | 14,300 | 47,360.00 | 677,248,000 | |
| 6869 | シスメックス | 12,300 | 8,188.00 | 100,712,400 | |
| 6920 | レーザーテック | 5,600 | 16,805.00 | 94,108,000 | |
| 6954 | ファナック | 14,100 | 22,180.00 | 312,738,000 | |
| 6963 | ローム | 6,400 | 10,190.00 | 65,216,000 | |
| 6965 | 浜松ホトニクス | 10,300 | 5,540.00 | 57,062,000 | |
| 6971 | 京セラ | 23,600 | 7,378.00 | 174,120,800 | |
| 6981 | 村田製作所 | 42,300 | 7,939.00 | 335,819,700 | |

| | | | | | |
|------|-----------------|---------|-----------|---------------|--|
| 7276 | 小糸製作所 | 7,700 | 4,340.00 | 33,418,000 | |
| 7751 | キヤノン | 73,600 | 3,199.00 | 235,446,400 | |
| 7752 | リコー | 42,200 | 1,067.00 | 45,027,400 | |
| 8035 | 東京エレクトロン | 11,000 | 47,770.00 | 525,470,000 | |
| 6201 | 豊田自動織機 | 10,800 | 8,320.00 | 89,856,000 | |
| 6902 | デンソー | 31,900 | 7,350.00 | 234,465,000 | |
| 7201 | 日産自動車 | 170,800 | 549.00 | 93,769,200 | |
| 7202 | いすゞ自動車 | 42,900 | 1,565.00 | 67,138,500 | |
| 7203 | トヨタ自動車 | 780,400 | 2,121.50 | 1,655,618,600 | |
| 7259 | アイシン | 10,800 | 4,255.00 | 45,954,000 | |
| 7261 | マツダ | 41,800 | 1,115.00 | 46,607,000 | |
| 7267 | 本田技研工業 | 120,000 | 3,304.00 | 396,480,000 | |
| 7269 | スズキ | 27,100 | 4,222.00 | 114,416,200 | |
| 7270 | SUBARU | 45,300 | 2,445.50 | 110,781,150 | |
| 7272 | ヤマハ発動機 | 21,900 | 2,636.00 | 57,728,400 | |
| 7309 | シマノ | 5,400 | 23,380.00 | 126,252,000 | |
| 4543 | テルモ | 47,500 | 4,126.00 | 195,985,000 | |
| 7701 | 島津製作所 | 17,400 | 4,395.00 | 76,473,000 | |
| 7733 | オリンパス | 90,800 | 2,700.00 | 245,160,000 | |
| 7741 | HOYA | 27,200 | 12,070.00 | 328,304,000 | |
| 7747 | 朝日インテック | 16,000 | 2,047.00 | 32,752,000 | |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス | 14,700 | 9,602.00 | 141,149,400 | |
| 7911 | 凸版印刷 | 19,300 | 2,283.00 | 44,061,900 | |
| 7912 | 大日本印刷 | 16,300 | 2,927.00 | 47,710,100 | |
| 7951 | ヤマハ | 10,300 | 5,520.00 | 56,856,000 | |
| 7974 | 任天堂 | 8,100 | 58,380.00 | 472,878,000 | |
| 9501 | 東京電力ホールディングス | 112,300 | 513.00 | 57,609,900 | |
| 9502 | 中部電力 | 47,400 | 1,352.00 | 64,084,800 | |
| 9503 | 関西電力 | 51,800 | 1,335.00 | 69,153,000 | |
| 9531 | 東京瓦斯 | 29,200 | 2,679.00 | 78,226,800 | |
| 9532 | 大阪瓦斯 | 27,600 | 2,518.00 | 69,496,800 | |
| 9001 | 東武鉄道 | 13,900 | 3,005.00 | 41,769,500 | |
| 9005 | 東急 | 39,100 | 1,557.00 | 60,878,700 | |
| 9007 | 小田急電鉄 | 21,700 | 1,769.00 | 38,387,300 | |
| 9008 | 京王電鉄 | 7,600 | 4,575.00 | 34,770,000 | |
| 9009 | 京成電鉄 | 10,200 | 3,575.00 | 36,465,000 | |

| | | | | | |
|------|-------------------------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 9020 | 東日本旅客鉄道 | 22,200 | 6,787.00 | 150,671,400 | |
| 9021 | 西日本旅客鉄道 | 16,200 | 4,948.00 | 80,157,600 | |
| 9022 | 東海旅客鉄道 | 10,600 | 15,540.00 | 164,724,000 | |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス | 12,600 | 4,105.00 | 51,723,000 | |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス | 16,800 | 3,625.00 | 60,900,000 | |
| 9064 | ヤマトホールディングス | 21,400 | 2,209.00 | 47,272,600 | |
| 9143 | S Gホールディングス | 21,200 | 2,247.00 | 47,636,400 | |
| 9147 | N I P P O N E X P R E S Sホール ディン | 5,700 | 7,630.00 | 43,491,000 | |
| 9101 | 日本郵船 | 11,900 | 9,630.00 | 114,597,000 | |
| 9104 | 商船三井 | 25,300 | 3,185.00 | 80,580,500 | |
| 9201 | 日本航空 | 10,600 | 2,386.00 | 25,291,600 | |
| 9202 | A N Aホールディングス | 11,800 | 2,500.00 | 29,500,000 | |
| 3626 | T I S | 16,600 | 3,460.00 | 57,436,000 | |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス | 4,300 | 4,370.00 | 18,791,000 | |
| 3659 | ネクソン | 36,400 | 2,863.00 | 104,213,200 | |
| 3769 | G M Oペイメントゲートウェイ | 3,100 | 9,490.00 | 29,419,000 | |
| 4307 | 野村総合研究所 | 24,700 | 3,615.00 | 89,290,500 | |
| 4684 | オービック | 5,100 | 19,530.00 | 99,603,000 | |
| 4689 | Zホールディングス | 195,600 | 416.80 | 81,526,080 | |
| 4704 | トレンドマイクロ | 9,800 | 6,680.00 | 65,464,000 | |
| 4716 | 日本オラクル | 2,800 | 7,820.00 | 21,896,000 | |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ | 7,100 | 3,300.00 | 23,430,000 | |
| 4768 | 大塚商会 | 8,400 | 4,130.00 | 34,692,000 | |
| 9432 | 日本電信電話 | 88,000 | 3,888.00 | 342,144,000 | |
| 9433 | K D D I | 118,700 | 4,338.00 | 514,920,600 | |
| 9434 | ソフトバンク | 211,400 | 1,518.50 | 321,010,900 | |
| 9435 | 光通信 | 1,500 | 14,360.00 | 21,540,000 | |
| 9602 | 東宝 | 8,200 | 4,790.00 | 39,278,000 | |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 46,400 | 1,921.00 | 89,134,400 | |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディ ングス | 6,300 | 5,960.00 | 37,548,000 | |
| 9697 | カプコン | 13,000 | 3,290.00 | 42,770,000 | |
| 9719 | S C S K | 11,500 | 2,271.00 | 26,116,500 | |
| 9766 | コナミホールディングス | 6,900 | 7,700.00 | 53,130,000 | |
| 9984 | ソフトバンクグループ | 88,800 | 5,418.00 | 481,118,400 | |
| 3038 | 神戸物産 | 11,100 | 3,355.00 | 37,240,500 | |

| | | | | | |
|------|----------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 8001 | 伊藤忠商事 | 87,500 | 3,661.00 | 320,337,500 | |
| 8002 | 丸紅 | 115,100 | 1,231.50 | 141,745,650 | |
| 8015 | 豊田通商 | 15,600 | 4,545.00 | 70,902,000 | |
| 8031 | 三井物産 | 102,700 | 2,980.00 | 306,046,000 | |
| 8053 | 住友商事 | 82,900 | 1,827.00 | 151,458,300 | |
| 8058 | 三菱商事 | 92,900 | 4,023.00 | 373,736,700 | |
| 9962 | ミスミグループ本社 | 20,900 | 2,946.00 | 61,571,400 | |
| 2702 | 日本マクドナルドホールディングス | 6,400 | 5,060.00 | 32,384,000 | |
| 3064 | M o n o t a R O | 18,400 | 2,006.00 | 36,910,400 | |
| 3092 | Z O Z O | 9,200 | 2,457.00 | 22,604,400 | |
| 3141 | ウエルシアホールディングス | 6,900 | 2,680.00 | 18,492,000 | |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス | 55,400 | 5,364.00 | 297,165,600 | |
| 7532 | パン・パシフィック・インターナショナルホ | 28,000 | 2,089.00 | 58,492,000 | |
| 8267 | イオン | 48,100 | 2,309.50 | 111,086,950 | |
| 9843 | ニトリホールディングス | 5,900 | 12,730.00 | 75,107,000 | |
| 9983 | ファーストリテイリング | 4,300 | 71,490.00 | 307,407,000 | |
| 7182 | ゆうちょ銀行 | 30,400 | 1,042.00 | 31,676,800 | |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 80,100 | 461.00 | 36,926,100 | |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 879,700 | 735.80 | 647,283,260 | |
| 8308 | りそなホールディングス | 159,000 | 508.70 | 80,883,300 | |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 24,900 | 4,184.00 | 104,181,600 | |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 96,100 | 4,071.00 | 391,223,100 | |
| 8331 | 千葉銀行 | 39,000 | 726.00 | 28,314,000 | |
| 8355 | 静岡銀行 | 32,800 | 806.00 | 26,436,800 | |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 177,500 | 1,528.50 | 271,308,750 | |
| 8473 | S B Iホールディングス | 18,000 | 2,693.00 | 48,474,000 | |
| 8601 | 大和証券グループ本社 | 100,000 | 613.10 | 61,310,000 | |
| 8604 | 野村ホールディングス | 214,200 | 507.20 | 108,642,240 | |
| 7181 | かんぽ生命保険 | 14,700 | 2,160.00 | 31,752,000 | |
| 8630 | S O M P Oホールディングス | 23,000 | 5,890.00 | 135,470,000 | |
| 8725 | MS&ADインシュアランスグループホール | 32,800 | 4,126.00 | 135,332,800 | |
| 8750 | 第一生命ホールディングス | 74,000 | 2,519.50 | 186,443,000 | |
| 8766 | 東京海上ホールディングス | 46,200 | 8,006.00 | 369,877,200 | |
| 8795 | T & Dホールディングス | 39,000 | 1,589.00 | 61,971,000 | |

| | | | | | |
|------|-------------------|------------|-----------|----------------|--|
| 8591 | オリックス | 88,000 | 2,340.00 | 205,920,000 | |
| 8593 | 三菱HCキャピタル | 48,600 | 633.00 | 30,763,800 | |
| 8697 | 日本取引所グループ | 37,000 | 2,090.50 | 77,348,500 | |
| 3003 | ヒューリック | 28,300 | 1,067.00 | 30,196,100 | |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス | 8,700 | 3,210.00 | 27,927,000 | |
| 3288 | オープンハウスグループ | 6,000 | 5,530.00 | 33,180,000 | |
| 3291 | 飯田グループホールディングス | 10,800 | 2,077.00 | 22,431,600 | |
| 8801 | 三井不動産 | 67,100 | 2,891.00 | 193,986,100 | |
| 8802 | 三菱地所 | 87,000 | 1,955.00 | 170,085,000 | |
| 8830 | 住友不動産 | 22,800 | 3,563.00 | 81,236,400 | |
| 2127 | 日本M&Aセンターホールディングス | 22,300 | 1,423.00 | 31,732,900 | |
| 2181 | パーソルホールディングス | 13,100 | 2,425.00 | 31,767,500 | |
| 2371 | カカクコム | 9,800 | 2,210.00 | 21,658,000 | |
| 2413 | エムスリー | 32,500 | 4,004.00 | 130,130,000 | |
| 2433 | 博報堂DYホールディングス | 17,200 | 1,241.00 | 21,345,200 | |
| 4324 | 電通グループ | 15,900 | 4,275.00 | 67,972,500 | |
| 4661 | オリエンタルランド | 14,700 | 18,445.00 | 271,141,500 | |
| 4732 | ユー・エス・エス | 16,100 | 2,358.00 | 37,963,800 | |
| 4751 | サイバーエージェント | 31,600 | 1,390.00 | 43,924,000 | |
| 4755 | 楽天グループ | 64,000 | 642.00 | 41,088,000 | |
| 6098 | リクルートホールディングス | 106,100 | 4,112.00 | 436,283,200 | |
| 6178 | 日本郵政 | 180,200 | 952.30 | 171,604,460 | |
| 9735 | セコム | 15,500 | 8,312.00 | 128,836,000 | |
| | 合 計 | 10,584,500 | | 30,233,256,110 | |

(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 | G L P 投資法人 | 314 | 50,930,800 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 157 | 51,888,500 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 312 | 52,384,800 | |
| | 日本ビルファンド投資法人 | 113 | 77,066,000 | |
| | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 92 | 55,660,000 | |
| | 日本都市ファンド投資法人 | 514 | 53,404,600 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 162 | 48,600,000 | |
| | 合 計 | 1,664 | 389,934,700 | |

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。

【中間財務諸表】

1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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、当中間計算期間(令和4年6月28日から令和4年12月27日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

令和5年3月1日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて全世界株式の令和4年6月28日から令和4年12月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、つみたて全世界株式の令和4年12月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和4年6月28日から令和4年12月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表

示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

【つみたて全世界株式】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第3期 [令和4年6月27日現在] | 第4期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在] |
|-----------------|------------------------|--------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 2,056,021 | 1,674,548 |
| 親投資信託受益証券 | 469,401,641 | 818,096,226 |
| 未収入金 | 1,633,470 | 4,014,823 |
| 流動資産合計 | 473,091,132 | 823,785,597 |
| 資産合計 | 473,091,132 | 823,785,597 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 969,333 | 822,479 |
| 未払受託者報酬 | 38,492 | 72,983 |
| 未払委託者報酬 | 346,357 | 656,800 |
| 未払利息 | 2 | 3 |
| その他未払費用 | 5,910 | 11,250 |
| 流動負債合計 | 1,360,094 | 1,563,515 |
| 負債合計 | 1,360,094 | 1,563,515 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 318,852,666 | 563,212,158 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金(△) | 152,878,372 | 259,009,924 |
| (分配準備積立金) | 14,958,299 | 14,328,879 |
| 元本等合計 | 471,731,038 | 822,222,082 |
| 純資産合計 | 471,731,038 | 822,222,082 |
| 負債純資産合計 | 473,091,132 | 823,785,597 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第3期中間計算期間 自 令和3年6月26日 至 令和3年12月25日 | 第4期中間計算期間 自 令和4年6月28日 至 令和4年12月27日 |
|-----------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 14,007,563 | △21,209,625 |
| 営業収益合計 | 14,007,563 | △21,209,625 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 66 | 629 |
| 受託者報酬 | 17,308 | 72,983 |
| 委託者報酬 | 155,705 | 656,800 |
| その他費用 | 2,619 | 11,250 |
| 営業費用合計 | 175,698 | 741,662 |

| | | |
|--|------------|-------------|
| 営業利益又は営業損失 (△) | 13,831,865 | △21,951,287 |
| 経常利益又は経常損失 (△) | 13,831,865 | △21,951,287 |
| 中間純利益又は中間純損失 (△) | 13,831,865 | △21,951,287 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△) | 226,622 | 707,337 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 (△) | 28,512,587 | 152,878,372 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 46,748,906 | 137,861,100 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 46,748,906 | 137,861,100 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,011,319 | 9,070,924 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,011,319 | 9,070,924 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金 (△) | 84,855,417 | 259,009,924 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 |
| 2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項 | ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年6月25日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当中間計算期間は令和4年6月28日から令和4年12月27日までとなっております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第3期 [令和4年6月27日現在] | 第4期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在] |
|-----------|----------------------|------------------------------|
| 1. 期首元本額 | 69,732,055 円 | 318,852,666 円 |
| 期中追加設定元本額 | 277,554,459 円 | 262,849,663 円 |
| 期中一部解約元本額 | 28,433,848 円 | 18,490,171 円 |
| 2. 受益権の総数 | 318,852,666 口 | 563,212,158 口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第3期中間計算期間 自 令和3年6月26日 至 令和3年12月25日 | 第4期中間計算期間 自 令和4年6月28日 至 令和4年12月27日 |
|--|--|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 第3期 [令和4年6月27日現在] | 第4期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在] |
|------------------------|--|---|
| 1. 中間貸借対照表計上額、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ぬ。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 | (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 |

| | | |
|----------------------------|--|----|
| | 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報）

| | 第3期 [令和4年6月27日現在] | 第4期中間計算期間末 [令和4年12月27日現在] |
|--------------|----------------------|------------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,4795円 | 1,4599円 |
| (1万口当たり純資産額) | (14,795円) | (14,599円) |

（参考）

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

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和4年12月27日現在]

| 資産の部 | |
|----------|-------------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 39,198,822,535 |
| コール・ローン | 2,289,507,289 |
| 株式 | 1,830,841,709,474 |
| 投資証券 | 42,666,920,680 |
| 派生商品評価勘定 | 38,612,534 |
| 未収入金 | 216,743,919 |
| 未収配当金 | 1,779,587,377 |
| 差入委託証拠金 | 11,256,903,401 |
| 流動資産合計 | 1,928,288,807,209 |
| 資産合計 | 1,928,288,807,209 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,462,191,353 |

| | |
|-------------|-------------------|
| 未払金 | 53,987,898 |
| 未払解約金 | 3,986,677,727 |
| 未払利息 | 4,391 |
| 流動負債合計 | 5,502,861,369 |
| 負債合計 | 5,502,861,369 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 430,258,794,465 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 1,492,527,151,375 |
| 元本等合計 | 1,922,785,945,840 |
| 純資産合計 | 1,922,785,945,840 |
| 負債純資産合計 | 1,928,288,807,209 |

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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | [令和4年12月27日現在] |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 令和4年6月28日 |
| 期首元本額 | 357,084,936,417円 |
| 期中追加設定元本額 | 121,754,858,756円 |
| 期中一部解約元本額 | 48,581,000,708円 |
| 元本の内訳※ | |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型) | 219,271,897円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型) | 975,617,572円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型) | 865,350,463円 |
| MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信 | 3,052,886,462円 |
| MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信 | 3,697,309,814円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金) | 1,712,745,535円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金) | 9,776,992,170円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金) | 10,312,809,608円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 54,569,264円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 141,750,130円 |
| ファンド・マネジャー(海外株式) | 781,818円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス | 13,423,877,438円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,107,686,118円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 73,047,608円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 1,735,751,450円 |
| コアバランス | 170,419円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金) | 211,453,683円 |

| | |
|---|-----------------------------------|
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金) | 250,175,734円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金) | 224,841,619円 |
| eMAXIS Slim 先進国株式インデックス 海外株式セレクション (ラップ向け) | 82,532,319,142円 2,296,545,006円 |
| eMAXIS Slim バランス (8資産均等型) | 4,623,309,939円 |
| つみたて先進国株式 | 20,365,549,596円 |
| つみたて8資産均等バランス | 2,137,870,459円 |
| つみたて4資産均等バランス | 706,871,835円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,767,699円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,021,389円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 4,244,355円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金) | 179,268,762円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金) | 185,594,066円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金) | 116,002,568円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式15) | 54,861,970円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式40) | 409,987,547円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式65) | 885,071,978円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本) | 36,968,390,962円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 451,386,443円 |
| 三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式) | 2,927,461,382円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー) | 143,527,834,761円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金) | 102,767,443円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式25) | 35,249,512円 |
| つみたて全世界株式 | 152,095,052円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金) | 39,036,579円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国株式 | 3,554,009,470円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス (株式80) | 12,511,354円 |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け) | 2,745,364,302円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド | 13,950,836円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド | 28,271,708,491円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 4,260,240,947円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型) | 164,522,901円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型) | 365,403,846円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 57,579,421円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN) | 152,895,140円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型) | 130,618,091円 |
| eMAXIS バランス (4資産均等型) | 319,711,531円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 90,548,068円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 106,981,531円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 396,200,645円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 310,009,625円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 595,091,745円 |
| 三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定) | 1,690,118,525円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定) | 14,536円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定) | 9,084,886円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 4,480,190,159円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限 | 52,835,905円 |

| | |
|--|-------------------|
| 定) | |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 844,079,324 円 |
| MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 10,657,377,316 円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定) | 606,237 円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 666,208,776 円 |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定) | 5,544,286,048 円 |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 9,208,601 円 |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定) | 64,872,362 円 |
| MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付) | 462,102,476 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) | 153,378,063 円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 375,225,753 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 52,469,394 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) | 315,910,445 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) | 42,948,070 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) | 2,283,462,618 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) | 373,741,168 円 |
| MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付) | 14,587,348 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) | 116,379 円 |
| 外国株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定) | 2,338,432,651 円 |
| 海外株式インデックスファンドS | 1,051,159,003 円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド | 2,630,736,880 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA | 852,513 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA | 2,448,175 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA | 817,342 円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA | 2,116,641 円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA | 30,729,995 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定) | 1,188,985 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 10,421,497 円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定) | 1,684,444 円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 15,736,915 円 |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド | 6,597,048,049 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) | 102,783,950 円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 420,139,771 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) | 440,203,031 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) | 428,525,043 円 |
| 合計 | 430,258,794,465 円 |
| 2. 受益権の総数 | 430,258,794,465 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)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和 4 年 12 月 27 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)
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 12 月 27 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 | 50,708,872,249 | — | 49,298,374,400 | △1,410,497,849 |
| | 合計 | 50,708,872,249 | — | 49,298,374,400 | △1,410,497,849 |

(注) 時価の算定方法

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[令和 4 年 12 月 27 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 | | | | |
| | カナダドル | 165,236,600 | — | 167,003,580 | 1,766,980 |
| | オーストラリアドル | 96,947,776 | — | 98,400,633 | 1,452,857 |
| | イギリスポンド | 215,828,548 | — | 217,513,275 | 1,684,727 |
| | 香港ドル | 41,154,742 | — | 41,254,322 | 99,580 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカドル | 1,636,551,000 | — | 1,647,954,903 | △11,403,903 |

| | | | |
|------------|---------------|---------------|-------------|
| カナダドル | 89,709,312 | 90,759,715 | △1,050,403 |
| オーストラリアドル | 59,121,340 | 59,968,497 | △847,157 |
| イギリスポンド | 164,523,504 | 166,012,886 | △1,489,382 |
| スイスフラン | 72,230,790 | 72,902,715 | △671,925 |
| 香港ドル | 16,186,295 | 16,298,794 | △112,499 |
| スウェーデンクローネ | 30,011,190 | 30,350,047 | △338,857 |
| デンマーククローネ | 19,206,097 | 19,402,062 | △195,965 |
| ユーロ | 184,867,688 | 186,842,711 | △1,975,023 |
| 合計 | 2,791,574,882 | 2,814,664,140 | △13,080,970 |

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報)

| | [令和4年12月27日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 4.4689円 |
| (1万口当たり純資産額) | (44,689円) |

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)

[令和4年12月27日現在]

| | |
|----------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 11,114,267,187 |
| コール・ローン | 1,387,109,681 |
| 株式 | 346,405,814,455 |
| 投資証券 | 426,349,811 |
| 派生商品評価勘定 | 8,559,466 |
| 未収入金 | 503,326 |
| 未収配当金 | 459,117,623 |
| 差入委託証拠金 | 2,890,700,013 |
| 流動資産合計 | 362,692,421,562 |
| 資産合計 | 362,692,421,562 |

| 負債の部 | |
|-------------|-----------------|
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 146,521,626 |
| 未払解約金 | 150,865,781 |
| 未払利息 | 2,660 |
| 流動負債合計 | 297,390,067 |
| 負債合計 | 297,390,067 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 123,604,720,296 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金(△) | 238,790,311,199 |
| 元本等合計 | 362,395,031,495 |
| 純資産合計 | 362,395,031,495 |
| 負債純資産合計 | 362,692,421,562 |

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、「追加情報」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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | [令和4年12月27日現在] |
|----------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 令和4年6月28日 |
| 期首元本額 | 103,718,140,955円 |
| 期中追加設定元本額 | 33,698,099,230円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,811,519,889円 |
| 元本の内訳※ | |
| MAXIS全世界株式(オール・カントリー)上場投信 | 765,576,866円 |
| eMAXIS新興国株式インデックス | 11,032,636,981円 |
| eMAXISバランス(8資産均等型) | 1,767,263,716円 |
| eMAXISバランス(波乗り型) | 244,070,981円 |
| 三菱UFJプライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 543,826,269円 |
| コアバランス | 66,637円 |
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 7,119,132,293円 |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス | 31,870,064,795円 |
| つみたて新興国株式 | 6,439,467,052円 |
| つみたて8資産均等バランス | 3,282,128,859円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 788,392円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,945,213円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 5,758,014円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本) | 7,654,603,392円 |

| | |
|-----------------------------------|-------------------|
| eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型) | 686,276,703 円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カンントリー) | 29,610,540,789 円 |
| 新興国株式インデックス・オープン (ラップ向け) | 1,777,111,752 円 |
| つみたて全世界株式 | 31,492,827 円 |
| ラップ向けインデックスf 新興国株式 | 729,965,515 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 38,745,046 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型) | 378,133,700 円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型) | 331,353,943 円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 15,150,505,366 円 |
| 新興国株式インデックスオープン | 486,291,225 円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | 882,098,879 円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型) | 42,648,324 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー) | 40,950,892 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー) | 231,933,287 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 213,883,114 円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー) | 802,709,419 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) | 1,134,540,407 円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 16,438,965 円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 61,805,863 円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 60,731,444 円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 60,437,882 円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 54,376,109 円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定) | 54,419,385 円 |
| 合計 | 123,604,720,296 円 |
| 2. 受益権の総数 | 123,604,720,296 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)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和4年12月27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 | <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 12 月 27 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 | 15,650,481,655 | — | 15,504,289,395 | △146,192,260 |
| 合計 | | 15,650,481,655 | — | 15,504,289,395 | △146,192,260 |

(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ではありません。

通貨関連

[令和 4 年 12 月 27 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 | 1,185,096,611 | — | 1,193,359,618 | 8,263,007 |
| | 売建 オフショア元 | 109,016 | — | 110,020 | △1,004 |
| | サウジアラビア リヤル | 4,889,435 | — | 4,921,338 | △31,903 |
| 合計 | | 1,190,095,062 | — | 1,198,390,976 | 8,230,100 |

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

| | [令和 4 年 12 月 27 日現在] |
|--------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.9319円 |
| (1万口当たり純資産額) | (29,319円) |

(追加情報)

自 令和 4 年 6 月 28 日

至 令和 4 年 12 月 27 日

当ファンドは、ロシア株式（DR（預託証券）を含みます。以下、「当該株式」）を組み入れております。令和 4 年 2 月 24 日に発生したロシアのウクライナ侵攻による当ファンドへの影響は以下の通りです。

ロシアが、令和 4 年 2 月 24 日に首都キーウを含むウクライナ国内の複数の都市への軍事侵攻に踏み切った以降、期末日時点においてロシア軍とウクライナ軍の戦闘が続いております。

令和 4 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SWIFT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、令和 4 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引扱いを継続しております。令和 4 年 3 月 11 日時点の当ファンドにおける当該株式の保有割合は 0.55%です。

なお、令和 4 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。

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。

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)

[令和 4 年 12 月 27 日現在]

| | |
|-------------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,801,957,346 |
| 株式 | 43,126,839,990 |
| 投資証券 | 524,821,600 |
| 未収入金 | 28,097,747 |
| 未収配当金 | 1,430,080 |
| 前払金 | 15,520,000 |
| 差入委託証拠金 | 25,440,000 |
| 流動資産合計 | 46,524,106,763 |
| 資産合計 | 46,524,106,763 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 14,097,600 |
| 未払金 | 1,100,408,811 |
| 未払解約金 | 1,120,084,896 |
| 未払利息 | 5,374 |
| 流動負債合計 | 2,234,596,681 |
| 負債合計 | 2,234,596,681 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 33,993,988,411 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 10,295,521,671 |
| 元本等合計 | 44,289,510,082 |

| | |
|---------|----------------|
| 純資産合計 | 44,289,510,082 |
| 負債純資産合計 | 46,524,106,763 |

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。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | [令和 4 年 12 月 27 日現在] |
|------------------------------------|----------------------|
| 1. 期首 | 令和 4 年 6 月 28 日 |
| 期首元本額 | 24,268,433,100 円 |
| 期中追加設定元本額 | 32,655,888,970 円 |
| 期中一部解約元本額 | 22,930,333,659 円 |
| 元本の内訳※ | |
| MAX I S 全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信 | 859,466,244 円 |
| eMAX I S S l i m 全世界株式 (オール・カントリー) | 33,099,166,552 円 |
| つみたて全世界株式 | 35,355,615 円 |
| 合計 | 33,993,988,411 円 |
| 2. 受益権の総数 | 33,993,988,411 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)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | [令和 4 年 12 月 27 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)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[令和 4 年 12 月 27 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 | 623,520,000 | — | 609,440,000 | △14,080,000 |
| | 合計 | 623,520,000 | — | 609,440,000 | △14,080,000 |

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

| | [令和4年12月27日現在] |
|--------------|----------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.3029円 |
| (1万口当たり純資産額) | (13,029円) |

2【ファンドの現況】

【つみたて全世界株式】

【純資産額計算書】

令和4年12月30日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------------|--------------|
| I 資産総額 | 838,832,219 |
| II 負債総額 | 316,506 |
| III 純資産総額 (I - II) | 838,515,713 |
| IV 発行済口数 | 575,488,277口 |
| V 1口当たり純資産価額 (III/IV) | 1.4571 |
| (10,000口当たり) | (14,571) |

(参考)

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和4年12月30日現在

(単位：円)

| | |
|--------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 1,935,028,137,787 |
| II 負債総額 | 1,672,924,107 |
| III 純資産総額 (I - II) | 1,933,355,213,680 |
| IV 発行済口数 | 433,204,796,790口 |

| | |
|-------------------|----------|
| V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ） | 4.4629 |
| （10,000口当たり） | （44,629） |

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

令和4年12月30日現在

（単位：円）

| | |
|-------------------|------------------|
| I 資産総額 | 363,492,486,010 |
| II 負債総額 | 73,992,130 |
| III 純資産総額（I－II） | 363,418,493,880 |
| IV 発行済口数 | 124,287,299,242口 |
| V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.9240 |
| （10,000口当たり） | （29,240） |

日本株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和4年12月30日現在

（単位：円）

| | |
|-------------------|-----------------|
| I 資産総額 | 44,464,733,037 |
| II 負債総額 | 373,216,045 |
| III 純資産総額（I－II） | 44,091,516,992 |
| IV 発行済口数 | 34,154,564,899口 |
| V 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.2909 |
| （10,000口当たり） | （12,909） |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

- ①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認める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、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

2022年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・ 会社の意思決定機構

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

・ 投資運用の意思決定機構

① 投資環境見通しの策定

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

- ②運用戦略の決定
運用戦略委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。
- ③運用計画の決定
②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。
- ④ポートフォリオの構築
各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。
- ⑤投資行動のモニタリング1
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、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。
- ⑥投資行動のモニタリング2
運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、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、ファンド管理委員会および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、必要に応じて是正を指示します。
- ⑦ファンドに関係する法人等の管理
受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。
- ⑧運用・管理に関する監督
内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年12月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類 | 本数 (本) | 純資産総額 (百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託 | 875 | 21,763,425 |
| 追加型公社債投資信託 | 16 | 1,413,534 |
| 単位型株式投資信託 | 90 | 413,739 |
| 単位型公社債投資信託 | 51 | 119,277 |
| 合計 | 1,032 | 23,709,975 |

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

(2) 監査証明について

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

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

独立監査人の監査報告書

令和4年6月10日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青木裕晃

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤鉄也

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和4年12月2日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄 也

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

| | 第 36 期 (令和 3 年 3 月 31 日現在) | 第 37 期 (令和 4 年 3 月 31 日現在) |
|-----------|-------------------------------|-------------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 533,622 | 565,222 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 158,856 | 197,334 |
| 未払償還金 | 133,877 | 7,418 |
| 未払手数料 | ※2 5,200,810 | ※2 6,423,139 |
| その他未払金 | ※2 4,412,521 | ※2 4,565,457 |
| 未払費用 | ※2 4,755,909 | ※2 4,328,968 |
| 未払消費税等 | 752,617 | 1,112,923 |
| 未払法人税等 | 873,027 | 769,692 |
| 賞与引当金 | 933,381 | 942,287 |
| 役員賞与引当金 | 160,710 | 149,028 |
| その他 | 691,143 | 5,517 |
| 流動負債合計 | 18,606,476 | 19,066,990 |
| 固定負債 | | |
| 長期未払金 | 21,600 | 10,800 |
| 退職給付引当金 | 1,145,514 | 1,246,300 |
| 役員退職慰労引当金 | 117,938 | 117,938 |
| 時効後支払損引当金 | 245,426 | 250,214 |
| 固定負債合計 | 1,530,479 | 1,625,252 |
| 負債合計 | 20,136,956 | 20,692,243 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 3,572,096 | 3,572,096 |
| その他資本剰余金 | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計 | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 342,589 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | 26,951,289 | 29,000,498 |
| 利益剰余金合計 | 34,291,879 | 36,341,088 |
| 株主資本合計 | 81,024,723 | 83,073,932 |

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

| | 第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日) | | 第37期 (自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日) | |
|--------------|-------------------------------------|------------|-------------------------------------|------------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 170,807 | | 243,133 |
| 受取利息 | ※2 | 2,726 | ※2 | 7,408 |
| 投資有価証券償還益 | | 81,557 | | 1,089,101 |
| 収益分配金等時効完成分 | | 275,835 | | 137,485 |
| 受取賃貸料 | ※2 | 65,808 | ※2 | 65,808 |
| その他 | | 12,504 | | 36,211 |
| 営業外収益合計 | | 609,239 | | 1,579,148 |
| 営業外費用 | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | 95,946 | | 3,074 |
| 時効後支払損引当金繰入 | | 16,395 | | 16,548 |
| 事務過誤費 | | - | | 76,076 |
| 賃貸関連費用 | | 13,472 | | 15,780 |
| その他 | | 2,932 | | 7,585 |
| 営業外費用合計 | | 128,747 | | 119,066 |
| 経常利益 | | 13,368,595 | | 17,011,221 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 2,007,655 | | 605,706 |
| 特別利益合計 | | 2,007,655 | | 605,706 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 51,737 | | 28,188 |
| 投資有価証券評価損 | | 26,317 | | 36,558 |
| 固定資産除却損 | ※1 | 536 | ※1 | 13,094 |
| 特別損失合計 | | 78,591 | | 77,840 |
| 税引前当期純利益 | | 15,297,659 | | 17,539,087 |
| 法人税、住民税及び事業税 | ※2 | 4,755,427 | ※2 | 5,366,608 |
| 法人税等調整額 | | △19,122 | | 22,446 |
| 法人税等合計 | | 4,736,304 | | 5,389,054 |
| 当期純利益 | | 10,561,354 | | 12,150,032 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第37期（自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成 10 年 4 月 1 日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成 28 年 4 月 1 日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

| | |
|-------|----------|
| 建物 | 5 年～50 年 |
| 器具備品 | 2 年～20 年 |
| 投資不動産 | 3 年～47 年 |

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

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

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

(会計方針の変更)

(1) 収益認識に関する会計基準等の適用

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

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

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

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

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(2) 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

令和5年3月期の期首より適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

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

※2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

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

※2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 9,457,670 千円
- ② 1株当たり配当額 44,700 円
- ③ 基準日 令和2年3月31日
- ④ 効力発生日 令和2年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

令和3年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

令和4年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(リース取引関係)

(借主側)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第 36 期(令和 3 年 3 月 31 日現在)

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

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

(注 2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注 4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(令和3年3月31日現在)

(単位：千円)

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

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

(注2) 市場価格のない株式等

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

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期(令和4年3月31日現在)

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金 | 51,593,362 | — | — | — |
| 金銭の信託 | 8,401,300 | — | — | — |
| 未収委託者報酬 | 15,750,264 | — | — | — |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| 投資信託 | 293,326 | 6,911,464 | 3,695,585 | — |
| 合計 | 76,038,253 | 6,911,464 | 3,695,585 | — |

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

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

2. その他有価証券

第36期(令和3年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | 株式 | — | — | — |
| | 債券 | — | — | — |
| | その他 | 14,810,957 | 11,362,471 | 3,448,485 |
| | 小計 | 14,810,957 | 11,362,471 | 3,448,485 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式 | — | — | — |
| | 債券 | — | — | — |
| | その他 | 6,076,354 | 6,207,447 | △131,093 |
| | 小計 | 6,076,354 | 6,207,447 | △131,093 |
| 合計 | | 20,887,311 | 17,569,919 | 3,317,392 |

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

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

第37期(令和4年3月31日現在)

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

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

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

3. 売却したその他有価証券

第36期(自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)

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

第37期(自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 第 36 期 (自 令和 2 年 4 月 1 日 至 令和 3 年 3 月 31 日) | 第 37 期 (自 令和 3 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 3 月 31 日) |
|---------------------|---|---|
| 勤務費用 | 203,106 千円 | 198,457 千円 |
| 利息費用 | 19,110 | 21,549 |
| 期待運用収益 | △44,130 | △47,588 |
| 数理計算上の差異の 費用処理額 | 41,361 | △3,547 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 65,361 | 65,361 |
| その他 | 44,446 | 109,013 |
| 確定給付制度に係る 退職給付費用 | 329,255 | 343,245 |

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 第 36 期 (令和 3 年 3 月 31 日現在) | 第 37 期 (令和 4 年 3 月 31 日現在) |
|---------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 減損損失 | 418,394千円 | 410,082千円 |
| 投資有価証券評価損 | 188,859 | 65,490 |
| 未払事業税 | 180,263 | 165,702 |
| 賞与引当金 | 285,801 | 288,528 |
| 役員賞与引当金 | 25,472 | 25,799 |
| 役員退職慰労引当金 | 36,112 | 36,112 |
| 退職給付引当金 | 350,756 | 381,617 |
| 減価償却超過額 | 68,024 | 145,316 |
| 委託者報酬 | 209,938 | - |
| 長期差入保証金 | 48,639 | 52,869 |
| 時効後支払損引当金 | 75,149 | 76,615 |
| 連結納税適用による時価評価 | 38,873 | 35,311 |
| その他 | 87,023 | 76,257 |
| 繰延税金資産 小計 | 2,013,308 | 1,759,702 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産 合計 | 2,013,308 | 1,759,702 |
| 繰延税金負債 | | |
| 前払年金費用 | △79,225 | △58,088 |
| 連結納税適用による時価評価 | △1,203 | △1,149 |
| その他有価証券評価差額金 | △1,015,785 | △717,957 |
| その他 | △101 | △101 |
| 繰延税金負債 合計 | △1,096,346 | △777,296 |
| 繰延税金資産の純額 | 916,962 | 982,406 |

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

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

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

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

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

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(注 2) | 科目 | 期末残高(注 2) |
|-------------|----------------------|---------|------------------|-------|----------------|-------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|-----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | ㈱三菱 UFJ 銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注 1) | 3,729,785 千円 | 未払手数料 | 764,501 千円 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱 UFJ モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注 1) | 5,655,482 千円 | 未払手数料 | 1,193,245 千円 |

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示してまいります。

2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

| | 第36期 （自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日） | 第37期 （自 令和3年4月1日 至 令和4年3月31日） |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 393,827.09円 | 400,322.84円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 49,916.36円 | 57,424.97円 |

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

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間財務諸表
(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第 38 期中間会計期間
(令和 4 年 9 月 30 日現在)

| | | |
|------------|----|-------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | | 48,375,193 |
| 有価証券 | | 270,676 |
| 前払費用 | | 804,517 |
| 未収入金 | | 78,340 |
| 未収委託者報酬 | | 16,141,814 |
| 未収収益 | | 751,362 |
| 金銭の信託 | | 10,401,500 |
| その他 | | 264,566 |
| 流動資産合計 | | 77,087,971 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | ※1 | 285,704 |
| 器具備品 | ※1 | 898,241 |
| 土地 | | 628,433 |
| 建設仮勘定 | | 39,450 |
| 有形固定資産合計 | | 1,851,829 |
| 無形固定資産 | | |
| 電話加入権 | | 15,822 |
| ソフトウェア | | 4,470,447 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 1,585,322 |
| 無形固定資産合計 | | 6,071,592 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 14,693,980 |
| 関係会社株式 | | 159,536 |
| 投資不動産 | ※1 | 809,716 |
| 長期差入保証金 | | 1,204,923 |
| 前払年金費用 | | 154,270 |
| 繰延税金資産 | | 1,369,880 |
| その他 | | 45,230 |
| 貸倒引当金 | | △23,600 |
| 投資その他の資産合計 | | 18,413,938 |
| 固定資産合計 | | 26,337,361 |
| 資産合計 | | 103,425,332 |

(単位：千円)

第 38 期中間会計期間
(令和 4 年 9 月 30 日現在)

| | |
|-----------|------------|
| (負債の部) | |
| 流動負債 | |
| 預り金 | 1,783,230 |
| 未払金 | |
| 未払収益分配金 | 112,635 |
| 未払償還金 | 7,418 |
| 未払手数料 | 6,226,860 |
| その他未払金 | 575,030 |
| 未払費用 | 5,329,791 |
| 未払消費税等 | ※2 592,374 |
| 未払法人税等 | 2,634,965 |
| 賞与引当金 | 954,015 |
| 役員賞与引当金 | 86,040 |
| その他 | 5,517 |
| 流動負債合計 | 18,307,880 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 1,299,571 |
| 役員退職慰労引当金 | 75,667 |
| 時効後支払損引当金 | 261,505 |
| 固定負債合計 | 1,636,744 |
| 負債合計 | 19,944,625 |
| (純資産の部) | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 3,572,096 |
| その他資本剰余金 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計 | 44,732,712 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | 28,593,826 |
| 利益剰余金合計 | 35,934,416 |
| 株主資本合計 | 82,667,260 |

(単位：千円)

第 38 期中間会計期間
(令和 4 年 9 月 30 日現在)

| | |
|--------------|-------------|
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 813,447 |
| 評価・換算差額等合計 | 813,447 |
| 純資産合計 | 83,480,707 |
| 負債純資産合計 | 103,425,332 |

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

第 38 期中間会計期間
(自 令和 4 年 4 月 1 日
至 令和 4 年 9 月 30 日)

| | |
|--------------|-----------|
| 営業外収益 | |
| 受取配当金 | 31,240 |
| 受取利息 | 5,115 |
| 投資有価証券償還益 | 780 |
| 収益分配金等時効完成分 | 93,217 |
| 受取賃貸料 | 32,904 |
| その他 | 32,041 |
| 営業外収益合計 | 195,299 |
| 営業外費用 | |
| 時効後支払損引当金繰入 | 39,158 |
| 事務過誤費 | 1,807 |
| 賃貸関連費用 | ※1 6,770 |
| その他 | 11,805 |
| 営業外費用合計 | 59,541 |
| 経常利益 | 7,906,314 |
| 特別利益 | |
| 投資有価証券売却益 | 364,481 |
| 特別利益合計 | 364,481 |
| 特別損失 | |
| 投資有価証券売却損 | 338 |
| 投資有価証券評価損 | 104,554 |
| 固定資産除却損 | 3,528 |
| 特別損失合計 | 108,421 |
| 税引前中間純利益 | 8,162,374 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,522,443 |
| 法人税等調整額 | △ 28,522 |
| 法人税等合計 | 2,493,921 |
| 中間純利益 | 5,668,453 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 38 期中間会計期間（自 令和 4 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 9 月 30 日）

（単位：千円）

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

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法
 - (1) 子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法を採用しております。
 - (2) その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産及び投資不動産
定率法を採用しております。ただし、平成 10 年 4 月 1 日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成 28 年 4 月 1 日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

| | |
|-------|----------|
| 建物 | 5 年～50 年 |
| 器具備品 | 2 年～20 年 |
| 投資不動産 | 3 年～47 年 |
 - (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5 年)に基づく定額法を採用しております。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
 - (2) 賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (3) 役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (4) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
 - ① 退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
 - ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10 年)による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として 10 年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
 - (5) 役員退職慰労引当金
役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。
 - (6) 時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 収益および費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 投資顧問料

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

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

当中間会計期間からグループ通算制度を適用しております。

[会計方針の変更]

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

(追加情報)

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

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

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

※2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 38 期中間会計期間 (自 令和 4 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

令和 4 年 6 月 28 日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

(リース取引関係)

第 38 期中間会計期間(令和 4 年 9 月 30 日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

(金融商品関係)

第 38 期中間会計期間(令和 4 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注 2) 市場価格のない株式等

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

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

(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。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

金銭の信託

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

(有価証券関係)

第 38 期中間会計期間（令和 4 年 9 月 30 日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

(注)「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」(中間貸借対照表計上額 10,401,500 千円、取得価額 10,400,000 千円)を含めております。
非上場株式(中間貸借対照表計上額 31,360 千円)については、市場価格がないため、含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

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

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

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 38 期中間会計期間(自 令和 4 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 9 月 30 日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第 38 期中間会計期間(自 令和 4 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 9 月 30 日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第 38 期中間会計期間 (令和 4 年 9 月 30 日現在) |
|--|-------------------------------------|
| 1 株当たり純資産額 (算定上の基礎) | 394, 556. 72 円 |
| 純資産の部の合計額 (千円) | 83, 480, 707 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額 (千円) | 83, 480, 707 |
| 1 株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数 (株) | 211, 581 |

1 株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第 38 期中間会計期間 (自 令和 4 年 4 月 1 日 至 令和 4 年 9 月 30 日) |
|---------------------------|---|
| 1 株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎) | 26, 790. 93 円 |
| 中間純利益金額 (千円) | 5, 668, 453 |
| 普通株主に帰属しない金額 (千円) | — |
| 普通株式に係る中間純利益金額 (千円) | 5, 668, 453 |
| 普通株式の期中平均株式数 (株) | 211, 581 |

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③ 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 【その他】

① 定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

② 訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

つみたて全世界株式

約 款

三菱UFJ国際投信株式会社

つみたて全世界株式

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

①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、主として対象インデックスに採用されている日本を含む先進国および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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

(3) 投資制限

①株式への実質投資割合に制限を設けません。

②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

⑧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。

⑨外国為替予約取引を行うことができます。

⑩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。

⑪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. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなかつた利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『つみたて全世界株式』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJ国際投信株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項および第2項ならびに第31条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第47条第8項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する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て得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以

下「外貨建価値証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、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って計算します。

- ③ 第30条に規定する予約為替の評価は、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るものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位および価額)

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。)および登録金融機関(金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約(以下「別に定める契約」といいます。)を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情(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、第1項による受益権の取得申込みの受付

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け取りを取消することができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。
- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑥ 前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認める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。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 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、約款第22条から第24条までに定めるものに限ります。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 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。

- ③ 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。

(投資の対象とする有価証券等)

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者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（以下これらを総称して「マザーファンド」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、前各号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。次号において同じ。）で次号で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）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せん。）
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前号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、第1号の証券または証書ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第16号の証券ならびに第13号および第19号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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せん。）により運用することを指図することができます。

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前号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、前各号に該当するものを除きます。）

8. 外国の者に対する権利で前号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前号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、前号の権利に類するもの

③ 委託者は、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。

④ 前項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。

⑤ 委託者は、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。以下本項および次項において同じ。）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。

⑥ 前項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。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害

関係人、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項ならびに前条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第21条から第24条、第26条から第28条、第30条、第34条から第36条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第20条 委託者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。

- ② 前項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者が投資することを指図することができます。
- ③ この信託およびマザーファンド（モルガン・スタンレー株式会社について、委託者が議決権行使権限を委託する、または、議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使している場合に限り。）において投資するモルガン・スタンレー株式会社については、委託者及び受託者が合意の上、委託者が適切な能力を有すると判断した独立した議決権行使助言会社に、当該株式にかかる議決権行使権限を委託するか、または、当該議決権行使助言会社による議決権行使助言（推奨）にしたがって、当該推奨通りに議決権を行使します。
- ④ 前項の議決権行使権限の委託または助言（推奨）どおりの議決権行使を停止しようとする場合は、第53条第2項から第6項の規定を準用することとし、必要な技術的読替えは委託者と受託者の協議にて定めます。

（信用取引の指図範囲）

第21条 委託者は、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。

- ② 前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号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（第25条に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図）

第22条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（スワップ取引の運用指図）

第23条 委託者は、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。

- ② 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、原則として第5条に規定する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。
- ③ 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。
- ④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第24条 委託者は、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。

- ② 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、原則として第5条に規定する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。
- ③ 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。
- ④ 委託者は、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第25条 委託者は、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（この信託約款において、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。

- ② 前項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。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第26条 委託者は、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各号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。
- ② 前項各号に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

(有価証券の空売りの指図範囲)

第27条 委託者は、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第28条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。

- ② 前項の売付けの指図は、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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

(有価証券の借入れ)

第28条 委託者は、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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、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。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第29条 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。

(外国為替予約取引の指図)

第30条 委託者は、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。

- ② 前項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。

(信託業務の委託等)

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第32条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券売却等の指図）

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的とし

て、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。
なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 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。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第39条 この信託の計算期間は、毎年6月26日から翌年6月25日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から2020年6月25日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告等）

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。
- ⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。
 1. 他の受益者の氏名または名称および住所
 2. 他の受益者が有する受益権の内容

（信託事務の諸費用および監査報酬）

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

（信託報酬等）

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の20の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（収益の分配）

第43条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 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（「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責）

第44条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第45条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第45条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿

に記載または記録されます。

- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金および償還金の時効）

第46条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとし、
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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、第1項による一部解約の実行の請求の受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付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとし

て第3項の規定に準じて計算された価額とします。

⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第48条第2項から第5項の規定にしたがいます。

(信託契約の解約)

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「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信託契約の解約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、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この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には適用しません。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、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第49条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、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。

② 委託者は、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。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場

合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の変更または併合（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、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更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、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の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以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款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には適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、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。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第47条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第55条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があつた場合には、これを交付します。

(公告)

第56条 委託者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/>

- ② 前項の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。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第57条 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、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定め

ます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第45条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

信託契約締結日 2020年3月6日

(附表)

1. 約款第13条第2項および第47条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

香港取引所の休業日

香港の銀行の休業日

 **MUFG** 三菱UFJ国際投信