

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月24日提出
【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
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)(「ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

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】

2021年9月25日から2022年9月26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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券		
追加型	内外	不動産投信	MRF	特殊型 ( )
		その他資産 ( )	ETF	
		資産複合		

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
債券 一般	(隔月) 年12回	日本 北米 欧州 アジア	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( )	(毎月) 日々 その他 ( )	オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (MSCIコク サイ・インデ ックス(配当込 み、円ヘッジ・ 円ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))						その他 ( )
資産複合 ( )						

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

ます。

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

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

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

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

#### 属性区分の定義

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

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

日本を除く先進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。

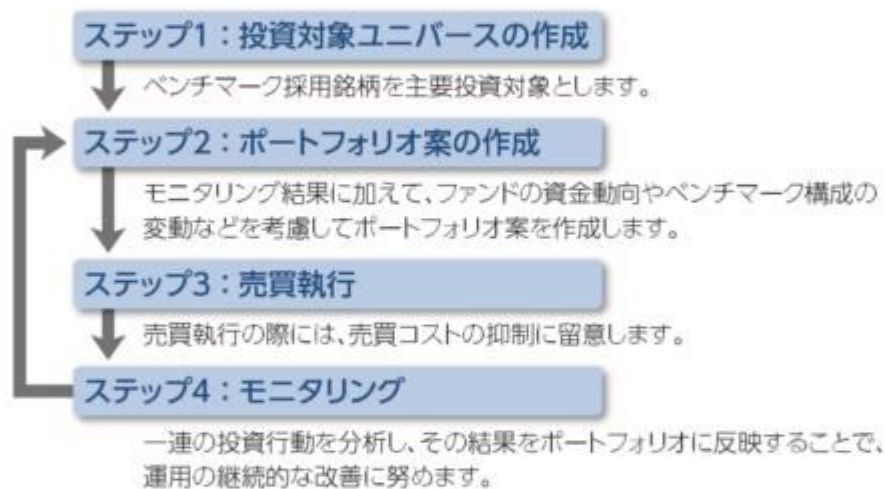
## ファンドの特色

特色 1

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

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

### <運用プロセスのイメージ>



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

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

### <対象インデックスの国・地域別構成比率>



- 四捨五入の関係で上記の数字を合計しても100%にならない場合があります。
- MSCI Inc.のデータを基に三菱UFJ国際投信作成(2021年5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除く先進国の株式に投資を行います。

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

※実際の運用はヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

特色

3

原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

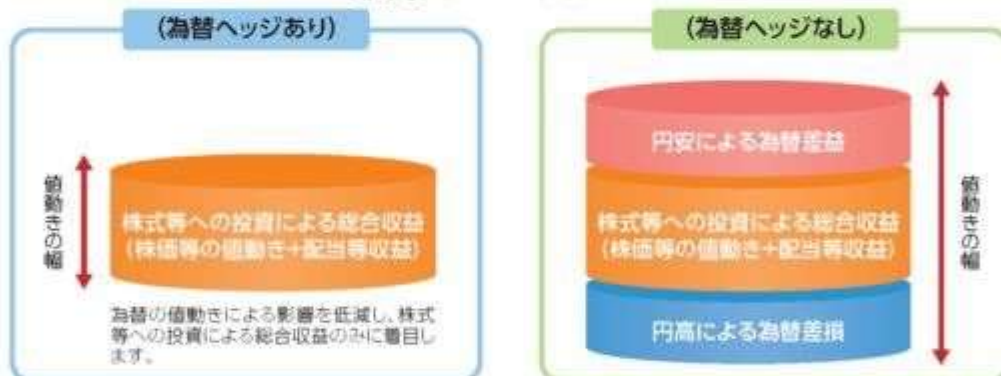
- 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をはかります。

#### 為替ヘッジの活用

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

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

#### <投資リターンのイメージ>



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

特色

4

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

運用は主にヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く先進国の株式へ投資するファミリーファンド方式により行います。



## ■主な投資制限

株式	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。

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

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の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いれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集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するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自ら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獨創性、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。

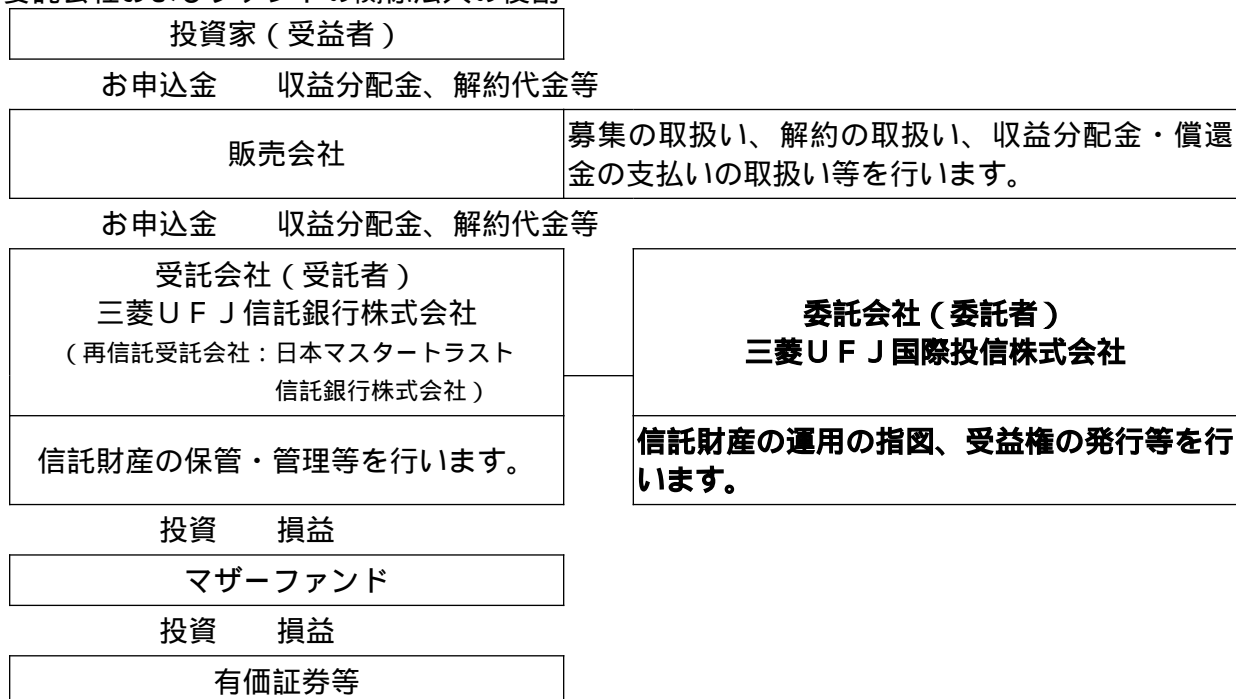
## (2) 【ファンドの沿革】

2017年8月16日

設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



## 委託会社と関係法人との契約の概要

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

## 委託会社の概況（2021年6月末現在）

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

株主名	住所	所有株式数	所有比率
-----	----	-------	------

三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%
---------------	-------------------	----------	--------

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を除く先進国の株式に投資を行い、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。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

### (2)【投資対象】

#### 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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

#### 有価証券の指図範囲

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。)で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)

22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

#### <ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンドの概要>

(基本方針)

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

(運用方法)

**投資対象**

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

**投資態度**

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

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

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

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

**（投資制限）**

株式への投資割合に制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

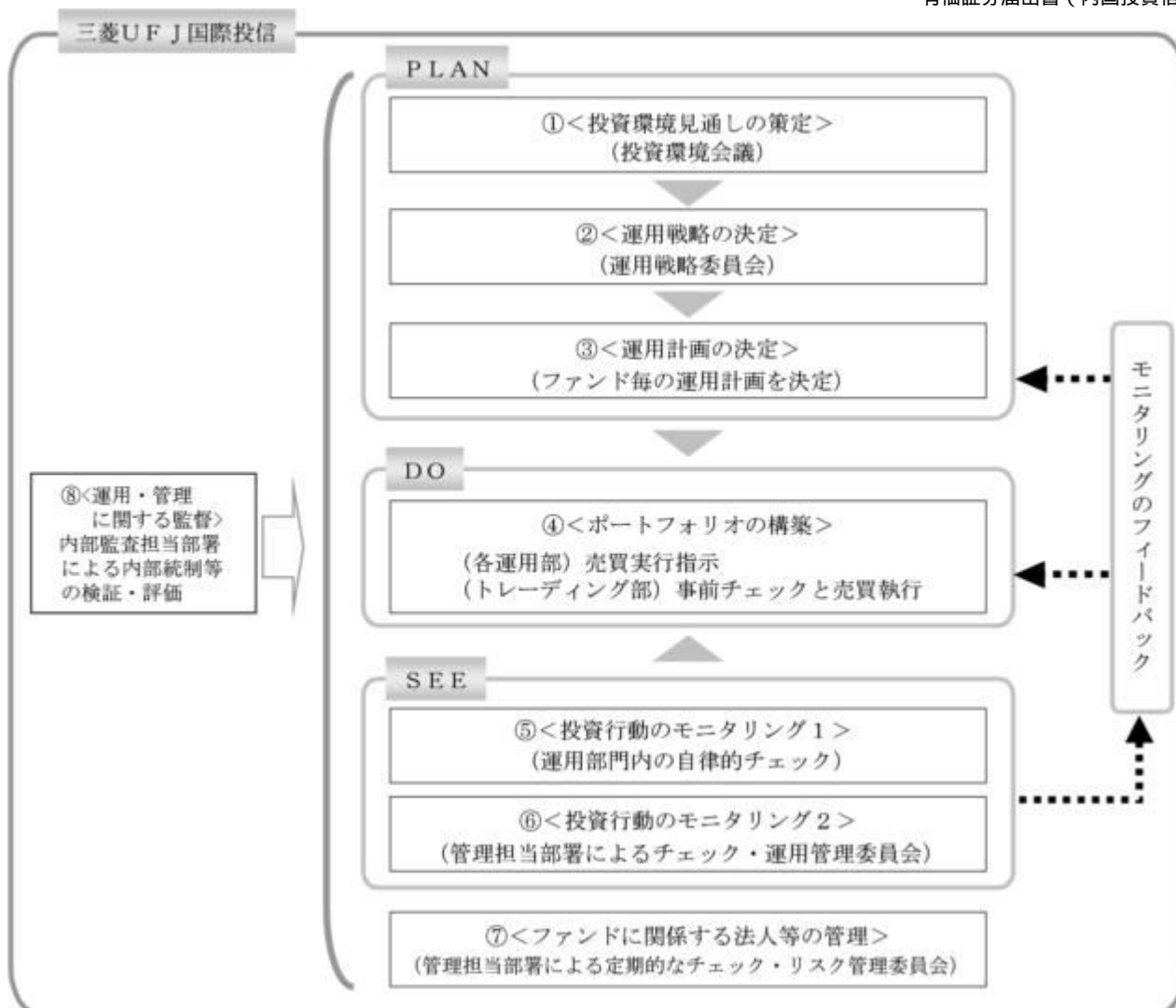
スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

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

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

**（3）【運用体制】**



#### 投資環境見通しの策定

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

#### 運用戦略の決定

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

#### 運用計画の決定

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

#### ポートフォリオの構築

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

#### 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。

#### 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、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、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、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。

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有

効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### （５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

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

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

同一銘柄の転換社債等

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

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

スワップ取引

a. 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。



- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 信用取引

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

#### 外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産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。

#### 公社債の借入れ

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

#### 資金の借入れ

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

#### 投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商

品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

#### 有価証券の貸付

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### デリバティブ取引等

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

#### 信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### <その他法令等に定められた投資制限>

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

<b>価格変動 リスク</b>	<p>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。</p>
<b>為替変動 リスク</b>	<p>組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。</p>
<b>信用リスク</b>	<p>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。</p>
<b>流動性 リスク</b>	<p>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。</p>

#### 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。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

#### （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、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。この内容は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。

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。

##### 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。

##### 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。

##### リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

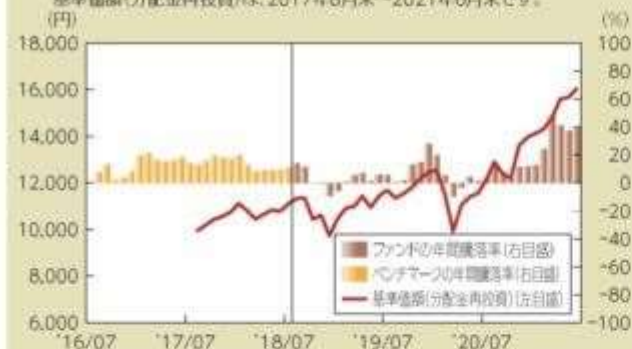
\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■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、2018年8月～2021年6月です。  
ベンチマークの年間騰落率は、2016年7月～2018年7月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2017年8月末～2021年6月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年7月末～2021年6月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2018年7月以前)の年間騰落率を含みます。



●基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

●年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

●ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
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、野村證券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0.220%（税抜0.200%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）  
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.09%	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、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。

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。

### 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

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

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

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

### 収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は2021年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### 【つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）】

#### （1）【投資状況】

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	675,605,077	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		33,805	0.01
純資産総額		675,638,882	100.00

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 6月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付外国株式インデックスマ ザーファンド	261,204,360	2.5748	672,574,289	2.5865	675,605,077	99.99

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

##### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 3年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

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



## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成30年 6月25日)	27,548,201	27,548,201	10,939	10,939
第2計算期間末日 (令和 1年 6月25日)	128,962,624	128,962,624	11,484	11,484
第3計算期間末日 (令和 2年 6月25日)	289,865,467	289,865,467	11,524	11,524
第4計算期間末日 (令和 3年 6月25日)	664,130,270	664,130,270	15,977	15,977
令和 2年 6月末日	295,016,313		11,554	
7月末日	328,263,113		12,107	
8月末日	361,411,640		12,904	
9月末日	364,893,134		12,409	
10月末日	375,613,565		12,199	
11月末日	432,007,022		13,596	
12月末日	458,505,354		13,952	
令和 3年 1月末日	490,733,652		14,122	
2月末日	506,643,880		14,325	
3月末日	550,565,335		14,786	
4月末日	603,133,168		15,604	
5月末日	631,382,601		15,678	
6月末日	675,638,882		16,049	

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	9.39
第2計算期間	4.98
第3計算期間	0.34
第4計算期間	38.64

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

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	36,960,507	11,777,262	25,183,245
第2計算期間	94,101,839	6,985,013	112,300,071
第3計算期間	176,292,521	37,066,376	251,526,216
第4計算期間	229,020,791	64,855,343	415,691,664

（参考）

ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	14,393,516,467	66.72
	イギリス	918,187,831	4.26
	カナダ	723,276,302	3.35
	フランス	689,972,867	3.20
	スイス	639,428,276	2.96
	ドイツ	604,455,689	2.80
	オーストラリア	436,753,753	2.02
	オランダ	361,970,280	1.68
	スウェーデン	246,084,480	1.14
	香港	192,385,569	0.89
	デンマーク	166,532,923	0.77
	スペイン	162,378,720	0.75

	イタリア	123,157,621	0.57
	フィンランド	68,966,155	0.32
	ベルギー	58,544,839	0.27
	シンガポール	58,450,935	0.27
	アイルランド	45,199,042	0.21
	ノルウェー	41,998,312	0.19
	イスラエル	23,975,635	0.11
	ルクセンブルグ	21,000,021	0.10
	ニュージーランド	16,160,618	0.07
	オーストリア	12,469,888	0.06
	ポルトガル	9,857,945	0.05
	小計	20,014,724,168	92.78
投資証券	アメリカ	386,326,789	1.79
	オーストラリア	27,709,639	0.13
	イギリス	11,145,212	0.05
	シンガポール	8,753,320	0.04
	香港	8,219,612	0.04
	フランス	6,637,927	0.03
	オランダ	4,474,019	0.02
	カナダ	3,452,868	0.02
	小計	456,719,386	2.12
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,100,868,982	5.10
純資産総額		21,572,312,536	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 3年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	804,956,052	3.73
	買建	カナダ	42,934,640	0.20
	買建	ドイツ	124,004,281	0.57
	買建	オーストラリア	30,006,320	0.14
	買建	イギリス	53,759,160	0.25
	買建	スイス	28,864,822	0.13

（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3年6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	57,433	13,923.12	799,646,999	15,075.37	865,823,806	4.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	24,511	27,228.11	667,388,288	30,011.41	735,609,720	3.41
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,464	356,499.96	521,915,953	381,295.32	558,216,350	2.59
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	8,224	33,896.08	278,761,423	38,911.99	320,012,257	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,008	255,302.68	257,345,103	278,702.51	280,932,135	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1,028	251,023.23	258,051,885	270,417.86	277,989,561	1.29
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	2,623	68,262.13	179,051,592	75,278.44	197,455,350	0.92
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,115	63,279.40	133,835,942	88,582.32	187,351,608	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	10,425	17,531.35	182,764,358	17,044.80	177,692,053	0.82
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	8,979	18,674.75	167,680,583	18,138.43	162,865,029	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	5,793	24,933.57	144,440,219	26,091.35	151,147,196	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	4,682	31,584.96	147,880,808	30,543.30	143,003,739	0.66
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	3,240	45,525.78	147,503,547	44,021.89	142,630,950	0.66
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	9,838	12,994.21	127,837,058	13,961.81	137,356,336	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	3,675	36,564.38	134,374,107	35,190.97	129,326,849	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	8,407	15,148.35	127,352,213	14,861.95	124,944,430	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	3,027	40,650.31	123,048,500	40,693.44	123,179,043	0.57
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	3,798	27,490.18	104,407,734	32,373.40	122,954,176	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	26,523	4,596.81	121,921,207	4,521.61	119,926,826	0.56
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	6,197	20,089.06	124,491,958	19,233.17	119,188,013	0.55
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,432	67,724.22	96,981,091	77,619.04	111,150,468	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,633	53,652.30	87,614,222	65,325.13	106,675,945	0.49
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	2,426	35,864.93	87,008,339	41,873.44	101,584,966	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	14,443	6,700.04	96,768,710	6,924.51	100,010,837	0.46

アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	15,595	6,358.34	99,158,468	6,252.19	97,502,953	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,510	54,745.94	82,666,379	58,994.42	89,081,589	0.41
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	14,113	6,473.35	91,358,434	6,174.78	87,144,772	0.40
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	13,857	6,086.32	84,338,181	6,275.41	86,958,426	0.40
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	3,129	23,836.62	74,584,799	27,181.66	85,051,445	0.39
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	14,397	5,841.94	84,106,430	5,850.78	84,233,792	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 3年 6月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	3.13
	素材	4.14
	資本財	6.13
	商業・専門サービス	1.16
	運輸	1.96
	自動車・自動車部品	1.90
	耐久消費財・アパレル	1.98
	消費者サービス	1.74
	メディア・娯楽	7.03
	小売	5.36
	食品・生活必需品小売り	1.26
	食品・飲料・タバコ	3.77
	家庭用品・パーソナル用品	1.66
	ヘルスケア機器・サービス	4.88
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.16
	銀行	5.80
	各種金融	4.49
	保険	2.88
	不動産	0.41
	ソフトウェア・サービス	11.65
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.49
	電気通信サービス	1.62
	公益事業	2.74
半導体・半導体製造装置	4.44	
小計	92.78	

投資証券		2.12
合計		94.90

（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 3年 6月30日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2109	買建	34	アメリカドル	7,174,062.32	793,307,811	7,279,400	804,956,052	3.73
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602109	買建	2	カナダドル	480,557.5	42,841,701	481,600	42,934,640	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2109	買建	23	ユーロ	950,627.2	125,083,526	942,425	124,004,281	0.57
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2109	買建	2	オーストラリアドル	364,655.5	30,310,165	361,000	30,006,320	0.14
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2109	買建	5	イギリスポンド	355,521	54,451,596	351,000	53,759,160	0.25
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2109	買建	2	スイスフラン	239,443.7	28,745,216	240,440	28,864,822	0.13

（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

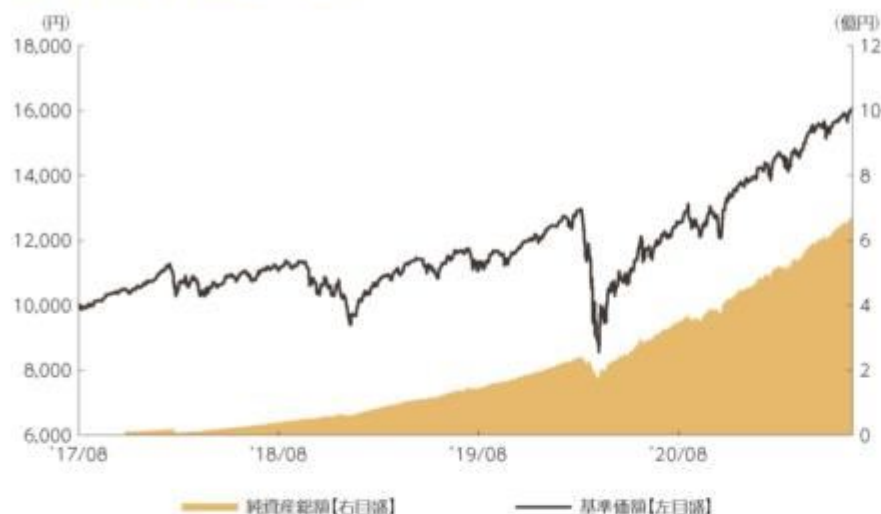


## 運用実績



2021年6月30日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2017年8月16日(設定日)～2021年6月30日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	16,049円
純資産総額	6.7億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

2021年6月	0円
2020年6月	0円
2019年6月	0円
2018年6月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

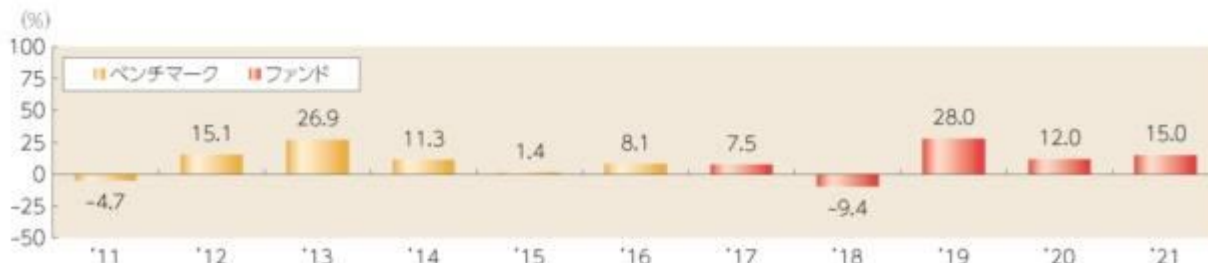
### ■主要な資産の状況

組入通貨	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 円	99.5%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	4.0%
その他	0.5%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	3.4%
		3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	2.6%
		4 FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.5%
		5 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.3%
		6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.3%
		7 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	0.9%
		8 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	0.9%
		9 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.8%
		10 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%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	5.0%

- 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
- 2017年は設定日から年末までの、2021年は年初から6月30日までの収益率を表示
- 2016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】

#### 申込みの受付

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### 申込単位

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

#### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

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/>

#### 申込手数料

ありません。

#### 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。

#### 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。

#### 取得申込みの受付の中止および取消し

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

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



申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

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

### 解約単位

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

### 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

### 信託財産留保額

ありません。

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

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/>

### 支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

### 解約請求受付時間

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

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。

### 解約請求受付の中止および取消し

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

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

##### （資産の評価方法）

###### ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

###### ・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

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

###### ・公社債等

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

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

###### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

###### ・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

###### ・外貨建資産

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

###### ・外国為替予約取引

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

###### ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

##### 基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

##### 基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

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（2017年8月16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】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更等

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続き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、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権

の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

#### 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。

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 運用報告書

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

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

#### 信託事務の再信託

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

#### 公告

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する受領権

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。

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。

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2年6月26日から令和3年6月25日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【つみたて先進国株式(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 [ 令和 2年 6月25日現在 ]	第4期 [ 令和 3年 6月25日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	647,194	1,214,142
親投資信託受益証券	289,830,393	664,052,411
流動資産合計	290,477,587	665,266,553
資産合計	290,477,587	665,266,553
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	352,751	519,395
未払受託者報酬	25,551	60,760
未払委託者報酬	229,913	546,766
その他未払費用	3,905	9,362
流動負債合計	612,120	1,136,283
負債合計	612,120	1,136,283
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	251,526,216	415,691,664
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	38,339,251	248,438,606
(分配準備積立金)	9,846,592	140,852,139
元本等合計	289,865,467	664,130,270
純資産合計	289,865,467	664,130,270
負債純資産合計	290,477,587	665,266,553

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 至	令和 1年 6月26日 令和 2年 6月25日	自 至	令和 2年 6月26日 令和 3年 6月25日
営業収益				
受取利息		1		2
有価証券売買等損益		2,615,276		148,523,937
営業収益合計		2,615,277		148,523,939
営業費用				
支払利息		93		59
受託者報酬		43,360		101,703
委託者報酬		390,155		915,172
その他費用		6,606		15,644
営業費用合計		440,214		1,032,578
営業利益又は営業損失( )		2,175,063		147,491,361
経常利益又は経常損失( )		2,175,063		147,491,361
当期純利益又は当期純損失( )		2,175,063		147,491,361
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( )		930,949		12,435,401
期首剰余金又は期首欠損金( )		16,662,553		38,339,251
剰余金増加額又は欠損金減少額		26,192,679		87,784,794
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		26,192,679		87,784,794
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,760,095		12,741,399
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,760,095		12,741,399
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		38,339,251		248,438,606



## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第4期 [ 令和 3年 6月25日現在 ]

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の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3期 [令和 2年 6月25日現在]	第4期 [令和 3年 6月25日現在]
1. 期首元本額	112,300,071円	251,526,216円
期中追加設定元本額	176,292,521円	229,020,791円
期中一部解約元本額	37,066,376円	64,855,343円
2. 受益権の総数	251,526,216口	415,691,664口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日			第4期 自 令和 2年 6月26日 至 令和 3年 6月25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	4,016,267円	費用控除後の配当等収益額	A	8,343,931円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	124,440,770円
収益調整金額	C	28,492,659円	収益調整金額	C	107,586,467円
分配準備積立金額	D	5,830,325円	分配準備積立金額	D	8,067,438円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	38,339,251円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	248,438,606円
当ファンドの期末残存口数	F	251,526,216口	当ファンドの期末残存口数	F	415,691,664口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,524円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,976円
1万口当たり分配金額	H	円	1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	円

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	第3期 自 令和 1年 6月26日 至 令和 2年 6月25日	第4期 自 令和 2年 6月26日 至 令和 3年 6月25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3期 [ 令和 2年 6月25日現在 ]	第4期 [ 令和 3年 6月25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

区分	第3期	第4期
	[ 令和 2年 6月25日現在 ]	[ 令和 3年 6月25日現在 ]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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3期	第4期
	[ 令和 2年 6月25日現在 ]	[ 令和 3年 6月25日現在 ]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	2,726,171	145,884,250
合計	2,726,171	145,884,250

## ( 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3期	第4期
	[ 令和 2年 6月25日現在 ]	[ 令和 3年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	1.1524円	1.5977円
(1万口当たり純資産額)	(11,524円)	(15,977円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド	257,904,463	664,052,411	
合計		257,904,463	664,052,411	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[ 令和 3年 6月25日現在 ]

資産の部	
流動資産	
預金	569,770,083
コール・ローン	433,499,473
株式	20,020,422,218
投資証券	458,378,292
派生商品評価勘定	56,225,285
未収入金	309,427
未収配当金	19,404,573
差入委託証拠金	170,142,539
流動資産合計	21,728,151,890
資産合計	21,728,151,890
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	172,055,024
未払解約金	53,323,328

[ 令和 3年 6月25日現在 ]

未払利息	223
流動負債合計	225,378,575
負債合計	225,378,575
純資産の部	
元本等	
元本	8,351,400,789
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,151,372,526
元本等合計	21,502,773,315
純資産合計	21,502,773,315
負債純資産合計	21,728,151,890

## 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。 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。 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本となる重要な事項	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)

[ 令和 3年 6月25日現在 ]

当期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当期間の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 3年 6月25日現在 ]
1. 期首	令和 2年 6月26日
期首元本額	11,268,092,910円
期中追加設定元本額	2,409,655,664円
期中一部解約元本額	5,326,347,785円
元本の内訳	
つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）	257,904,463円
ヘッジ付先進国株式インデックスオープン	1,006,998,042円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	1,151,370,733円

	[令和 3年 6月25日現在]
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	16,758,686円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,165,761,489円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	1,730,756,486円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,179,024,240円
MUKAM ヘッジ付外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	1,691,488,306円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）	26,963,884円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）	25,804,765円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）	25,946,633円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定）	24,910,229円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）	23,785,936円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）	23,926,897円
合計	8,351,400,789円
2. 受益権の総数	8,351,400,789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 2年 6月26日 至 令和 3年 6月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 2年 6月26日 至 令和 3年 6月25日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</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、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</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。</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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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 3年 6月25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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 3年 6月25日現在 ]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	693,164,055	
投資証券	24,588,100	
合計	717,752,155	

(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 3年 6月25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	1,108,993,454		1,114,206,099	5,212,645
	合計	1,108,993,454		1,114,206,099	5,212,645

## （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 3年 6月25日現在 ]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	14,709,241,963		14,876,416,965	167,175,002
	カナダドル	765,719,177		759,229,288	6,489,889
	オーストラリアドル	498,916,979		496,380,108	2,536,871
	イギリスポンド	979,449,732		972,547,569	6,902,163



スイスフラン	660,459,846	654,749,852	5,709,994
香港ドル	222,373,416	224,898,241	2,524,825
シンガポールドル	88,014,736	87,780,459	234,277
ニュージーランドドル	27,144,334	26,798,914	345,420
スウェーデンクローネ	267,725,458	265,707,300	2,018,158
ノルウェークローネ	52,384,105	52,107,721	276,384
デンマーククローネ	185,636,896	183,852,630	1,784,266
イスラエルシェケル	40,294,648	40,839,372	544,724
ユーロ	2,251,844,173	2,228,939,428	22,904,745
合計	20,749,205,463	20,870,247,847	121,042,384

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

- (イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	[ 令和 3年 6月25日現在 ]
1口当たり純資産額	2.5748円
(1万口当たり純資産額)	(25,748円)

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1) 株式

(単位：円)

			評価額	
--	--	--	-----	--

通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	2,710	23.55	63,820.50	
	CHENIERE ENERGY INC	793	87.50	69,387.50	
	CHEVRON CORP	6,567	107.14	703,588.38	
	CONOCOPHILLIPS	4,590	61.39	281,780.10	
	DEVON ENERGY CORP	2,361	29.74	70,216.14	
	EOG RESOURCES INC	1,964	86.09	169,080.76	
	EXXON MOBIL CORP	14,443	64.52	931,862.36	
	HALLIBURTON CO	2,923	23.80	69,567.40	
	HESS CORP	979	88.50	86,641.50	
	KINDER MORGAN INC	6,824	18.24	124,469.76	
	MARATHON PETROLEUM CORP	2,284	62.34	142,384.56	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,199	31.74	101,536.26	
	ONEOK INC	1,534	55.89	85,735.26	
	PHILLIPS 66	1,499	89.69	134,445.31	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	737	164.11	120,949.07	
	SCHLUMBERGER LTD	4,950	33.26	164,637.00	
	VALERO ENERGY CORP	1,364	81.73	111,479.72	
	WILLIAMS COS INC	4,052	26.77	108,472.04	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	748	289.93	216,867.64	
	ALBEMARLE CORP	383	165.97	63,566.51	
	AMCOR PLC	5,658	11.52	65,180.16	
	AVERY DENNISON CORP	288	207.82	59,852.16	
	BALL CORP	1,128	82.03	92,529.84	
	CELANESE CORP	405	150.01	60,754.05	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	755	50.81	38,361.55	
	CORTEVA INC	2,647	44.35	117,394.45	
	CROWN HOLDINGS INC	452	100.36	45,362.72	
	DOW INC	2,504	63.11	158,027.44	
	DUPONT DE NEMOURS INC	1,893	76.40	144,625.20	
	EASTMAN CHEMICAL CO	457	117.21	53,564.97	
	ECOLAB INC	866	208.24	180,335.84	
	FMC CORP	415	112.85	46,832.75	
	FREEMPORT-MCMORAN INC	4,921	37.52	184,635.92	
	INTERNATIONAL PAPER CO	1,300	60.78	79,014.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	873	148.42	129,570.66	
	LINDE PLC	1,781	285.13	507,816.53	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	924	102.47	94,682.28		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	218	358.96	78,253.28		
MOSAIC CO/THE	1,377	31.23	43,003.71		
NEWMONT CORP	2,699	62.30	168,147.70		
NUCOR CORP	1,033	97.88	101,110.04		

PACKAGING CORP OF AMERICA	353	133.80	47,231.40
PPG INDUSTRIES INC	833	169.52	141,210.16
RPM INTERNATIONAL INC	415	88.10	36,561.50
SEALED AIR CORP	494	58.27	28,785.38
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	882	270.08	238,210.56
STEEL DYNAMICS INC	774	60.98	47,198.52
VULCAN MATERIALS CO	464	175.90	81,617.60
WESTROCK CO	851	53.36	45,409.36
3M CO	1,968	193.26	380,335.68
ALLEGION PLC	311	138.72	43,141.92
AMETEK INC	769	133.63	102,761.47
BOEING CO/THE	1,884	250.57	472,073.88
CARRIER GLOBAL CORP	2,931	46.22	135,470.82
CATERPILLAR INC	1,853	219.34	406,437.02
CUMMINS INC	505	239.11	120,750.55
DEERE & CO	1,011	350.62	354,476.82
DOVER CORP	516	147.68	76,202.88
EATON CORP PLC	1,343	145.65	195,607.95
EMERSON ELECTRIC CO	2,106	95.35	200,807.10
FASTENAL CO	1,912	51.68	98,812.16
FORTIVE CORP	1,127	69.48	78,303.96
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	471	97.69	46,011.99
GENERAC HOLDINGS INC	208	392.62	81,664.96
GENERAL DYNAMICS CORP	818	188.11	153,873.98
GENERAL ELECTRIC CO	29,799	13.15	391,856.85
HEICO CORP	118	143.29	16,908.22
HEICO CORP-CLASS A	260	131.52	34,195.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,368	217.69	515,489.92
HOWMET AEROSPACE INC	1,484	34.58	51,316.72
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	144	211.07	30,394.08
IDEX CORP	247	218.80	54,043.60
ILLINOIS TOOL WORKS	1,072	222.56	238,584.32
INGERSOLL-RAND INC	1,378	47.64	65,647.92
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	700	63.93	44,751.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,423	66.58	161,323.34
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	728	219.65	159,905.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	330.64	35,709.12
LOCKHEED MARTIN CORP	856	377.73	323,336.88
MASCO CORP	825	57.60	47,520.00
NORDSON CORP	160	218.10	34,896.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	535	369.68	197,778.80
OTIS WORLDWIDE CORP	1,437	81.37	116,928.69

OWENS CORNING	390	97.00	37,830.00
PACCAR INC	1,237	88.48	109,449.76
PARKER HANNIFIN CORP	432	298.87	129,111.84
PENTAIR PLC	643	66.04	42,463.72
PLUG POWER INC	1,779	32.90	58,529.10
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	5,169	86.85	448,927.65
ROCKWELL AUTOMATION INC	394	285.51	112,490.94
ROPER TECHNOLOGIES INC	369	461.60	170,330.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	567	58.05	32,914.35
SMITH (A.O.) CORP	489	67.77	33,139.53
SNAP-ON INC	195	221.28	43,149.60
STANLEY BLACK & DECKER INC	561	202.59	113,652.99
SUNRUN INC	498	52.84	26,314.32
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	166	423.82	70,354.12
TEXTRON INC	733	66.70	48,891.10
TRANE TECHNOLOGIES PLC	801	179.84	144,051.84
TRANSDIGM GROUP INC	176	679.99	119,678.24
UNITED RENTALS INC	262	316.80	83,001.60
WABTEC CORP	579	83.47	48,329.13
WW GRAINGER INC	154	441.61	68,007.94
XYLEM INC	599	116.92	70,035.08
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	535	86.47	46,261.45
CINTAS CORP	334	377.80	126,185.20
CLARIVATE PLC	1,145	26.50	30,342.50
COPART INC	706	131.39	92,761.34
COSTAR GROUP INC	138	878.24	121,197.12
EQUIFAX INC	405	239.18	96,867.90
IHS MARKIT LTD	1,321	113.37	149,761.77
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	445	135.24	60,181.80
LEIDOS HOLDINGS INC	450	103.07	46,381.50
REPUBLIC SERVICES INC	815	108.33	88,288.95
ROBERT HALF INTL INC	413	89.34	36,897.42
ROLLINS INC	820	33.90	27,798.00
TRANSUNION	694	110.32	76,562.08
VERISK ANALYTICS INC	513	173.31	88,908.03
WASTE CONNECTIONS INC	905	120.11	108,699.55
WASTE MANAGEMENT INC	1,428	138.54	197,835.12
AMERCO	30	562.05	16,861.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	430	94.35	40,570.50
CSX CORP	2,581	95.15	245,582.15
DELTA AIR LINES INC	476	44.91	21,377.16
EXPEDITORS INTL WASH INC	579	125.05	72,403.95

FEDEX CORP	852	303.69	258,743.88
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	311	160.49	49,912.39
KANSAS CITY SOUTHERN	312	285.17	88,973.04
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	586	45.82	26,850.52
LYFT INC-A	892	61.78	55,107.76
NORFOLK SOUTHERN CORP	852	264.94	225,728.88
OLD DOMINION FREIGHT LINE	350	252.10	88,235.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	487	54.66	26,619.42
UBER TECHNOLOGIES INC	4,063	50.82	206,481.66
UNION PACIFIC CORP	2,280	218.47	498,111.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,448	206.10	504,532.80
XPO LOGISTICS INC	293	150.32	44,043.76
APTIV PLC	943	155.13	146,287.59
AUTOLIV INC	296	99.73	29,520.08
BORGWARNER INC	764	48.77	37,260.28
FORD MOTOR CO	13,186	15.26	201,218.36
GENERAL MOTORS CO	4,392	60.04	263,695.68
LEAR CORP	210	178.33	37,449.30
TESLA INC	2,623	679.82	1,783,167.86
DR HORTON INC	1,247	89.32	111,382.04
GARMIN LTD	505	143.04	72,235.20
HASBRO INC	417	93.18	38,856.06
LENNAR CORP-A	942	97.27	91,628.34
LULULEMON ATHLETICA INC	439	361.91	158,878.49
MOHAWK INDUSTRIES INC	222	190.22	42,228.84
NEWELL BRANDS INC	1,472	26.60	39,155.20
NIKE INC -CL B	4,330	133.60	578,488.00
NVR INC	12	4,818.45	57,821.40
PELOTON INTERACTIVE INC-A	832	121.85	101,379.20
PULTEGROUP INC	843	53.42	45,033.06
VF CORP	1,161	81.37	94,470.57
WHIRLPOOL CORP	214	214.75	45,956.50
AIRBNB INC-CLASS A	191	150.73	28,789.43
ARAMARK	824	38.51	31,732.24
BOOKING HOLDINGS INC	139	2,246.23	312,225.97
CAESARS ENTERTAINMENT INC	727	104.73	76,138.71
CARNIVAL CORP	2,814	27.46	77,272.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	94	1,489.22	139,986.68
DARDEN RESTAURANTS INC	456	139.85	63,771.60
DOMINO'S PIZZA INC	127	459.81	58,395.87
DRAFTKINGS INC - CL A	695	51.06	35,486.70
EXPEDIA GROUP INC	457	170.05	77,712.85

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	977	124.51	121,646.27
LAS VEGAS SANDS CORP	1,201	51.92	62,355.92
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	975	140.79	137,270.25
MCDONALD'S CORP	2,540	233.33	592,658.20
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,023	17.02	17,411.46
MGM RESORTS INTERNATIONAL	1,286	44.06	56,661.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	752	86.97	65,401.44
STARBUCKS CORP	4,004	111.99	448,407.96
VAIL RESORTS INC	129	324.74	41,891.46
WYNN RESORTS LTD	364	124.15	45,190.60
YUM! BRANDS INC	1,039	116.99	121,552.61
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,623	92.51	242,653.73
ALPHABET INC-CL A	1,028	2,450.00	2,518,600.00
ALPHABET INC-CL C	1,008	2,545.64	2,566,005.12
ALTICE USA INC- A	949	34.31	32,560.19
CABLE ONE INC	20	1,852.56	37,051.20
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	460	711.54	327,308.40
COMCAST CORP-CLASS A	15,595	56.06	874,255.70
DISCOVERY INC - A	476	30.32	14,432.32
DISCOVERY INC-C	1,167	28.65	33,434.55
DISH NETWORK CORP-A	889	41.19	36,617.91
ELECTRONIC ARTS INC	966	138.65	133,935.90
FACEBOOK INC-CLASS A	8,224	343.18	2,822,312.32
FOX CORP - CLASS A	1,301	38.30	49,828.30
FOX CORP - CLASS B	366	36.28	13,278.48
IAC/INTERACTIVECORP	252	152.10	38,329.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,436	32.55	46,741.80
LIBERTY BROADBAND-A	115	163.75	18,831.25
LIBERTY BROADBAND-C	536	169.02	90,594.72
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	410	46.49	19,060.90
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	472	46.01	21,716.72
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	757	48.29	36,555.53
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	525	91.99	48,294.75
MATCH GROUP INC	892	164.27	146,528.84
NETFLIX INC	1,510	518.06	782,270.60
NEWS CORP - CLASS A	1,451	25.57	37,102.07
OMNICOM GROUP	702	79.60	55,879.20
PINTEREST INC- CLASS A	1,889	76.28	144,092.92
ROKU INC	365	423.58	154,606.70
SEA LTD-ADR	52	289.42	15,049.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,870	6.41	24,806.70
SNAP INC - A	3,172	67.65	214,585.80

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	387	175.06	67,748.22
TWITTER INC	2,686	68.25	183,319.50
VIACOMCBS INC - CLASS B	2,005	42.87	85,954.35
WALT DISNEY CO/THE	6,197	177.93	1,102,632.21
ZILLOW GROUP INC - A	161	121.87	19,621.07
ZILLOW GROUP INC - C	582	121.18	70,526.76
ADVANCE AUTO PARTS INC	249	200.96	50,039.04
AMAZON.COM INC	1,464	3,449.08	5,049,453.12
AUTOZONE INC	80	1,454.55	116,364.00
BEST BUY CO INC	814	111.38	90,663.32
BURLINGTON STORES INC	218	322.61	70,328.98
CARMAX INC	562	119.43	67,119.66
CARVANA CO	255	304.51	77,650.05
CHEWY INC - CLASS A	308	80.62	24,830.96
DOLLAR GENERAL CORP	825	213.90	176,467.50
DOLLAR TREE INC	777	99.34	77,187.18
EBAY INC	2,405	66.57	160,100.85
ETSY INC	441	181.52	80,050.32
GENUINE PARTS CO	472	126.16	59,547.52
HOME DEPOT INC	3,675	311.84	1,146,012.00
L BRANDS INC	835	72.14	60,236.90
LKQ CORP	930	49.33	45,876.90
LOWE'S COS INC	2,487	191.75	476,882.25
MERCADOLIBRE INC	152	1,542.39	234,443.28
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	254	549.62	139,603.48
POOL CORP	141	459.03	64,723.23
ROSS STORES INC	1,196	123.17	147,311.32
TARGET CORP	1,702	239.84	408,207.68
TJX COMPANIES INC	4,066	66.97	272,300.02
TRACTOR SUPPLY COMPANY	430	180.96	77,812.80
ULTA BEAUTY INC	179	351.85	62,981.15
WAYFAIR INC- CLASS A	265	319.19	84,585.35
COSTCO WHOLESALE CORP	1,509	392.07	591,633.63
KROGER CO	2,538	39.15	99,362.70
SYSCO CORP	1,712	77.23	132,217.76
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,582	52.10	134,522.20
WALMART INC	5,306	136.91	726,444.46
ALTRIA GROUP INC	6,302	47.43	298,903.86
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,931	61.69	119,123.39
BOSTON BEER COMPANY INC-A	30	1,019.62	30,588.60
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,077	74.07	79,773.39
BUNGE LTD	526	80.29	42,232.54

CAMPBELL SOUP CO	679	45.20	30,690.80
COCA-COLA CO/THE	13,960	54.39	759,284.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	770	61.20	47,124.00
CONAGRA BRANDS INC	1,594	35.42	56,459.48
CONSTELLATION BRANDS INC-A	601	226.00	135,826.00
GENERAL MILLS INC	2,151	59.15	127,231.65
HERSHEY CO/THE	486	172.39	83,781.54
HORMEL FOODS CORP	959	47.40	45,456.60
JM SMUCKER CO/THE	397	128.57	51,042.29
KELLOGG CO	891	63.44	56,525.04
KEURIG DR PEPPER INC	2,495	34.59	86,302.05
KRAFT HEINZ CO/THE	2,366	40.37	95,515.42
LAMB WESTON HOLDINGS INC	467	80.03	37,374.01
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	915	86.28	78,946.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	706	54.96	38,801.76
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	4,789	62.65	300,030.85
MONSTER BEVERAGE CORP	1,404	90.14	126,556.56
PEPSICO INC	4,703	145.67	685,086.01
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,302	99.03	525,057.06
TYSON FOODS INC-CL A	994	74.28	73,834.32
CHURCH & DWIGHT CO INC	826	83.18	68,706.68
CLOROX COMPANY	427	172.46	73,640.42
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,725	80.56	219,526.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	777	308.70	239,859.90
KIMBERLY-CLARK CORP	1,136	131.07	148,895.52
PROCTER & GAMBLE CO/THE	8,407	133.02	1,118,299.14
ABBOTT LABORATORIES	6,037	111.70	674,332.90
ABIOMED INC	174	311.81	54,254.94
ALIGN TECHNOLOGY INC	266	617.39	164,225.74
AMERISOURCEBERGEN CORP	570	115.48	65,823.60
ANTHEM INC	831	378.33	314,392.23
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,695	81.40	137,973.00
BECTON DICKINSON AND CO	983	239.82	235,743.06
BOSTON SCIENTIFIC CORP	4,784	43.71	209,108.64
CARDINAL HEALTH INC	959	56.19	53,886.21
CENTENE CORP	2,057	72.80	149,749.60
CERNER CORP	1,014	78.28	79,375.92
CIGNA CORP	1,192	234.77	279,845.84
COOPER COS INC/THE	180	390.61	70,309.80
CVS HEALTH CORP	4,455	83.77	373,195.35
DANAHER CORP	2,182	267.35	583,357.70
DAVITA INC	240	121.33	29,119.20



DENTSPLY SIRONA INC	737	63.77	46,998.49
DEXCOM INC	322	425.00	136,850.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,110	103.80	219,018.00
HCA HEALTHCARE INC	917	204.43	187,462.31
HENRY SCHEIN INC	543	75.14	40,801.02
HOLOGIC INC	857	65.00	55,705.00
HUMANA INC	434	440.73	191,276.82
IDEXX LABORATORIES INC	301	614.93	185,093.93
INSULET CORP	216	277.04	59,840.64
INTUITIVE SURGICAL INC	400	904.57	361,828.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	334	264.99	88,506.66
MASIMO CORP	196	241.53	47,339.88
MCKESSON CORP	564	188.98	106,584.72
MEDTRONIC PLC	4,589	125.09	574,038.01
MOLINA HEALTHCARE INC	200	249.66	49,932.00
NOVOCURE LTD	303	223.69	67,778.07
OAK STREET HEALTH INC	300	60.31	18,093.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	460	129.19	59,427.40
RESMED INC	486	245.97	119,541.42
STERIS PLC	284	204.13	57,972.92
STRYKER CORP	1,148	261.39	300,075.72
TELADOC HEALTH INC	476	163.27	77,716.52
TELEFLEX INC	161	400.82	64,532.02
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,240	398.87	1,292,338.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	249	149.42	37,205.58
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	468	312.00	146,016.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	263	359.54	94,559.02
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	709	164.39	116,552.51
10X GENOMICS INC-CLASS A	251	194.11	48,721.61
ABBVIE INC	6,019	114.74	690,620.06
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,081	146.67	158,550.27
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	771	180.72	139,335.12
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	384	173.68	66,693.12
AMGEN INC	1,965	240.95	473,466.75
AVANTOR INC	1,705	35.16	59,947.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	84	631.90	53,079.60
BIO-TECHNE CORP	136	439.51	59,773.36
BIOGEN INC	514	349.16	179,468.24
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	588	83.78	49,262.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	7,626	65.85	502,172.10
CATALENT INC	615	109.26	67,194.90
CHARLES RIVER LABORATORIES	175	366.78	64,186.50

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	1,613	34.99	56,438.87
ELI LILLY & CO	2,776	232.97	646,724.72
EXACT SCIENCES CORP	551	128.49	70,797.99
GILEAD SCIENCES INC	4,259	67.18	286,119.62
HORIZON THERAPEUTICS PLC	730	94.32	68,853.60
ILLUMINA INC	493	468.07	230,758.51
INCYTE CORP	621	86.13	53,486.73
IQVIA HOLDINGS INC	673	240.89	162,118.97
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	206	178.80	36,832.80
JOHNSON & JOHNSON	8,979	163.37	1,466,899.23
MERCK & CO. INC.	8,623	76.36	658,452.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	81	1,355.41	109,788.21
MODERNA INC	1,070	220.14	235,549.80
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	329	100.58	33,090.82
NOVAVAX INC	227	192.48	43,692.96
PERKINELMER INC	364	151.55	55,164.20
PFIZER INC	19,018	39.19	745,315.42
PPD INC	498	46.21	23,012.58
REGENERON PHARMACEUTICALS	371	544.45	201,990.95
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	548	43.03	23,580.44
SEAGEN INC	490	157.40	77,126.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,500	10.42	36,470.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,342	495.36	664,773.12
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	910	191.94	174,665.40
VIATRIS INC	4,035	14.36	57,942.60
WATERS CORP	205	344.58	70,638.90
ZOETIS INC	1,611	185.38	298,647.18
BANK OF AMERICA CORP	26,523	40.83	1,082,934.09
CITIGROUP INC	7,088	71.32	505,516.16
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,486	46.56	69,188.16
FIFTH THIRD BANCORP	2,478	38.59	95,626.02
FIRST REPUBLIC BANK/CA	610	185.19	112,965.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	5,278	14.22	75,053.16
JPMORGAN CHASE & CO	10,425	152.51	1,589,916.75
KEYCORP	3,396	20.94	71,112.24
M & T BANK CORP	470	147.85	69,489.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,435	189.18	271,473.30
REGIONS FINANCIAL CORP	3,374	20.32	68,559.68
SVB FINANCIAL GROUP	172	561.04	96,498.88
TRUIST FINANCIAL CORP	4,561	55.32	252,314.52
US BANCORP	4,836	56.88	275,071.68
WELLS FARGO & CO	14,086	45.18	636,405.48

AGNC INVESTMENT CORP	1,778	17.15	30,492.70
ALLY FINANCIAL INC	1,306	50.76	66,292.56
AMERICAN EXPRESS CO	2,326	168.21	391,256.46
AMERIPRISE FINANCIAL INC	389	245.44	95,476.16
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	4,672	9.20	42,982.40
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	619	59.12	36,595.28
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,801	50.25	140,750.25
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	4,682	275.49	1,289,844.18
BLACKROCK INC	519	867.34	450,149.46
BLACKSTONE GROUP INC/THE	2,311	99.62	230,221.82
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,554	157.57	244,863.78
CARLYLE GROUP INC/THE	437	46.29	20,228.73
CBOE GLOBAL MARKETS INC	418	121.13	50,632.34
CME GROUP INC	1,216	216.98	263,847.68
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,026	120.63	123,766.38
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,454	30.51	44,361.54
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	121	330.63	40,006.23
FRANKLIN RESOURCES INC	1,050	32.53	34,156.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	110	168.11	18,492.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,176	368.75	433,650.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	1,898	118.09	224,134.82
INVESCO LTD	1,407	27.20	38,270.40
KKR & CO INC	1,725	60.13	103,724.25
MARKETAXESS HOLDINGS INC	132	461.06	60,859.92
MOODY'S CORP	568	361.97	205,598.96
MORGAN STANLEY	4,800	87.08	417,984.00
MSCI INC	293	533.08	156,192.44
NASDAQ INC	379	177.80	67,386.20
NORTHERN TRUST CORP	661	114.32	75,565.52
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	417	131.52	54,843.84
S&P GLOBAL INC	817	411.18	335,934.06
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,898	73.39	359,464.22
SEI INVESTMENTS COMPANY	448	61.37	27,493.76
STATE STREET CORP	1,213	81.86	99,296.18
SYNCHRONY FINANCIAL	2,020	49.00	98,980.00
T ROWE PRICE GROUP INC	801	195.14	156,307.14
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	383	83.65	32,037.95
VOYA FINANCIAL INC	481	61.10	29,389.10
AFLAC INC	2,317	53.16	123,171.72
ALLEGHANY CORP	53	669.26	35,470.78
ALLSTATE CORP	1,078	128.93	138,986.54
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	221	125.52	27,739.92

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,012	48.21	145,208.52
AON PLC-CLASS A	762	238.48	181,721.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,321	38.84	51,307.64
ARTHUR J GALLAGHER & CO	659	140.34	92,484.06
ASSURANT INC	220	155.48	34,205.60
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	488	64.38	31,417.44
BROWN & BROWN INC	767	53.22	40,819.74
CHUBB LTD	1,524	161.20	245,668.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	523	117.75	61,583.25
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	72	192.24	13,841.28
EVEREST RE GROUP LTD	158	252.61	39,912.38
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	1,070	43.99	47,069.30
GLOBE LIFE INC	309	96.30	29,756.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,234	62.21	76,767.14
LINCOLN NATIONAL CORP	582	63.28	36,828.96
LOEWS CORP	837	55.12	46,135.44
MARKEL CORP	45	1,173.98	52,829.10
MARSH & MCLENNAN COS	1,719	138.15	237,479.85
METLIFE INC	2,577	60.01	154,645.77
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	928	62.92	58,389.76
PROGRESSIVE CORP	1,974	95.69	188,892.06
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,332	102.51	136,543.32
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	247	117.02	28,903.94
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	190	148.39	28,194.10
TRAVELERS COS INC/THE	901	149.97	135,122.97
WILLIS TOWERS WATSON PLC	456	232.55	106,042.80
WR BERKLEY CORP	449	73.93	33,194.57
CBRE GROUP INC - A	1,135	87.72	99,562.20
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	4,700	4.82	22,654.00
ACCENTURE PLC-CL A	2,161	291.56	630,061.16
ADOBE INC	1,633	578.26	944,298.58
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	562	115.83	65,096.46
ANSYS INC	306	341.55	104,514.30
AUTODESK INC	743	286.96	213,211.28
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,451	196.08	284,512.08
AVALARA INC	262	162.72	42,632.64
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	600	61.84	37,104.00
BLACK KNIGHT INC	500	77.07	38,535.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	398	160.32	63,807.36
CADENCE DESIGN SYS INC	933	135.02	125,973.66
CERIDIAN HCM HOLDING INC	426	97.00	41,322.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	368	116.59	42,905.12

CITRIX SYSTEMS INC	465	114.52	53,251.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	812	104.57	84,910.84
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,898	69.82	132,518.36
COUPA SOFTWARE INC	265	254.52	67,447.80
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	619	253.70	157,040.30
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	113	134.64	15,214.32
DATADOG INC - CLASS A	620	106.44	65,992.80
DOCUSIGN INC	628	276.72	173,780.16
DROPBOX INC-CLASS A	1,147	29.84	34,226.48
DYNATRACE INC	723	59.66	43,134.18
EPAM SYSTEMS INC	193	518.53	100,076.29
FAIR ISAAC CORP	111	501.01	55,612.11
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	2,107	145.76	307,116.32
FISERV INC	2,036	108.50	220,906.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	271	256.63	69,546.73
FORTINET INC	484	239.99	116,155.16
GARTNER INC	304	238.27	72,434.08
GLOBAL PAYMENTS INC	996	191.51	190,743.96
GODADDY INC - CLASS A	548	86.02	47,138.96
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	314	113.95	35,780.30
HUBSPOT INC	161	588.29	94,714.69
INTL BUSINESS MACHINES CORP	3,040	145.44	442,137.60
INTUIT INC	931	482.62	449,319.22
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	243	164.45	39,961.35
MASTERCARD INC - A	3,027	374.75	1,134,368.25
MICROSOFT CORP	24,511	266.69	6,536,838.59
MONGODB INC	178	382.63	68,108.14
NORTONLIFELOCK INC	2,150	27.36	58,824.00
OKTA INC	423	244.98	103,626.54
ORACLE CORP	6,515	77.74	506,476.10
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,900	26.53	50,407.00
PALO ALTO NETWORKS INC	334	372.60	124,448.40
PAYCHEX INC	1,118	104.28	116,585.04
PAYCOM SOFTWARE INC	171	367.35	62,816.85
PAYPAL HOLDINGS INC	3,798	293.21	1,113,611.58
PTC INC	359	137.74	49,448.66
RINGCENTRAL INC-CLASS A	262	302.80	79,333.60
SALESFORCE.COM INC	3,129	243.77	762,756.33
SERVICENOW INC	666	552.07	367,678.62
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	1,645	44.21	72,725.45
SNOWFLAKE INC-CLASS A	75	251.25	18,843.75
SPLUNK INC	594	139.73	82,999.62

SQUARE INC - A	1,322	244.15	322,766.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	756	72.81	55,044.36
SYNOPSYS INC	511	273.80	139,911.80
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,500	75.88	113,820.00
TWILIO INC - A	540	386.56	208,742.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	132	446.05	58,878.60
UNITY SOFTWARE INC	200	113.76	22,752.00
VERISIGN INC	336	229.43	77,088.48
VISA INC-CLASS A SHARES	5,793	236.24	1,368,538.32
VMWARE INC-CLASS A	270	155.82	42,071.40
WESTERN UNION CO	1,554	23.27	36,161.58
WIX.COM LTD	202	305.00	61,610.00
WORKDAY INC-CLASS A	629	241.71	152,035.59
ZENDESK INC	390	147.76	57,626.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	693	373.40	258,766.20
ZSCALER INC	257	219.64	56,447.48
AMPHENOL CORP-CL A	2,111	68.04	143,632.44
APPLE INC	57,433	133.41	7,662,136.53
ARISTA NETWORKS INC	198	363.50	71,973.00
ARROW ELECTRONICS INC	284	112.87	32,055.08
CDW CORP/DE	479	170.29	81,568.91
CISCO SYSTEMS INC	14,397	52.78	759,873.66
COGNEX CORP	659	82.02	54,051.18
CORNING INC	2,562	41.00	105,042.00
DELL TECHNOLOGIES -C	875	99.08	86,695.00
F5 NETWORKS INC	234	187.47	43,867.98
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	4,505	14.62	65,863.10
HP INC	4,430	29.47	130,552.10
IPG PHOTONICS CORP	132	210.75	27,819.00
JUNIPER NETWORKS INC	1,175	27.33	32,112.75
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	657	152.66	100,297.62
MOTOROLA SOLUTIONS INC	590	214.56	126,590.40
NETAPP INC	768	80.99	62,200.32
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	699	86.39	60,386.61
TE CONNECTIVITY LTD	1,166	133.64	155,824.24
TRIMBLE INC	901	80.49	72,521.49
WESTERN DIGITAL CORP	1,010	69.79	70,487.90
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	188	510.39	95,953.32
AT&T INC	24,311	28.79	699,913.69
LIBERTY GLOBAL PLC- C	1,190	27.77	33,046.30
LIBERTY GLOBAL PLC-A	662	27.87	18,449.94
LUMEN TECHNOLOGIES INC	3,562	13.95	49,689.90

T-MOBILE US INC	2,107	145.60	306,779.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	14,113	56.37	795,549.81
AES CORP	2,391	25.97	62,094.27
ALLIANT ENERGY CORP	878	56.42	49,536.76
AMEREN CORPORATION	903	81.25	73,368.75
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,754	82.85	145,318.90
AMERICAN WATER WORKS CO INC	654	154.76	101,213.04
ATMOS ENERGY CORP	413	97.46	40,250.98
CENTERPOINT ENERGY INC	2,017	24.51	49,436.67
CMS ENERGY CORP	966	59.10	57,090.60
CONSOLIDATED EDISON INC	1,229	73.43	90,245.47
DOMINION ENERGY INC	2,721	74.61	203,013.81
DTE ENERGY COMPANY	643	130.23	83,737.89
DUKE ENERGY CORP	2,673	99.07	264,814.11
EDISON INTERNATIONAL	1,287	55.28	71,145.36
ENERGY CORP	718	100.96	72,489.28
ESSENTIAL UTILITIES INC	761	46.15	35,120.15
EVERGY INC	762	61.38	46,771.56
EVERSOURCE ENERGY	1,153	79.28	91,409.84
EXELON CORP	3,282	44.24	145,195.68
FIRSTENERGY CORP	1,894	37.18	70,418.92
NEXTERA ENERGY INC	6,669	72.88	486,036.72
NISOURCE INC	1,390	24.84	34,527.60
NRG ENERGY INC	899	37.53	33,739.47
P G & E CORP	5,031	10.00	50,310.00
PINNACLE WEST CAPITAL	441	81.51	35,945.91
PPL CORP	2,536	27.93	70,830.48
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,782	59.37	105,797.34
SEMPRA ENERGY	1,065	135.55	144,360.75
SOUTHERN CO/THE	3,572	60.98	217,820.56
UGI CORP	748	46.83	35,028.84
VISTRA CORP	1,625	18.25	29,656.25
WEC ENERGY GROUP INC	1,049	89.08	93,444.92
XCEL ENERGY INC	1,868	66.26	123,773.68
ADVANCED MICRO DEVICES	4,111	86.10	353,957.10
ANALOG DEVICES INC	1,246	167.04	208,131.84
APPLIED MATERIALS INC	3,120	138.26	431,371.20
BROADCOM INC	1,391	470.06	653,853.46
ENPHASE ENERGY INC	419	170.77	71,552.63
INTEL CORP	13,857	56.07	776,961.99
KLA CORP	519	315.89	163,946.91
LAM RESEARCH CORP	485	635.02	307,984.70

	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,687	56.14	150,848.18
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	890	102.53	91,251.70
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	904	149.12	134,804.48
	MICRON TECHNOLOGY INC	3,794	80.58	305,720.52
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	144	359.35	51,746.40
	NVIDIA CORP	2,115	768.22	1,624,785.30
	NXP SEMICONDUCTORS NV	934	203.83	190,377.22
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,411	37.76	53,279.36
	QORVO INC	375	182.89	68,583.75
	QUALCOMM INC	3,867	137.92	533,336.64
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	589	177.79	104,718.31
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	165	267.28	44,101.20
	TERADYNE INC	552	130.61	72,096.72
	TEXAS INSTRUMENTS INC	3,135	188.61	591,292.35
	XILINX INC	818	133.71	109,374.78
	アメリカドル 小計	1,091,322		129,303,070.23 (14,351,347,764)
カナダドル	CAMECO CORP	1,200	24.67	29,604.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	4,000	44.91	179,640.00
	CENOVUS ENERGY INC	4,900	12.08	59,192.00
	ENBRIDGE INC	6,900	49.40	340,860.00
	IMPERIAL OIL LTD	800	39.98	31,984.00
	INTER PIPELINE LTD	1,500	20.57	30,855.00
	KEYERA CORP	700	33.30	23,310.00
	PARKLAND CORP	400	39.04	15,616.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,757	40.24	70,701.68
	SUNCOR ENERGY INC	5,400	30.67	165,618.00
	TC ENERGY CORP	3,300	63.02	207,966.00
	AGNICO EAGLE MINES LTD	800	77.12	61,696.00
	B2GOLD CORP	4,100	5.36	21,976.00
	BARRICK GOLD CORP	6,200	25.86	160,332.00
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	500	69.49	34,745.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,000	28.18	56,360.00
	FRANCO-NEVADA CORP	600	178.92	107,352.00
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,800	8.54	15,372.00
	KINROSS GOLD CORP	4,000	7.97	31,880.00
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	900	49.15	44,235.00
	LUNDIN MINING CORP	2,000	11.06	22,120.00
	NUTRIEN LTD	1,888	75.07	141,732.16
	PAN AMERICAN SILVER CORP	600	35.30	21,180.00
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,800	27.97	50,346.00
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	300	88.03	26,409.00



WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,500	54.19	81,285.00
YAMANA GOLD INC	2,700	5.36	14,472.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	800	22.07	17,656.00
CAE INC	900	39.08	35,172.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	300	106.96	32,088.00
WSP GLOBAL INC	400	145.18	58,072.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	500	39.13	19,565.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	300	75.39	22,617.00
THOMSON REUTERS CORP	623	120.38	74,996.74
AIR CANADA	700	26.38	18,466.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,400	130.55	313,320.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,300	93.96	216,108.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	1,000	116.70	116,700.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	600	45.25	27,150.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	980	80.21	78,605.80
QUEBECOR INC -CL B	400	32.25	12,900.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,500	35.40	53,100.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	200	195.64	39,128.00
DOLLARAMA INC	1,000	56.92	56,920.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	3,000	43.44	130,320.00
EMPIRE CO LTD 'A'	500	39.32	19,660.00
LOBLAW COMPANIES LTD	500	76.29	38,145.00
METRO INC/CN	800	59.14	47,312.00
WESTON (GEORGE) LTD	316	117.16	37,022.56
SAPUTO INC	1,000	36.67	36,670.00
BAUSCH HEALTH COS INC	1,000	36.68	36,680.00
CANOPY GROWTH CORP	700	30.55	21,385.00
BANK OF MONTREAL	2,200	127.76	281,072.00
BANK OF NOVA SCOTIA	4,100	80.24	328,984.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,500	146.00	219,000.00
NATIONAL BANK OF CANADA	1,200	93.71	112,452.00
ROYAL BANK OF CANADA	4,800	125.71	603,408.00
TORONTO-DOMINION BANK	6,200	87.17	540,454.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	4,300	63.66	273,738.00
IGM FINANCIAL INC	400	45.16	18,064.00
ONEX CORPORATION	200	92.16	18,432.00
TMX GROUP LTD	200	132.54	26,508.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	100	550.55	55,055.00
GREAT-WEST LIFECO INC	800	36.87	29,496.00
IA FINANCIAL CORP INC	400	68.64	27,456.00
INTACT FINANCIAL CORP	500	168.98	84,490.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	6,700	24.18	162,006.00

	POWER CORP OF CANADA	1,800	40.24	72,432.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,100	63.04	132,384.00	
	FIRSTSERVICE CORP	100	214.47	21,447.00	
	BLACKBERRY LTD	1,600	15.65	25,040.00	
	CGI INC	800	111.89	89,512.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	75	1,878.50	140,887.50	
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	300	104.39	31,317.00	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	200	99.68	19,936.00	
	OPEN TEXT CORP	800	62.45	49,960.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	400	1,822.84	729,136.00	
	BCE INC	100	60.69	6,069.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1,100	64.58	71,038.00	
	TELUS CORP	1,100	27.54	30,294.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,900	18.78	35,682.00	
	ALTAGAS LTD	800	26.27	21,016.00	
	ATCO LTD -CLASS I	400	45.09	18,036.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	500	48.12	24,060.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	600	35.24	21,144.00	
	EMERA INC	800	56.64	45,312.00	
	FORTIS INC	1,700	56.12	95,404.00	
	HYDRO ONE LTD	1,000	30.28	30,280.00	
	NORTHLAND POWER INC	800	41.00	32,800.00	
	カナダドル 小計	137,839		8,130,399.44	(731,898,557)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	741	28.24	20,925.84	
	OIL SEARCH LTD	5,902	3.78	22,309.56	
	SANTOS LTD	5,792	7.21	41,760.32	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	506	32.50	16,445.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	3,140	22.58	70,901.20	
	BHP GROUP LTD	10,008	47.60	476,380.80	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,464	21.69	31,754.16	
	EVOLUTION MINING LTD	5,134	4.66	23,924.44	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	5,893	22.74	134,006.82	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,503	45.84	68,897.52	
	NEWCREST MINING LTD	2,762	25.72	71,038.64	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,289	9.93	42,589.77	
	ORICA LTD	1,899	13.20	25,066.80	
	RIO TINTO LTD	1,294	124.36	160,921.84	
	SOUTH32 LTD	17,826	2.91	51,873.66	
	REECE LTD	1,100	23.20	25,520.00	
	BRAMBLES LTD	5,498	11.07	60,862.86	
AURIZON HOLDINGS LTD	5,283	3.70	19,547.10		

QANTAS AIRWAYS LTD	3,418	4.63	15,825.34
SYDNEY AIRPORT	5,184	5.78	29,963.52
TRANSURBAN GROUP	9,462	14.51	137,293.62
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,061	42.51	87,613.11
CROWN RESORTS LTD	1,748	11.99	20,958.52
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	216	117.04	25,280.64
TABCORP HOLDINGS LTD	7,081	5.17	36,608.77
REA GROUP LTD	142	166.82	23,688.44
SEEK LTD	963	32.83	31,615.29
WESFARMERS LTD	3,814	57.70	220,067.80
COLES GROUP LTD	4,931	16.80	82,840.80
WOOLWORTHS GROUP LTD	4,419	37.75	166,817.25
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	4,419	6.02	26,602.38
TREASURY WINE ESTATES LTD	2,286	11.77	26,906.22
COCHLEAR LTD	239	244.95	58,543.05
RAMSAY HEALTH CARE LTD	639	63.60	40,640.40
SONIC HEALTHCARE LTD	1,530	37.39	57,206.70
CSL LTD	1,545	286.61	442,812.45
AUST AND NZ BANKING GROUP	10,005	28.04	280,540.20
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	6,036	98.65	595,451.40
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	11,570	26.09	301,861.30
WESTPAC BANKING CORP	12,417	25.83	320,731.11
ASX LTD	641	78.53	50,337.73
MACQUARIE GROUP LTD	1,180	152.45	179,891.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	598	52.77	31,556.46
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	7,742	5.05	39,097.10
MEDIBANK PRIVATE LTD	8,517	3.14	26,743.38
QBE INSURANCE GROUP LTD	5,377	10.99	59,093.23
SUNCORP GROUP LTD	4,699	10.90	51,219.10
LENDLEASE GROUP	2,085	12.02	25,061.70
AFTERPAY LTD	743	130.50	96,961.50
COMPUTERSHARE LTD	2,002	17.02	34,074.04
WISETECH GLOBAL LTD	671	32.28	21,659.88
XERO LTD	450	137.94	62,073.00
TELSTRA CORP LTD	14,025	3.58	50,209.50
AGL ENERGY LTD	2,638	9.01	23,768.38
APA GROUP	3,769	9.16	34,524.04
AUSNET SERVICES	8,746	1.74	15,218.04
ORIGIN ENERGY LTD	6,617	4.68	30,967.56
オーストラリアドル 小計	244,659		5,227,050.28 (439,804,010)
イギリスポンド BP PLC	69,035	3.24	223,880.50

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	13,900	14.82	206,081.40
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	12,542	14.34	179,852.28
ANGLO AMERICAN PLC	4,550	29.24	133,042.00
ANTOFAGASTA PLC	1,057	14.38	15,199.66
BHP GROUP PLC	7,136	21.15	150,926.40
CRODA INTERNATIONAL PLC	450	72.18	32,481.00
EVRAZ PLC	2,373	5.98	14,190.54
GLENCORE PLC	35,139	3.14	110,389.16
JOHNSON MATTHEY PLC	520	30.98	16,109.60
MONDI PLC	1,655	18.91	31,304.32
RIO TINTO PLC	3,808	60.00	228,480.00
ASHTED GROUP PLC	1,499	53.00	79,447.00
BAE SYSTEMS PLC	10,941	5.33	58,381.17
BUNZL PLC	1,267	24.00	30,408.00
DCC PLC	310	58.84	18,240.40
FERGUSON PLC	810	99.02	80,206.20
MELROSE INDUSTRIES PLC	18,928	1.54	29,272.15
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	26,792	1.07	28,876.41
SMITHS GROUP PLC	1,451	15.94	23,136.19
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	237	135.40	32,089.80
EXPERIAN PLC	3,066	28.22	86,522.52
INTERTEK GROUP PLC	566	55.92	31,650.72
RELX PLC	6,510	19.52	127,107.75
RENTOKIL INITIAL PLC	6,202	4.94	30,687.49
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	3,809	7.02	26,769.65
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	458	46.69	21,384.02
BURBERRY GROUP PLC	1,495	22.45	33,562.75
PERSIMMON PLC	1,000	29.56	29,560.00
TAYLOR WIMPEY PLC	13,119	1.61	21,226.54
COMPASS GROUP PLC	6,192	15.40	95,387.76
ENTAIN PLC	1,876	18.48	34,668.48
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	609	50.42	30,705.78
WHITBREAD PLC	741	32.50	24,082.50
AUTO TRADER GROUP PLC	2,760	6.47	17,873.76
INFORMA PLC	5,746	5.05	29,051.77
PEARSON PLC	2,588	8.35	21,609.80
WPP PLC	3,996	9.79	39,144.81
JD SPORTS FASHION PLC	2,049	9.12	18,699.17
KINGFISHER PLC	7,715	3.61	27,905.15
NEXT PLC	452	78.90	35,662.80
OCADO GROUP PLC	1,781	19.82	35,308.32
SAINSBURY (J) PLC	4,929	2.72	13,431.52

TESCO PLC	26,404	2.23	58,973.33
WM MORRISON SUPERMARKETS	8,805	2.33	20,586.09
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,341	22.42	30,065.22
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	7,388	27.71	204,721.48
COCA-COLA HBC AG-DI	649	26.76	17,367.24
DIAGEO PLC	7,950	34.88	277,335.75
IMPERIAL BRANDS PLC	3,278	15.61	51,169.58
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,409	64.43	155,211.87
UNILEVER PLC	8,952	42.48	380,325.72
SMITH & NEPHEW PLC	3,236	15.58	50,416.88
ASTRAZENECA PLC	4,469	84.15	376,066.35
GLAXOSMITHKLINE PLC	17,077	14.11	240,956.47
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	677	23.83	16,132.91
BARCLAYS PLC	58,310	1.74	101,692.64
HSBC HOLDINGS PLC	69,258	4.24	294,069.46
LLOYDS BANKING GROUP PLC	249,195	0.47	117,607.58
NATWEST GROUP PLC	18,618	2.09	38,911.62
STANDARD CHARTERED PLC	9,072	4.65	42,193.87
3I GROUP PLC	3,378	11.82	39,944.85
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,216	15.95	19,401.28
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,086	81.82	88,856.52
M&G PLC	8,628	2.41	20,802.10
SCHRODERS PLC	394	35.33	13,920.02
ST JAMES'S PLACE PLC	1,927	14.97	28,847.19
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	8,583	2.76	23,706.24
ADMIRAL GROUP PLC	677	32.17	21,779.09
AVIVA PLC	13,288	4.14	55,105.33
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	3,956	2.90	11,496.13
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	21,453	2.63	56,485.74
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,244	6.65	14,940.55
PRUDENTIAL PLC	8,797	14.43	126,940.71
AVEVA GROUP PLC	303	36.88	11,174.64
SAGE GROUP PLC/THE	3,616	6.88	24,878.08
HALMA PLC	1,333	27.23	36,297.59
BT GROUP PLC	31,043	2.02	62,924.16
VODAFONE GROUP PLC	90,312	1.25	113,160.93
NATIONAL GRID PLC	11,931	9.23	110,230.50
SEVERN TRENT PLC	862	25.09	21,627.58
SSE PLC	3,623	15.16	54,924.68
UNITED UTILITIES GROUP PLC	2,507	9.90	24,824.31
イギリスポンド 小計	1,010,304		6,010,069.52 (928,435,539)

スイスフラン	CLARIANT AG-REG	934	19.10	17,844.07
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	26	901.00	23,426.00
	GIVAUDAN-REG	31	4,377.00	135,687.00
	HOLCIM LTD	1,747	56.26	98,286.22
	SIKA AG-REG	497	303.60	150,889.20
	ABB LTD-REG	6,099	31.40	191,508.60
	GEBERIT AG-REG	123	699.60	86,050.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	63	268.40	16,909.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	157	279.00	43,803.00
	ADECCO GROUP AG-REG	526	62.76	33,011.76
	SGS SA-REG	20	2,874.00	57,480.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	177	317.50	56,197.50
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1,765	114.20	201,563.00
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	113	322.60	36,453.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	226	62.05	14,023.30
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	12	2,174.00	26,088.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	9,215.00	9,215.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	96,900.00	96,900.00
	NESTLE SA-REG	9,838	116.00	1,141,208.00
	ALCON INC	1,671	64.58	107,913.18
	SONOVA HOLDING AG-REG	198	341.70	67,656.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	34	1,479.50	50,303.00
	LONZA GROUP AG-REG	260	663.80	172,588.00
	NOVARTIS AG-REG	7,569	85.08	643,970.52
	ROCHE HOLDING AG-BR	85	372.00	31,620.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2,426	343.05	832,239.30
	VIFOR PHARMA AG	134	127.70	17,111.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	141	81.20	11,449.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	8,114	9.66	78,446.15
	JULIUS BAER GROUP LTD	762	61.08	46,542.96
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	80	1,401.50	112,120.00
	UBS GROUP AG-REG	12,375	14.32	177,210.00
BALOISE HOLDING AG - REG	162	146.10	23,668.20	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	112	461.70	51,710.40	
SWISS RE AG	1,074	85.08	91,375.92	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	508	375.70	190,855.60	
SWISS PRIME SITE-REG	214	93.25	19,955.50	
TEMENOS AG - REG	223	152.70	34,052.10	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	575	115.65	66,498.75	
SWISSCOM AG-REG	89	527.40	46,938.60	
スイスフラン 小計	59,162		5,310,770.23 (642,178,336)	

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	9,332	61.35	572,518.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	5,000	132.30	661,500.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	6,000	32.10	192,600.00	
	MTR CORP	5,000	42.90	214,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	8,000	60.65	485,200.00	
	SANDS CHINA LTD	9,200	33.50	308,200.00	
	SJM HOLDINGS LTD	9,000	8.26	74,340.00	
	WYNN MACAU LTD	7,200	12.72	91,584.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	5,600	16.98	95,088.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	5,300	24.50	129,850.00	
	WH GROUP LTD	35,500	6.94	246,370.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	6,240	15.06	93,974.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	13,000	26.60	345,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	2,900	153.90	446,310.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	4,100	459.60	1,884,360.00	
	AIA GROUP LTD	41,200	97.15	4,002,580.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	6,332	53.30	337,495.60	
	ESR CAYMAN LTD	6,400	25.40	162,560.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	9,000	19.42	174,780.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	6,118	37.40	228,813.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	6,250	40.95	255,937.50	
	SINO LAND CO	13,000	12.80	166,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,500	118.00	531,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	1,000	56.60	56,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,400	23.65	127,710.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	45.50	227,500.00	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	13,000	10.60	137,800.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	47.40	142,200.00		
CLP HOLDINGS LTD	5,500	77.60	426,800.00		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	12,500	7.87	98,375.00		
HONG KONG & CHINA GAS	39,474	12.22	482,372.28		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	4,000	48.55	194,200.00		
	香港ドル 小計	313,046		13,595,318.18	(194,413,049)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	4,400	5.11	22,484.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	5,100	3.90	19,890.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,900	4.96	19,344.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	12,300	0.86	10,639.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	7,500	4.53	33,975.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	6,400	29.50	188,800.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	11,200	11.81	132,272.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	4,300	25.67	110,381.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,600	11.07	28,782.00	
	CAPITALAND LTD	8,400	3.72	31,248.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,100	7.41	15,561.00	
	UOL GROUP LTD	2,200	7.34	16,148.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	18.42	23,946.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	28,000	2.31	64,680.00	
	シンガポールドル 小計	99,700		718,150.50	(59,369,501)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	4,213	7.35	30,965.55	
	A2 MILK CO LTD	3,140	6.56	20,598.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,959	31.85	62,394.15	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,872	12.96	24,261.12	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	6,556	4.74	31,108.22	
	MERCURY NZ LTD	3,187	6.50	20,731.43	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,652	5.21	19,026.92	
	ニュージーランドドル 小計	24,579		209,085.79	(16,386,053)
スウェーデンクローネ	LUNDIN ENERGY AB	641	311.00	199,351.00	
	BOLIDEN AB	1,052	323.00	339,796.00	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	2,306	137.60	317,305.60	
	ALFA LAVAL AB	1,129	302.70	341,748.30	
	ASSA ABLOY AB-B	3,341	268.20	896,056.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	2,253	523.20	1,178,769.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	1,327	449.60	596,619.20	
	EPIROC AB-A	2,203	192.25	423,526.75	
	EPIROC AB-B	1,481	167.35	247,845.35	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	423	276.30	116,874.90	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,632	90.04	417,065.28	
	SANDVIK AB	3,852	216.20	832,802.40	
	SKANSKA AB-B SHS	1,243	228.00	283,404.00	
	SKF AB-B SHARES	1,200	216.60	259,920.00	
	VOLVO AB-A SHS	621	222.00	137,862.00	
	VOLVO AB-B SHS	5,065	215.55	1,091,760.75	
	SECURITAS AB-B SHS	897	131.50	117,955.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	826	235.90	194,853.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,684	113.80	191,639.20	
	EVOLUTION AB	567	1,477.40	837,685.80	
	EMBRACER GROUP AB	900	228.20	205,380.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,508	201.70	505,863.60		
ZALANDO SE	189	749.58	141,671.86		
ICA GRUPPEN AB	258	388.40	100,207.20		
SWEDISH MATCH AB	5,501	74.60	410,374.60		



	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,003	278.70	558,236.10
	NORDEA BANK ABP	11,083	95.69	1,060,532.27
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	5,960	113.50	676,460.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	5,052	98.32	496,712.64
	SWEDBANK AB - A SHARES	3,191	161.30	514,708.30
	EQT AB	802	317.00	254,234.00
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	436	331.20	144,403.20
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	544	311.20	169,292.80
	INVESTOR AB-B SHS	6,412	197.10	1,263,805.20
	KINNEVIK AB - B	967	328.80	317,949.60
	LUNDBERGS AB-B SHS	218	542.40	118,243.20
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	413	548.80	226,654.40
	SINCH AB	2,000	145.00	290,000.00
	ERICSSON LM-B SHS	10,228	106.50	1,089,282.00
	HEXAGON AB-B SHS	6,554	125.80	824,493.20
	TELE2 AB-B SHS	1,425	117.20	167,010.00
	TELIA CO AB	9,335	36.62	341,894.37
	スウェーデンクローネ 小計	112,722		18,900,249.77 (247,593,271)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	3,305	182.56	603,360.80
	NORSK HYDRO ASA	4,906	54.30	266,395.80
	YARA INTERNATIONAL ASA	578	469.60	271,428.80
	ADEVINTA ASA	1,063	170.00	180,710.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	227	364.20	82,673.40
	SCHIBSTED ASA-CL A	309	420.00	129,780.00
	MOWI ASA	1,407	228.70	321,780.90
	ORKLA ASA	2,653	87.90	233,198.70
	DNB ASA	3,309	195.80	647,902.20
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	937	193.25	181,075.25
	TELENOR ASA	2,517	144.85	364,587.45
	ノルウェークローネ 小計	21,211		3,282,893.30 (42,841,757)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	358	568.80	203,630.40
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	709	470.90	333,868.10
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	33	3,063.00	101,079.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	3,609	233.70	843,423.30
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	10	17,440.00	174,400.00
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	20	18,130.00	362,600.00
	DSV PANALPINA A/S	697	1,490.50	1,038,878.50
	PANDORA A/S	382	866.20	330,888.40
	CARLSBERG AS-B	358	1,169.00	418,502.00
	AMBU A/S-B	553	233.30	129,014.90

	COLOPLAST-B	438	980.60	429,502.80
	DEMANT A/S	332	353.00	117,196.00
	GN STORE NORD A/S	399	546.60	218,093.40
	GENMAB A/S	218	2,620.00	571,160.00
	NOVO NORDISK A/S-B	5,860	513.60	3,009,696.00
	DANSKE BANK A/S	2,193	111.90	245,396.70
	TRYG A/S	1,196	157.00	187,772.00
	ORSTED A/S	661	867.00	573,087.00
	デンマーククローネ 小計	18,026		9,288,188.50 (165,422,637)
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	3,295	22.77	75,027.15
	ELBIT SYSTEMS LTD	124	433.30	53,729.20
	BANK HAPOLIM BM	3,964	25.87	102,548.68
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	5,403	24.99	135,020.97
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	2,731	15.60	42,603.60
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	658	101.00	66,458.00
	AZRIELI GROUP LTD	199	233.60	46,486.40
	NICE LTD	237	777.70	184,314.90
	イスラエルシェケル 小計	16,611		706,188.90 (24,174,399)
ユーロ	ENI SPA	8,423	10.54	88,778.42
	GALP ENERGIA SGPS SA	1,849	9.60	17,765.19
	NESTE OYJ	1,465	54.00	79,110.00
	OMV AG	477	49.76	23,735.52
	REPSOL SA	4,896	11.09	54,335.80
	TENARIS SA	1,379	9.43	13,006.72
	TOTALENERGIES SE	8,494	40.25	341,925.97
	VOPAK	329	38.85	12,781.65
	AIR LIQUIDE SA	1,605	151.12	242,547.60
	AKZO NOBEL N.V.	637	106.60	67,904.20
	ARCELORMITTAL	2,597	25.53	66,314.39
	ARKEMA	246	105.00	25,830.00
	BASF SE	3,109	65.61	203,981.49
	COVESTRO AG	608	54.58	33,184.64
	CRH PLC	2,633	42.89	112,929.37
	EVONIK INDUSTRIES AG	609	28.12	17,125.08
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	326	41.84	13,639.84
	HEIDELBERGCEMENT AG	514	74.04	38,056.56
	KONINKLIJKE DSM NV	575	157.55	90,591.25
	LANXESS AG	242	58.28	14,103.76
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	868	45.41	39,415.88	
SOLVAY SA	289	107.95	31,197.55	

STORA ENSO OYJ-R SHS	2,208	15.20	33,572.64
SYMRISE AG	422	117.60	49,627.20
UMICORE	660	49.40	32,604.00
UPM-KYMMENE OYJ	1,948	31.91	62,160.68
VOESTALPINE AG	334	34.08	11,382.72
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	660	22.66	14,955.60
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	660	1.18	781.77
AIRBUS SE	1,992	111.92	222,944.64
ALSTOM	1,023	42.93	43,917.39
BOUYGUES SA	856	32.05	27,434.80
BRENTAG SE	537	79.40	42,637.80
CNH INDUSTRIAL NV	3,478	13.71	47,700.77
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	1,781	56.19	100,074.39
DASSAULT AVIATION SA	12	1,027.00	12,324.00
EIFFAGE	307	87.96	27,003.72
FERROVIAL SA	1,707	25.37	43,306.59
GEA GROUP AG	530	34.11	18,078.30
KINGSPAN GROUP PLC	499	82.76	41,297.24
KION GROUP AG	221	91.82	20,292.22
KNORR-BREMSE AG	217	111.55	24,206.35
KONE OYJ-B	1,189	69.20	82,278.80
LEGRAND SA	889	89.68	79,725.52
MTU AERO ENGINES AG	176	217.70	38,315.20
PRYSMIAN SPA	861	30.34	26,122.74
RATIONAL AG	21	758.20	15,922.20
SAFRAN SA	1,198	126.36	151,379.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,826	137.10	250,344.60
SIEMENS AG-REG	2,601	135.24	351,759.24
SIEMENS ENERGY AG	1,277	25.51	32,576.27
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	861	27.27	23,479.47
THALES SA	397	85.86	34,086.42
VINCI SA	1,804	93.91	169,413.64
WARTSILA OYJ ABP	1,431	12.61	18,052.06
BUREAU VERITAS SA	1,052	26.76	28,151.52
RANDSTAD NV	358	64.74	23,176.92
TELEPERFORMANCE	212	342.80	72,673.60
WOLTERS KLUWER	887	84.94	75,341.78
ADP	139	123.50	17,166.50
AENA SME SA	278	147.15	40,907.70
ATLANTIA SPA	1,859	15.78	29,344.31
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,120	9.84	11,024.16
DEUTSCHE POST AG-REG	3,352	58.31	195,455.12

GETLINK SE	1,575	13.57	21,380.62
INPOST SA	700	15.10	10,571.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,109	92.53	102,615.77
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	159	76.90	12,227.10
CONTINENTAL AG	372	128.50	47,802.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	2,900	78.85	228,665.00
FAURECIA	355	43.50	15,442.50
FERRARI NV	443	169.75	75,199.25
MICHELIN (CGDE)	591	135.65	80,169.15
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	543	96.68	52,497.24
RENAULT SA	678	35.36	23,977.47
STELLANTIS NV	6,804	16.99	115,613.56
VALEO SA	846	27.04	22,875.84
VOLKSWAGEN AG	115	284.80	32,752.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	625	218.85	136,781.25
ADIDAS AG	644	292.50	188,370.00
ESSILORLUXOTTICA	998	155.40	155,089.20
HERMES INTERNATIONAL	112	1,228.50	137,592.00
KERING	254	750.90	190,728.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	947	673.20	637,520.40
MONCLER SPA	737	57.46	42,348.02
PUMA SE	388	96.68	37,511.84
SEB SA	116	152.10	17,643.60
ACCOR SA	594	32.93	19,560.42
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	555	166.75	92,546.25
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	400	51.58	20,632.00
SODEXO SA	319	78.06	24,901.14
BOLLORE	2,292	4.60	10,556.95
PUBLICIS GROUPE	830	54.36	45,118.80
SCOUT24 AG	272	69.02	18,773.44
UBISOFT ENTERTAINMENT	335	58.08	19,456.80
VIVENDI	2,404	28.19	67,768.76
DELIVERY HERO SE	579	108.75	62,966.25
HELLOFRESH SE	603	78.50	47,335.50
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	3,818	30.86	117,823.48
JUST EAT TAKEAWAY	642	76.65	49,209.30
PROSUS NV	1,641	81.78	134,200.98
ZALANDO SE	591	101.95	60,252.45
CARREFOUR SA	2,206	17.07	37,667.45
COLRUYT SA	260	46.85	12,181.00
JERONIMO MARTINS	716	15.60	11,173.18
KESKO OYJ-B SHS	858	30.93	26,537.94

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	3,545	24.65	87,384.25
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,664	63.31	168,657.84
DANONE	2,291	57.08	130,770.28
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	1,787	11.41	20,398.60
HEINEKEN HOLDING NV	436	85.65	37,343.40
HEINEKEN NV	891	103.45	92,173.95
JDE PEET'S NV	306	30.93	9,464.58
KERRY GROUP PLC-A	537	115.85	62,211.45
PERNOD RICARD SA	735	187.40	137,739.00
REMY COINTREAU	106	169.20	17,935.20
BEIERSDORF AG	351	101.65	35,679.15
HENKEL AG & CO KGAA	407	77.50	31,542.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	605	90.10	54,510.50
L'OREAL	856	390.15	333,968.40
AMPLIFON SPA	508	41.23	20,944.84
BIOMERIEUX	194	91.50	17,751.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	127	161.75	20,542.25
DIASORIN SPA	118	154.60	18,242.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	723	69.60	50,320.80
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,524	43.98	67,025.52
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,182	42.12	134,041.75
ORPEA	139	103.50	14,386.50
SARTORIUS AG-VORZUG	91	430.00	39,130.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	984	50.90	50,085.60
ARGENX SE	157	266.60	41,856.20
BAYER AG-REG	3,319	51.30	170,264.70
EUROFINS SCIENTIFIC	476	94.97	45,205.72
GRIFOLS SA	1,110	22.37	24,830.70
IPSEN	177	90.24	15,972.48
MERCK KGAA	427	157.85	67,401.95
ORION OYJ-CLASS B	302	36.63	11,062.26
QIAGEN N.V.	849	39.99	33,951.51
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	262	48.25	12,641.50
SANOFI	3,852	87.60	337,435.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	89	387.90	34,523.10
UCB SA	417	84.14	35,086.38
ABN AMRO BANK NV-CVA	1,269	10.55	13,395.56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	22,388	5.33	119,328.04
BANCO SANTANDER SA	58,674	3.31	194,680.33
BNP PARIBAS	3,809	54.10	206,066.90
CAIXABANK SA	16,293	2.63	42,932.05
COMMERZBANK AG	2,939	6.21	18,251.19

CREDIT AGRICOLE SA	3,808	11.88	45,246.65
ERSTE GROUP BANK AG	930	32.28	30,020.40
FINECOBANK SPA	2,287	14.72	33,676.07
ING GROEP NV	13,144	11.19	147,081.36
INTESA SANPAOLO	55,581	2.36	131,393.48
KBC GROUP NV	910	64.10	58,331.00
MEDIOBANCA SPA	2,085	9.98	20,816.64
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	694	19.85	13,775.90
SOCIETE GENERALE SA	2,786	25.43	70,861.91
UNICREDIT SPA	7,143	10.36	74,044.33
AMUNDI SA	166	74.65	12,391.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	7,352	11.00	80,930.81
DEUTSCHE BOERSE AG	649	147.90	95,987.10
EURAZEO SE	141	73.30	10,335.30
EXOR NV	386	66.04	25,491.44
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	361	95.16	34,352.76
NATIXIS	4,432	4.00	17,732.43
SOFINA	49	366.80	17,973.20
WENDEL	45	115.70	5,206.50
AEGON NV	6,892	3.54	24,425.24
AGEAS	667	48.28	32,202.76
ALLIANZ SE-REG	1,400	214.85	300,790.00
ASSICURAZIONI GENERALI	4,036	16.93	68,329.48
AXA SA	6,704	21.73	145,677.92
CNP ASSURANCES	804	14.29	11,493.18
HANNOVER RUECK SE	231	141.60	32,709.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	470	237.20	111,484.00
NN GROUP NV	975	40.16	39,156.00
POSTE ITALIANE SPA	1,510	11.42	17,251.75
SAMPO OYJ-A SHS	1,706	39.27	66,994.62
SCOR SE	454	26.68	12,112.72
AROUNDTOWN SA	3,093	6.88	21,304.58
DEUTSCHE WOHNEN SE	1,185	51.50	61,027.50
LEG IMMOBILIEN SE	263	124.15	32,651.45
VONOVIA SE	1,882	55.28	104,036.96
ADYEN NV	66	2,021.00	133,386.00
AMADEUS IT GROUP SA	1,614	64.18	103,586.52
ATOS SE	357	52.38	18,699.66
BECHTLE AG	100	152.30	15,230.00
CAPGEMINI SE	534	161.55	86,267.70
DASSAULT SYSTEMES SE	440	205.30	90,332.00
EDEMRED	860	50.34	43,292.40

NEMETSCHEK SE	270	64.64	17,452.80
NEXI SPA	1,762	18.63	32,834.87
SAP SE	3,554	118.66	421,717.64
TEAMVIEWER AG	700	33.75	23,625.00
WORLDLINE SA	784	81.00	63,504.00
NOKIA OYJ	18,876	4.33	81,799.14
CELLNEX TELECOM SA	1,807	54.50	98,481.50
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	11,277	17.87	201,542.54
ELISA OYJ	513	50.10	25,701.30
ILIAD SA	69	123.30	8,507.70
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	1,126	9.78	11,021.28
KONINKLIJKE KPN NV	11,684	2.63	30,799.02
ORANGE	6,607	9.62	63,559.34
PROXIMUS	713	16.36	11,664.68
TELECOM ITALIA SPA	29,748	0.42	12,529.85
TELECOM ITALIA-RSP	27,906	0.44	12,527.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	4,887	2.22	10,883.34
TELEFONICA SA	17,421	3.93	68,464.53
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	265	34.28	9,084.20
E.ON SE	7,334	9.95	72,980.63
EDF	1,575	11.68	18,396.00
EDP RENOVAVEIS SA	1,007	18.49	18,619.43
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	10,180	4.55	46,349.54
ELIA GROUP SA/NV	144	88.10	12,686.40
ENAGAS SA	745	19.71	14,683.95
ENDESA SA	1,194	22.45	26,805.30
ENEL SPA	27,550	8.03	221,336.70
ENGIE	6,384	11.68	74,590.65
FORTUM OYJ	1,425	23.65	33,701.25
IBERDROLA SA	19,555	10.47	204,740.85
NATURGY ENERGY GROUP SA	716	21.97	15,730.52
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,616	16.47	26,615.52
RWE AG	2,124	30.46	64,697.04
SNAM SPA	6,672	4.88	32,619.40
SUEZ	1,261	20.03	25,257.83
TERNA SPA	5,366	6.32	33,913.12
UNIPER SE	259	31.01	8,031.59
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,756	25.35	44,514.60
VERBUND AG	216	77.90	16,826.40
ASM INTERNATIONAL NV	171	265.70	45,434.70
ASML HOLDING NV	1,432	582.10	833,567.20
INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,606	33.05	152,251.33

STMICROELECTRONICS NV	2,478	30.75	76,198.50
ユーロ 小計	652,779		16,436,771.98 (2,176,557,345)
合 計	3,801,960		20,020,422,218 (20,020,422,218)

(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	434	79,803.92	
		AMERICAN TOWER CORP	1,511	399,130.65	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	464	98,381.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	477	56,796.39	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	374	50,482.52	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,462	286,449.66	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	994	149,129.82	
		DUKE REALTY CORP	1,223	58,508.32	
		EQUINIX INC	302	235,354.64	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	570	42,909.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,194	93,729.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	236	72,270.28	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	432	70,731.36	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,874	63,453.64	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,718	47,918.34	
		INVITATION HOMES INC	1,874	70,349.96	
		IRON MOUNTAIN INC	1,025	44,433.75	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,162	44,321.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	384	65,122.56	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	825	30,112.50	
		PROLOGIS INC	2,509	304,266.43	
		PUBLIC STORAGE	529	159,673.36	
		REALTY INCOME CORP	1,350	90,450.00	
		REGENCY CENTERS CORP	470	30,343.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	379	119,661.67	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	1,136	148,384.32	
SUN COMMUNITIES INC	353	61,273.74			
UDR INC	1,064	52,785.04			
VENTAS INC	1,235	71,580.60			
VEREIT INC	781	36,277.45			



		VICI PROPERTIES INC	2,009	62,499.99	
		VORNADO REALTY TRUST	618	29,589.84	
		WELLTOWER INC	1,394	116,343.24	
		WEYERHAEUSER CO	2,635	90,196.05	
		WP CAREY INC	568	43,883.68	
アメリカドル合計			37,565	3,476,598.44 (385,867,660)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	400	22,872.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	700	15,463.00	
カナダドル合計			1,100	38,335.00 (3,450,916)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	3,640	39,748.80	
		GOODMAN GROUP	5,899	124,114.96	
		GPT GROUP	5,913	29,151.09	
		MIRVAC GROUP	13,434	39,898.98	
		SCENTRE GROUP	16,513	46,566.66	
		STOCKLAND	8,162	38,851.12	
		VICINITY CENTRES	11,078	18,389.48	
オーストラリアドル合計			64,639	336,721.09 (28,331,712)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	2,628	13,502.66	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	2,269	15,778.62	
		SEGRO PLC	4,029	44,802.48	
イギリスポンド合計			8,926	74,083.76 (11,444,459)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	7,600	594,700.00	
香港ドル合計			7,600	594,700.00 (8,504,210)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	11,600	34,684.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	12,200	25,498.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	10,100	21,917.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	12,400	25,544.00	
シンガポールドル合計			46,300	107,643.00 (8,898,846)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	225	16,942.50	
		GECINA SA	161	21,501.55	
		KLEPIERRE	614	13,956.22	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	467	37,317.97	
ユーロ合計			1,467	89,718.24 (11,880,489)	
合計				458,378,292 (458,378,292)	

(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	602銘柄	97.38%	70.08%
	投資証券	35銘柄		1.88%
カナダドル	株式	89銘柄	99.53%	3.57%
	投資証券	2銘柄		0.02%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	93.95%	2.15%
	投資証券	7銘柄		0.14%
イギリスポンド	株式	83銘柄	98.78%	4.53%
	投資証券	3銘柄		0.06%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.00%	3.14%
香港ドル	株式	32銘柄	95.81%	0.95%
	投資証券	1銘柄		0.04%
シンガポールドル	株式	14銘柄	86.96%	0.29%
	投資証券	4銘柄		0.04%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%	0.08%
スウェーデンクローネ	株式	42銘柄	100.00%	1.21%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.00%	0.21%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%	0.81%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	0.12%
ユーロ	株式	233銘柄	99.46%	10.63%
	投資証券	4銘柄		0.06%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）】

## 【純資産額計算書】

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	676,747,597
負債総額	1,108,715
純資産総額（ - ）	675,638,882
発行済口数	420,995,167口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.6049
（10,000口当たり）	（16,049）

（参考）

## ヘッジ付外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

令和 3年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	21,710,171,285
負債総額	137,858,749
純資産総額（ - ）	21,572,312,536
発行済口数	8,340,266,355口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.5865
（10,000口当たり）	（25,865）

## 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

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

### 第三部【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

2021年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 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。

###### 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、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、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、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。

###### 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。

2021年6月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	897	17,600,344
追加型公社債投資信託	16	1,436,394
単位型株式投資信託	79	355,163
単位型公社債投資信託	45	187,593
合計	1,037	19,579,494

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表の作成方法について

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

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

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度(自令和2年4月1日至令和3年3月31日)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 56,398,457	2 56,803,388
有価証券	1,960,318	2,001
前払費用	575,904	598,135
未収入金	14,559	31,359
未収委託者報酬	10,296,453	13,216,357
未収収益	2 638,994	2 662,230
金銭の信託	100,000	2,300,000

その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	584,048	1	548,902
器具備品	1	871,893	1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	819,255	1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
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		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	687,565	533,622
未払金		
未払収益分配金	131,478	158,856
未払償還金	395,400	133,877
未払手数料	2 4,026,078	2 5,200,810
その他未払金	2 3,818,195	2 4,412,521
未払費用	2 4,402,578	2 4,755,909
未払消費税等	629,469	752,617
未払法人税等	617,341	873,027
賞与引当金	933,517	933,381
役員賞与引当金	124,590	160,710
その他	701,285	691,143
流動負債合計	16,467,499	18,606,476
固定負債		
長期未払金	32,400	21,600
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
役員退職慰労引当金	130,784	117,938

時効後支払損引当金	238,811	245,426
固定負債合計	1,412,398	1,530,479
負債合計	17,879,897	20,136,956
(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	25,847,605	26,951,289
利益剰余金合計	33,188,194	34,291,879
株主資本合計	79,921,039	81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)	第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	67,967,489	67,963,712
投資顧問料	2,385,084	2,443,980
その他営業収益	16,085	21,613
営業収益合計	70,368,658	70,429,306
営業費用		
支払手数料	2 27,106,451	2 26,689,896
広告宣伝費	696,418	668,150
公告費	1,000	250
調査費		
調査費	1,857,271	2,077,942
委託調査費	11,579,175	12,035,954
事務委託費	847,769	798,528
営業雑経費		
通信費	153,731	296,490



印刷費	427,118	378,180
協会費	52,053	51,841
諸会費	15,990	16,613
事務機器関連費	1,953,926	1,977,769
その他営業雑経費		8,391
営業費用合計	44,690,907	45,000,009
一般管理費		
給料		
役員報酬	331,987	352,879
給料・手当	6,611,427	6,461,546
賞与引当金繰入	933,517	933,381
役員賞与引当金繰入	124,590	160,710
福利厚生費	1,276,950	1,272,568
交際費	11,871	2,721
旅費交通費	165,891	22,768
租税公課	360,165	402,939
不動産賃借料	647,402	666,331
退職給付費用	422,919	481,135
役員退職慰労引当金繰入	48,183	11,763
固定資産減価償却費	1,307,555	1,358,911
諸経費	427,212	413,538
一般管理費合計	12,669,674	12,541,193
営業利益	13,008,076	12,888,103

(単位：千円)

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	90,965	170,807
受取利息	2 4,169	2 2,726
投資有価証券償還益	585,179	81,557
収益分配金等時効完成分	101,734	275,835
受取賃貸料	2 65,808	2 65,808
その他	19,987	12,504
営業外収益合計	867,845	609,239
営業外費用		
投資有価証券償還損	96,379	95,946
時効後支払損引当金繰入		16,395
事務過誤費	3,483	
賃貸関連費用	20,339	13,472
その他	1,920	2,932
営業外費用合計	122,122	128,747
経常利益	13,753,799	13,368,595
特別利益		
投資有価証券売却益	174,842	2,007,655
特別利益合計	174,842	2,007,655
特別損失		
投資有価証券売却損	75,963	51,737
投資有価証券評価損	163,865	26,317
固定資産除却損	1 8,832	1 536

固定資産売却損		435	
特別損失合計		249,096	78,591
税引前当期純利益		13,679,545	15,297,659
法人税、住民税及び事業税	2	4,146,534	2
法人税等調整額		79,824	19,122
法人税等合計		4,226,359	4,736,304
当期純利益		9,453,186	10,561,354

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金合計	
		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			
					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	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計							221,989	221,989	221,989
当期末残高	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

	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	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

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								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金合計	
		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			
					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

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,815	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

## [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

## 時価のあるもの

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。

## 時価のないもの

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。

## 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

については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(3) 「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、実務対応報告第39号「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」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」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。

（未適用の会計基準等）

- ・ 「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 企業会計基準委員会）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・ 「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・ 「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 企業会計基準委員会）
- ・ 「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 企業会計基準委員会）
- ・ 「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 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）

- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会)

## (1)概要

国際会計基準審議会( IASB )及び米国財務会計基準審議会( FASB )が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準( IFRS )においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

## (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

## (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」等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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

## 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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

## (損益計算書関係)

## 1.固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

## 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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
--	--------------------------------------	-------------------------------------

支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自平成31年4月1日至令和2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

令和元年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。

配当金の総額	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年6月27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。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

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。

配当金の総額	9,457,670千円
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
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。

配当金の総額	10,576,511千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超		709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

## (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。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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があります。

## 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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）参照）。

## 第35期(令和2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) 現金及び預金	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 金銭の信託	100,000	100,000	-
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,428,625	85,428,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

## 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) 現金及び預金	56,803,388	56,803,388	-
(2) 有価証券	2,001	2,001	-
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	-
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	-
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	-
資産計	90,907,057	90,907,057	-
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	-
負債計	5,200,810	5,200,810	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資産

## (1) 現金及び預金、(4) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2)有価証券、(5)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

## (3)金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

負債

## (1)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (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

(単位：千円)

区分	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、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、「(5)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35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
金銭の信託	100,000	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

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

## (有価証券関係)

## 1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の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、前事業年度の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、記載しておりません。

## 2.その他有価証券



## 第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,874,369	10,037,087	1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(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100,000千円)を含めておりません。

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)を含めておりません。

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。

## 3.売却したその他有価証券

第35期(自平成31年4月1日至令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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

## 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163,865千円(その他有価証券のその他163,865千円)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。

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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の 発生額	52,430	18,826
退職給付の支払額	162,904	192,890
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

#### (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の 発生額	164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	-
退職給付の支払額	140,518	159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

#### (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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	2,460,824	2,649,846
	508,982	161,046
非積立型制度の退職給付債務	748,929	918,342
未積立退職給付債務	1,257,911	1,079,388
未認識数理計算上の差異	203,136	161,333
未認識過去勤務費用	419,405	354,043
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	375,031	258,835

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678
---------------------	---------	---------

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る退職給付費用	269,848	329,255

(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

## 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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
合計	100	100

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
割引率	0.095 ~ 0.52%	0.051 ~ 0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

## (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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756

減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	114,834	79,225
連結納税適用による時価評価	1,260	1,203
その他有価証券評価差額金	801	1,015,785
その他	109	101
繰延税金負債 合計	117,005	1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期(令和2年3月31日現在)及び第36期(令和3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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)及び第36期(自令和2年4月1日至令和3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35期(自平成31年4月1日至令和2年3月31日)及び第36期(自令和2年4月1日至令和3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35期（自平成31年4月1日至令和2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	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,234,629 千円	未払手数料	712,210 千円
						投資の助言  役員の兼任	投資助言料 (注3)	583,270 千円	未払費用	302,681 千円

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	(株)三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	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(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,128,270 千円	未払手数料	772,495 千円
						投資の助言  役員の兼任	投資助言料 (注3)	523,327 千円	未払費用	290,120 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35期（自平成31年4月1日至令和2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3)	科目	期末残高(注3)
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	----------	----	----------

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）	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円	
							取引銀行	コーラブル預金の払戻（注2）	20,000,000 千円		
								コーラブル預金の預入（注2）	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
								コーラブル預金に係る受取利息（注2）	4,126 千円	未収収益	997 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）	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円	

## 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3)	科目	期末残高(注3)
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

## 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. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
3. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第35期 （自平成31年4月1日 至令和2年3月31日）	第36期 （自令和2年4月1日 至令和3年3月31日）
1株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
1株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36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. 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35期 （自平成31年4月1日 至令和2年3月31日）	第36期 （自令和2年4月1日 至令和3年3月31日）
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（2021年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
PayPay銀行株式会社	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社山形銀行	12,008 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社横浜銀行	215,628 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社百十四銀行	37,322 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社琉球銀行	56,967 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社あおぞら銀行	100,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社大光銀行	10,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エース証券株式会社	8,831 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
浜銀TT証券株式会社	3,307 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
丸八証券株式会社	3,751 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

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

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



### 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年6月末現在）

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

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

#### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

令和3年6月28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	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊	藤	鉄	也	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

### 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2年4月1日から令和3年3月31日までの第36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3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。

### 財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和3年7月28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 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたて先進国株式（為替ヘッジあり）の令和2年6月26日から令和3年6月25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、つみたて先進国株式（為替ヘッジあり）の令和3年6月25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。

## 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) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。