

# 外国株式インデックス・オープン

追加型投信／海外／株式／インデックス型

投資信託説明書

(請求目論見書)

2024年3月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

外国株式インデックス・オープンの募集については、委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を 2024 年 2 月 29 日に関東財務局長に提出しており、2024 年 3 月 1 日にその届出の効力が生じております。

発行者名	:	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
代表者の役職・氏名	:	代表取締役社長 菱田 賀夫
本店の所在の場所	:	東京都港区芝公園一丁目 1 番 1 号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	:	該当事項はありません。

## 目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	2
(7)【申込期間】	2
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	3
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	13
3【投資リスク】	21
4【手数料等及び税金】	24
5【運用状況】	28
第2【管理及び運営】	38
1【申込(販売)手続等】	38
2【換金(解約)手続等】	39
3【資産管理等の概要】	41
4【受益者の権利等】	45
第3【ファンドの経理状況】	46
1【財務諸表】	49
2【ファンドの現況】	110
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	111
第三部【委託会社等の情報】	112
第1【委託会社等の概況】	112
1【委託会社等の概況】	112
2【事業の内容及び営業の概況】	113
3【委託会社等の経理状況】	114
4【利害関係人との取引制限】	148
5【その他】	148
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

外国株式インデックス・オープン

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
- ②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、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又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。
- ③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又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。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。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】

10 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（※1）に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の 0.1%）（※2）を加えた価額（販売基準価額）とします。

※1「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

※2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

### (5)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の販売基準価額に、1.1%（税抜 1.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

**(6)【申込単位】**

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」(税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース) で再投資する場合は1口単位です。

**(7)【申込期間】**

2024年3月1日から2024年8月29日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**(8)【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

**(9)【払込期日】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。

継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社(以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。)の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**(10)【払込取扱場所】**

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

### <振替受益権について>

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

### <受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後 3 時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

### <申込みコース>

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の 2 つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

### <受益権の取得申込みの受付の中止等>

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及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できます。

### <受付不可日>

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

## 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】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

###### <信託金限度額>

上限 3,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

###### 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
追加型	海外	債券	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

◆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」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。



## <商品分類表定義>

### [単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信…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う。
- (2) 追加型投信…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う。

### [投資対象地域による区分]

- (1) 国内…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 海外…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

### [投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 債券…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、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及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う。
- (4) その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる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う。

### [独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) 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号及び第2号に規定する証券投資信託並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う。

### [補足分類]

- (1) インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型…目論見書又は投資信託約款において、投資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う。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### <属性区分表定義>

##### [投資対象資産による属性区分]

###### (1) 株式

- ①一般…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う。
- ②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

###### (2) 債券

- ①一般…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う。
- ②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又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、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③社債…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- ④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又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う。
- ⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- ①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

##### [決算頻度による属性区分]

- (1) 年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、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う。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3)北米…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (7)中南米…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (8)アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (9)中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、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))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ…「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・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又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う。
- (2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

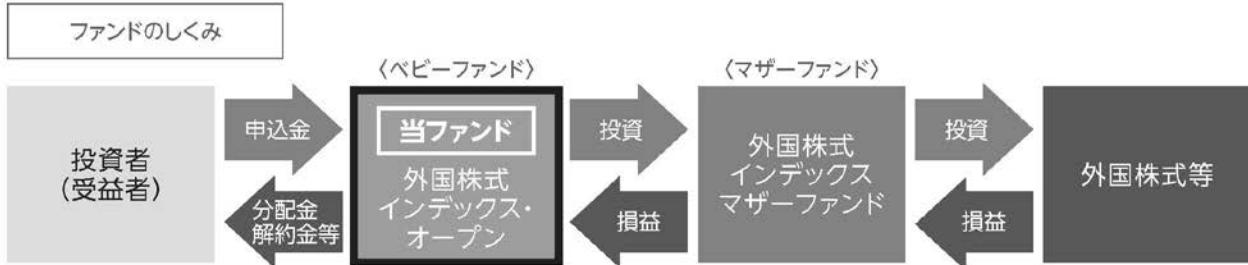
- (1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)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う。

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<ファンドの特色>

**1.** 日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



**?** ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

<マザーファンドの概要>

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

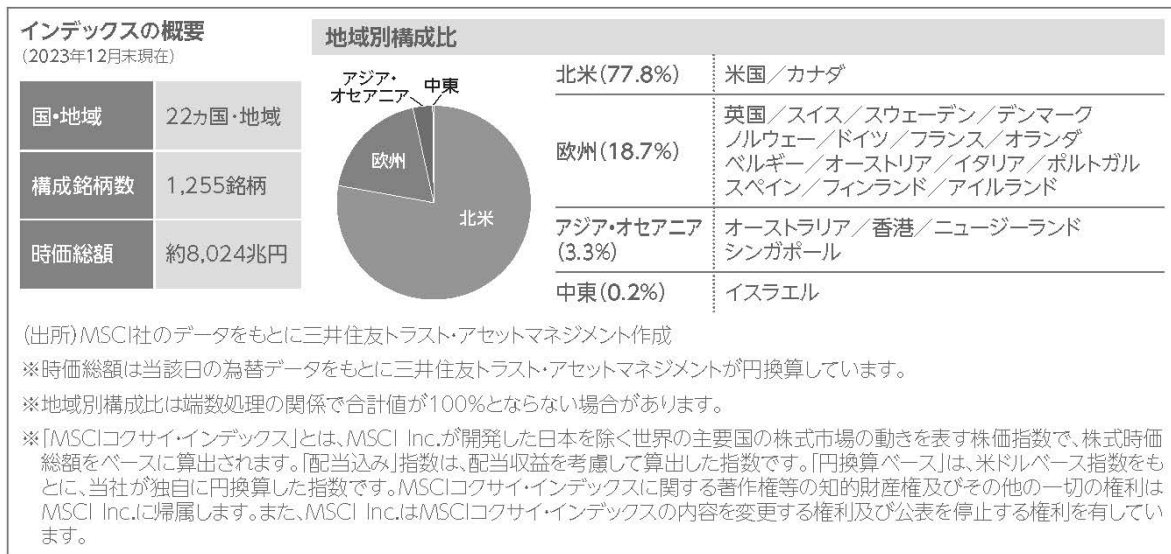
マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

### ? MSCIコクサイ・インデックスとは



#### 分配方針

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 分配金額については、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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### 主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

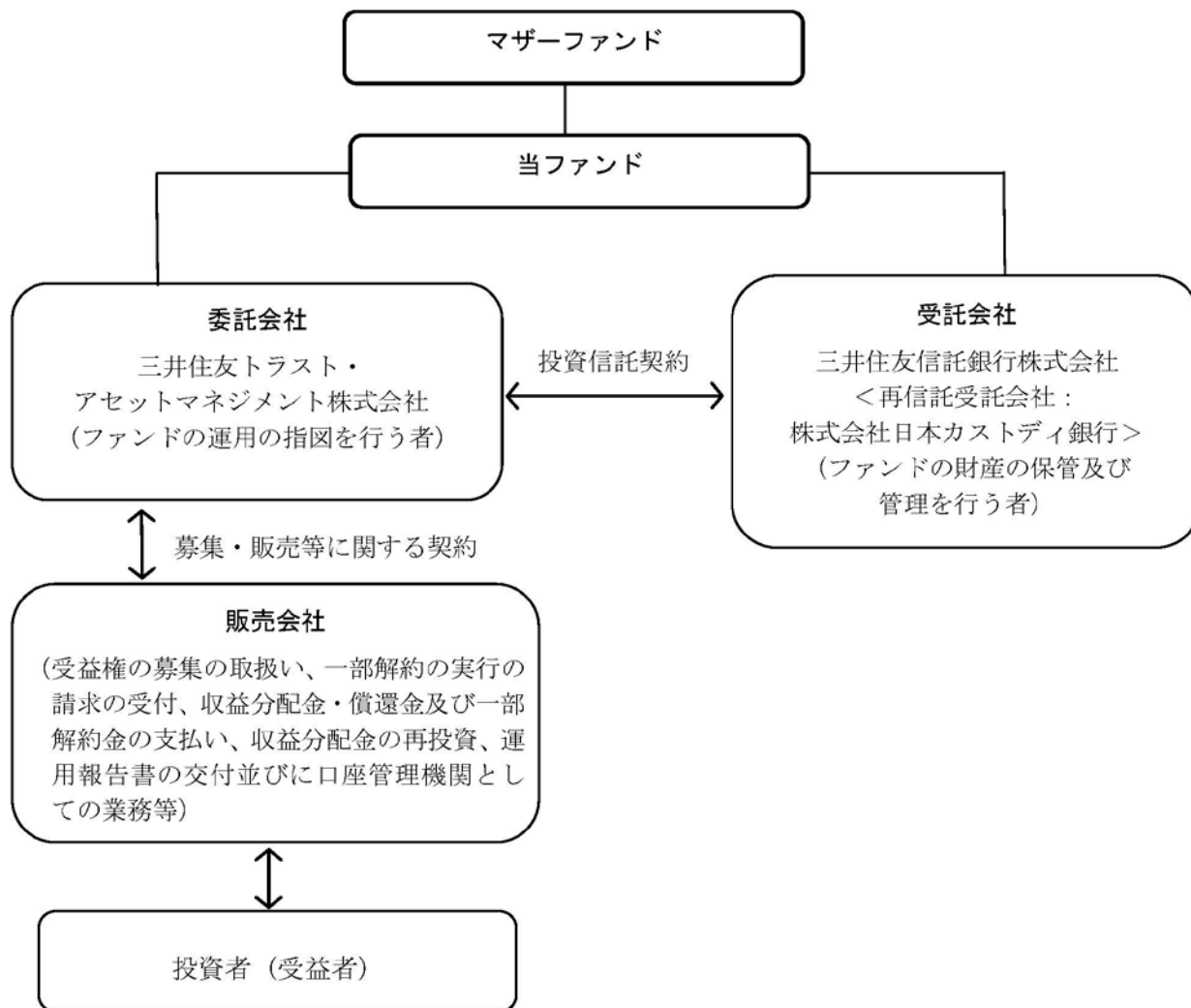
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

#### (2) 【ファンドの沿革】

2000年5月30日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	当ファンドの名称を「すみしん 外国株式インデックス・オープン」から「外国株式インデックス・オープン」に変更 当ファンドの主要投資対象である「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2023年12月29日現在)

イ. 資本金の額：20億円

ロ. 委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### ①基本方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ②投資対象

外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

#### ③投資態度

- 1) 主として、外国株式インデックス マザーファンド受益証券に投資し、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2) 株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3) 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- 4) 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並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ため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 5) 投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並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ため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 7) 投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並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ため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 8) 投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並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ため、為替先渡取引を行うことができます。

### (2) 【投資対象】

#### ①有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国株式インデックス マザーファンドの受益証券並びに次に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又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. コマーシャル・ペーパー
11. 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。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又は外国証券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。)
14. 投資証券又は外国投資証券（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。)
15. 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。)
16. オプションを表示する証券又は証書（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。)
17. 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。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 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。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第 1 号の証券又は証書、第 12 号並びに第 17 号の証券又は証書のうち第 1 号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 2 号から第 6 号までの証券及び第 12 号並びに第 17 号の証券又は証書のうち第 2 号から第 6 号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第 13 号の証券及び第 14 号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## ②金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ. 上記①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会

社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ、第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (参考)マザーファンドの概要

### 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1)投資対象

原則として、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

①原則としてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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ため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

#### 3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

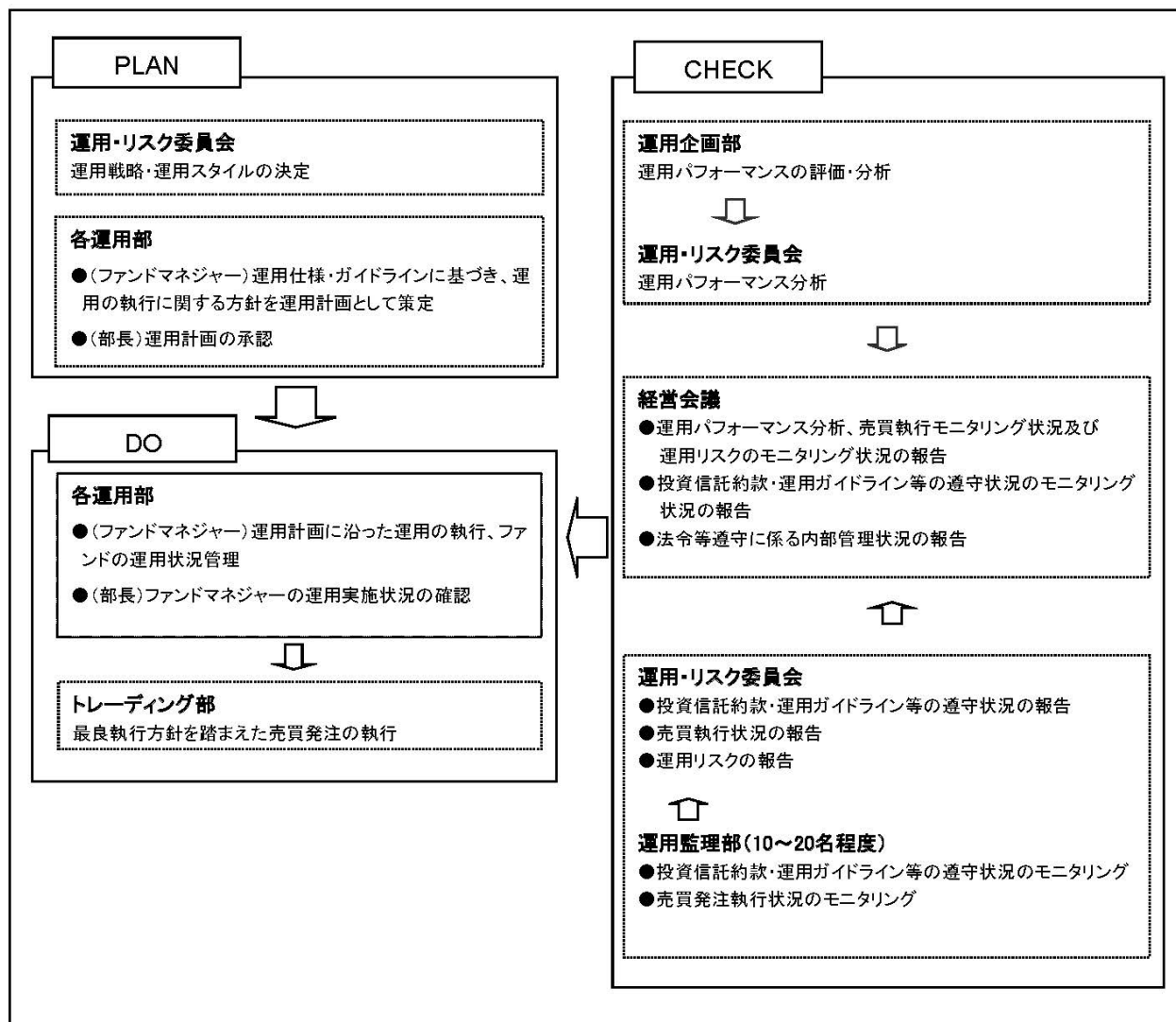
③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

- ⑤同一銘柄の転換社債、並びに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（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。



4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ⑩委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並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ため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並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ため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及び先物オプション取引を行うことを指図することができます。
- ⑪委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並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ため、異なった通貨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。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、原則として当ファンドの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。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑫委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並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ため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの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可能なものについてはこの限りではありません。為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。
- ⑬委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付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、投資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、投資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。
- ⑭委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額（投資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投資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をいいます。）を含みます。）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。

⑮委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ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。当該資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。また、借入金の利息は、投資信託財産中より支弁します。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内

⑯一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑰デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### <関連法令に基づく投資制限>

##### ①同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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全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) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様様の投資元本は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。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様様に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ① 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### ② 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

##### ③ 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

##### ④ 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

##### ⑤ カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

- ① ファンドは、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
- ② 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
- ③ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。  
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、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率を示すものではありません。



投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には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。

④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。

⑤ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

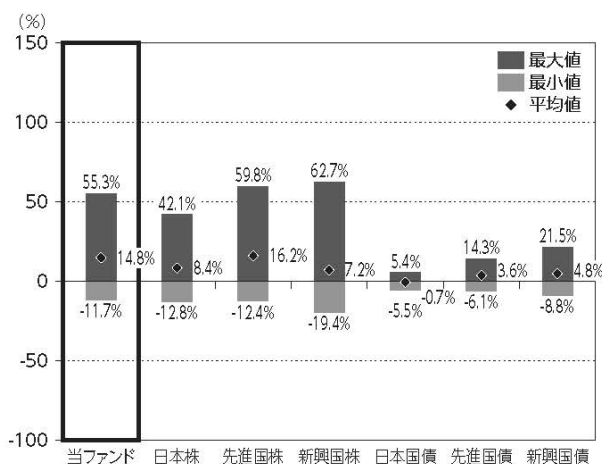
## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \*当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いますので、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。
- \*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当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いますので、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。

## 各資産クラスの指数について

<b>日本株</b> TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
<b>先進国株</b> MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
<b>新興国株</b> MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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。
<b>新興国債</b> JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）（※1）を加えた価額（販売基準価額）に、1.1%（税抜 1.0%）（※2）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

※1：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

※2：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

②「分配金再投資コース」（※3）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※3：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.88%（税抜 0.8%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.396% (税抜 0.36%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.407% (税抜 0.37%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

- ②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

### (4) 【その他の手数料等】

- ①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

### ①個人の受益者に対する課税

#### イ. 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率 (内 訳)
2037年12月31日まで	20.315% (所得税 15.315%、住民税 5%)
2038年1月1日以降	20% (所得税 15%、住民税 5%)

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

#### ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、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）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ. の表の通りです。

#### ハ. 損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

### ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### ②法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率 (所得税のみ)
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

### ③個別元本について

イ. 追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ. 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。

- ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ. 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。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

#### ④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ. 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又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、
- ロ. 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。

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

※上記は、2024年1月1日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### (参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.92%	0.89%	0.03%

※対象期間は2022年5月31日～2023年5月29日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5 【運用状況】

以下は、2023年12月29日現在の状況について記載してあります。

### 【外国株式インデックス・オープン】

#### (1) 【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,826,988,043	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,416,543	0.05
合計(純資産総額)		4,829,404,586	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### (2) 【投資資産】

#### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	883,513,571	4.7916	4,233,446,711	5.4634	4,826,988,043	99.95

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(注) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 14 期計算期間末	(2014 年 5 月 29 日)	1,758,035,378	1,791,997,838	12,941	13,191
第 15 期計算期間末	(2015 年 5 月 29 日)	2,169,191,366	2,209,024,362	16,337	16,637
第 16 期計算期間末	(2016 年 5 月 30 日)	2,064,365,337	2,109,754,246	13,645	13,945
第 17 期計算期間末	(2017 年 5 月 29 日)	2,021,006,899	2,059,869,891	15,601	15,901
第 18 期計算期間末	(2018 年 5 月 29 日)	2,026,474,675	2,062,781,536	16,745	17,045
第 19 期計算期間末	(2019 年 5 月 29 日)	2,186,852,209	2,232,882,123	16,628	16,978
第 20 期計算期間末	(2020 年 5 月 29 日)	2,094,261,976	2,131,755,466	16,757	17,057
第 21 期計算期間末	(2021 年 5 月 31 日)	3,070,040,178	3,108,660,697	23,848	24,148
第 22 期計算期間末	(2022 年 5 月 30 日)	3,622,048,520	3,670,757,953	26,026	26,376
第 23 期計算期間末	(2023 年 5 月 29 日)	4,256,131,064	4,322,325,706	28,934	29,384
	2022 年 12 月末日	3,731,741,301	—	25,438	—
	2023 年 1 月末日	3,874,526,139	—	26,378	—
	2 月末日	4,004,133,596	—	27,284	—
	3 月末日	4,054,877,594	—	27,129	—
	4 月末日	4,118,692,932	—	27,853	—
	5 月末日	4,256,929,494	—	28,676	—
	6 月末日	4,568,805,502	—	30,909	—
	7 月末日	4,591,460,629	—	31,358	—
	8 月末日	4,658,834,847	—	31,881	—
	9 月末日	4,556,494,983	—	31,093	—
	10 月末日	4,397,891,193	—	30,021	—
	11 月末日	4,738,128,687	—	32,357	—
	12 月末日	4,829,404,586	—	32,908	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 14 期計算期間	2013 年 5 月 30 日～2014 年 5 月 29 日	250
第 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	300
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	300
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	300
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	300
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	350
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	300



第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	300
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	350
第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	450

### ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 14 期計算期間	2013 年 5 月 30 日～2014 年 5 月 29 日	16.5
第 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	28.6
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	△14.6
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	16.5
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	9.3
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	1.4
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	2.6
第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	44.1
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	10.6
第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	12.9
第 24 期中間計算期間	2023 年 5 月 30 日～2023 年 11 月 29 日	11.7

(注 1) 収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に 100 を乗じて得た数字です。

(注 2) 小数第 2 位を四捨五入しております。

### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第 14 期計算期間	2013 年 5 月 30 日～2014 年 5 月 29 日	629,763,336	743,537,133	1,358,498,433
第 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	499,130,409	529,862,277	1,327,766,565
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	402,682,221	217,485,148	1,512,963,638
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	185,293,328	402,823,878	1,295,433,088
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	134,008,067	219,212,433	1,210,228,722
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	745,961,689	641,050,011	1,315,140,400
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	729,811,741	795,169,139	1,249,783,002
第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	403,458,266	365,890,627	1,287,350,641
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	216,844,179	112,496,708	1,391,698,112
第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	195,937,282	116,643,343	1,470,992,051
第 24 期中間計算期間	2023 年 5 月 30 日～2023 年 11 月 29 日	89,174,916	95,147,420	1,465,019,547

(注) 当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	436,821,245,267	68.92
	イギリス	24,618,803,131	3.88
	カナダ	21,498,781,749	3.39
	スイス	19,790,379,855	3.12
	フランス	19,459,694,281	3.07
	ドイツ	15,130,555,628	2.39
	オーストラリア	12,419,341,448	1.96
	オランダ	11,967,127,087	1.89
	アイルランド	11,327,699,665	1.79
	デンマーク	5,948,861,645	0.94
	スウェーデン	5,745,002,531	0.91
	スペイン	4,599,683,457	0.73
	イタリア	3,492,708,022	0.55
	香港	2,923,160,701	0.46
	シンガポール	1,990,878,487	0.31
	フィンランド	1,897,947,389	0.30
	ジャージー	1,668,614,638	0.26
	ベルギー	1,356,764,905	0.21
	イスラエル	1,251,430,089	0.20
	ノルウェー	1,170,291,225	0.18
	ケイマン	822,555,086	0.13
	キュラソー	817,138,352	0.13
	バミューダ	800,661,258	0.13
	ニュージーランド	515,461,679	0.08
	リベリア	381,134,046	0.06
	ルクセンブルク	370,673,947	0.06
オーストリア	340,212,200	0.05	
ポルトガル	336,147,214	0.05	
パナマ	190,150,446	0.03	
マン島	89,348,667	0.01	
	小計	609,742,454,095	96.20
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	68,791,609	0.01
	香港	52,713,045	0.01

	小計	121,504,654	0.02
投資証券	アメリカ	10,967,896,802	1.73
	オーストラリア	793,123,448	0.13
	フランス	271,340,844	0.04
	シンガポール	254,235,875	0.04
	イギリス	199,518,358	0.03
	香港	132,831,954	0.02
	ベルギー	58,274,249	0.01
	カナダ	56,326,500	0.01
	小計	12,733,548,030	2.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	11,202,036,242	1.77
合計(純資産総額)		633,799,543,021	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザー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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,950,153,003	1.25
	買建	カナダ	326,532,931	0.05
	買建	ドイツ	1,461,803,793	0.23
	買建	イギリス	629,755,623	0.10
	買建	オーストラリア	460,889,112	0.07

(注1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2) 投資比率とは、マザー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。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	283,731,555	0.04
	売建	—	82,169,702	△0.01

(注1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

(注2) 投資比率とは、マザー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

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	1,210,717	24,864.28	30,103,617,309	27,455.45	33,240,781,753	5.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	546,594	47,251.92	25,827,617,340	53,225.96	29,092,991,692	4.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	719,107	17,107.66	12,302,245,001	21,753.88	15,643,371,268	2.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	191,277	55,480.53	10,612,150,623	70,237.05	13,434,732,710	2.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・エンターテインメント	459,452	17,683.37	8,124,662,630	19,888.82	9,137,958,540	1.44
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・エンターテインメント	172,117	37,414.47	6,439,667,075	50,820.52	8,747,076,405	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・エンターテインメント	405,242	17,782.83	7,206,352,964	20,037.74	8,120,134,806	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	27,675.29	6,122,190,807	35,908.51	7,943,503,119	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	112,604.02	3,869,862,560	159,191.41	5,470,931,198	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	19,435.67	4,353,727,963	24,153.64	5,410,586,452	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	72,060	68,537.16	4,938,788,253	74,446.56	5,364,619,618	0.85
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,580	61,232.73	3,831,944,793	82,381.95	5,155,462,775	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	101,297	45,681.93	4,627,443,415	50,714.15	5,137,191,567	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	31,931.14	3,960,866,891	36,932.53	4,581,258,999	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	14,897.75	4,616,321,599	14,209.94	4,403,193,864	0.69
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	187,036	21,871.54	4,090,766,648	22,207.74	4,153,647,120	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	53,062.81	3,442,184,632	60,464.96	3,922,362,318	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	41,483.25	3,196,989,945	49,266.06	3,796,788,124	0.60

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	183,167	20,662.70	3,784,726,574	20,668.88	3,785,857,824	0.60
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	253,029	12,058.28	3,051,094,979	14,718.05	3,724,094,992	0.59
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	18,760.39	3,901,598,775	16,283.94	3,386,572,998	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,384	106,521.72	3,343,077,703	107,768.60	3,382,209,993	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,608	72,335.68	2,503,393,454	94,047.47	3,254,794,946	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	198,157	15,714.70	3,113,979,758	15,426.84	3,056,938,137	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,931	19,562.12	2,698,223,009	21,948.19	3,027,336,140	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	21,833.04	3,108,436,053	21,241.87	3,024,270,053	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	35,550	59,724.68	2,123,212,633	84,462.60	3,002,645,487	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	30,481.93	2,275,842,509	37,667.21	2,812,309,338	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	321,355	8,522.92	2,738,884,773	8,332.51	2,677,694,554	0.42
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	17,853.61	2,259,803,749	21,098.63	2,670,538,095	0.42

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.62
		素材	4.01
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.06
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.08

		メディア・娯楽	5.90
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.54
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	4.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
		銀行	5.41
		金融サービス	6.68
		保険	2.98
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.97
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.67
		電気通信サービス	1.15
		公益事業	2.64
		半導体・半導体製造装置	6.52
		不動産管理・開発	0.36
		小計	96.20
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	2.01
合計			98.23

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 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

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 EMIN	買建	232	アメリカドル	54,426,043.1	7,719,245,693	56,054,100	7,950,153,003	1.25
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	12	カナダドル	2,960,170	317,448,631	3,044,880	326,532,931	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	23	スイスフラン	2,553,261	429,560,630	2,534,140	426,343,713	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	145	ユーロ	6,638,194	1,042,993,041	6,590,250	1,035,460,080	0.16
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,632,025	449,028,503	4,754,375	460,889,112	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	45	イギリスポンド	3,417,853.75	617,537,816	3,485,475	629,755,623	0.10

(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注 2) 投資比率とは、マザー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。

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,670,000.00	236,572,200	236,629,815	0.04
	ユーロ	買建	300,000.00	47,249,100	47,101,740	0.01
	アメリカドル	売建	580,000.00	82,162,800	82,169,702	△0.01

(注 1) 評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

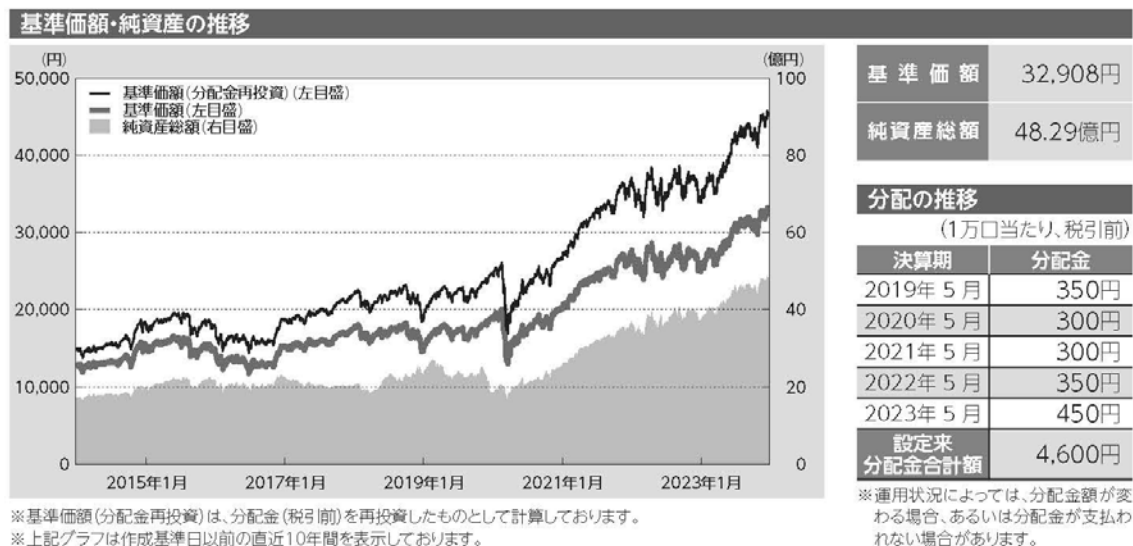
(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

《参考情報》

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

 運用実績

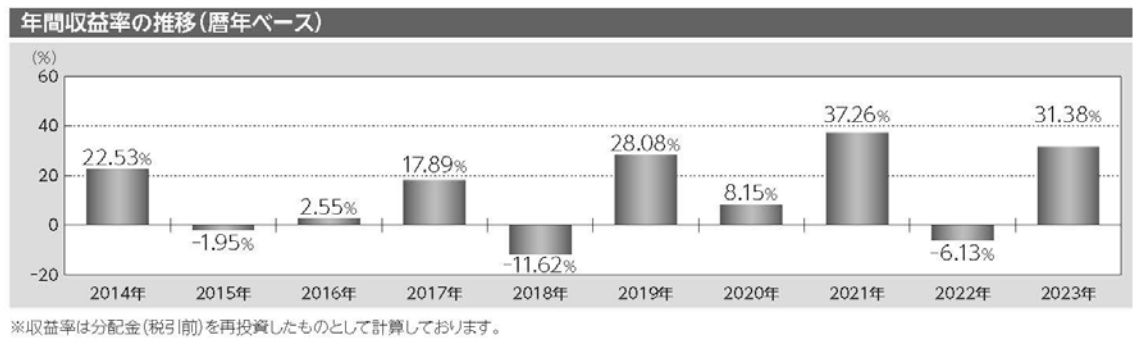
当初設定日：2000年5月30日  
作成基準日：2023年12月29日



**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	4.6%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	2.5%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	2.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.4%
META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.4%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
TESLA INC	アメリカ	株式	自動車・自動車部品	1.3%
BROADCOM INC	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	0.9%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	0.9%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### <申込手続>

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### <申込コース>

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」(※)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### <申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### <申込単位>

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### <申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

販売基準価額＝取得申込受付日の翌営業日の基準価額＋追加設定時信託財産留保額  
＝取得申込受付日の翌営業日の基準価額＋（取得申込受付日の翌営業日の基準価額  
×0.1%）

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の販売基準価額とします。

#### <申込手数料>

前記 第1ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (1) 申込手数料をご覧ください。

#### <申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### <受付不可日>

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### <申込受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所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、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及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できます。

#### <その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。委託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

## 2 【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### <一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### <一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### <解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ (<https://www.smtam.jp/>) でご覧いただけます。

#### <一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5 営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### <受付不可日>

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

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

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

###### イ. マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

###### ロ. マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

##### <基準価額の照会方法>

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ (<https://www.smtam.jp/>) でご覧いただけます。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3)【信託期間】

無期限とします。(2000年5月30日設定)

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了(償還)と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

### (4)【計算期間】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとします。

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

### (5)【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

- ①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。
  - ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
  - ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
  - ・やむを得ない事情が発生した場合
- ②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
- ③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
- ④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

#### (2)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)における公告等の手続き

委託会社は上記(1)①によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

- ①委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、ファンドの繰上償還を行いません。
- ④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、投資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、上記②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の

交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

##### (1)投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及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、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。
- ④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、新受託会社を選任します。
- ②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。

#### <反対者の買取請求権>

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資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。

#### <運用報告書>

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマースャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- ①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- ②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 4 【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金に対する請求権

- ① 受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ② 収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③ 上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- ④ 上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、
- ⑤ 受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (2) 償還金に対する請求権

- ① 受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ② 償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、
- ④ 受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、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いて、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。



### 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)」並びに同規則第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、第23期計算期間(2022年5月31日から2023年5月29日まで)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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年8月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

## 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」に掲げられている外国株式インデックス・オープンの2022年5月31日から2023年5月29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、外国株式インデックス・オープンの2023年5月29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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンズと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- (注) 1. 上記は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、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【外国株式インデックス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 22 期 (2022 年 5 月 30 日現在)	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,331,441	19,268,023
親投資信託受益証券	3,620,276,785	4,254,043,055
未収入金	52,301,718	70,176,815
流動資産合計	3,689,909,944	4,343,487,893
資産合計	3,689,909,944	4,343,487,893
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	48,709,433	66,194,642
未払解約金	3,397,047	3,714,080
未払受託者報酬	1,362,112	1,508,012
未払委託者報酬	14,204,802	15,726,324
未払利息	15	39
その他未払費用	188,015	213,732
流動負債合計	67,861,424	87,356,829
負債合計	67,861,424	87,356,829
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,391,698,112	1,470,992,051
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	2,230,350,408	2,785,139,013
(分配準備積立金)	1,090,512,730	1,424,511,054
元本等合計	3,622,048,520	4,256,131,064
純資産合計	3,622,048,520	4,256,131,064
負債純資産合計	3,689,909,944	4,343,487,893

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自 2021年6月1日 至 2022年5月30日		自 2022年5月31日 至 2023年5月29日	
営業収益				
受取利息		49		30
有価証券売買等損益		361,624,895		529,593,718
営業収益合計		361,624,944		529,593,748
営業費用				
支払利息		3,730		5,298
受託者報酬		2,633,870		2,994,012
委託者報酬		27,467,335		31,223,186
その他費用		188,015		213,732
営業費用合計		30,292,950		34,436,228
営業利益又は営業損失(△)		331,331,994		495,157,520
経常利益又は経常損失(△)		331,331,994		495,157,520
当期純利益又は当期純損失(△)		331,331,994		495,157,520
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(△)		16,383,423		11,538,779
期首剰余金又は期首欠損金(△)		1,782,689,537		2,230,350,408
剰余金増加額又は欠損金減少額		337,707,715		324,416,087
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		337,707,715		324,416,087
剰余金減少額又は欠損金増加額		156,285,982		187,051,581
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		156,285,982		187,051,581
分配金		48,709,433		66,194,642
期末剰余金又は期末欠損金(△)		2,230,350,408		2,785,139,013

(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 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第23期計算期間は2022年5月31日から2023年5月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第22期 (2022年5月30日現在)	第23期 (2023年5月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,391,698,112口	1,470,992,051口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,6026円 (26,026円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,8934円 (28,934円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自2021年6月1日 至2022年5月30日			第23期 自2022年5月31日 至2023年5月29日		
分配金の計算過程			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	51,470,944円	費用控除後の配当等収益額	A	71,858,466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	263,477,627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	411,760,275円
収益調整金額	C	1,522,334,714円	収益調整金額	C	1,755,640,450円
分配準備積立金額	D	824,273,592円	分配準備積立金額	D	1,007,086,955円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,661,556,877円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,246,346,146円
当ファンドの期末残存口数	F	1,391,698,112口	当ファンドの期末残存口数	F	1,470,992,051口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	19,124円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	22,069円
1万口当たり分配金額	H	350円	1万口当たり分配金額	H	450円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	48,709,433円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	66,194,642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

	第23期 自2022年5月31日 至2023年5月29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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(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) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

### (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。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	第 22 期 自 2021 年 6 月 1 日 至 2022 年 5 月 30 日	第 23 期 自 2022 年 5 月 31 日 至 2023 年 5 月 29 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	1,287,350,641 円	1,391,698,112 円
期中追加設定元本額	216,844,179 円	195,937,282 円
期中一部解約元本額	112,496,708 円	116,643,343 円

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	第 22 期 (2022 年 5 月 30 日現在)	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)
	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	346,769,144	514,408,880
合計	346,769,144	514,408,880

### (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

#### (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

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	890,134,765	4,254,043,055	
合計		890,134,765	4,254,043,055	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

##### 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)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

##### 外国株式インデックス マザーファンド

###### 貸借対照表

	2023年5月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,148,130,917
コール・ローン	307,034,669
株式	555,592,325,162
投資信託受益証券	179,853,892
投資証券	11,285,726,028
派生商品評価勘定	638,477,672
未収入金	37,466,677
未収配当金	826,943,261
差入委託証拠金	4,545,549,111
流動資産合計	582,561,507,389
資産合計	582,561,507,389
負債の部	



流動負債	
派生商品評価勘定	12,881,945
前受金	628,108,805
未払金	54,493,970
未払解約金	511,930,640
未払利息	621
流動負債合計	1,207,415,981
負債合計	1,207,415,981
純資産の部	
元本等	
元本	121,644,600,809
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	459,709,490,599
元本等合計	581,354,091,408
純資産合計	581,354,091,408
負債純資産合計	582,561,507,389

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年5月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年5月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		121,644,600,809口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.7791円 (47,791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

		2023年5月29日現在
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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年5月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券	

	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</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	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約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>

(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。
-------------

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年5月31日
期首元本額	124,778,059,850円
期中追加設定元本額	16,749,612,981円
期中一部解約元本額	19,883,072,022円
期末元本額	121,644,600,809円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,818,294,850円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,172,434円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,890,123,327円
世界経済インデックスファンド	11,659,741,137円
外国株式インデックス・オープン	890,134,765円
DCマイセレクション25	772,351,973円
DCマイセレクション50	3,718,032,451円
DCマイセレクション75	4,452,815,816円
DC外国株式インデックス・オープン	12,380,384,611円
DCマイセレクションS25	414,087,663円
DCマイセレクションS50	1,942,823,086円
DCマイセレクションS75	1,790,450,783円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	29,102,851円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	148,951,405円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	113,583,208円
DC世界経済インデックスファンド	9,236,960,810円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,084,876,749円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,046,222円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,528,471円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,463,022円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	9,533,949円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	37,948,390円

バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	8,554,198円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	24,215,124円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	207,653,821円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	151,997,491円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	1,134,703,301円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	79,260,045円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	20,988,576円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	138,760,023円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	45,581,213円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	904,970,174円
FOFs用外国株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	971,757,885円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,126,011,675円
コア投資戦略ファンド(安定型)	304,044,821円
コア投資戦略ファンド(成長型)	736,906,633円
分散投資コア戦略ファンドA	1,696,464,551円
分散投資コア戦略ファンドS	8,287,346,972円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,350,641,913円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	991,871,162円
コア投資戦略ファンド(切替型)	339,465,119円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	526,543,562円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,469,386円
SMT インデックスバランス・オープン	129,439,609円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	190,175,925円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	10,821,370,570円
SMT 世界経済インデックス・オープン	232,971,840円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	937,867,057円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	161,506,587円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,972,676円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	752,479,135円
グローバル経済コア	534,720,086円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,463,638円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,130,836円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	288,399,668円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	61,645,058円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	66,364,495円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	64,661,623円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	31,446,653円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	41,254,603円
10資産分散投資ファンド	54,763,415円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	136,715,824円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	25,019,730円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	474,207,670円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,478,711,110円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	106,517,990円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	82,116,060円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	84,417,317円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	76,032,093円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	214,968,295円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	209,372,552円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	208,311,048円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	209,262,076円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	207,193,300円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	103,512,005円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	134,994,647円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年5月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	11,600,373,933	
投資信託受益証券	△34,639,961	
投資証券	△2,699,256,376	
合計	8,866,477,596	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年5月29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	13,972,037,653	—	14,600,146,458	628,108,805
合計		13,972,037,653	—	14,600,146,458	628,108,805

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2023年5月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	553,845,170	—	554,878,352	1,033,182
	アメリカドル	505,582,450	—	506,618,640	1,036,190
	ユーロ	48,262,720	—	48,259,712	△3,008
	売建	382,163,800	—	385,710,060	△3,546,260
	アメリカドル	278,860,000	—	281,497,400	△2,637,400
	香港ドル	103,303,800	—	104,212,660	△908,860
	合計		936,008,970	—	940,588,412

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	33.41	781,526.72	
	BAKER HUGHES CO	77,332	27.89	2,156,789.48	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	138.90	2,533,952.70	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	77.63	658,457.66	
	CHEVRON CORP	146,184	154.08	22,524,030.72	
	CONOCOPHILLIPS	98,490	101.85	10,031,206.50	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	24.24	1,551,360.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	48.07	2,415,805.92	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	130.99	1,737,844.33	
	EOG RESOURCES INC	46,173	110.12	5,084,570.76	
	EQT CORPORATION	27,026	36.09	975,368.34	
	EXXON MOBIL	327,418	104.97	34,369,067.46	
	HALLIBURTON CO	70,302	30.20	2,123,120.40	
	HESS CORP	21,535	130.20	2,803,857.00	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	42.94	576,641.26	
	KINDER MORGAN INC	157,856	16.21	2,558,845.76	
	MARATHON OIL CORP	50,360	23.26	1,171,373.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	37,518	108.81	4,082,333.58	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,802	58.94	3,406,849.88	
	ONEOK INC	35,533	57.30	2,036,040.90	
	OVINTIV INC	20,998	34.44	723,171.12	
	PHILLIPS 66	37,618	94.91	3,570,324.38	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,482	207.93	3,635,032.26	
	SCHLUMBERGER	111,773	44.48	4,971,663.04	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	69.19	1,196,848.62		
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,315.01	700,900.33		
VALERO ENERGY CORP	30,789	113.82	3,504,403.98		
WILLIAMS COS	98,553	28.75	2,833,398.75		

AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	273.83	4,780,250.31
ALBEMARLE CORP	9,440	203.99	1,925,665.60
ALCOA CORP	15,500	33.69	522,195.00
AMCOR PLC	110,292	9.79	1,079,758.68
AVERY DENNISON CORP	6,638	162.97	1,081,794.86
BALL CORP	25,605	53.81	1,377,805.05
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	107.42	921,878.44
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	62.85	1,038,721.95
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.36	617,480.00
CORTEVA INC	55,406	55.17	3,056,749.02
CROWN HOLDINGS INC	9,940	78.77	782,973.80
DOW INC	55,796	50.34	2,808,770.64
DUPONT DE NEMOURS INC	38,372	67.60	2,593,947.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	81.31	718,129.92
ECOLAB INC	19,940	166.91	3,328,185.40
FMC CORP	10,507	103.59	1,088,420.13
FREEPORT-MCMORAN INC	111,600	34.77	3,880,332.00
INT'L PAPER CO	25,191	30.62	771,348.42
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	78.26	1,510,965.82
LINDE PLC	39,250	356.21	13,981,242.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	87.31	1,723,935.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,892	399.16	1,952,690.72
MOSAIC CO/THE	27,732	33.89	939,837.48
NEWMONT CORPORATION	61,808	40.68	2,514,349.44
NUCOR CORP	20,956	136.14	2,852,949.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	127.20	977,786.40
PPG INDUSTRIES INC	19,305	133.73	2,581,657.65
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,000	239.71	1,198,550.00
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	80.08	837,316.48
SEALED AIR CORP	11,690	40.10	468,769.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	229.14	4,431,338.46
STEEL DYNAMICS INC	13,766	95.65	1,316,717.90
VULCAN MATERIALS CO	10,153	196.00	1,989,988.00
WESTLAKE CORP	2,222	111.88	248,597.36
WESTROCK CO	21,356	28.47	608,005.32
3 M COMPANY	43,028	96.94	4,171,134.32

AECOM	10,456	77.06	805,739.36
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	57.44	632,127.20
ALLEGION PLC	7,601	107.10	814,067.10
AMETEK INC	17,753	148.22	2,631,349.66
AXON ENTERPRISE INC	5,367	194.95	1,046,296.65
BOEING CO	44,686	203.63	9,099,410.18
CARLISLE COS INC	4,378	216.83	949,281.74
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	40.89	2,786,980.62
CATERPILLAR	41,312	211.80	8,749,881.60
CUMMINS INC	11,372	212.64	2,418,142.08
DEERE&CO	22,675	357.21	8,099,736.75
DOVER CORP	10,657	137.03	1,460,328.71
EATON CORP	31,311	182.46	5,713,005.06
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	79.51	3,688,150.86
FASTENAL CO	44,011	55.16	2,427,646.76
FERGUSON PLC	16,011	147.66	2,364,184.26
FORTIVE CORP	25,400	67.82	1,722,628.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.18	641,075.80
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	115.43	601,505.73
GENERAL DYNAMICS CORP	18,106	205.25	3,716,256.50
GENERAL ELECTRIC CO	87,133	102.74	8,952,044.42
GRACO INC	13,378	77.13	1,031,845.14
GRAINGER (WW) INC	3,667	664.23	2,435,731.41
HEICO CORP	3,640	159.30	579,852.00
HEICO CORP-CLASS A	6,394	126.16	806,667.04
HONEYWELL INTL INC	52,641	193.75	10,199,193.75
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	43.50	1,374,339.00
HUBBELL INC	4,432	290.91	1,289,313.12
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	201.29	708,943.38
IDEX CORP	5,916	203.48	1,203,787.68
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	225.07	5,485,180.97
INGERSOLL-RAND INC	31,562	58.89	1,858,686.18
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	49.68	630,936.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	53,782	61.88	3,328,030.16
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	178.76	2,624,554.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	280.54	708,644.04



LOCKHEED MARTIN CORP	18,902	448.45	8,476,601.90
MASCO CORP	19,462	50.77	988,085.74
NORDSON CORP	4,121	220.82	909,999.22
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	438.32	5,080,128.80
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	81.79	2,769,245.82
OWENS CORNING	6,460	109.80	709,308.00
PACCAR INC	42,159	71.35	3,008,044.65
PARKER HANNIFIN CORP	10,335	332.88	3,440,314.80
PENTAIR PLC	14,533	57.60	837,100.80
PLUG POWER INC	41,884	8.25	345,543.00
QUANTA SERVICES INC	11,465	174.00	1,994,910.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,466	93.26	10,954,879.16
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	286.23	2,629,881.24
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.97	580,361.16
SMITH (A.O.) CORP	9,016	66.67	601,096.72
SNAP-ON INC	4,000	257.35	1,029,400.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	78.70	991,462.60
TEXTRON	16,934	62.81	1,063,624.54
TORO CO	8,812	104.36	919,620.32
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	166.80	3,108,818.40
TRANSDIGM GROUP INC	3,986	792.49	3,158,865.14
UNITED RENTALS INC	5,364	350.97	1,882,603.08
WABTEC CORP	12,976	94.74	1,229,346.24
XYLEM INC	18,991	98.35	1,867,764.85
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	212.48	6,983,367.68
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	96.25	1,093,785.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	149.59	1,457,305.78
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	62.50	666,750.00
CINTAS CORP	7,433	468.72	3,483,995.76
CLARIVATE PLC	27,357	7.68	210,101.76
COPART INC	35,164	87.88	3,090,212.32
COSTAR GROUP INC	32,116	78.49	2,520,784.84
EQUIFAX INC	9,230	210.64	1,944,207.20
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	114.01	1,215,460.61
LEIDOS HOLDINGS	11,220	80.30	900,966.00
PAYCHEX INC	26,437	108.17	2,859,690.29

PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	280.95	1,189,823.25
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	172.61	590,844.03
REPUBLIC SERVICES INC	18,327	141.08	2,585,573.16
ROBERT HALF INTL INC	7,185	67.50	484,987.50
ROLLINS INC	17,468	39.33	687,016.44
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	55.21	1,067,485.35
TRANSUNION	15,741	72.40	1,139,648.40
VERISK ANALYTICS INC	12,079	217.07	2,621,988.53
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	138.45	2,737,848.75
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	161.28	5,242,567.68
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	97.54	816,117.18
CSX CORP	169,261	30.81	5,214,931.41
DELTA AIR LINES INC	14,609	35.89	524,317.01
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	115.51	1,418,462.80
FEDEX CORP	19,274	224.15	4,320,267.10
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.04	343,553.44
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	170.27	1,200,744.04
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	55.96	762,343.08
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	210.57	4,019,149.59
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,302	315.83	2,306,190.66
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.65	401,253.45
U-HAUL HOLDING CO	6,606	56.43	372,776.58
UBER TECHNOLOGIES INC	119,525	38.45	4,595,736.25
UNION PACIFIC CORP	48,838	193.10	9,430,617.80
UNITED PARCEL SERVICE B	58,304	171.57	10,003,217.28
APTIV PLC	21,362	92.13	1,968,081.06
BORGWARNER INC	19,781	47.17	933,069.77
FORD MOTOR COMPANY	306,411	12.09	3,704,508.99
GENERAL MOTORS CO	112,798	33.29	3,755,045.42
LEAR CORP	5,287	127.61	674,674.07
LUCID GROUP INC	31,234	7.87	245,811.58
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	15.14	407,795.90
TESLA INC	213,069	193.17	41,158,538.73
DR HORTON INC	25,466	106.71	2,717,476.86
GARMIN LTD	12,854	103.83	1,334,630.82
HASBRO INC	10,572	60.07	635,060.04

LENNAR CORP-CL A	20,844	107.45	2,239,687.80
LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	340.26	3,189,597.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	95.10	395,901.30
NEWELL BRANDS INC	31,461	8.73	274,654.53
NIKE B	99,374	107.51	10,683,698.74
NVR INC	247	5,617.56	1,387,537.32
PULTE GROUP INC	16,747	65.87	1,103,124.89
VF CORP	25,718	18.05	464,209.90
WHIRLPOOL CORP	3,785	134.22	508,022.70
AIRBNB INC-CLASS A	29,936	106.81	3,197,464.16
ARAMARK	16,686	39.54	659,764.44
BOOKING HOLDINGS INC	3,056	2,591.13	7,918,493.28
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	42.15	740,154.00
CARNIVAL CORPORATION	84,361	11.28	951,592.08
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	2,071.02	4,471,332.18
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	161.28	1,484,904.96
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	299.83	853,915.84
DOORDASH INC - A	19,212	67.44	1,295,657.28
EXPEDIA GROUP INC	11,638	96.35	1,121,321.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,810	138.09	2,873,652.90
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	56.35	1,440,306.00
MARRIOTT INTL A	21,339	171.76	3,665,186.64
MCDONALD'S CORP	58,058	286.04	16,606,910.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	40.39	919,034.06
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	79.00	1,352,164.00
STARBUCKS CORP	90,925	98.53	8,958,840.25
VAIL RESORTS INC	3,014	241.41	727,609.74
WYNN RESORTS LTD	9,302	101.13	940,711.26
YUM BRANDS INC	21,705	129.86	2,818,611.30
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,442	78.66	4,833,027.72
ALPHABET INC-CL A	474,294	124.61	59,101,775.34
ALPHABET INC-CL C	433,996	125.43	54,436,118.28
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,752	330.25	2,890,348.00
COMCAST CORP-CL A	344,872	39.48	13,615,546.56
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	6.66	134,079.12
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	126.80	2,732,666.80

FOX CORP - CLASS A	21,544	31.40	676,481.60
FOX CORP- CLASS B	10,345	29.25	302,591.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	37.71	1,075,149.81
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	75.02	686,658.06
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	71.40	1,098,060.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	28.42	386,057.28
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	28.45	181,624.80
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	82.15	1,190,435.65
MATCH GROUP INC	22,730	34.11	775,320.30
META PLATFORMS INC-CLASS A	179,617	262.04	47,066,838.68
NETFLIX INC	35,024	378.88	13,269,893.12
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.54	620,700.66
OMNICOM GROUP	16,538	89.95	1,487,593.10
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	14.91	724,417.26
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	24.23	1,108,934.41
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	40.12	1,125,727.08
ROKU INC	9,122	56.05	511,288.10
SEA LTD-ADR	28,338	60.12	1,703,680.56
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	3.53	213,452.04
SNAP INC - A	83,375	10.28	857,095.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	138.98	1,788,255.66
THE WALT DISNEY CO	144,810	88.29	12,785,274.90
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	67.67	2,481,526.57
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	11.44	2,029,604.72
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	23.48	515,033.80
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	112.15	517,684.40
AMAZON.COM	727,070	120.11	87,328,377.70
AUTOZONE INC	1,495	2,460.79	3,678,881.05
BATH & BODY WORKS INC	19,806	36.89	730,643.34
BEST BUY COMPANY INC	15,285	74.33	1,136,134.05
BURLINGTON STORES INC	5,108	159.11	812,733.88
CARMAX INC	13,591	72.48	985,075.68
CHEWY INC - CLASS A	6,878	30.50	209,779.00
EBAY	41,952	44.36	1,860,990.72
ETSY INC	10,294	85.53	880,445.82
GENUINE PARTS CO	11,319	157.21	1,779,459.99

HOME DEPOT	80,884	292.83	23,685,261.72
LKQ CORP	19,286	53.59	1,033,536.74
LOWES COMPANIES	47,875	206.52	9,887,145.00
MERCADOLIBRE INC	3,552	1,282.26	4,554,587.52
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,175	923.00	4,776,525.00
POOL CORP	3,304	328.01	1,083,745.04
ROSS STORES INC	28,076	103.37	2,902,216.12
TJX COMPANIES INC	91,766	77.00	7,065,982.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	211.50	1,887,003.00
ULTA BEAUTY INC	3,920	420.27	1,647,458.40
COSTCO WHOLESALE CORP	35,279	507.26	17,895,625.54
DOLLAR GENERAL CORP	17,687	205.10	3,627,603.70
DOLLAR TREE INC	17,931	142.45	2,554,270.95
KROGER CO	51,785	47.31	2,449,948.35
SYSCO CORP	39,357	70.72	2,783,327.04
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	138.93	5,035,239.99
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	30.01	1,793,607.67
WALMART INC	117,948	146.42	17,269,946.16
ALTRIA GROUP INC	142,110	44.61	6,339,527.10
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	72.73	3,188,119.55
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	61.58	1,478,289.48
BUNGE LIMITED	11,604	94.30	1,094,257.20
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.51	817,412.19
COCA-COLA CO	326,933	60.26	19,700,982.58
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	62.88	967,974.72
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.84	1,404,191.36
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	232.88	3,013,467.20
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	63.57	841,793.94
GENERAL MILLS INC	46,616	84.18	3,924,134.88
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	257.72	3,097,536.68
HORMEL FOODS CORP	23,338	38.47	897,812.86
JM SMUCKER CO	7,850	146.56	1,150,496.00
KELLOGG CO	18,772	67.67	1,270,301.24
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	31.41	1,952,288.55
KRAFT HEINZ CO/THE	56,727	38.34	2,174,913.18
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	109.45	1,299,828.20

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	86.93	1,807,274.70
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	60.64	889,528.16
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	75.13	8,137,180.04
MONSTER BEVERAGE CORP	60,676	57.61	3,495,544.36
PEPSICO INC	108,690	183.58	19,953,310.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,090	90.84	11,272,335.60
TYSON FOODS INC	23,306	52.01	1,212,145.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	93.97	1,817,943.62
CLOROX COMPANY	9,570	159.09	1,522,491.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	76.21	4,747,044.69
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	194.44	3,533,752.56
KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	136.30	3,594,639.90
PROCTER & GAMBLE CO	187,873	145.40	27,316,734.20
ABBOTT LABORATORIES	137,251	102.87	14,119,010.37
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	285.39	1,696,072.77
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,707	168.41	1,971,575.87
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	41.29	1,652,136.77
BECTON DICKINSON & CO	22,473	241.12	5,418,689.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,067	51.06	5,875,321.02
CARDINAL HEALTH	21,902	82.83	1,814,142.66
CENTENE CORP	45,335	62.72	2,843,411.20
CVS HEALTH CORP	104,660	67.64	7,079,202.40
DAVITA INC	4,627	94.28	436,233.56
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	36.96	656,927.04
DEXCOM INC	30,645	115.05	3,525,707.25
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	82.01	3,973,876.56
ELEVANCE HEALTH INC	19,014	445.89	8,478,152.46
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	78.43	2,346,704.03
HCA HEALTHCARE INC	16,567	264.41	4,380,480.47
HENRY SCHEIN INC	11,747	74.92	880,085.24
HOLOGIC INC	18,875	79.03	1,491,691.25
HUMANA INC	9,946	496.60	4,939,183.60
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	468.94	3,165,813.94
INSULET CORP	5,246	272.63	1,430,216.98
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	306.90	8,666,242.20
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	215.60	1,411,748.80

MASIMO CORP	4, 147	157. 35	652, 530. 45
MCKESSON CORP	11, 489	387. 95	4, 457, 157. 55
MEDTRONIC PLC	105, 263	81. 46	8, 574, 723. 98
MOLINA HEALTHCARE INC	4, 545	273. 03	1, 240, 921. 35
NOVOCURE LTD	7, 933	73. 56	583, 551. 48
QUEST DIAGNOSTICS	8, 679	133. 77	1, 160, 989. 83
RESMED INC	11, 169	215. 44	2, 406, 249. 36
STERIS PLC	8, 018	200. 44	1, 607, 127. 92
STRYKER CORP	26, 887	272. 58	7, 328, 858. 46
TELEFLEX INC	3, 934	232. 35	914, 064. 90
THE CIGNA GROUP	24, 609	244. 10	6, 007, 056. 90
THE COOPER COS INC	4, 134	369. 39	1, 527, 058. 26
UNITEDHEALTH GROUP INC	74, 171	481. 52	35, 714, 819. 92
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4, 672	127. 98	597, 922. 56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11, 255	165. 48	1, 862, 477. 40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16, 923	127. 65	2, 160, 220. 95
ABBVIE INC	140, 386	137. 56	19, 311, 498. 16
AGILENT TECHNOLOGIES	23, 785	120. 42	2, 864, 189. 70
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9, 643	188. 26	1, 815, 391. 18
AMGEN	42, 448	216. 93	9, 208, 244. 64
AVANTOR INC	49, 647	20. 65	1, 025, 210. 55
BIO-RAD LABORATORIES-A	1, 853	379. 00	702, 287. 00
BIO-TECHNE CORP	12, 980	83. 50	1, 083, 830. 00
BIOGEN INC	11, 060	298. 66	3, 303, 179. 60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14, 783	88. 48	1, 308, 073. 75
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	169, 623	63. 82	10, 825, 339. 86
CATALENT INC	13, 739	37. 12	509, 991. 68
CHARLES RIVER LABORATORIES	4, 204	194. 12	816, 080. 48
DANAHER CORP	54, 898	232. 21	12, 747, 864. 58
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36, 061	8. 32	300, 027. 52
EXACT SCIENCES CORP	14, 756	82. 01	1, 210, 139. 56
GILEAD SCIENCES INC	99, 953	77. 09	7, 705, 376. 77
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17, 926	99. 61	1, 785, 608. 86
ILLUMINA INC	12, 687	195. 89	2, 485, 256. 43
INCYTE CORP	15, 212	62. 58	951, 966. 96
IQVIA HOLDINGS INC	15, 126	199. 45	3, 016, 880. 70

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	125.90	625,848.90
JOHNSON & JOHNSON	207,999	154.35	32,104,645.65
LILLY (ELI) & CO	63,340	425.79	26,969,538.60
MERCK & CO	201,265	111.07	22,354,503.55
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,348.19	2,437,527.52
MODERNA INC	26,107	126.24	3,295,747.68
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	91.22	615,005.24
PFIZER	445,597	37.60	16,754,447.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	725.05	6,246,305.75
REPLIGEN CORP	4,353	171.02	744,450.06
REVVITY INC	10,545	116.67	1,230,285.15
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	32.38	974,087.54
SEAGEN INC	10,981	193.49	2,124,713.69
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.45	686,450.45
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,133	522.02	16,252,048.66
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	207.32	750,083.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	329.99	6,825,843.15
VIATRIS INC	89,720	9.11	817,349.20
WATERS CORP	4,749	260.61	1,237,636.89
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	343.50	1,980,964.50
ZOETIS INC	36,859	164.74	6,072,151.66
BANK OF AMERICA CORP	574,499	28.31	16,264,066.69
CITIGROUP	153,036	44.60	6,825,405.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	27.01	1,067,489.22
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.26	1,374,649.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	1,273.15	1,209,492.50
FIRST HORIZON CORP	44,308	10.88	482,071.04
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.52	1,200,458.24
JPMORGAN CHASE & CO	232,844	136.94	31,885,657.36
KEY CORP	71,223	9.89	704,395.47
M & T BANK CORP	13,674	123.60	1,690,106.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,049	118.78	3,806,780.22
REGIONS FINL CORP	70,810	17.78	1,259,001.80
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	30.70	3,197,558.50
US BANCORP	111,007	30.67	3,404,584.69
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	36.89	526,530.97



WELLS FARGO & CO	304,998	41.23	12,575,067.54
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.62	573,101.98
AMERICAN EXPRESS	50,389	157.24	7,923,166.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	309.13	2,690,049.26
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	65.42	2,083,888.68
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	85.20	1,088,856.00
BANK NEW YORK CO	61,254	40.78	2,497,938.12
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,354	320.60	33,135,292.40
BLACKROCK INC	11,937	672.30	8,025,245.10
BLACKSTONE INC	56,921	85.70	4,878,129.70
BLOCK INC	43,057	59.00	2,540,363.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,514	102.85	3,035,514.90
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	27.95	437,948.55
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	133.77	1,187,208.75
CME GROUP INC	28,271	176.67	4,994,637.57
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	56.92	545,065.92
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	102.36	2,149,764.72
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	25.42	711,327.86
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	388.44	1,222,809.12
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	46,912	54.46	2,554,827.52
FISERV INC	47,748	113.77	5,432,289.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	233.75	1,402,967.50
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.61	641,582.70
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	38.39	165,712.82
GLOBAL PAYMENTS INC	20,864	99.97	2,085,774.08
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,705	332.01	8,866,327.05
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	105.16	4,609,478.28
INVESCO LTD	26,420	14.89	393,393.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	148.56	774,443.28
KKR & CO INC	44,282	51.68	2,288,493.76
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	197.70	1,262,512.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	279.28	895,650.96
MASTERCARD INC-CLASS A	67,952	374.37	25,439,190.24
MOODY' S CORP	13,065	313.00	4,089,345.00
MORGAN STANLEY	100,851	83.90	8,461,398.90
MSCI INC	6,518	475.83	3,101,459.94

NASDAQ INC	28,971	54.22	1,570,807.62
NORTHERN TRUST CORP	15,902	72.62	1,154,803.24
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	60.22	5,223,904.34
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	106.63	1,909,423.41
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	93.16	1,442,675.76
S&P GLOBAL INC	26,714	360.78	9,637,876.92
SCHWAB (CHARLES) CORP	116,330	53.67	6,243,431.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	57.43	548,456.50
STATE STREET CORP	29,059	68.47	1,989,669.73
SYNCHRONY FINANCIAL	36,117	30.90	1,116,015.30
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.42	435,704.22
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	69.03	625,480.83
VISA INC-CLASS A SHARES	128,824	225.01	28,986,688.24
AFLAC	46,816	64.49	3,019,163.84
ALLSTATE CORP	20,709	109.53	2,268,256.77
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	113.85	719,418.15
AMERICAN INT'L GROUP	59,547	54.07	3,219,706.29
AON PLC	16,687	310.67	5,184,150.29
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	71.00	2,110,546.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,436	203.81	3,349,821.16
ASSURANT INC	4,726	124.78	589,710.28
BROWN & BROWN INC	19,873	62.87	1,249,415.51
CHUBB LTD	33,210	190.09	6,312,888.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,206	98.32	1,101,773.92
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	219.00	474,354.00
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	350.06	1,150,997.28
FNF GROUP	20,461	34.73	710,610.53
GLOBE LIFE INC	8,106	105.24	853,075.44
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	68.68	1,698,525.08
LOEWS CORP	16,741	57.11	956,078.51
MARKEL GROUP INC	1,007	1,328.65	1,337,950.55
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	173.23	6,824,569.08
METLIFE INC	54,127	51.81	2,804,319.87
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	68.17	1,263,599.12
PROGRESSIVE CORP	47,071	128.49	6,048,152.79
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,190	80.14	2,339,286.60

TRAVELERS COS INC/THE	18,521	172.29	3,190,983.09
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	221.02	1,867,176.96
WR BERKLEY CORP	17,572	56.15	986,667.80
WEYERHAEUSER CO	59,710	28.25	1,686,807.50
ACCENTURE PLC-CL A	49,817	303.60	15,124,441.20
ADOBE INC	36,682	415.39	15,237,335.98
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	90.57	1,040,105.88
ANSYS INC	6,794	319.40	2,170,003.60
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	164.00	392,616.00
ATLASSIAN CORP-CL A	11,855	166.15	1,969,708.25
AUTODESK INC	17,467	198.90	3,474,186.30
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	47.82	669,288.72
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	98.27	731,423.61
BLACK KNIGHT INC	11,543	56.09	647,446.87
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	228.33	4,878,042.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	123.86	1,006,238.64
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	61.14	1,240,102.62
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	62.88	2,511,175.68
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,682	154.12	2,571,029.84
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	154.89	480,159.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	93.16	1,875,962.92
DOCUSIGN INC	14,969	55.00	823,295.00
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.81	526,181.08
DYNATRACE INC	14,790	49.70	735,063.00
EPAM SYSTEMS INC	4,768	258.08	1,230,525.44
FAIR ISAAC CORP	2,115	791.62	1,674,276.30
FORTINET INC	51,829	67.77	3,512,451.33
GARTNER INC	6,340	343.26	2,176,268.40
GEN DIGITAL INC	43,555	17.11	745,226.05
GODADDY INC - CLASS A	11,388	72.35	823,921.80
HUBSPOT INC	3,646	496.21	1,809,181.66
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	128.89	9,230,586.24
INTUIT INC	21,209	418.43	8,874,481.87
MICROSOFT CORP	562,164	332.89	187,138,773.96
MONGODB INC	5,325	283.36	1,508,892.00
OKTA INC	11,505	88.10	1,013,590.50

ORACLE CORP	128,416	104.08	13,365,537.28
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	13.65	1,709,580.60
PALO ALTO NETWORKS INC	24,051	211.70	5,091,596.70
PTC INC	8,226	131.03	1,077,852.78
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,196	449.96	3,687,872.16
SALESFORCE INC	79,382	215.44	17,102,058.08
SERVICENOW INC	16,202	537.46	8,707,926.92
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	150.01	2,652,176.80
SPLUNK INC	13,355	99.58	1,329,890.90
SYNOPSYS INC	12,010	444.73	5,341,207.30
TWILIO INC - A	12,842	60.10	771,804.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	393.60	1,314,230.40
UNITY SOFTWARE INC	21,912	27.65	605,866.80
VERISIGN INC	7,790	225.99	1,760,462.10
VMWARE INC-CLASS A	16,717	133.24	2,227,373.08
WIX.COM LTD	5,010	77.65	389,026.50
WORKDAY INC-CLASS A	15,455	216.07	3,339,361.85
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,515	66.27	1,094,449.05
ZSCALER INC	7,204	130.62	940,986.48
AMPHENOL CORPORATION	47,254	76.61	3,620,128.94
APPLE INC	1,262,821	175.43	221,536,688.03
ARISTA NETWORKS INC	18,674	170.35	3,181,115.90
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	128.54	557,606.52
CDW CORP/DE	10,882	174.22	1,895,862.04
CISCO SYSTEMS	326,126	49.86	16,260,642.36
COGNEX CORP	14,352	54.82	786,776.64
CORNING	64,989	31.53	2,049,103.17
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	48.51	1,090,553.31
F5 INC	4,851	148.20	718,918.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	15.34	1,494,606.88
HP INC	77,329	31.30	2,420,397.70
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	30.50	772,290.50
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	161.63	2,236,635.94
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	284.57	3,703,393.98
NETAPP INC	18,303	69.83	1,278,098.49
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	62.29	1,032,955.07

TE CONNECTIVITY LTD	24,490	122.78	3,006,882.20
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	397.31	1,549,111.69
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	47.19	836,112.42
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	39.71	1,024,120.90
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	264.72	1,101,764.64
AT&T INC	569,565	15.50	8,828,257.50
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	16.34	253,531.44
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	17.15	323,603.35
T-MOBILE US INC	49,791	135.15	6,729,253.65
VERIZON COMMUNICATIONS	331,476	35.00	11,601,660.00
AES CORP	54,375	19.87	1,080,431.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.97	1,059,054.66
AMEREN CORPORATION	20,898	80.77	1,687,931.46
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	82.25	3,282,350.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,892	143.46	1,992,946.32
ATMOS ENERGY CORP	11,302	113.70	1,285,037.40
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.34	1,345,186.44
CMS ENERGY CORP	23,697	57.10	1,353,098.70
CONSOLIDATED EDISON INC	27,140	92.69	2,515,606.60
CONSTELLATION ENERGY	25,114	83.85	2,105,808.90
DOMINION ENERGY INC	66,179	49.86	3,299,684.94
DTE ENERGY COMPANY	15,851	106.51	1,688,290.01
DUKE ENERGY CORP	60,751	88.70	5,388,613.70
EDISON INTL	30,339	65.63	1,991,148.57
ENTERGY CORP	16,181	96.80	1,566,320.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	40.61	828,403.39
EVERGY INC	18,475	57.46	1,061,573.50
EVERSOURCE ENERGY	27,450	68.69	1,885,540.50
EXELON CORP	81,368	39.39	3,205,085.52
FIRSTENERGY CORP	45,523	36.71	1,671,149.33
NEXTERA ENERGY INC	155,688	73.92	11,508,456.96
NISOURCE INC	32,351	26.85	868,624.35
NRG ENERGY INC	19,068	33.94	647,167.92
PG&E CORP	118,132	16.52	1,951,540.64
PPL CORPORATION	58,459	26.01	1,520,518.59
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	59.57	2,351,108.76

	SEMPRA ENERGY	24,582	143.85	3,536,120.70	
	SOUTHERN CO	85,837	69.47	5,963,096.39	
	UGI CORP	18,019	28.30	509,937.70	
	VISTRA CORP	31,797	24.45	777,436.65	
	WEC ENERGY GROUP INC	26,142	86.90	2,271,739.80	
	XCEL ENERGY INC	43,741	64.32	2,813,421.12	
	ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	127.03	16,228,844.68	
	ANALOG DEVICES	40,091	176.53	7,077,264.23	
	APPLIED MATERIALS	68,040	136.06	9,257,522.40	
	BROADCOM INC	33,103	812.73	26,903,801.19	
	ENPHASE ENERGY INC	11,020	165.20	1,820,504.00	
	ENTEGRIS INC	12,483	107.22	1,338,427.26	
	FIRST SOLAR INC	7,921	201.77	1,598,220.17	
	INTEL CORP	325,216	29.00	9,431,264.00	
	KLA CORP	11,488	461.19	5,298,150.72	
	LAM RESEARCH CORP	10,752	628.25	6,754,944.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	65,557	65.51	4,294,639.07	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	78.32	3,468,714.48	
	MICRON TECHNOLOGY	86,632	73.93	6,404,703.76	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	520.92	1,839,368.52	
	NVIDIA CORP	196,006	389.46	76,336,496.76	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	181.18	3,706,580.44	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	86.62	2,985,618.16	
	QORVO INC	8,556	100.04	855,942.24	
	QUALCOMM	89,339	110.35	9,858,558.65	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	105.05	1,404,728.60	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	294.41	1,223,567.96	
	TERADYNE INC	12,318	103.71	1,277,499.78	
	TEXAS INSTRUMENTS	72,562	176.29	12,791,954.98	
	WOLFSPEED INC	10,256	51.20	525,107.20	
	CBRE GROUP INC-A	25,904	75.57	1,957,565.28	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.37	431,319.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	13,427	44.95	603,543.65	
	アメリカドル 小計	26,913,831		2,886,926,600.26 (406,392,657,518)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	16.91	927,682.60	

CAMECO CORP	31,793	37.25	1,184,289.25
CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,954	75.82	6,668,672.28
CENOVUS ENERGY INC	111,293	22.69	2,525,238.17
ENBRIDGE	159,030	48.85	7,768,615.50
IMPERIAL OIL	16,488	63.99	1,055,067.12
KEYERA CORP	18,607	30.65	570,304.55
PARKLAND CORP	14,075	33.50	471,512.50
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	41.91	1,913,862.06
SUNCOR ENERGY	109,226	38.86	4,244,522.36
TC ENERGY CORP	78,423	54.11	4,243,468.53
TOURMALINE OIL CORP	25,009	59.44	1,486,534.96
AGNICO EAGLE MINES	36,354	69.45	2,524,785.30
BARRICK GOLD CORP	133,727	23.14	3,094,442.78
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	65.61	862,049.79
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	30.58	1,325,948.80
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	198.40	3,048,019.20
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.68	553,725.96
KINROSS GOLD CORP	108,451	6.46	700,593.46
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.14	631,144.02
NUTRIEN LTD	41,509	76.11	3,159,249.99
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	20.22	372,270.42
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	52.17	1,846,087.62
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	97.15	340,510.75
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	37,268	60.77	2,264,776.36
CAE INC	25,999	29.98	779,450.02
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	107.15	558,572.95
WSP GLOBAL INC	9,951	173.36	1,725,105.36
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	49.85	673,224.25
RB GLOBAL INC	10,245	73.04	748,294.80
THOMSON REUTERS CORP	13,293	169.14	2,248,378.02
AIR CANADA	13,805	21.75	300,258.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	155.16	7,142,635.44
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	72,867	104.92	7,645,205.64
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	148.09	864,401.33
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	70.18	1,421,425.72
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	100.10	307,307.00

GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	38.59	659,078.61
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	99.69	2,300,147.37
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.74	497,648.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	168.90	762,245.70
DOLLARAMA INC	22,000	83.74	1,842,280.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	65,467	67.39	4,411,821.13
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	35.45	540,718.85
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	120.85	1,560,536.05
METRO INC	18,840	73.51	1,384,928.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	164.94	861,976.44
SAPUTO INC	20,898	35.35	738,744.30
BANK MONTREAL	54,470	114.74	6,249,887.80
BANK NOVA SCOTIA	93,348	66.80	6,235,646.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	73,910	57.54	4,252,781.40
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	100.10	2,731,628.90
ROYAL BANK OF CANADA	109,566	123.08	13,485,383.28
TORONTO-DOMINION BANK	142,518	78.26	11,153,458.68
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.32	1,227,322.32
BROOKFIELD CORP	114,442	42.87	4,906,128.54
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.15	656,466.85
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.94	299,253.90
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	43.27	186,104.27
ONEX CORP	6,603	62.20	410,706.60
TMX GROUP LTD	4,685	146.44	686,071.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	992.42	1,740,704.68
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.23	933,203.24
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	87.60	611,185.20
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	202.59	2,685,330.45
MANULIFE FINANCIAL CORP	143,336	25.53	3,659,368.08
POWER CORP OF CANADA	43,577	35.44	1,544,368.88
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,433	66.95	3,242,589.35
CGI INC - CL A	16,084	140.58	2,261,088.72
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,688.93	4,313,043.72
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	104.94	732,900.96
OPEN TEXT CORP	20,463	56.77	1,161,684.51
SHOPIFY INC - CLASS A	95,607	80.69	7,714,528.83



	BCE INC	6,203	61.87	383,779.61
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,381	61.51	1,868,735.31
	TELUS CORP	32,908	26.34	866,796.72
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	11.28	584,507.04
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	22.83	556,937.85
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	45.61	515,164.95
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.32	374,967.68
	EMERA INC	23,223	56.38	1,309,312.74
	FORTIS INC	35,547	57.46	2,042,530.62
	HYDRO ONE LTD	28,888	38.63	1,115,943.44
	NORTHLAND POWER INC	17,854	29.76	531,335.04
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	197.15	530,333.50
	カナダドル 小計	3,211,307		187,518,939.92 (19,398,834,334)
ユーロ	ENI	198,271	13.19	2,615,591.03
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.39	412,088.18
	NESTE OIL OYJ	32,766	36.19	1,185,801.54
	OMV AG	12,549	43.24	542,618.76
	REPSOL SA	111,112	13.07	1,452,789.40
	TENARIS SA	40,648	11.98	486,963.04
	TOTALENERGIES SE	195,959	55.76	10,926,673.84
	AIR LIQUIDE	41,239	159.34	6,571,022.26
	AKZO NOBEL	15,301	72.26	1,105,650.26
	ARCELORMITTAL	41,072	24.31	998,460.32
	ARKEMA	4,369	85.82	374,947.58
	BASF SE	73,837	46.91	3,463,693.67
	COVESTRO AG	14,454	38.82	561,104.28
	CRH PLC	60,480	45.20	2,733,696.00
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	110.64	1,516,542.48
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.67	315,447.79
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,001	68.28	682,868.28
	OCI NV	7,248	22.35	161,992.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	34.21	667,231.84
	SOLVAY SA	5,356	101.50	543,634.00
	STORA ENSO OYJ R	42,169	12.03	507,293.07
	SYMRISE AG	10,018	103.50	1,036,863.00

UMICORE	17,605	27.49	483,961.45
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.41	1,244,748.84
VOESTALPINE AG	7,152	29.80	213,129.60
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	31.11	486,000.42
AIRBUS SE	46,560	125.68	5,851,660.80
ALSTOM	24,388	26.53	647,013.64
BOUYGUES ORD	16,606	30.24	502,165.44
BRENTAG SE	12,514	74.62	933,794.68
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.42	1,006,342.92
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,494	28.40	951,229.60
DASSAULT AVIATION SA	2,130	164.50	350,385.00
EIFFAGE	5,924	101.40	600,693.60
FERROVIAL SA	37,026	28.97	1,072,643.22
GEA GROUP AG	13,382	39.06	522,700.92
IMCD NV	4,641	142.60	661,806.60
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	63.30	784,793.40
KNORR-BREMSE AG	5,022	66.00	331,452.00
KONE OYJ-B	26,369	48.44	1,277,314.36
LEGRAND SA	21,768	88.34	1,922,985.12
METSO CORPORATION	51,970	10.18	529,054.60
MTU AERO ENGINES AG	3,962	222.10	879,960.20
PRYSMIAN SPA	21,155	35.34	747,617.70
RATIONAL AG	483	625.00	301,875.00
RHEINMETALL AG	3,660	247.50	905,850.00
SAFRAN SA	26,468	139.06	3,680,640.08
SAINT-GOBAIN	40,093	53.62	2,149,786.66
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	164.00	6,993,944.00
SIEMENS	60,788	156.68	9,524,263.84
SIEMENS ENERGY AG	36,841	24.16	890,078.56
THALES SA	8,524	134.05	1,142,642.20
VINCI S. A.	41,377	108.36	4,483,611.72
WARTSILA OYJ	41,917	10.62	445,158.54
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.41	612,031.93
RANDSTAD NV	10,558	46.95	495,698.10
TELEPERFORMANCE	4,734	147.00	695,898.00
WOLTERS KLUWER	20,644	107.50	2,219,230.00

ADP	2,382	142.00	338,244.00
AENA SME SA	5,508	146.70	808,023.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.22	418,153.14
DEUTSCHE POST AG-REG	81,221	42.14	3,422,652.94
GETLINK	35,220	16.71	588,702.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	104.46	2,789,604.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	98.15	489,866.65
CONTINENTAL AG	8,168	66.98	547,092.64
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	117.95	1,108,730.00
FERRARI NV	10,170	271.70	2,763,189.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	62,534	71.44	4,467,428.96
MICHELIN	55,356	27.54	1,524,504.24
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	54.46	639,632.70
RENAULT SA	17,362	33.23	576,939.26
STELLANTIS NV	175,794	14.77	2,596,828.96
VALEO SA	16,596	19.31	320,468.76
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,283	119.76	1,830,292.08
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	147.15	365,814.90
ADIDAS AG	12,635	155.44	1,963,984.40
HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,959.20	4,929,347.20
KERING	5,997	517.70	3,104,646.90
LVMH	22,026	843.50	18,578,931.00
MONCLER SPA	14,541	63.38	921,608.58
PUMA SE	9,220	45.03	415,176.60
SEB SA	2,282	95.70	218,387.40
ACCOR	14,436	31.29	451,702.44
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	67.30	2,377,103.30
DELIVERY HERO SE	13,414	37.40	501,750.67
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,563	185.45	2,329,808.35
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	15.37	239,403.92
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	37.30	302,428.40
SODEXO	6,173	101.75	628,102.75
BOLLORE SE	83,646	5.85	489,747.33
PUBLICIS GROUPE	17,217	70.18	1,208,289.06
SCOUT24 SE	7,492	59.46	445,474.32
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	53,677	18.75	1,006,712.13

VIVENDI SE	61,243	8.49	520,443.01
D' IETEREN GROUP	2,217	165.50	366,913.50
INDITEX	87,326	31.13	2,718,458.38
PROSUS	64,875	64.71	4,198,061.25
ZALANDO SE	17,664	28.39	501,480.96
CARREFOUR	52,544	17.60	924,774.40
HELLOFRESH SE	13,805	22.41	309,370.05
JERONIMO MARTINS	24,901	22.52	560,770.52
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.57	352,958.72
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,126	30.42	2,620,383.55
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	53.17	3,594,611.02
DANONE (GROUPE)	51,543	57.16	2,946,197.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	51,242	12.25	627,714.50
HEINEKEN HOLDING NV	6,849	82.95	568,124.55
HEINEKEN NV	20,157	99.56	2,006,830.92
JDE PEET' S BV	7,000	27.46	192,220.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	93.30	1,217,565.00
PERNOD-RICARD	16,694	210.30	3,510,748.20
REMY COINTREAU	2,519	148.20	373,315.80
BEIERSDORF AG	7,430	124.10	922,063.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	68.20	598,796.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	76.28	1,101,406.92
LOREAL	19,143	411.00	7,867,773.00
AMPLIFON SPA	11,650	33.00	384,450.00
BIOMERIEUX	3,044	95.56	290,884.64
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	108.35	371,640.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	99.22	205,385.40
ESSILORLUXOTTICA	22,662	176.92	4,009,361.04
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	40.25	683,646.25
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	26.75	901,180.75
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.20	1,307,215.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.66	1,157,285.22
ARGENX SE	4,177	374.10	1,562,615.70
BAYER	76,626	54.40	4,168,454.40
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	61.50	628,530.00
GRIFOLS SA	27,685	11.34	314,086.32

IPSEN	3, 532	111. 00	392, 052. 00
MERCK KGAA	10, 555	165. 15	1, 743, 158. 25
ORION OYJ-CLASS B	9, 854	40. 82	402, 240. 28
QIAGEN N. V.	17, 038	42. 73	728, 033. 74
RECORDATI SPA	10, 171	43. 17	439, 082. 07
SANOFI	90, 096	99. 40	8, 955, 542. 40
SARTORIUS AG-VORZUG	1, 824	317. 30	578, 755. 20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2, 524	244. 60	617, 370. 40
UCB (GROUPE)	9, 389	83. 10	780, 225. 90
ABN AMRO BANK NV-CVA	27, 685	14. 46	400, 325. 10
AIB GROUP PLC	88, 299	3. 81	336, 419. 19
BANCO BILBAO VIZCAYA	472, 469	6. 48	3, 061, 599. 12
BANCO SANTANDER SA	1, 306, 699	3. 19	4, 177, 516. 70
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88, 378	8. 82	779, 493. 96
BNP PARIBAS	89, 945	56. 31	5, 064, 802. 95
CAIXABANK	336, 789	3. 56	1, 200, 315. 99
COMMERZBANK AG	81, 889	9. 72	796, 452. 41
CREDIT AGRICOLE SA	99, 453	11. 91	1, 184, 485. 23
ERSTE GROUP BANK AG	25, 376	30. 74	780, 058. 24
FINECOBANK SPA	41, 585	12. 41	516, 069. 85
ING GROEP NV-CVA	293, 860	12. 13	3, 566, 284. 96
INTESA SANPAOLO	1, 247, 505	2. 24	2, 800, 648. 72
KBC GROEP NV	21, 452	61. 60	1, 321, 443. 20
MEDIOBANCA	53, 990	10. 44	563, 925. 55
SOCIETE GENERALE	63, 329	23. 84	1, 509, 763. 36
UNICREDIT SPA	149, 896	18. 70	2, 804, 254. 36
ADYEN NV	1, 746	1, 528. 40	2, 668, 586. 40
AMUNDI SA	4, 626	56. 65	262, 062. 90
DEUTSCHE BANK NAMEN	157, 109	9. 74	1, 530, 555. 87
DEUTSCHE BOERSE	15, 678	164. 80	2, 583, 734. 40
EDENRED	20, 131	60. 24	1, 212, 691. 44
EURAZEO SA	3, 357	62. 90	211, 155. 30
EURONEXT NV	6, 480	63. 40	410, 832. 00
EXOR NV	7, 825	77. 88	609, 411. 00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8, 515	73. 16	622, 957. 40
NEXI SPA	48, 458	7. 53	364, 888. 74

SOFINA	1, 238	199. 20	246, 609. 60
WENDEL	2, 023	99. 85	201, 996. 55
WORLDLINE SA	20, 332	38. 66	786, 035. 12
AEGON	148, 741	4. 33	645, 387. 19
AGEAS	11, 086	40. 38	447, 652. 68
ALLIANZ SE-REG	31, 825	207. 40	6, 600, 505. 00
ASSICURAZIONI GENERALI	82, 625	17. 94	1, 482, 705. 62
AXA SA	145, 657	27. 09	3, 946, 576. 41
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4, 455	199. 45	888, 549. 75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11, 181	334. 00	3, 734, 454. 00
NN GROUP NV	22, 611	34. 85	787, 993. 35
POSTE ITALIANE SPA	46, 035	9. 79	450, 958. 86
SAMPO OYJ-A SHS	38, 655	43. 00	1, 662, 165. 00
BECHTLE AG	7, 659	37. 07	283, 919. 13
CAPGEMINI SA	13, 474	157. 00	2, 115, 418. 00
DASSAULT SYSTEMES SA	52, 767	40. 71	2, 148, 408. 40
NEMETSCHEK SE	5, 455	72. 36	394, 723. 80
SAP SE	82, 544	122. 64	10, 123, 196. 16
NOKIA OYJ	451, 941	3. 81	1, 722, 573. 12
CELLNEX TELECOM SA	47, 754	37. 22	1, 777, 403. 88
DEUTSCHE TELEKOM	256, 698	21. 04	5, 400, 925. 92
ELISA A	10, 227	53. 36	545, 712. 72
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30, 375	11. 73	356, 450. 62
KPN (KON.)	282, 927	3. 24	917, 532. 26
ORANGE	149, 082	11. 39	1, 698, 043. 98
TELECOM ITALIA ORD	852, 552	0. 25	220, 384. 69
TELEFONICA	431, 420	3. 92	1, 695, 049. 18
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98, 715	2. 69	265, 839. 49
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9, 513	14. 06	133, 752. 78
ACCIONA SA	2, 181	160. 10	349, 178. 10
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5, 437	31. 30	170, 178. 10
E. ON SE	186, 604	11. 14	2, 078, 768. 56
EDP RENOVAVEIS SA	21, 466	18. 89	405, 492. 74
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	21, 466	0. 26	5, 667. 02
ELIA GROUP SA/NV	3, 125	117. 10	365, 937. 50
ENAGAS	21, 663	17. 57	380, 618. 91

	ENDESA	25,972	19.98	518,920.56
	ENEL	630,812	5.95	3,755,854.64
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.54	1,025,821.63
	ENGIE	145,658	13.89	2,024,063.56
	FORTUM OYJ	32,550	12.53	408,014.25
	IBERDROLA SA	486,473	11.49	5,589,574.77
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.08	261,060.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	15.79	484,559.01
	RWE STAMM	50,344	39.01	1,963,919.44
	SNAM SPA	147,559	4.91	725,104.92
	TERNA SPA	123,882	7.71	955,873.51
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,273	26.96	1,328,400.08
	VERBUND AG	6,430	69.30	445,599.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,965	405.80	1,608,997.00
	ASML HOLDING NV	31,858	682.10	21,730,341.80
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	34.54	3,638,590.30
	STMICROELECTRONICS NV	55,076	40.68	2,240,491.68
	AROUNDTOWN SA	64,068	0.93	59,647.30
	LEG IMMOBILIE SE	5,275	49.43	260,743.25
	VONOVIA SE	52,580	17.47	918,572.60
	ユーロ 小計	14,631,130		377,057,734.56 (56,875,388,681)
イギリスポンド	BP PLC	1,440,571	4.76	6,870,083.09
	SHELL PLC-NEW	562,022	23.52	13,221,567.55
	ANGLO AMERICAN PLC	101,345	23.18	2,349,683.82
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	13.89	414,849.12
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	62.38	681,439.12
	GLENORE PLC	833,513	4.22	3,522,425.93
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	17.90	301,663.44
	MONDI PLC	41,710	12.82	534,930.75
	RIO TINTO PLC REG	88,610	49.25	4,364,042.50
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	49.21	1,639,529.57
	BAE SYSTEMS PLC	240,104	9.50	2,281,948.41
	BUNZL PLC	29,127	31.94	930,316.38
	DCC PLC	6,622	47.10	311,896.20
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.49	947,822.36

SMITHS GROUP PLC	26,476	16.42	434,735.92
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	110.95	611,778.30
EXPERIAN PLC	74,115	28.28	2,095,972.20
INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.53	590,741.70
RELX PLC	149,499	24.87	3,718,040.13
RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	6.32	1,344,573.44
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.73	346,831.07
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.75	276,342.00
BURBERRY GROUP PLC	29,776	22.15	659,538.40
PERSIMMON PLC	25,686	12.26	314,910.36
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.15	305,436.27
COMPASS GROUP PLC	142,427	22.16	3,156,182.32
ENTAIN PLC	49,630	14.02	695,812.60
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	53.52	792,684.72
PEARSON	55,305	8.00	442,550.61
WHITBREAD PLC	17,434	32.57	567,825.38
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.26	453,901.96
INFORMA PLC	110,598	7.05	780,379.48
WPP PLC	85,821	8.73	749,217.33
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.51	312,305.75
KINGFISHER PLC	153,717	2.31	355,393.70
NEXT PLC	11,044	64.00	706,816.00
OCADO GROUP PLC	54,753	4.07	222,844.71
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.75	407,921.25
TESCO PLC	601,050	2.63	1,585,569.90
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	18.61	479,021.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	26.70	4,533,633.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	24.22	434,991.20
DIAGEO	179,481	34.98	6,278,245.38
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.35	1,188,435.69
HALEON PLC	405,046	3.30	1,336,651.80
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	64.16	3,596,296.32
UNILEVER PLC	200,460	41.69	8,357,177.40
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.25	840,631.72
ASTRAZENECA	123,190	117.84	14,516,709.60
GSK PLC	318,698	13.92	4,436,913.55



	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	18.51	304,645.81
	BARCLAYS	1,252,105	1.57	1,969,811.58
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,575,458	6.10	9,622,897.46
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.45	2,391,125.75
	NATWEST GROUP PLC	412,008	2.67	1,102,121.40
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.49	1,234,892.54
	3I GROUP PLC	74,757	19.38	1,448,790.66
	ABRDN PLC	153,430	2.01	309,621.74
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.00	264,764.31
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	30,297	84.84	2,570,397.48
	M&G PLC	229,107	1.98	454,433.73
	SCHRODERS PLC	82,861	4.56	378,509.04
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	11.12	455,390.75
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.19	376,953.45
	AVIVA PLC	240,378	4.01	964,636.91
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.28	1,119,421.27
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.56	283,565.56
	PRUDENTIAL	212,226	11.25	2,387,542.50
	SAGE GROUP PLC	76,660	8.57	657,282.84
	HALMA PLC	31,069	23.95	744,102.55
	BT GROUP PLC	479,168	1.44	690,241.50
	VODAFONE GROUP PLC	2,054,746	0.79	1,632,906.64
	NATIONAL GRID PLC	286,962	10.89	3,126,450.99
	SEVERN TRENT PLC	17,468	27.26	476,177.68
	SSE PLC	81,692	18.33	1,497,822.82
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.04	508,076.10
	イギリスポンド 小計	21,744,140		143,271,794.16 (24,896,339,671)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.42	233,481.16
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	707.00	405,818.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,051.00	2,282,148.00
	HOLCIM LTD	44,847	56.50	2,533,855.50
	SIG GROUP AG	26,203	25.70	673,417.10
	SIKA AG-BR	11,714	251.50	2,946,071.00
	ABB LTD	122,184	33.70	4,117,600.80
	GEBERIT AG-REG	2,964	491.30	1,456,213.20

SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	185.20	379,289.60
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	193.00	596,756.00
VAT GROUP AG	1,956	372.00	727,632.00
ADECCO GROUP AG-REG	15,639	28.19	440,863.41
SGS SA	12,650	81.68	1,033,252.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	261.70	1,197,800.90
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	149.70	6,128,867.70
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	282.30	700,950.90
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.70	203,594.60
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,897.00	531,160.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,200.00	873,600.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,890.00	892,980.00
NESTLE SA - REGISTERED	218,301	112.06	24,462,810.06
ALCON INC	38,399	71.68	2,752,440.32
SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	238.70	927,826.90
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	136.85	1,168,699.00
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	93.50	172,975.00
LONZA GROUP AG-REG	5,733	572.00	3,279,276.00
NOVARTIS	171,731	88.91	15,268,603.21
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	314.80	697,282.00
ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	290.70	16,228,036.80
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	89.85	223,456.95
CREDIT SUISSE GROUP AG	297,417	0.79	235,554.26
JULIUS BAER GROUP LTD	18,791	56.76	1,066,577.16
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	824.40	1,511,125.20
UBS GROUP AG	261,888	17.91	4,691,723.52
BALOISE HOLDING AG - REG	4,366	141.60	618,225.60
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	532.20	1,287,391.80
SWISS RE LTD	24,445	91.34	2,232,806.30
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	425.60	5,045,062.40
TEMENOS AG - REG	5,150	74.92	385,838.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	59.78	877,929.08
SWISSCOM	1,861	573.40	1,067,097.40
BKW AG	1,744	162.00	282,528.00
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	76.00	431,604.00
スイスフラン 小計	1,475,426		113,270,220.83

				(17,601,059,614)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	342.70	7,625,760.40
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	419.20	2,256,553.60
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	147.35	7,940,249.45
	ALFA LAVAL AB	19,283	394.40	7,605,215.20
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	246.00	18,690,342.00
	ATLAS COPCO A	207,097	161.00	33,342,617.00
	ATLAS COPCO B	127,608	138.35	17,654,566.80
	EPIROC AB-A	53,479	196.65	10,516,645.35
	EPIROC AB-B	28,804	167.80	4,833,311.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	86.16	3,335,425.92
	INDUTRADE AB	22,644	257.60	5,833,094.40
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	215.30	3,014,630.60
	LIFCO AB-B SHS	17,970	234.90	4,221,153.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	107.15	13,163,163.20
	SANDVIK AB	87,644	198.35	17,384,187.40
	SKANSKA B	25,507	147.80	3,769,934.60
	SKF AB-B	36,050	180.85	6,519,642.50
	VOLVO AB-A SHS	13,514	209.40	2,829,831.60
	VOLVO B	114,238	204.05	23,310,263.90
	SECURITAS B	28,375	82.46	2,339,802.50
	VOLVO CAR AB-B	49,839	37.86	1,886,904.54
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	157.05	3,340,296.45
	EVOLUTION AB	15,096	1,414.40	21,351,782.40
	EMBRACER GROUP AB	53,147	23.73	1,261,444.04
	HENNES & MAURITZ B	55,229	138.56	7,652,530.24
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	297.20	14,703,672.80
	GETINGE AB-B SHS	17,796	253.50	4,511,286.00
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	230.40	3,302,784.00
	NORDEA BANK ABP	258,570	109.88	28,411,671.60
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	115.60	15,171,922.00
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	87.96	10,619,938.56	
SWEDBANK AB-A	72,526	170.30	12,351,177.80	
EQT AB	31,471	208.60	6,564,850.60	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	290.30	3,430,765.40	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	289.50	3,233,136.00	

	INVESTOR AB-A SHS	38,925	219.90	8,559,607.50	
	INVESTOR AB-B SHS	140,493	218.20	30,655,572.60	
	KINNEVIK AB - B	18,792	153.00	2,875,176.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	462.20	3,364,816.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	56.79	12,192,188.31	
	HEXAGON AB-B SHS	147,005	124.00	18,228,620.00	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	102.05	4,772,062.10	
	TELIA CO AB	230,643	26.39	6,086,668.77	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	38.74	2,196,558.00	
	SAGAX AB-B	17,402	213.20	3,710,106.40	
	スウェーデンクローナ 小計	2,947,684		426,621,928.73 (5,554,617,512)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	251.40	6,977,607.00	
	EQUINOR ASA	73,436	294.90	21,656,276.40	
	NORSK HYDRO	100,517	69.64	7,000,003.88	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	425.10	5,312,899.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	451.60	3,904,082.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	77.75	1,486,346.75	
	MOWI ASA	31,968	189.45	6,056,337.60	
	ORKLA	69,804	81.36	5,679,253.44	
	SALMAR ASA	5,423	490.30	2,658,896.90	
	DNB BANK ASA	71,795	185.85	13,343,100.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	182.90	3,397,184.60	
	TELENOR ASA	51,193	114.90	5,882,075.70	
	ノルウェークローネ 小計	490,725		83,354,064.82 (1,056,929,541)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	528.00	4,479,024.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	351.20	6,009,383.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,708.00	1,289,540.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	200.10	16,338,965.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,500.00	2,518,500.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	11,670.00	5,064,780.00	
	DSV A/S	14,203	1,336.00	18,975,208.00	
	PANDORA A/S	7,957	568.80	4,525,941.60	
	CARLSBERG AS-B	6,830	1,085.00	7,410,550.00	
	COLOPLAST-B	9,208	878.00	8,084,624.00	

	DEMANT A/S	8,512	272.70	2,321,222.40	
	GENMAB A/S	5,250	2,820.00	14,805,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,448	1,137.60	149,535,244.80	
	DANSKE BANK A/S	56,132	143.55	8,057,748.60	
	TRYG A/S	29,772	159.55	4,750,122.60	
	ORSTED A/S	15,439	614.00	9,479,546.00	
	デンマーククローネ 小計	393,407		263,645,400.60 (5,338,819,362)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	31.54	650,638.66	
	SANTOS	265,406	7.45	1,977,274.70	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.05	456,486.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	147,086	34.88	5,130,359.68	
	BHP GROUP LTD	399,952	42.75	17,097,948.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.04	662,020.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	19.62	2,719,175.04	
	IGO LTD	56,345	14.25	802,916.25	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	37.85	1,398,481.80	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	69.82	1,006,036.38	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	25.90	1,915,020.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	12.55	1,275,431.40	
	ORICA LTD	38,288	15.32	586,572.16	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.54	951,061.90	
	RIO TINTO LTD	28,272	107.77	3,046,873.44	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.93	1,362,817.89	
	REECE LTD	16,814	18.02	302,988.28	
	BRAMBLES LTD	108,007	14.03	1,515,338.21	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	22.34	991,359.84	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.51	419,764.41	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.43	546,550.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.59	3,642,743.66	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	38.39	1,774,001.90	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	25.82	459,415.26	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.95	900,964.35	
	REA GROUP LTD	3,586	137.81	494,186.66	
	SEEK LTD	28,001	23.95	670,623.95	
	WESFARMERS LTD	92,975	48.93	4,549,266.75	

	COLES GROUP LTD	108,486	18.11	1,964,681.46
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.26	687,980.26
	WOOLWORTHS GROUP LTD	101,437	37.98	3,852,577.26
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.76	752,169.60
	COCHLEAR LIMITED	4,783	245.00	1,171,835.00
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	57.44	695,426.08
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	34.65	1,290,747.15
	CSL LIMITED	37,924	304.18	11,535,722.32
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	236,293	23.47	5,545,796.71
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	98.16	13,196,630.40
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	247,090	26.23	6,481,170.70
	WESTPAC BANKING	272,224	20.92	5,694,926.08
	ASX LTD	14,549	67.71	985,112.79
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	174.00	5,062,356.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.20	866,642.40
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.57	828,893.31
	QBE INSURANCE GROUP	126,465	14.71	1,860,300.15
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.06	1,238,923.84
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	74.90	1,033,694.90
	XERO LTD	11,340	110.67	1,254,997.80
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.36	1,344,916.12
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	8.35	1,264,749.45
	オーストラリアドル 小計	5,435,162		125,916,567.85 (11,569,214,254)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.74	720,709.14
	EBOS GROUP LTD	14,283	42.48	606,741.84
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	23.98	958,720.40
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.22	904,541.55
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.30	407,061.90
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.35	591,410.40
	ニュージーランドドル 小計	484,999		4,189,185.23 (356,876,689)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	48.45	10,368,106.20
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	76.85	8,222,950.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.58	1,065,360.00
	MTR CORP	125,000	38.15	4,768,750.00

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.24	1,588,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	49.35	8,586,900.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	24.70	4,890,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.15	2,939,885.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.18	2,751,698.18	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.70	6,671,550.00	
	HANG SENG BANK	59,400	109.10	6,480,540.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	294.00	27,753,600.00	
	AIA GROUP LTD	931,200	76.50	71,236,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	42.85	1,606,875.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	57.75	7,940,625.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.33	6,631,135.81	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	42.25	4,732,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	43.10	7,089,777.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.32	1,777,240.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	12.10	2,093,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.45	3,312,280.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	18.98	2,588,397.50	
	SINO LAND CO	315,400	10.50	3,311,700.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	124,500	101.80	12,674,100.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	53.25	2,156,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.54	1,879,748.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	39.90	4,907,700.00	
	香港ドル 小計	5,848,053		220,027,043.89 (3,953,885,978)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	34.41	275,280.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.40	721,920.00	
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.12	269,098.87	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.76	554,224.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.48	701,991.36	
	GENTING SINGAPORE LTD	315,000	1.02	321,300.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.98	710,828.00	
	DBS GROUP	140,400	31.63	4,440,852.00	
	OCBC BANK	257,100	12.25	3,149,475.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	28.13	2,641,407.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.29	613,140.00	

	VENTURE CORP LTD	25,700	15.40	395,780.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.47	1,681,929.21	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.45	771,075.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.85	293,180.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.80	323,000.00	
	シンガポールドル 小計	4,600,766		17,864,480.44 (1,858,977,834)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	22.24	1,321,656.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	743.00	1,594,478.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	31.50	3,096,765.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	28.16	3,168,337.92	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	5,099	143.20	730,176.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.35	1,925,325.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	126.00	1,575,378.00	
	NICE LTD	4,991	704.10	3,514,163.10	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	4.77	844,084.89	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	149.80	1,498,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	195.30	300,176.10	
	イスラエルシェケル 小計	582,982		19,568,541.29 (738,724,174)	
	合 計	88,759,612		555,592,325,162 (555,592,325,162)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	838,730.30	
		LENLEASE GROUP	64,786	501,443.64	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,340,173.94 (123,135,181)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,156,300.00	
		香港ドル 小計		315,000	3,156,300.00 (56,718,711)
投資信託受益証券合計			463,076	179,853,892 (179,853,892)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,397,460.31	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	841,873.54	



	AMERICAN TOWER CORPORATION	37,446	6,821,912.28	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	689,692.88	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	1,946,044.36	
	BOSTON PROPERTIES	11,259	537,504.66	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	805,276.08	
	CROWN CASTLE INC	33,305	3,722,166.80	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,317,091.59	
	EQUINIX INC	7,399	5,394,980.85	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	899,082.90	
	EQUITY RESIDENTIAL PTY	29,464	1,757,232.96	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,095,027.90	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,593,031.44	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	851,912.60	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	547,808.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	881,309.55	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	952,650.94	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,502,817.12	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,249,807.08	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	865,498.79	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	396,285.12	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,342,102.20	
	PROLOGIS INC	73,426	9,174,578.70	
	PUBLIC STORAGE	12,022	3,446,587.18	
	REALTY INCOME CORP	49,865	2,925,080.90	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	699,865.34	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	1,920,875.40	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,472	2,607,313.92	
	SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,311,612.75	
	UDR INC	23,815	934,262.45	
	VENTAS INC	31,565	1,353,507.20	
	VICI PROPERTIES INC	75,143	2,294,115.79	
	WELLTOWER INC	35,075	2,579,415.50	
	WP CAREY INC	16,024	1,091,234.40	
	アメリカドル 小計	966,150	68,747,019.48 (9,677,517,932)	

カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	236,726.28	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	311,349.00	
カナダドル 小計		20,377	548,075.28 (56,698,387)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	226,465.68	
	GECINA SA	3,139	299,617.55	
	KLEPIERRE	17,225	359,830.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	448,937.70	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	337,313.68	
ユーロ 小計		48,695	1,672,164.86 (252,229,347)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	274,534.19	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	337,171.11	
	SEGRO PLC	103,383	813,830.97	
イギリスポンド 小計		239,086	1,425,536.27 (247,715,437)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	754,601.80	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,650,716.67	
	GPT GROUP	167,884	715,185.84	
	MIRVAC GROUP	266,683	613,370.90	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,040,902.59	
	STOCKLAND	207,412	900,168.08	
	VICINITY CENTERS	305,149	578,257.35	
オーストラリアドル 小計		1,556,308	7,253,203.23 (666,424,312)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	8,277,775.00	
香港ドル 小計		170,500	8,277,775.00 (148,751,616)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	767,172.60	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	677,058.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	464,429.96	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	363,000.00	
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,271,660.56 (236,388,997)	
投資証券合計		4,126,972	11,285,726,028	

		(11, 285, 726, 028)	
	合計	11, 465, 579, 920	(11, 465, 579, 920)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601 銘柄	97.7%	—	—	71.7%
	投資証券 35 銘柄	—	—	2.3%	1.7%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.7%	—	—	3.4%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 222 銘柄	99.6%	—	—	10.0%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式 76 銘柄	99.0%	—	—	4.4%
	投資証券 3 銘柄	—	—	1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 43 銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式 45 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.6%	—	—	2.0%
	投資信託受 益証券 2 銘柄	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	95.1%	—	—	0.7%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	3.6%	0.0%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.7%	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	11.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注) 時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 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  
注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和 52 年大蔵省令第 38 号)」並びに同規則第 38 条の 3 及び第 57 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 24 期中間計算期間(2023 年 5 月 30 日から 2023 年 11 月 29 日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年2月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式インデックス・オープン（2023年5月30日から2023年11月29日までの中間計算期間）の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、外国株式インデックス・オープン（2023年11月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年5月30日から2023年11月29日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、

個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- (注) 1. 上記は中間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、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

【外国株式インデックス・オープン】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)	第 24 期中間計算期間 (2023 年 11 月 29 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,268,023	26,150,001
親投資信託受益証券	4,254,043,055	4,732,753,524
未収入金	70,176,815	237,456
流動資産合計	4,343,487,893	4,759,140,981
資産合計	4,343,487,893	4,759,140,981
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	66,194,642	-
未払解約金	3,714,080	3,779,062
未払受託者報酬	1,508,012	1,758,691
未払委託者報酬	15,726,324	18,340,604
未払利息	39	25
その他未払費用	213,732	125,556
流動負債合計	87,356,829	24,003,938
負債合計	87,356,829	24,003,938
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,470,992,051	1,465,019,547
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	2,785,139,013	3,270,117,496
(分配準備積立金)	1,424,511,054	1,335,425,776
元本等合計	4,256,131,064	4,735,137,043
純資産合計	4,256,131,064	4,735,137,043
負債純資産合計	4,343,487,893	4,759,140,981



## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 23 期中間計算期間 自 2022 年 5 月 31 日 至 2022 年 11 月 30 日	第 24 期中間計算期間 自 2023 年 5 月 30 日 至 2023 年 11 月 29 日
営業収益		
受取利息	12	36
有価証券売買等損益	171,979,773	518,392,513
営業収益合計	171,979,785	518,392,549
営業費用		
支払利息	3,054	3,406
受託者報酬	1,486,000	1,758,691
委託者報酬	15,496,862	18,340,604
その他費用	106,079	125,556
営業費用合計	17,091,995	20,228,257
営業利益又は営業損失(△)	154,887,790	498,164,292
経常利益又は経常損失(△)	154,887,790	498,164,292
中間純利益又は中間純損失(△)	154,887,790	498,164,292
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	2,873,140	15,885,235
期首剰余金又は期首欠損金(△)	2,230,350,408	2,785,139,013
剰余金増加額又は欠損金減少額	173,746,437	182,884,503
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	173,746,437	182,884,503
剰余金減少額又は欠損金増加額	66,179,835	180,185,077
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	66,179,835	180,185,077
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	2,489,931,660	3,270,117,496

### (3) 【中間注記表】

#### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

#### (中間貸借対照表に関する注記)

	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)	第 24 期中間計算期間 (2023 年 11 月 29 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,470,992,051 口	1,465,019,547 口
2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 2,8934 円 (28,934 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 3,2321 円 (32,321 円)

#### (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の時価等に関する事項

	第 24 期中間計算期間 (2023 年 11 月 29 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(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) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

#### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

#### (その他の注記)

##### 元本の移動

区分	第 23 期 自 2022 年 5 月 31 日 至 2023 年 5 月 29 日	第 24 期中間計算期間 自 2023 年 5 月 30 日 至 2023 年 11 月 29 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,391,698,112 円	1,470,992,051 円
期中追加設定元本額	195,937,282 円	89,174,916 円
期中一部解約元本額	116,643,343 円	95,147,420 円

#### (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年11月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,231,473,747
コール・ローン	877,378,246
株式	595,892,989,841
投資信託受益証券	160,029,040
投資証券	11,774,004,836
派生商品評価勘定	697,043,401
未収入金	3,577,684
未収配当金	755,133,190
差入委託証拠金	4,673,901,255
流動資産合計	625,065,531,240
資産合計	625,065,531,240
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,314,389
前受金	676,321,432
未払解約金	311,686,692
未払利息	869
流動負債合計	1,011,323,382
負債合計	1,011,323,382
純資産の部	
元本等	
元本	116,381,398,740
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	507,672,809,118
元本等合計	624,054,207,858
純資産合計	624,054,207,858
負債純資産合計	625,065,531,240

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。

	<p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年11月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		116,381,398,740 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.3621 円 (53,621 円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年11月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年5月30日
期首元本額	121,644,600,809 円
期中追加設定元本額	7,517,587,562 円
期中一部解約元本額	12,780,789,631 円
期末元本額	116,381,398,740 円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,575,587,428 円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,016,978 円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,693,523,933 円
世界経済インデックスファンド	13,019,982,572 円
外国株式インデックス・オープン	882,630,597 円
DCマイセレクション25	639,377,643 円
DCマイセレクション50	3,481,390,711 円

DCマイセレクション75	4,330,857,020円
DC外国株式インデックス・オープン	12,721,609,443円
DCマイセレクションS25	403,814,633円
DCマイセレクションS50	1,903,926,665円
DCマイセレクションS75	1,912,205,988円
DCターゲット・イヤーフンド2025	20,697,833円
DCターゲット・イヤーフンド2035	139,991,107円
DCターゲット・イヤーフンド2045	109,791,709円
DC世界経済インデックスファンド	9,503,369,620円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,008,762,373円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,773,301円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,142,957円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	21,890,767円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	7,895,440円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,182,785円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	7,602,496円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	21,595,270円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	159,850,297円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	131,446,426円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	994,642,947円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	68,523,807円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,431,747円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	114,028,172円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	36,939,242円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	787,426,934円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	850,559,545円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,180,347,933円
コア投資戦略ファンド（安定型）	135,892,093円
コア投資戦略ファンド（成長型）	319,464,712円
分散投資コア戦略ファンドA	1,605,660,699円
分散投資コア戦略ファンドS	7,339,764,093円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,478,575,164円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,015,065,692円
コア投資戦略ファンド（切替型）	143,320,748円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	490,636,921円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,718,383円
SMT インデックスバランス・オープン	122,662,424円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,157,099円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	5,125,761,114円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,572,491円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,033,681,444円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	180,400,082円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,513,694円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,273,627,043円
グローバル経済コア	535,238,417円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,391,370円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,988,553円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,458,335円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,671,774円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	143,611,530円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	136,585,362円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	60,029,472円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	67,594,496円
10資産分散投資ファンド	51,337,218円
グローバル10資産バランスファンド	1,439,347円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	57,879,855円

外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	200,343,870円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	618,554,677円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,454,179,033円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	99,705,579円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	69,905,701円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	86,834,153円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	81,522,528円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	186,731,857円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	180,617,821円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	179,700,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	181,779,484円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	179,977,573円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	91,791,755円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	116,188,483円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年11月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,743,844,065	—	16,420,165,497	676,321,432
合計		15,743,844,065	—	16,420,165,497	676,321,432

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 通貨関連

（2023年11月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	810,778,000	—	808,185,580	△2,592,420
	アメリカドル	678,256,000	—	675,751,220	△2,504,780
	デンマーククローネ	73,746,000	—	73,761,980	15,980
	オーストラリアドル	58,776,000	—	58,672,380	△103,620
合計		810,778,000	—	808,185,580	△2,592,420

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。



## 2 【ファンドの現況】

### 【外国株式インデックス・オープン】

#### 【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	4,834,869,422円
II 負債総額	5,464,836円
III 純資産総額 (I - II)	4,829,404,586円
IV 発行済口数	1,467,531,862口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.2908円
(1万口当たり純資産額)	(32,908円)

(参考)

### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	634,263,010,203円
II 負債総額	463,467,182円
III 純資産総額 (I - II)	633,799,543,021円
IV 発行済口数	116,009,010,515口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	5.4634円
(1万口当たり純資産額)	(54,634円)

#### 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。

##### (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

該当事項はありません。

##### (4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### ① 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

###### ② 受益権の譲渡

イ. 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又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。

ロ. 上記イ. の申請のある場合には、上記イ. 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及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又は記録するものとします。ただし、上記イ. 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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ. 上記イ. 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又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又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。

###### ③ 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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

###### ④ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

###### ⑤ 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者）に支払います。

###### ⑥ 質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従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（2023年12月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減: 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### ①会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### ②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファ

ンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

#### [DO (実行)]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [CHECK (検証・評価)]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN-DO-CHECK の PDC サイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は 2024 年 2 月 29 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2023 年 12 月 29 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	218,373
単位型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

### 3【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」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。）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「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）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定に基づき、「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）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 37 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第 38 期事業年度の中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

### 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井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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、継続企業的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。

監査等委員会の責任は、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、監査等委員会に対して、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。

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は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、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 289	※1 255
器具備品	※1 687	※1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179



(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	—	—	—
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

## 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

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(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しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づいて償却しております。

### 5. 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、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

#### (2) 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の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

### 7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

#### (1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」という。)に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (3) 投資助言業務

当社は、投資顧問(助言)契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

### 8. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過措置に代って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲げすることとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	〃	681	〃
計	681	〃	866	〃

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24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

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

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

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。



## (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

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8. ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

##### ①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

##### ②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してしております。

##### ③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

#### (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。

### 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度 (2022年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1、*2)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*3)	—	196	—	196
資産計	—	196	—	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	—	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(71)	—	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	—	(1,485)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 投資有価証券のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 6,474 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 133 百万円) は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 13,876 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 840 百万円) は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,913 百万円であります。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 218 百万円) は上記に含めておりません。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

(注 2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

	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	21,675	—	—	—
未収委託者報酬	9,067	—	—	—
未収運用受託報酬	6,252	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	108	1,712	0

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

	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	23,067	—	—	—
未収委託者報酬	9,147	—	—	—
未収運用受託報酬	5,815	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	594	2,144	38

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。  
 なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	—	0	0
合計		6,915	—	△80	△80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建				
	米ドル	152	—	3	3
合計		7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ		21	—	△0
合計			5,082	—	△88

(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退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(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の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	—	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

### 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 100 百万円、当事業年度 109 百万円であります。

(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

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	—	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃
その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

#### 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

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間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため、注記を省略しております。

#### 3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 7. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事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]



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

内国籍投資信託又は本邦顧客から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) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395 百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395 百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[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]

該当事項はありません。

[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]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引 役員 の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売 代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	21,406,512 円 22 銭	22,044,962 円 63 銭
1 株当たり当期純利益金額	2,162,405 円 20 銭	1,816,227 円 49 銭

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

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

## 独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三上和彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 田中洋一

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は中間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、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601
固定資産		
有形固定資産	※1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045
負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	※2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

(単位：百万円)

## 第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		43,700
利益剰余金合計		46,300
株主資本合計		65,540
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		164
繰延ヘッジ損益		△906
評価・換算差額等合計		△741
純資産合計		64,798
負債・純資産合計		77,045

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

## 第 38 期中間会計期間

(自 2023 年 4 月 1 日

至 2023 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	※1	6,965
営業利益		3,722
営業外収益	※2	1,680
営業外費用	※3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	—	—	—
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	—	—	△1,055	△1,055	△1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	114	△395	△280	△280
当中間期変動額合計	114	△395	△280	△1,335
当中間期末残高	164	△906	△741	64,798

## 注記事項

(重要な会計方針)

第 38 期中間会計期間  
(自 2023 年 4 月 1 日  
至 2023 年 9 月 30 日)

### 1. 資産の評価基準及び評価方法

#### (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(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しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

#### (2) デリバティブ

時価法によっております。

#### (3) 金銭の信託

時価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づいて償却しております。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

#### (2) 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の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

### 4. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

#### (1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」という。)に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドの AUM に固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。当該収益は、年 4 回等契約で定められた時期に各ファンドの AUM に固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (3) 投資助言業務

当社は、投資顧問(助言)契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。当該収益は、年 4 回等契約で定められた時期に各ファンドの AUM に固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。



(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間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計上しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(表示方法の変更)

第 38 期中間会計期間  
(自 2023 年 4 月 1 日  
至 2023 年 9 月 30 日)

従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第 38 期中間会計期末  
(2023 年 9 月 30 日)

- ※1 有形固定資産の減価償却累計額 957 百万円
- ※2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第 38 期中間会計期間  
(自 2023 年 4 月 1 日  
至 2023 年 9 月 30 日)

- ※1 減価償却実施額
- |        |         |
|--------|---------|
| 有形固定資産 | 91 百万円  |
| 無形固定資産 | 972 百万円 |
- ※2 営業外収益の主要項目
- |          |           |
|----------|-----------|
| 金銭の信託運用益 | 1,589 百万円 |
|----------|-----------|
- ※3 営業外費用の主要項目
- |          |           |
|----------|-----------|
| デリバティブ費用 | 1,269 百万円 |
| 為替差損     | 784 百万円   |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

### (2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

### (金融商品関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) \*2、\*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	—	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,137	—	4,137
資産計	1,206	18,133	—	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	—	339
通貨関連取引	—	(134)	—	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	—	205

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (中間貸借対照表計上額 1,041 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は 16,243 百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (中間貸借対照表計上額 271 百万円) は上記に含めておりません。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンズワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

(注 2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末(2023年9月30日)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位:百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	△343
小計	1,426	1,769	△343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額271百万円)は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)	
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	—	△76	△76
	英ポンド	267	—	△1	△1
	カナダドル	126	—	△1	△1
	スイスフラン	176	—	△0	△0
	香港ドル	214	—	△2	△2
	ユーロ	719	—	△3	△3
合計	7,449	—	△84	△84	

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	9,373	—	226	226
店頭				
トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	—	113	113
合計	13,239	—	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	—	△24
	英ポンド		3,612	—	△23
	スイスフラン		22	—	△0
	香港ドル		90	—	△1
	ユーロ	51	—	△0	
合計			5,713	—	△49

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存

在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

[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]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[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]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
1株当たり純資産額	21,599,648 円 64 銭
1株当たり中間純利益	770,782 円 86 銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
中間純利益	2,312 百万円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	2,312 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

##### (1) 自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2) 運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取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。以下同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

##### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

2024年2月29日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託  
外国株式インデックス・オープン  
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社



## 運用の基本方針

約款第 16 条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

外国株式インデックス マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

#### (2) 投資態度

①主として、外国株式インデックス マザーファンド受益証券に投資し、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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ため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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ため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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ため、異なった通貨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。）を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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ため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①株式への実質投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

④同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対す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投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

##### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（繰越分およびマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

##### (2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

##### (3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
外国株式インデックス・オープン  
約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第1条の2 受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

**(信託の目的、金額および限度額)**

第2条 委託者は、金990,969,836円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金3,000億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第3条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第47条第7項、第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の分割および再分割)**

第4条 委託者は、第2条第1項による受益権について990,969,836口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第5条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

**(当初の受益者)**

第6条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第4条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**(追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)**

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た追加設定時における信託財産留保額（以下「追加設定時信託財産留保額」といいます。）を加算した額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じて得た金額とします。

②この約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用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従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」とい

います。) 、預金その他の資産をいいます。以下同じ。) の円換算については、原則として、わが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③第 26 条に規定する為替予約の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### (信託日時の異なる受益権の内容)

第 8 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### (受益権の帰属と受益証券の不発行)

第 9 条 この信託の受益権は、平成 19 年 1 月 4 日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。) の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 4 条第 1 項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成 18 年 12 月 29 日現在のすべての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成 19 年 1 月 4 日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成 19 年 1 月 4 日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

#### (受益権の設定に係る受託者の通知)

第 10 条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### (受益権の申込単位、価額および手数料)

第 11 条 指定販売会社は、第 4 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対しては、指定販売会社が委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものと

します。ただし、指定販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得申込に応ずることができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクストパリ証券取引所のいずれかの取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、追加信託の取得申込みを受付けないものとします。

- ②第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第3項または第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ③第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額を加算した額（以下「販売基準価額」といいます。）に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1口につき1円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④前項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。
- ⑤前各項の規定にかかわらず、指定販売会社は、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、原則として、第37条に規定する各計算期間終了日の販売基準価額とします。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、取引所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、指定販売会社は、受益権の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できます。

#### **（受益権の譲渡に係る記載または記録）**

第11条の2 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ②第1項の申請のある場合には、第1項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、第1項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### **（受益権の譲渡の対抗要件）**

第11条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### **（受益証券の再交付）**

第 12 条 (削除)

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第 13 条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第 14 条 (削除)

(運用の指図範囲等)

第 15 条 委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。

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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定す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. コマーシャル・ペーパー
11. 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
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券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。）
14. 投資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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 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。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の

受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定す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つて金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資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。

⑤委託者は、取得時において、投資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、マザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資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。

⑥前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資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、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### （運用の基本方針）

第16条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

#### （投資する株式等の範囲）

第17条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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、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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

#### （同一銘柄の株式等への投資制限）

第18条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に

属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資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。

③前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資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、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第19条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに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をいいます。

#### (信用取引の指図範囲)

第20条 委託者は、投資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ものとし、かつ次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ

②前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ

1. 投資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. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資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、ならびに投資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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### (先物取引等の運用指図、目的および範囲)

第21条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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ため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含



めて取扱うものとしします。(以下同じ。)

- ②委託者は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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ため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。

#### (スワップ取引の運用指図、目的および範囲)

第 22 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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ため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第 3 条に定める信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとしします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとしします。
- ④前項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資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の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤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します。
- ⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

#### (為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 23 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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ため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決算日が原則として第 3 条に定める信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- ③為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の時価総額を超えないものとしします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとしします。
- ④前項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益

証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- ⑤為替先渡取引の評価は、当該取引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。
- ⑥委託者は、為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑦本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### （有価証券の貸付の指図および範囲）

第 24 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付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、投資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、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### （特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第 25 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### （外国為替予約の指図）

第 26 条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資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投資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をいいます。

#### （保管業務の委任）

第 27 条 受託者は、委託者と協議のうえ、投資信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

#### （有価証券等の保管）

第 28 条 受託者は、投資信託財産に属する有価証券等を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管さ

せることができます。

#### (混蔵寄託)

第 29 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### (一括登録)

第 30 条 (削除)

#### (投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 31 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### (一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第 32 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### (再投資の指図)

第 33 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### (資金の借入れ)

第 34 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3. 借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%以内

③前項の借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

④借入金の利息は、投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第 35 条 委託者の指示に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第 36 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第 37 条 この信託の計算期間は、毎年 5 月 30 日から翌年 5 月 29 日までとすることを原則とします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第 3 条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告)

第 38 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する計算書および報告書を作成してこれを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する総計算書および報告書を作成してこれを委託者に提出します。

#### (信託事務の諸費用)

第 39 条 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税を含みます。）は、第 37 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 40 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 37 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 80 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (収益の分配方式)

第 41 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、

信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備金として積み立てることができます。

②前項第 1 号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資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の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 42 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 44 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 44 条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (収益分配金の再投資)

第 43 条 (削除)

#### (収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第 44 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③償還金は、信託終了後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われず。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

④一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 5 営業日目から受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項および第 4 項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとしします。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。

## (受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

### 第 45 条 (削除)

## (収益分配金および償還金の時効)

第 46 条 受益者が、収益分配金については第 44 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について第 44 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

## (投資信託契約の一部解約)

第 47 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位または指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- ②平成 19 年 1 月 4 日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。
- ③委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に 0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額（「解約時信託財産留保額」といいます。）を控除した価額とします。
- ⑤委託者は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。
- ⑦委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 5 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑧委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑨前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑩前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 7 項の投資信託契約の解約をしません。

⑪委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑫第9項から前項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第9項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第47条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第48条 委託者は、第3条の規定による信託終了前にこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託契約の解約をしません。

⑤委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥第3項から前項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

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

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

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

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

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契

約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 52 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 53 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

#### (投資信託約款の変更)

第 53 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の投資信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### (反対者の買取請求権)

第 54 条 第 47 条第 7 項から同条第 12 項および第 48 条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第 47 条第 9 項または第 48 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### (運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 54 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

#### (公告)

第 55 条 委託者が行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### (投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第 56 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

#### (付則)

第 1 条 第 44 条第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、第 44 条第 6 項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加



信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第2条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第9条、第10条、第12条から第14条、第45条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成12年5月30日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社