

# DC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

【確定拠出年金専用ファンド】

投資信託説明書

(請求目論見書)

2023年12月29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。

DC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 2023 年 12 月 28 日に関東財務局長に提出しており、2023 年 12 月 29 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】	1
(7)【申込期間】	1
(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】	2
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】	12
3【投資リスク】	20
4【手数料等及び税金】	23
5【運用状況】	25
第2【管理及び運営】	35
1【申込（販売）手続等】	35
2【換金（解約）手続等】	36
3【資産管理等の概要】	38
4【受益者の権利等】	42
第3【ファンドの経理状況】	43
1【財務諸表】	46
2【ファンドの現況】	95
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	96
第三部【委託会社等の情報】	97
第1【委託会社等の概況】	97
1【委託会社等の概況】	97
2【事業の内容及び営業の概況】	98
3【委託会社等の経理状況】	99
4【利害関係人との取引制限】	121
5【その他】	121
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DC 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（※）とします。

※「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。

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

1 円以上 1 円単位とします。

### (7)【申込期間】

2023 年 12 月 29 日から 2024 年 6 月 28 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>

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

##### <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並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休業日

ロンドンの銀行休業日

## 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	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を除	ファンド	( )		
大型株	年2回	く)			TOPIX	条件付運用型
中小型株	年4回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他	ロング・ショート型/絶対
債券					(MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース))	収益追求型
一般	年6回	北米				
公債	(隔月)	欧州				その他
社債						( )
その他債券	年12回	アジア				
クレジット属性	(毎月)	オセアニア				
( )	日々					
不動産投信	その他	中南米				
	( )	アフリカ				
その他資産						
(投資信託証券		中近東				
(株式 一般))		(中東)				
資産複合		エマージング				
( )						
資産配分						
固定型						
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いません。

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。

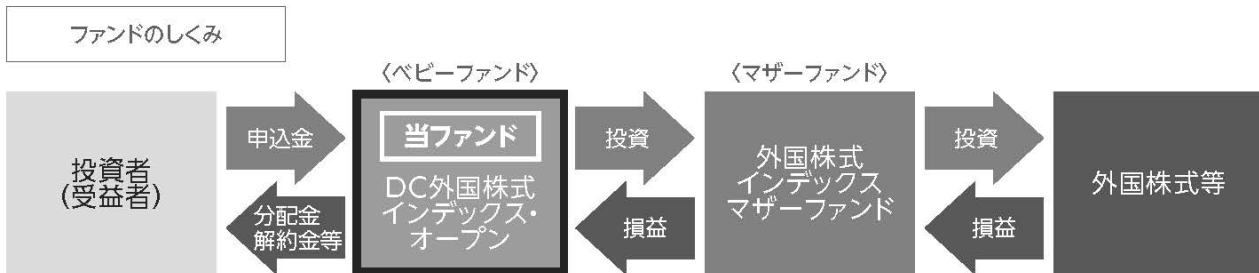
(4) その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

◆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。

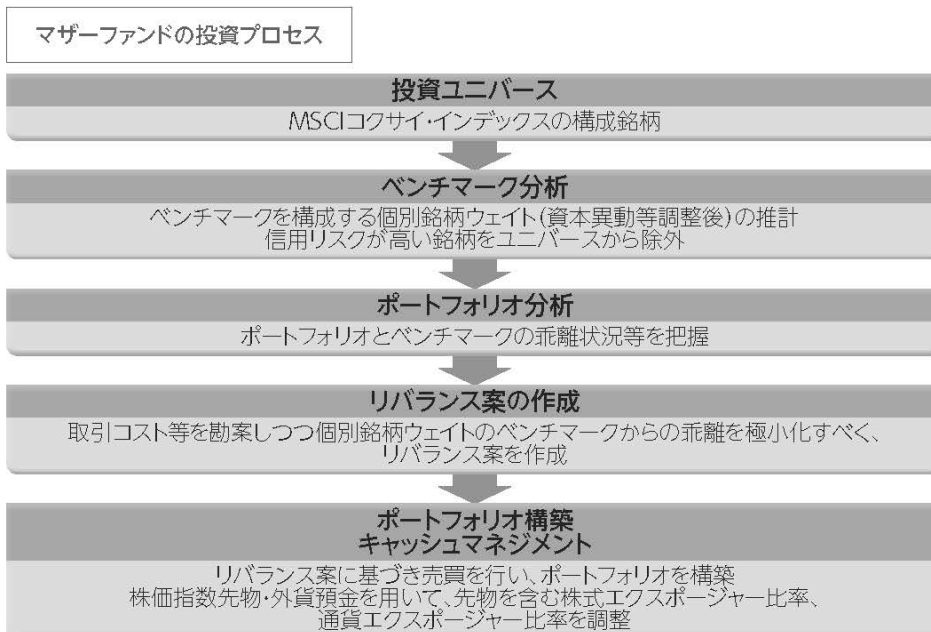


### ? ファミリーファンド方式とは

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。



※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

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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックス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。

#### 分配方針

- 原則として、毎年9月30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およ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。

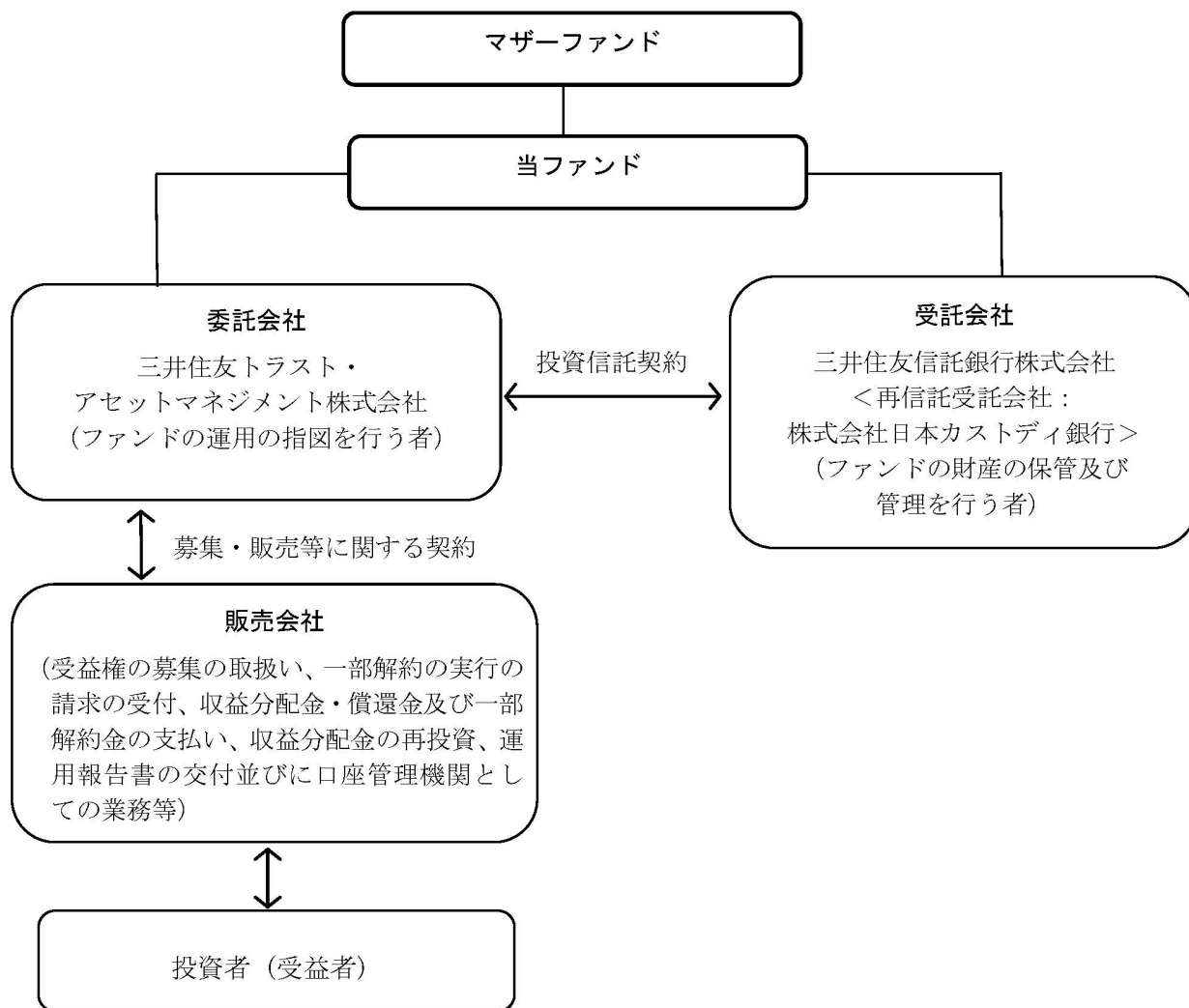
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

### (2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1日	本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	本ファンドの名称を「すみしん DC 外国株式インデックス・オープン」から「DC 外国株式インデックス・オープン」に変更 本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10月31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】

#### (イ) 基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ) 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（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）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、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) 実質組入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) 運用の効率化をはかるため、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) 有価証券等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、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効率的な運用ならびに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効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

### (2)【投資対象】

(イ) 本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

(ロ) 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マザーファンド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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券 (新株引受権証券と社債券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. 投資証券もしくは投資法人債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せん。)
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せん。)
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、および第 14 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 13 号の証券および第 14 号の証券(「投資法人債券」を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(ハ) 委託者は、信託金を、前記 (ロ) 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
- (二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(ハ)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およ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、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、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。

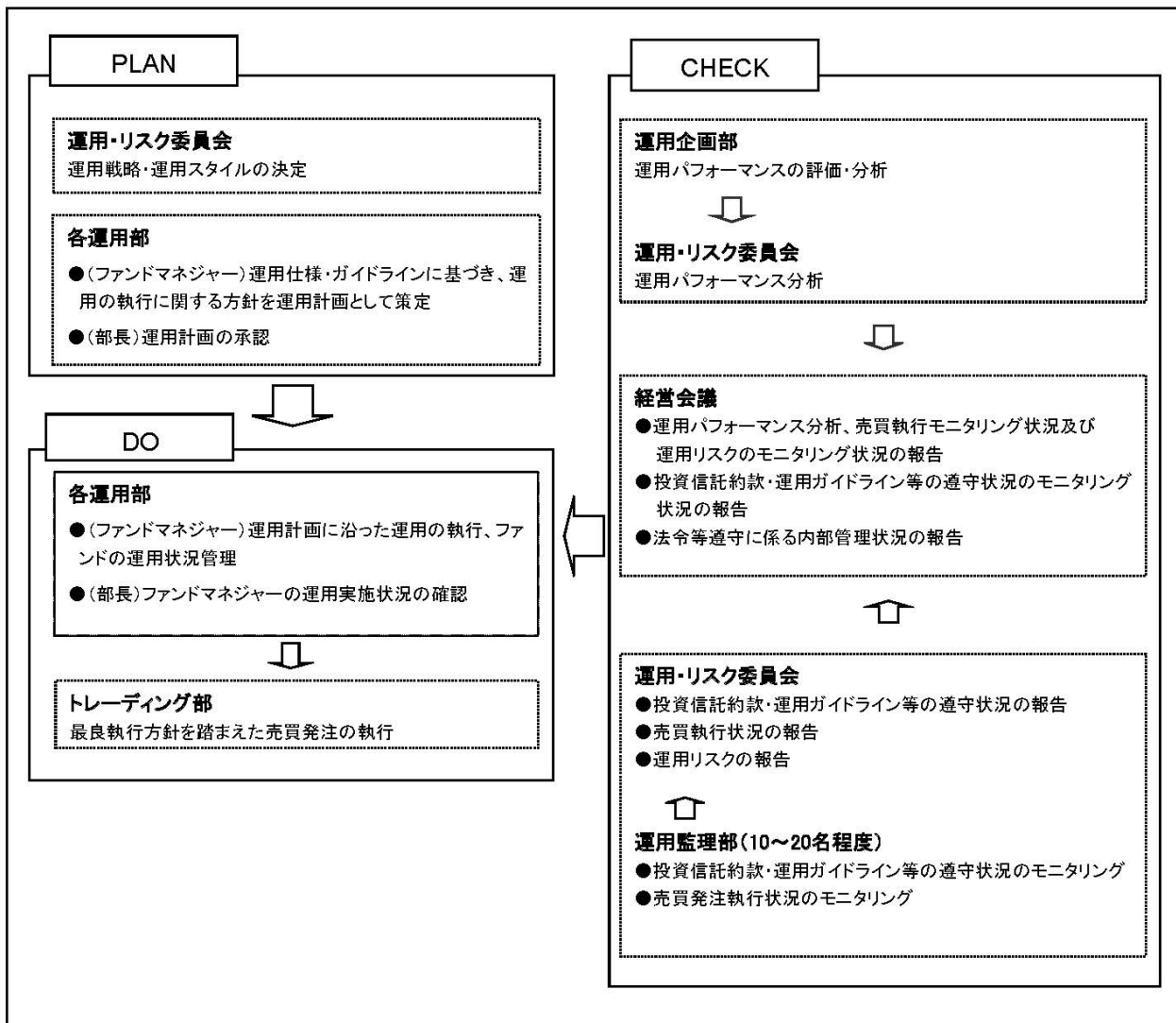
③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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、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およ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。

(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】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

- ・ 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、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

※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。

#### (5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

①株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑦マザーファンド受益証券以外の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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑧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（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。）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。前文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ます。（投資信託約款第19条）

⑨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。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ます。（投資信託約款第22条）

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券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委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等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、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、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委託者が適当と認める外国の取引所等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。（投資信託約款第 23 条）
- ⑪委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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（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、原則として本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。（投資信託約款第 24 条）
- ⑫委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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本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。（投資信託約款第 25 条）
- ⑬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。（投資信託約款第 26 条）
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委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第 28 条）
- ⑮委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資

金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、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%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第 36 条）

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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

※前記①から⑦における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑦に掲げる当該各資産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各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの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各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記⑪、⑫および⑭における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

#### <関連法令に基づく投資制限>

##### イ. 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、投資者の皆様は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。
- ⑥確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## (2) リスクの管理体制

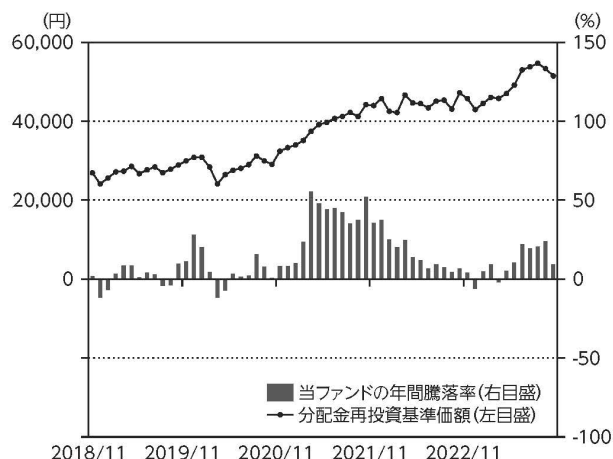
委託会社におけるリスク管理体制

- ・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】

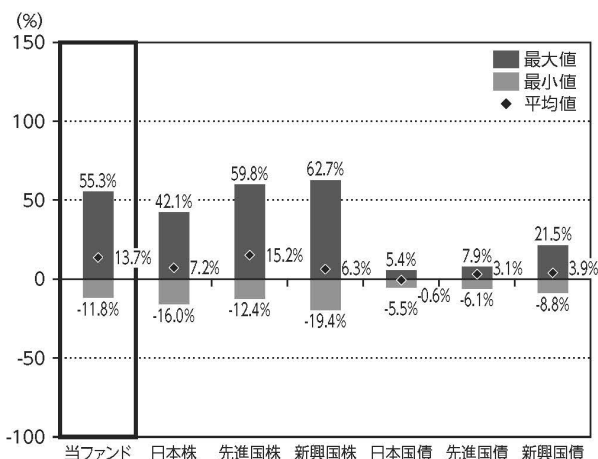
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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



\*2018年11月～2023年10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

日本株 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。
先進国株 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。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、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。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、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。
先進国債 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。
新興国債 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】

ありません。

##### (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、信託財産留保額（※）の控除はありません。

※「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

##### (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 0.275%（税抜 0.25%）（※）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 0.1265% (税抜 0.115%)	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 0.0935% (税抜 0.085%)	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 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

※「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。

- 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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

※上記は、2023年10月31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10月1日～2023年10月2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10月31日現在の状況について記載してあります。

### 【DC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	63,220,631,010	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	31,366,122	0.05
合計(純資産総額)		63,251,997,132	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	12,702,813,199	5.1514	65,437,880,185	4.9769	63,220,631,010	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 13 期計算期間末	(2014 年 9 月 30 日)	10,784,005,815	10,784,005,815	20,456	20,456
第 14 期計算期間末	(2015 年 9 月 30 日)	11,660,543,974	11,660,543,974	20,674	20,674
第 15 期計算期間末	(2016 年 9 月 30 日)	12,010,556,272	12,010,556,272	19,557	19,557
第 16 期計算期間末	(2017 年 10 月 2 日)	16,657,048,067	16,657,048,067	25,863	25,863
第 17 期計算期間末	(2018 年 10 月 1 日)	20,827,907,679	20,827,907,679	28,917	28,917
第 18 期計算期間末	(2019 年 9 月 30 日)	22,583,883,724	22,583,883,724	27,818	27,818
第 19 期計算期間末	(2020 年 9 月 30 日)	28,088,372,694	28,088,372,694	29,948	29,948
第 20 期計算期間末	(2021 年 9 月 30 日)	44,437,735,913	44,437,735,913	41,202	41,202
第 21 期計算期間末	(2022 年 9 月 30 日)	49,982,028,287	49,982,028,287	43,085	43,085
第 22 期計算期間末	(2023 年 10 月 2 日)	65,038,039,831	65,038,039,831	53,328	53,328
	2022 年 10 月末日	55,195,669,762	—	47,175	—
	11 月末日	53,716,375,360	—	45,752	—
	12 月末日	50,837,949,523	—	42,942	—
	2023 年 1 月末日	52,987,820,218	—	44,529	—
	2 月末日	54,502,401,730	—	46,058	—
	3 月末日	54,872,032,282	—	45,795	—
	4 月末日	56,261,269,231	—	47,016	—
	5 月末日	58,806,783,690	—	49,175	—
	6 月末日	63,584,450,096	—	53,003	—
	7 月末日	64,991,909,307	—	53,773	—
	8 月末日	66,479,636,998	—	54,668	—
	9 月末日	65,041,910,968	—	53,316	—
	10 月末日	63,251,997,132	—	51,478	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 13 期計算期間	2013 年 10 月 1 日～2014 年 9 月 30 日	0
第 14 期計算期間	2014 年 10 月 1 日～2015 年 9 月 30 日	0
第 15 期計算期間	2015 年 10 月 1 日～2016 年 9 月 30 日	0
第 16 期計算期間	2016 年 10 月 1 日～2017 年 10 月 2 日	0
第 17 期計算期間	2017 年 10 月 3 日～2018 年 10 月 1 日	0
第 18 期計算期間	2018 年 10 月 2 日～2019 年 9 月 30 日	0
第 19 期計算期間	2019 年 10 月 1 日～2020 年 9 月 30 日	0

第20期計算期間	2020年10月1日～2021年9月30日	0
第21期計算期間	2021年10月1日～2022年9月30日	0
第22期計算期間	2022年10月1日～2023年10月2日	0

### ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第13期計算期間	2013年10月1日～2014年9月30日	25.7
第14期計算期間	2014年10月1日～2015年9月30日	1.1
第15期計算期間	2015年10月1日～2016年9月30日	△5.4
第16期計算期間	2016年10月1日～2017年10月2日	32.2
第17期計算期間	2017年10月3日～2018年10月1日	11.8
第18期計算期間	2018年10月2日～2019年9月30日	△3.8
第19期計算期間	2019年10月1日～2020年9月30日	7.7
第20期計算期間	2020年10月1日～2021年9月30日	37.6
第21期計算期間	2021年10月1日～2022年9月30日	4.6
第22期計算期間	2022年10月1日～2023年10月2日	23.8

(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13期計算期間	2013年10月1日～2014年9月30日	1,521,908,168	1,052,984,543	5,271,799,266
第14期計算期間	2014年10月1日～2015年9月30日	1,857,940,393	1,489,664,884	5,640,074,775
第15期計算期間	2015年10月1日～2016年9月30日	1,413,274,013	912,179,071	6,141,169,717
第16期計算期間	2016年10月1日～2017年10月2日	1,664,339,529	1,365,115,383	6,440,393,863
第17期計算期間	2017年10月3日～2018年10月1日	1,965,600,718	1,203,377,289	7,202,617,292
第18期計算期間	2018年10月2日～2019年9月30日	2,336,552,629	1,420,598,127	8,118,571,794
第19期計算期間	2019年10月1日～2020年9月30日	3,634,946,823	2,374,557,577	9,378,961,040
第20期計算期間	2020年10月1日～2021年9月30日	3,776,870,397	2,370,451,251	10,785,380,186
第21期計算期間	2021年10月1日～2022年9月30日	3,246,101,975	2,430,764,985	11,600,717,176
第22期計算期間	2022年10月1日～2023年10月2日	2,448,225,461	1,853,055,665	12,195,886,972

(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	397,380,116,524	68.79
	イギリス	23,706,070,855	4.10
	カナダ	19,234,975,685	3.33
	スイス	18,060,948,113	3.13
	フランス	17,830,334,312	3.09
	ドイツ	13,332,105,730	2.31
	オーストラリア	10,738,131,482	1.86
	オランダ	10,322,159,460	1.79
	アイルランド	10,216,808,091	1.77
	デンマーク	5,549,806,292	0.96
	スウェーデン	4,589,342,282	0.79
	スペイン	4,173,165,765	0.72
	イタリア	3,132,648,819	0.54
	香港	2,924,695,757	0.51
	シンガポール	1,902,909,384	0.33
	フィンランド	1,749,058,633	0.30
	ジャージー	1,588,057,159	0.27
	ベルギー	1,217,688,462	0.21
	ノルウェー	1,138,721,292	0.20
	バミューダ	1,053,635,578	0.18
	イスラエル	1,013,721,667	0.18
	キュラソー	929,980,128	0.16
	ケイマン	853,734,500	0.15
	ニュージーランド	404,345,478	0.07
	オーストリア	327,689,875	0.06
	ポルトガル	320,645,631	0.06
	ルクセンブルク	309,358,594	0.05
リベリア	219,716,870	0.04	
パナマ	122,393,969	0.02	
マン島	82,422,532	0.01	
	小計	554,425,388,919	95.98
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	102,913,156	0.02
	香港	48,844,908	0.01

	小計	151,758,064	0.03
投資証券	アメリカ	9,195,250,791	1.59
	オーストラリア	628,767,245	0.11
	シンガポール	225,821,581	0.04
	フランス	211,623,455	0.04
	イギリス	155,995,356	0.03
	香港	116,157,059	0.02
	カナダ	49,653,935	0.01
	ベルギー	46,797,681	0.01
	小計	10,630,067,103	1.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	12,442,060,732	2.15
合計(純資産総額)		577,649,274,818	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	9,324,591,089	1.61
	買建	カナダ	391,951,833	0.07
	買建	ドイツ	1,795,365,792	0.31
	買建	イギリス	640,393,603	0.11
	買建	オーストラリア	435,701,288	0.08

(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	—	1,219,216,623	0.21

(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	1,205,677	26,201.50	31,590,553,559	25,460.05	30,696,606,229	5.31



			アおよび 機器						
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	541,466	49,745.72	26,935,616,558	50,431.21	27,306,789,940	4.73
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	707,853	17,973.44	12,722,557,579	19,841.47	14,044,845,550	2.43
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	189,337	58,367.43	11,051,115,055	61,539.81	11,651,763,214	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	455,405	18,630.46	8,484,406,145	18,608.01	8,474,182,889	1.47
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	169,572	39,298.17	6,663,870,543	45,250.69	7,673,251,124	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	405,242	18,745.76	7,596,572,175	18,800.88	7,618,907,226	1.32
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	218,306	29,082.96	6,348,986,562	29,507.29	6,441,619,237	1.12
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	71,368	72,147.19	5,149,000,979	79,238.80	5,655,115,028	0.98
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	61,851	64,267.56	3,975,013,289	84,579.30	5,231,314,414	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	98,928	48,019.66	4,750,489,157	50,446.16	4,990,538,617	0.86
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギ ー	309,867	15,704.45	4,866,292,338	15,830.11	4,905,231,422	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	20,488.10	4,589,479,430	20,545.66	4,602,372,600	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	124,044	33,660.19	4,175,345,194	34,847.79	4,322,659,362	0.75
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	184,567	23,054.92	4,255,179,150	21,982.45	4,057,235,827	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	180,673	21,765.36	3,932,414,188	22,315.86	4,031,873,844	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	31,634	121,554.24	3,845,247,005	125,775.28	3,978,775,445	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	64,870	55,936.12	3,628,576,636	55,680.51	3,611,994,956	0.63
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	249,398	12,122.99	3,023,450,754	14,407.90	3,593,301,943	0.62
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバ コ	204,668	18,517.44	3,789,928,194	16,195.72	3,314,747,463	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	77,067	43,729.54	3,370,104,821	42,084.07	3,243,293,393	0.56

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	139,075	23,051.86	3,205,938,313	21,841.91	3,037,664,454	0.53
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	194,506	16,588.95	3,226,651,460	15,351.68	2,985,995,193	0.52
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	135,241	20,608.06	2,787,054,717	21,213.97	2,868,999,044	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,969	76,019.70	2,582,313,512	82,960.10	2,818,071,936	0.49
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	113,530	21,958.61	2,492,961,552	24,373.12	2,767,080,336	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,939	62,461.96	2,182,358,673	78,782.79	2,752,592,228	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,700	107,759.75	3,308,224,387	87,580.32	2,688,715,824	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	314,924	8,989.45	2,830,995,141	8,394.98	2,643,782,729	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	105,521	27,345.49	2,885,523,756	24,262.48	2,560,201,448	0.44

(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	5.34
		素材	3.97
		資本財	6.47
		商業・専門サービス	1.57
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	1.88
		耐久消費財・アパレル	1.51
		消費者サービス	2.04
		メディア・娯楽	5.90
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.47
		生活必需品流通・小売り	1.75
		食品・飲料・タバコ	3.74
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	4.44
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.19
銀行	5.12		

		金融サービス	6.33
		保険	3.21
		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	9.79
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.75
		電気通信サービス	1.20
		公益事業	2.74
		半導体・半導体製造装置	5.74
		不動産管理・開発	0.32
		小計	95.98
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.84
合計			97.85

(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	298	アメリカドル	64,665,548.4	9,668,146,141	62,367,675	9,324,591,089	1.61
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	16	カナダドル	3,770,416	407,355,744	3,627,840	391,951,833	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	32	スイスフラン	3,473,404	575,786,180	3,330,880	552,159,977	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	194	ユーロ	8,087,230.8	1,283,120,038	7,835,660	1,243,205,815	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	27	オーストラリアドル	4,712,664	448,598,486	4,577,175	435,701,288	0.08
	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	48	イギリスポンド	3,639,985	661,530,874	3,523,680	640,393,603	0.11

(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	6,500,000.00	972,901,000	971,601,400	0.17
	カナダドル	買建	300,000.00	32,431,800	32,407,200	0.01
	ユーロ	買建	400,000.00	63,304,000	63,456,400	0.01
	イギリスポンド	買建	200,000.00	36,281,000	36,342,460	0.01
	スイスフラン	買建	210,000.00	34,843,410	34,809,663	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	3,000,000.00	40,311,000	40,224,900	0.01
	デンマーククローネ	買建	1,000,000.00	21,204,000	21,257,300	0.00
	香港ドル	買建	1,000,000.00	19,154,000	19,117,300	0.00

(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。

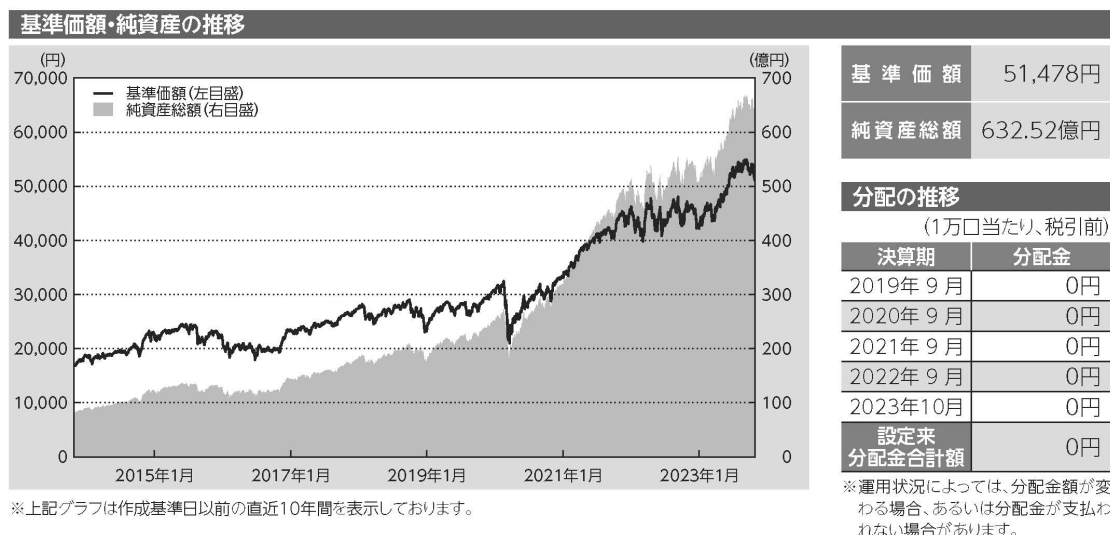
(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

《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

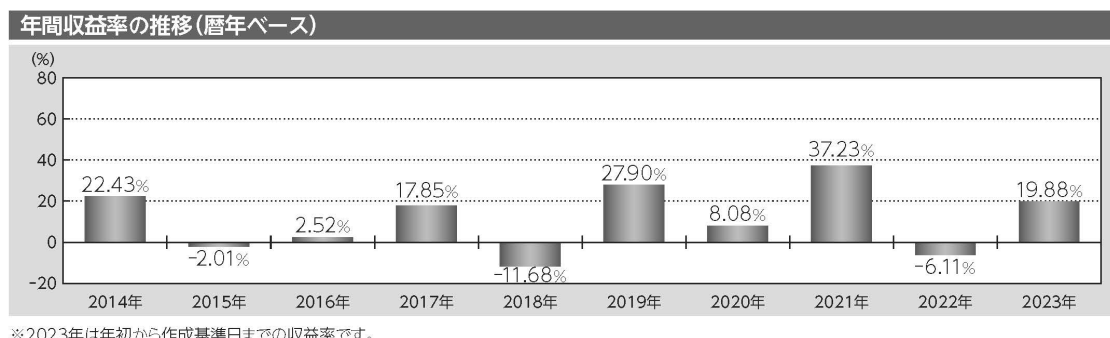
当初設定日：2001年10月1日  
作成基準日：2023年10月31日



**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	5.3%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	4.7%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	一般消費財・サービス流通・小売り	2.4%
NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体・半導体製造装置	2.0%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.5%
META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	1.3%
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	1.1%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア機器・サービス	1.0%
ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	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>

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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>

当ファンドは、「分配金再投資コース」(※)専用ファンドです。

※「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>

1円以上1円単位とします。

#### <申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

(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基準価額とします。

#### <申込手数料>

ありません。

#### <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休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <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>

1口以上1口単位とします。

#### <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（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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

#### <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休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <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、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、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1万口あ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>

###### ①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### ②マザーファンドの主要な投資対象である株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

###### ③外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額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、わが国における本ファンドの基準価額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。

##### <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。（2001年10月1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10月1日から翌年9月30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5億口を下回るようになった場合
  - ・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。）を行うおとす場合、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ナル・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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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ます。）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。

##### (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ます。）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ます。

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22期計算期間(2022年10月1日から2023年10月2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12月11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 山田信之

## 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DC外国株式インデックス・オープンの2022年10月1日から2023年10月2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、DC外国株式インデックス・オープンの2023年10月2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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・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】

【DC外国株式インデックス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 21 期 (2022 年 9 月 30 日現在)	第 22 期 (2023 年 10 月 2 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	352,976,385	372,507,950
親投資信託受益証券	49,956,709,892	65,005,530,845
未収入金	-	23,837,639
流動資産合計	50,309,686,277	65,401,876,434
資産合計	50,309,686,277	65,401,876,434
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	101,373,013	88,160,948
未払受託者報酬	16,839,557	20,539,946
未払委託者報酬	207,687,803	253,325,988
未払利息	855	641
その他未払費用	1,756,762	1,809,080
流動負債合計	327,657,990	363,836,603
負債合計	327,657,990	363,836,603
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,600,717,176	12,195,886,972
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	38,381,311,111	52,842,152,859
(分配準備積立金)	12,498,818,908	22,048,884,873
元本等合計	49,982,028,287	65,038,039,831
純資産合計	49,982,028,287	65,038,039,831
負債純資産合計	50,309,686,277	65,401,876,434

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期		第 22 期	
	自 2021 年 10 月 1 日	至 2022 年 9 月 30 日	自 2022 年 10 月 1 日	至 2023 年 10 月 2 日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,208		663
有価証券売買等損益		2,370,138,498		12,715,083,219
営業収益合計		2,370,139,706		12,715,083,882
<b>営業費用</b>				
支払利息		76,535		121,987
受託者報酬		32,642,503		37,944,656
委託者報酬		402,590,798		467,983,952
その他費用		1,756,762		1,809,080
営業費用合計		437,066,598		507,859,675
営業利益又は営業損失(△)		1,933,073,108		12,207,224,207
経常利益又は経常損失(△)		1,933,073,108		12,207,224,207
当期純利益又は当期純損失(△)		1,933,073,108		12,207,224,207
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(△)		568,882,347		854,573,019
期首剰余金又は期首欠損金(△)		33,652,355,727		38,381,311,111
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,030,957,820		9,290,550,874
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,030,957,820		9,290,550,874
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,666,193,197		6,182,360,314
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,666,193,197		6,182,360,314
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		38,381,311,111		52,842,152,859

### (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10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第22期計算期間は2022年10月1日から2023年10月2日までとなっております。

#### (貸借対照表に関する注記)

	第21期 (2022年9月30日現在)	第22期 (2023年10月2日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,600,717,176口	12,195,886,972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) 4,3085円 (43,085円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 5,3328円 (53,328円)

#### (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自2021年10月1日 至2022年9月30日			第22期 自2022年10月1日 至2023年10月2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	－円	費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,364,213,262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	11,352,706,960円
収益調整金額	C	26,022,590,457円	収益調整金額	C	30,793,267,986円
分配準備積立金額	D	11,134,605,646円	分配準備積立金額	D	10,696,177,913円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	38,521,409,365円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,842,152,859円
当ファンドの期末残存口数	F	11,600,717,176口	当ファンドの期末残存口数	F	12,195,886,972口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	33,206円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	43,327円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

#### (金融商品に関する注記)

##### 1. 金融商品の状況に関する事項

	第22期 自2022年10月1日 至2023年10月2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 22 期 (2023 年 10 月 2 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 21 期 自 2021 年 10 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日	第 22 期 自 2022 年 10 月 1 日 至 2023 年 10 月 2 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	10,785,380,186 円	11,600,717,176 円
期中追加設定元本額	3,246,101,975 円	2,448,225,461 円
期中一部解約元本額	2,430,764,985 円	1,853,055,665 円

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	第 21 期 (2022 年 9 月 30 日現在)	第 22 期 (2023 年 10 月 2 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,249,637,024	12,507,275,090
合計	2,249,637,024	12,507,275,090

### (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	12,617,043,369	65,005,530,845	
合計		12,617,043,369	65,005,530,845	

(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10月2日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	12,699,032,983
コール・ローン	388,296,008
株式	561,335,259,536
投資信託受益証券	160,706,637
投資証券	10,944,685,348
派生商品評価勘定	9,665,086
未収入金	3,965,579
未収配当金	598,966,078
前払金	588,369,918
差入委託証拠金	4,387,449,742
流動資産合計	591,116,396,915
資産合計	591,116,396,915
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	597,637,559
未払金	77,770,649
未払解約金	114,520,048
未払利息	668
流動負債合計	789,928,924
負債合計	789,928,924
純資産の部	
元本等	
元本	114,577,143,137
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	475,749,324,854
元本等合計	590,326,467,991
純資産合計	590,326,467,991
負債純資産合計	591,116,396,915

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年10月2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) 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>
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</p>

	<p>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	<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。</p> <p>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>
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10月2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		114,577,143,137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)	5.1522円 (51,522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10月2日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>また、当ファンドは、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、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月2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。

(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10月2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年10月1日
期首元本額	128,335,928,077円
期中追加設定元本額	14,265,005,735円
期中一部解約元本額	28,023,790,675円
期末元本額	114,577,143,137円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,584,656,685円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,900,976円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,464,761,212円
世界経済インデックスファンド	12,702,263,957円
外国株式インデックス・オープン	883,071,570円
DCマイセレクション25	646,954,560円
DCマイセレクション50	3,503,942,939円
DCマイセレクション75	4,362,419,530円
DC外国株式インデックス・オープン	12,617,043,369円
DCマイセレクションS25	411,558,324円
DCマイセレクションS50	1,887,136,607円
DCマイセレクションS75	1,898,461,450円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	20,858,531円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	139,676,076円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	109,644,875円



DC世界経済インデックスファンド	9,457,847,420円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	997,244,962円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,777,533円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,357,647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）	21,919,341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）	7,792,631円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	21,945,351円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	168,226,228円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	133,637,092円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,012,778,531円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	69,073,884円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,896,351円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	116,595,969円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	38,298,181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）	885,215,160円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,143,447,697円
コア投資戦略ファンド（安定型）	113,740,322円
コア投資戦略ファンド（成長型）	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンドA	1,549,153,616円
分散投資コア戦略ファンドS	7,326,808,258円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,464,100,919円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,008,195,448円
コア投資戦略ファンド（切替型）	133,649,708円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	499,445,552円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,529,049円
SMT インデックスバランス・オープン	128,080,046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セクション（SMA専用）	4,640,470,844円
SMT 世界経済インデックス・オープン	249,039,869円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,010,427,786円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	176,581,684円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,332,838円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,110,283,759円
グローバル経済コア	534,036,193円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,382,160円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,195,644円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	116,500,119円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	27,810,950円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	139,254,936円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	132,817,174円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	56,621,782円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	62,421,180円
10資産分散投資ファンド	53,170,717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）	54,890,130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）	23,173,862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）	439,220,327円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,457,569,679円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	102,751,018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）	73,087,436円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,042,301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）	78,606,339円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	194,200,383円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	186,765,260円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	185,818,200円

SMTAM海外バランスファンド2021-04 (適格機関投資家専用)	189,041,134円
SMTAM海外バランスファンド2021-07 (適格機関投資家専用)	187,171,165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)	120,414,728円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月2日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,538,309,409	
投資信託受益証券	△28,785,739	
投資証券	△582,916,801	
合計	5,926,606,869	

(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10月2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	18,631,985,912	—	18,043,615,994	△588,369,918
合計		18,631,985,912	—	18,043,615,994	△588,369,918

(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10月2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	472,206,200	—	472,603,645	397,445
	アメリカドル	390,516,200	—	390,853,345	337,145
	スイスフラン	81,690,000	—	81,750,300	60,300
合計		472,206,200	—	472,603,645	397,445

(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	41.10	961,411.20	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.32	2,731,366.24	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	165.96	3,003,710.04	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	86.23	731,402.86	
	CHEVRON CORP	135,745	168.62	22,889,321.90	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	119.80	10,791,584.00	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.05	1,475,469.30	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	47.70	2,397,211.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	154.88	2,054,792.96	
	EOG RESOURCES INC	43,691	126.76	5,538,271.16	
	EQT CORPORATION	27,026	40.58	1,096,715.08	
	EXXON MOBIL	301,729	117.58	35,477,295.82	
	HALLIBURTON CO	70,302	40.50	2,847,231.00	
	HESS CORP	21,602	153.00	3,305,106.00	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	56.93	764,512.97	
	KINDER MORGAN INC	144,061	16.58	2,388,531.38	
	MARATHON OIL CORP	50,360	26.75	1,347,130.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	31,527	151.34	4,771,296.18	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	64.88	3,205,461.28	
	ONEOK INC	43,535	63.43	2,761,425.05	
	OVINTIV INC	20,398	47.57	970,332.86	
	PHILLIPS 66	34,260	120.15	4,116,339.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	229.55	3,988,201.70	
	SCHLUMBERGER	105,564	58.30	6,154,381.20	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	85.72	1,482,784.56		
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,823.56	971,957.48		

VALERO ENERGY CORP	26,571	141.71	3,765,376.41
WILLIAMS COS	90,577	33.69	3,051,539.13
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	283.40	4,678,367.20
ALBEMARLE CORP	8,403	170.04	1,428,846.12
AMCOR PLC	110,292	9.16	1,010,274.72
AVERY DENNISON CORP	6,638	182.67	1,212,563.46
BALL CORP	21,539	49.78	1,072,211.42
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	125.52	1,077,212.64
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	85.74	1,127,395.26
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.63	672,090.00
CORTEVA INC	51,304	51.16	2,624,712.64
CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.48	879,491.20
DOW INC	51,372	51.56	2,648,740.32
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	74.59	2,544,936.21
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	76.72	677,591.04
ECOLAB INC	18,665	169.40	3,161,851.00
FMC CORP	8,264	66.97	553,440.08
FREEMONT-MCMORAN INC	105,762	37.29	3,943,864.98
INT'L PAPER CO	25,191	35.47	893,524.77
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	68.17	1,316,158.19
LINDE PLC	36,447	372.35	13,571,040.45
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	94.70	1,869,851.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	410.48	1,794,208.08
MOSAIC CO/THE	27,732	35.60	987,259.20
NEWMONT CORPORATION	61,808	36.95	2,283,805.60
NUCOR CORP	18,727	156.35	2,927,966.45
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	153.55	1,195,079.65
PPG INDUSTRIES INC	17,495	129.80	2,270,851.00
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	262.23	1,081,960.98
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.81	991,333.36
SEALED AIR CORP	11,690	32.86	384,133.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	255.05	4,654,662.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	107.22	1,245,681.96
VULCAN MATERIALS CO	10,153	202.02	2,051,109.06
WESTLAKE CORP	2,222	124.67	277,016.74
WESTROCK CO	21,356	35.80	764,544.80

3 M COMPANY	40,676	93.62	3,808,087.12
AECOM	10,456	83.04	868,266.24
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	62.67	750,034.56
ALLEGION PLC	5,598	104.20	583,311.60
AMETEK INC	17,753	147.76	2,623,183.28
AXON ENTERPRISE INC	5,367	198.99	1,067,979.33
BOEING CO	42,311	191.68	8,110,172.48
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	124.49	1,370,634.90
CARLISLE COS INC	3,456	259.26	896,002.56
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	55.20	3,425,877.60
CATERPILLAR	38,381	273.00	10,478,013.00
CUMMINS INC	10,414	228.46	2,379,182.44
DEERE&CO	20,925	377.38	7,896,676.50
DOVER CORP	10,657	139.51	1,486,758.07
EATON CORP	29,584	213.28	6,309,675.52
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	96.57	4,101,617.61
FASTENAL CO	44,011	54.64	2,404,761.04
FERGUSON PLC	16,260	164.47	2,674,282.20
FORTIVE CORP	25,894	74.16	1,920,299.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.16	640,869.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	108.96	567,790.56
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	220.97	3,757,373.88
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	110.55	8,959,193.10
GRACO INC	13,378	72.88	974,988.64
GRAINGER (WW) INC	3,363	691.84	2,326,657.92
HEICO CORP	3,640	161.93	589,425.20
HEICO CORP-CLASS A	4,690	129.22	606,041.80
HONEYWELL INTL INC	49,482	184.74	9,141,304.68
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	46.25	1,496,835.00
HUBBELL INC	3,709	313.41	1,162,437.69
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	204.58	507,767.56
IDEX CORP	5,916	208.02	1,230,646.32
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	230.31	5,218,363.98
INGERSOLL-RAND INC	31,562	63.72	2,011,130.64
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	46.42	589,534.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	53.21	2,674,653.86

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	174.12	2,556,429.84
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	374.44	945,835.44
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	408.96	6,928,600.32
MASCO CORP	15,277	53.45	816,555.65
NORDSON CORP	4,121	223.17	919,683.57
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	440.19	4,727,640.60
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	80.31	2,466,882.27
OWENS CORNING	6,460	136.41	881,208.60
PACCAR INC	38,842	85.02	3,302,346.84
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	389.52	3,714,073.20
PENTAIR PLC	10,813	64.75	700,141.75
QUANTA SERVICES INC	11,573	187.07	2,164,961.11
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	285.87	2,420,175.42
RTX CORP	108,761	71.97	7,827,529.17
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.82	522,974.96
SMITH (A.O.) CORP	9,016	66.13	596,228.08
SNAP-ON INC	4,000	255.06	1,020,240.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	83.58	1,052,940.84
TEXTRON	17,063	78.14	1,333,302.82
TORO CO	8,812	83.10	732,277.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	202.91	3,455,151.48
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	843.13	3,443,342.92
UNITED RENTALS INC	5,364	444.57	2,384,673.48
WABTEC CORP	13,304	106.27	1,413,816.08
WATSCO INC	2,656	377.72	1,003,224.32
XYLEM INC	16,864	91.03	1,535,129.92
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	240.58	7,409,623.42
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	109.27	1,009,654.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	179.05	1,484,324.50
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	67.85	723,823.80
CINTAS CORP	6,804	481.01	3,272,792.04
CLARIVATE PLC	27,357	6.71	183,565.47
COPART INC	63,766	43.09	2,747,676.94
EQUIFAX INC	9,160	183.18	1,677,928.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	136.50	1,183,045.50
LEIDOS HOLDINGS	8,529	92.16	786,032.64

PAYCHEX INC	24,118	115.33	2,781,528.94
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	259.27	1,098,008.45
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	181.70	621,959.10
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	142.51	2,345,002.05
ROBERT HALF INC	7,185	73.28	526,516.80
ROLLINS INC	17,468	37.33	652,080.44
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	52.54	809,221.08
TRANSUNION	15,741	71.79	1,130,046.39
VERISK ANALYTICS INC	10,738	236.24	2,536,745.12
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	134.30	2,655,782.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	152.44	4,609,175.84
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	86.13	720,649.71
CSX CORP	152,261	30.75	4,682,025.75
DELTA AIR LINES INC	9,648	37.00	356,976.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.63	1,407,656.40
FEDEX CORP	17,749	264.92	4,702,065.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.54	400,058.94
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	188.52	1,083,612.96
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	50.15	683,193.45
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	196.93	3,332,055.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	409.14	3,009,633.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	27.07	366,338.31
U-HAUL HOLDING CO	6,606	52.39	346,088.34
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	45.99	6,195,910.77
UNION PACIFIC CORP	45,361	203.63	9,236,860.43
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	155.87	8,380,194.68
APTIV PLC	21,896	98.59	2,158,726.64
BORGWARNER INC	19,781	40.37	798,558.97
FORD MOTOR COMPANY	290,797	12.42	3,611,698.74
GENERAL MOTORS CO	103,664	32.97	3,417,802.08
LEAR CORP	3,648	134.20	489,561.60
LUCID GROUP INC	61,234	5.59	342,298.06
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	24.28	1,246,438.08
TESLA INC	213,419	250.22	53,401,702.18
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	514.09	1,081,131.27
DR HORTON INC	22,973	107.47	2,468,908.31

GARMIN LTD	10,561	105.20	1,111,017.20
HASBRO INC	10,572	66.14	699,232.08
LENNAR CORP-CL A	18,864	112.23	2,117,106.72
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	385.61	3,323,572.59
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	85.81	357,227.03
NIKE B	91,582	95.62	8,757,070.84
NVR INC	247	5,963.30	1,472,935.10
PULTE GROUP INC	16,747	74.05	1,240,115.35
VF CORP	25,718	17.67	454,437.06
WHIRLPOOL CORP	3,785	133.70	506,054.50
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	137.21	4,216,326.09
ARAMARK	16,686	34.70	579,004.20
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,083.95	8,631,976.05
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	46.35	813,906.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	13.72	985,233.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,831.83	3,749,756.01
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	143.22	1,318,626.54
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	378.79	1,078,793.92
DOORDASH INC - A	19,212	79.47	1,526,777.64
DRAFTKINGS INC	32,654	29.44	961,333.76
EXPEDIA GROUP INC	11,638	103.07	1,199,528.66
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	150.18	2,879,701.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	106.08	401,724.96
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	45.84	1,171,670.40
MARRIOTT INTL A	19,516	196.56	3,836,064.96
MCDONALD'S CORP	54,264	263.44	14,295,308.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	36.76	836,437.04
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	92.14	1,577,068.24
STARBUCKS CORP	85,428	91.27	7,797,013.56
VAIL RESORTS INC	3,014	221.89	668,776.46
WYNN RESORTS LTD	6,702	92.41	619,331.82
YUM BRANDS INC	22,162	124.94	2,768,920.28
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,681	93.63	5,494,302.03
ALPHABET INC-CL A	444,829	130.86	58,210,322.94
ALPHABET INC-CL C	395,244	131.85	52,112,921.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	439.82	3,163,185.44



COMCAST CORP-CL A	312,679	44.34	13,864,186.86
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	120.40	2,375,853.20
FOX CORP - CLASS A	21,544	31.20	672,172.80
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.88	298,763.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	28.66	817,125.26
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	91.32	835,851.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	62.30	958,111.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	25.46	345,848.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	83.04	964,343.52
MATCH GROUP INC	22,730	39.17	890,447.75
META PLATFORMS INC-CLASS A	165,576	300.21	49,707,570.96
NETFLIX INC	33,103	377.60	12,499,692.80
NEWS CORP-CLASS A	33,479	20.06	671,588.74
OMNICOM GROUP	14,048	74.48	1,046,295.04
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	12.90	419,353.20
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	27.03	1,237,082.01
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	28.96	825,446.88
ROKU INC	9,122	70.59	643,921.98
SEA LTD-ADR	28,338	43.95	1,245,455.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.52	273,315.36
SNAP INC - A	63,578	8.91	566,479.98
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	140.39	1,806,398.13
THE WALT DISNEY CO	135,788	81.05	11,005,617.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	78.15	2,624,511.45
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	10.86	1,926,705.18
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	16.40	359,734.00
AMAZON.COM	690,901	127.12	87,827,335.12
AUTOZONE INC	1,368	2,539.99	3,474,706.32
BATH & BODY WORKS INC	13,528	33.80	457,246.40
BEST BUY COMPANY INC	15,285	69.47	1,061,848.95
BURLINGTON STORES INC	5,108	135.30	691,112.40
CARMAX INC	10,695	70.73	756,457.35
CHEWY INC - CLASS A	6,878	18.26	125,592.28
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	108.58	537,471.00
EBAY	41,952	44.09	1,849,663.68
ETSY INC	10,294	64.58	664,786.52

GENUINE PARTS CO	9,903	144.38	1,429,795.14
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	39.74	278,180.00
HOME DEPOT	75,273	302.16	22,744,489.68
LKQ CORP	19,286	49.51	954,849.86
LOWES COMPANIES	44,328	207.84	9,213,131.52
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,267.88	4,251,201.64
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	908.86	4,159,852.22
POOL CORP	2,664	356.10	948,650.40
ROSS STORES INC	25,425	112.95	2,871,753.75
TJX COMPANIES INC	85,671	88.88	7,614,438.48
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	203.05	1,593,130.30
ULTA BEAUTY INC	3,920	399.45	1,565,844.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.75	568,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	564.96	18,623,906.40
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	105.80	1,723,164.60
DOLLAR TREE INC	16,318	106.45	1,737,051.10
KROGER CO	50,664	44.75	2,267,214.00
SYSKO CORP	40,090	66.05	2,647,944.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	110.57	3,783,705.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	22.24	1,146,850.08
WALMART INC	110,203	159.93	17,624,765.79
ALTRIA GROUP INC	132,765	42.05	5,582,768.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	75.42	3,063,409.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	57.69	1,384,906.14
BUNGE LIMITED	11,604	108.25	1,256,133.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.08	651,898.52
COCA-COLA CO	305,497	55.98	17,101,722.06
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	62.48	961,817.12
CONAGRA BRANDS INC	33,324	27.42	913,744.08
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	251.33	3,010,682.07
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	52.20	691,232.40
GENERAL MILLS INC	43,531	63.99	2,785,548.69
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	200.08	2,189,275.36
HORMEL FOODS CORP	23,338	38.03	887,544.14
JM SMUCKER CO	7,850	122.91	964,843.50
KELLOGG CO	18,819	59.51	1,119,918.69

KEURIG DR PEPPER INC	65,371	31.57	2,063,762.47
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	33.64	2,319,948.96
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	92.46	1,098,054.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	75.64	1,368,478.88
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	63.59	932,801.71
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	69.40	7,031,885.60
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	52.95	3,089,526.60
PEPSICO INC	102,377	169.44	17,346,758.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	92.58	10,681,139.76
TYSON FOODS INC	23,306	50.49	1,176,719.94
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	91.63	1,772,673.98
CLOROX COMPANY	9,570	131.06	1,254,244.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	71.11	4,178,494.71
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	144.55	2,453,447.15
KENVUE INC	111,921	20.08	2,247,373.68
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	120.85	2,978,106.55
PROCTER & GAMBLE CO	177,374	145.86	25,871,771.64
ABBOTT LABORATORIES	129,183	96.85	12,511,373.55
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	305.32	1,603,845.96
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	37.74	1,569,078.24
BECTON DICKINSON & CO	21,103	258.53	5,455,758.59
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	52.80	5,641,046.40
CARDINAL HEALTH	19,151	86.82	1,662,689.82
CENCORA INC	12,469	179.97	2,244,045.93
CENTENE CORP	40,934	68.88	2,819,533.92
COOPER COS INC/THE	3,504	318.01	1,114,307.04
CVS HEALTH CORP	95,131	69.82	6,642,046.42
DAVITA INC	4,627	94.53	437,390.31
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	34.16	607,159.84
DEXCOM INC	28,772	93.30	2,684,427.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	69.28	3,121,202.56
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	435.42	7,679,502.54
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	68.04	2,035,824.84
HCA HEALTHCARE INC	15,457	245.98	3,802,112.86
HENRY SCHEIN INC	8,755	74.25	650,058.75
HOLOGIC INC	18,875	69.40	1,309,925.00

HUMANA INC	9,297	486.52	4,523,176.44
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	437.27	2,697,081.36
INSULET CORP	5,246	159.49	836,684.54
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	292.29	7,609,770.15
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	201.05	1,316,475.40
MCKESSON CORP	10,179	434.85	4,426,338.15
MEDTRONIC PLC	98,891	78.36	7,749,098.76
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	327.89	1,490,260.05
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	121.86	1,057,622.94
RESMED INC	10,920	147.87	1,614,740.40
STERIS PLC	6,933	219.42	1,521,238.86
STRYKER CORP	25,363	273.27	6,930,947.01
TELEFLEX INC	3,934	196.41	772,676.94
THE CIGNA GROUP	22,079	286.07	6,316,139.53
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,912	504.19	35,248,931.28
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	125.73	587,410.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	203.45	2,289,829.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	112.22	1,711,803.88
ABBVIE INC	133,056	149.06	19,833,327.36
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	111.82	2,436,669.62
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	177.10	1,707,775.30
AMGEN	39,709	268.76	10,672,190.84
AVANTOR INC	49,647	21.08	1,046,558.76
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	358.45	664,207.85
BIO-TECHNE CORP	12,980	68.07	883,548.60
BIOGEN INC	10,740	257.01	2,760,287.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	88.48	1,307,999.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	58.04	9,073,973.60
CATALENT INC	13,739	45.53	625,536.67
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	195.98	823,899.92
DANAHER CORP	53,074	248.10	13,167,659.40
ELI LILLY & CO	60,535	537.13	32,515,164.55
EXACT SCIENCES CORP	12,208	68.22	832,829.76
GILEAD SCIENCES INC	92,825	74.94	6,956,305.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	115.69	1,806,846.42
ILLUMINA INC	11,423	137.28	1,568,149.44

INCYTE CORP	15,212	57.77	878,797.24
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	196.75	2,722,233.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	129.44	643,446.24
JOHNSON & JOHNSON	179,427	155.75	27,945,755.25
MERCK & CO	191,177	102.95	19,681,672.15
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,108.07	1,802,829.89
MODERNA INC	24,153	103.29	2,494,763.37
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	112.50	758,475.00
PFIZER	419,551	33.17	13,916,506.67
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	822.96	6,577,096.32
REPLIGEN CORP	4,353	159.01	692,170.53
REVVITY INC	8,524	110.70	943,606.80
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	27.14	816,452.62
SEAGEN INC	11,325	212.15	2,402,598.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	10.20	939,838.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	506.17	14,511,893.90
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	225.87	817,197.66
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	347.74	6,658,177.78
VIATRIS INC	89,720	9.86	884,639.20
WATERS CORP	4,749	274.21	1,302,223.29
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	375.21	2,163,836.07
ZOETIS INC	34,383	173.98	5,981,954.34
BANK OF AMERICA CORP	535,131	27.38	14,651,886.78
CITIGROUP	144,682	41.13	5,950,770.66
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.80	1,059,189.60
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.33	1,378,458.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,380.10	1,057,156.60
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.02	488,274.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.40	1,186,764.80
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	145.02	31,599,422.94
KEY CORP	71,223	10.76	766,359.48
M & T BANK CORP	11,807	126.45	1,492,995.15
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	122.77	3,641,112.66
REGIONS FINL CORP	70,810	17.20	1,217,932.00
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.61	2,762,982.14
US BANCORP	113,859	33.06	3,764,178.54

WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	40.31	575,344.63
WELLS FARGO & CO	273,135	40.86	11,160,296.10
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.68	574,393.72
AMERICAN EXPRESS	47,011	149.19	7,013,571.09
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	329.68	2,576,778.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	89.76	2,582,125.92
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	102.87	1,314,678.60
BANK NEW YORK CO	61,254	42.65	2,612,483.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,275	350.30	34,075,432.50
BLACKROCK INC	11,143	646.49	7,203,838.07
BLACKSTONE INC	52,505	107.14	5,625,385.70
BLOCK INC	39,463	44.26	1,746,632.38
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	97.05	2,920,913.85
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	30.16	472,577.04
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	156.21	1,115,964.24
CME GROUP INC	26,740	200.22	5,353,882.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	75.08	945,632.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	86.63	1,644,843.81
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	28.39	794,437.37
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	437.26	1,376,494.48
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	55.27	2,366,108.70
FISERV INC	46,319	112.96	5,232,194.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	255.34	1,293,041.76
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.58	640,800.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	57.81	249,507.96
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	115.39	2,394,227.11
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	323.57	8,028,418.84
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	110.02	4,577,272.08
INVESCO LTD	26,420	14.52	383,618.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	151.14	787,892.82
KKR & CO INC	44,805	61.60	2,759,988.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	237.65	1,261,208.55
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	213.64	685,143.48
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	395.91	25,048,037.97
MOODY'S CORP	12,261	316.17	3,876,560.37
MORGAN STANLEY	93,231	81.67	7,614,175.77

MSCI INC	5,952	513.08	3,053,852.16
NASDAQ INC	24,183	48.59	1,175,051.97
NORTHERN TRUST CORP	15,902	69.48	1,104,870.96
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	58.46	4,635,059.56
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	104.87	1,657,575.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	100.43	1,555,258.98
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	9.81	313,066.53
S&P GLOBAL INC	24,377	365.41	8,907,599.57
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	54.90	6,131,945.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.23	575,196.50
STATE STREET CORP	26,059	66.96	1,744,910.64
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	30.57	892,521.72
TOAST INC-CLASS A	20,341	18.73	380,986.93
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	80.20	726,692.20
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	230.01	27,781,527.84
AFLAC	43,196	76.75	3,315,293.00
ALLSTATE CORP	18,556	111.41	2,067,323.96
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	111.67	705,642.73
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	60.60	3,304,760.40
AON PLC	15,249	324.22	4,944,030.78
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	79.71	2,113,112.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	227.93	3,627,050.09
ASSURANT INC	4,726	143.58	678,559.08
BROWN & BROWN INC	20,155	69.84	1,407,625.20
CHUBB LTD	30,784	208.18	6,408,613.12
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	102.29	1,136,441.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	293.79	636,349.14
EVEREST GROUP LTD	3,288	371.67	1,222,050.96
FNF GROUP	20,461	41.30	845,039.30
GLOBE LIFE INC	5,948	108.73	646,726.04
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	70.91	1,753,675.21
LOEWS CORP	12,757	63.31	807,645.67
MARKEL GROUP INC	1,007	1,472.49	1,482,797.43
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	190.30	7,002,849.70
METLIFE INC	48,925	62.91	3,077,871.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	72.07	1,335,889.52

PROGRESSIVE CORP	43,513	139.30	6,061,360.90
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	94.89	2,516,577.69
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	163.31	2,800,276.57
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	208.96	1,552,363.84
WR BERKLEY CORP	17,572	63.49	1,115,646.28
WEYERHAEUSER CO	52,615	30.66	1,613,175.90
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	307.11	14,416,664.73
ADOBE INC	34,096	509.90	17,385,550.40
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	106.54	1,223,505.36
ANSYS INC	6,794	297.55	2,021,554.70
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	204.26	488,998.44
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	201.51	2,304,468.36
AUTODESK INC	15,965	206.91	3,303,318.15
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.16	743,020.08
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	108.57	808,086.51
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	234.30	4,758,164.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	133.28	824,470.08
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	63.04	1,278,640.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	67.74	2,459,436.18
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	29.61	364,203.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	167.38	2,773,653.98
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	163.77	507,687.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	91.09	1,613,750.44
DOCUSIGN INC	14,969	42.00	628,698.00
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.23	628,141.64
DYNATRACE INC	22,028	46.73	1,029,368.44
EPAM SYSTEMS INC	4,768	255.69	1,219,129.92
FAIR ISAAC CORP	1,816	868.53	1,577,250.48
FORTINET INC	48,642	58.68	2,854,312.56
GARTNER INC	5,655	343.61	1,943,114.55
GEN DIGITAL INC	43,555	17.68	770,052.40
GODADDY INC - CLASS A	11,388	74.48	848,178.24
HUBSPOT INC	3,646	492.50	1,795,655.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	140.30	9,459,867.80
INTUIT INC	20,854	510.94	10,655,142.76
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	197.66	927,816.04



MICROSOFT CORP	528,983	315.75	167,026,382.25
MONDAY.COM LTD	1,631	159.22	259,687.82
MONGODB INC	5,325	345.86	1,841,704.50
OKTA INC	11,505	81.51	937,772.55
ORACLE CORP	123,187	105.92	13,047,967.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	16.00	2,091,856.00
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	234.44	5,273,258.92
PTC INC	8,226	141.68	1,165,459.68
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	484.28	3,824,843.44
SALESFORCE INC	72,631	202.78	14,728,114.18
SERVICENOW INC	15,145	558.96	8,465,449.20
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	152.77	2,952,433.02
SPLUNK INC	11,101	146.25	1,623,521.25
SYNOPSYS INC	11,321	458.97	5,195,999.37
TWILIO INC - A	12,842	58.53	751,642.26
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	386.14	1,289,321.46
UIPATH INC - CLASS A	28,419	17.11	486,249.09
UNITY SOFTWARE INC	16,437	31.39	515,957.43
VERISIGN INC	6,723	202.53	1,361,609.19
VMWARE INC-CLASS A	17,149	166.48	2,854,965.52
WIX.COM LTD	5,010	91.80	459,918.00
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	214.85	3,257,985.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	69.94	1,157,297.18
ZSCALER INC	7,204	155.59	1,120,870.36
AMPHENOL CORPORATION	44,247	83.99	3,716,305.53
APPLE INC	1,177,684	171.21	201,631,277.64
ARISTA NETWORKS INC	19,289	183.93	3,547,825.77
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	125.24	543,291.12
CDW CORP/DE	9,584	201.76	1,933,667.84
CISCO SYSTEMS	304,444	53.76	16,366,909.44
COGNEX CORP	14,352	42.44	609,098.88
CORNING	58,221	30.47	1,773,993.87
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	68.90	1,248,743.60
F5 INC	4,851	161.14	781,690.14
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	17.37	1,692,393.84
HP INC	68,329	25.70	1,756,055.30

JABIL INC	11,304	126.89	1,434,364.56
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	27.79	703,670.59
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	132.31	1,830,905.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	272.24	3,321,872.48
NETAPP INC	15,191	75.88	1,152,693.08
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	65.95	841,258.20
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	274.22	969,093.48
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	123.53	2,815,866.35
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	408.58	1,356,485.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	53.86	954,291.48
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.63	1,176,797.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	236.53	984,437.86
AT&T INC	529,966	15.02	7,960,089.32
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.56	350,208.64
T-MOBILE US INC	40,399	140.05	5,657,879.95
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	32.41	10,117,721.39
AES CORP	54,375	15.20	826,500.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	48.45	1,006,694.10
AMEREN CORPORATION	20,898	74.83	1,563,797.34
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	75.22	2,792,015.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	123.83	1,791,572.44
ATMOS ENERGY CORP	11,302	105.93	1,197,220.86
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	26.85	1,274,462.10
CMS ENERGY CORP	23,697	53.11	1,258,547.67
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	85.53	2,367,042.75
CONSTELLATION ENERGY	25,114	109.08	2,739,435.12
DOMINION ENERGY INC	60,549	44.67	2,704,723.83
DTE ENERGY COMPANY	15,851	99.28	1,573,687.28
DUKE ENERGY CORP	57,283	88.26	5,055,797.58
EDISON INTL	30,900	63.29	1,955,661.00
ENTERGY CORP	16,181	92.50	1,496,742.50
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	34.33	700,297.67
EVERGY INC	18,475	50.70	936,682.50
EVERSOURCE ENERGY	27,450	58.15	1,596,217.50
EXELON CORP	73,907	37.79	2,792,945.53
FIRSTENERGY CORP	39,425	34.18	1,347,546.50

NEXTERA ENERGY INC	150,399	57.29	8,616,358.71
NISOURCE INC	32,351	24.68	798,422.68
NRG ENERGY INC	19,068	38.52	734,499.36
PG&E CORP	148,742	16.13	2,399,208.46
PPL CORPORATION	58,459	23.56	1,377,294.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	56.91	2,030,719.53
SEMPRA	45,886	68.03	3,121,624.58
SOUTHERN CO	81,133	64.72	5,250,927.76
VISTRA CORP	22,676	33.18	752,389.68
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	80.55	1,888,655.85
XCEL ENERGY INC	39,963	57.22	2,286,682.86
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	102.82	12,300,150.96
ANALOG DEVICES	37,601	175.09	6,583,559.09
APPLIED MATERIALS	62,818	138.45	8,697,152.10
BROADCOM INC	30,991	830.58	25,740,504.78
ENPHASE ENERGY INC	9,617	120.15	1,155,482.55
ENTEGRIS INC	10,321	93.91	969,245.11
FIRST SOLAR INC	7,921	161.59	1,279,954.39
INTEL CORP	310,036	35.55	11,021,779.80
KLA CORP	10,294	458.66	4,721,446.04
LAM RESEARCH CORP	10,237	626.77	6,416,244.49
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	85.93	943,339.54
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	54.13	3,447,756.22
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	78.05	3,178,039.90
MICRON TECHNOLOGY	81,347	68.03	5,534,036.41
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	462.00	1,631,322.00
NVIDIA CORP	184,802	434.99	80,387,021.98
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	199.92	3,860,455.20
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	92.95	2,975,422.45
QORVO INC	6,249	95.47	596,592.03
QUALCOMM	82,879	111.06	9,204,541.74
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	98.59	1,108,348.78
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	129.51	538,243.56
TERADYNE INC	12,318	100.46	1,237,466.28
TEXAS INSTRUMENTS	67,444	159.01	10,724,270.44
WOLFSPEED INC	10,256	38.10	390,753.60

	CBRE GROUP INC-A	22,995	73.86	1,698,410.70
	COSTAR GROUP INC	29,397	76.89	2,260,335.33
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.57	352,359.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	46.16	545,103.44
	アメリカドル 小計	25,632,158		2,786,485,655.31 (417,387,686,308)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	21.68	810,832.00
	CAMECO CORP	31,793	53.89	1,713,324.77
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	87.84	7,229,846.88
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	28.28	3,147,366.04
	ENBRIDGE	159,113	45.05	7,168,040.65
	IMPERIAL OIL	16,488	83.66	1,379,386.08
	KEYERA CORP	18,607	31.89	593,377.23
	PARKLAND CORP	14,896	39.73	591,818.08
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	40.84	1,557,270.04
	SUNCOR ENERGY	98,973	46.71	4,623,028.83
	TC ENERGY CORP	75,669	46.71	3,534,498.99
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	68.35	1,709,365.15
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	61.72	2,228,092.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	19.73	2,638,433.71
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	57.01	837,419.89
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	32.09	1,391,422.40
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	181.33	2,483,314.35
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.64	603,499.08
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.19	671,311.69
	LUNDIN MINING CORP	31,977	10.13	323,927.01
	NUTRIEN LTD	37,152	83.88	3,116,309.76
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	19.66	440,698.56
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	58.46	2,068,665.56
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	98.61	345,628.05
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	55.12	1,758,658.72
	CAE INC	25,999	31.71	824,428.29
	STANTEC INC	9,001	88.13	793,258.13
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	110.62	576,662.06
	WSP GLOBAL INC	9,951	191.70	1,907,606.70
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	43.13	602,569.23

RB GLOBAL INC	14,445	85.04	1,228,402.80
THOMSON REUTERS CORP	11,033	166.16	1,833,243.28
AIR CANADA	13,805	19.38	267,540.90
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	147.09	6,212,640.33
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	100.96	6,991,278.08
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	174.44	1,018,206.28
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	72.79	1,474,288.66
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	102.81	315,626.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	38.07	373,847.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	90.45	2,086,952.85
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	146.05	659,123.65
DOLLARAMA INC	22,000	93.58	2,058,760.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	68.98	3,919,512.58
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	36.95	256,063.50
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	115.40	1,490,160.20
METRO INC	18,840	70.54	1,328,973.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	150.63	787,192.38
SAPUTO INC	20,898	28.40	593,503.20
BANK MONTREAL	52,757	114.58	6,044,897.06
BANK NOVA SCOTIA	88,533	60.88	5,389,889.04
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	52.43	3,530,845.92
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	90.23	2,175,535.53
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	118.70	12,227,999.20
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	81.83	11,080,272.98
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	45.26	1,312,585.26
BROOKFIELD CORP	104,769	42.47	4,449,539.43
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.49	634,964.71
IGM FINANCIAL INC	7,685	34.45	264,748.25
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	20.37	87,611.37
ONEX CORP	6,603	79.83	527,117.49
TMX GROUP LTD	23,425	29.19	683,775.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,108.77	1,944,782.58
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.86	924,401.68
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	85.20	594,440.40
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	198.02	2,624,755.10
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.82	3,246,902.76

	POWER CORP OF CANADA	43,577	34.58	1,506,892.66
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	66.27	2,890,299.78
	CGI INC - CL A	16,084	133.88	2,153,325.92
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,804.07	4,178,064.30
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	99.69	696,234.96
	OPEN TEXT CORP	20,463	47.67	975,471.21
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	74.14	6,597,496.18
	BCE INC	6,203	51.85	321,625.55
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.11	442,472.00
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	52.15	1,453,994.15
	TELUS CORP	32,908	22.18	729,899.44
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	8.04	416,616.72
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.05	635,489.75
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	32.51	367,200.45
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	28.70	296,298.80
	EMERA INC	17,459	47.42	827,905.78
	FORTIS INC	35,547	51.59	1,833,869.73
	HYDRO ONE LTD	20,587	34.58	711,898.46
	NORTHLAND POWER INC	17,854	22.12	394,930.48
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	197.56	531,436.40
	カナダドル 小計	3,050,470		176,271,863.55 (19,451,600,142)
ユーロ	ENI	174,687	15.25	2,665,024.87
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	14.04	556,854.48
	NESTE OIL OYJ	32,766	32.13	1,052,771.58
	OMV AG	12,549	45.32	568,720.68
	REPSOL SA	89,536	15.57	1,394,075.52
	TENARIS SA	40,648	14.98	609,110.28
	TOTALENERGIES SE	167,847	62.31	10,458,546.57
	AIR LIQUIDE	38,920	159.84	6,220,972.80
	AKZO NOBEL	12,357	68.48	846,207.36
	ARCELORMITTAL	42,704	23.77	1,015,287.60
	ARKEMA	4,369	93.56	408,763.64
	BASF SE	64,204	42.95	2,757,561.80
	COVESTRO AG	14,454	51.06	738,021.24
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	80.13	1,098,341.91

EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.32	277,841.02
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	73.52	791,442.80
OCI NV	7,248	26.39	191,274.72
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	31.56	615,546.24
SOLVAY SA	5,356	104.85	561,576.60
STORA ENSO OYJ R	42,169	11.89	501,389.41
SYMRISE AG	10,018	90.32	904,825.76
UMICORE	17,605	22.45	395,232.25
UPM KYMMENE OYJ	42,324	32.47	1,374,260.28
VOESTALPINE AG	7,152	25.84	184,807.68
WACKER CHEMIE AG	1,770	135.65	240,100.50
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	34.07	558,850.21
AIRBUS SE	44,063	126.98	5,595,119.74
ALSTOM	24,388	22.60	551,168.80
BOUYGUES ORD	16,606	33.14	550,322.84
BRENTAG SE	12,514	73.48	919,528.72
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.54	935,040.04
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.82	1,134,751.50
DASSAULT AVIATION SA	2,130	178.40	379,992.00
EIFFAGE	5,924	90.04	533,396.96
FERROVIAL SE	37,026	28.97	1,072,643.22
GEA GROUP AG	13,382	34.96	467,834.72
IMCD NV	4,641	120.00	556,920.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	70.96	879,762.08
KNORR-BREMSE AG	5,022	60.18	302,223.96
KONE OYJ-B	26,369	39.92	1,052,650.48
LEGRAND SA	19,340	87.30	1,688,382.00
METSO CORPORATION	51,970	9.95	517,309.38
MTU AERO ENGINES AG	3,962	171.75	680,473.50
PRYSMIAN SPA	21,155	38.15	807,063.25
RATIONAL AG	483	600.00	289,800.00
RHEINMETALL AG	3,820	243.90	931,698.00
SAFRAN SA	24,910	148.64	3,702,622.40
SAINT-GOBAIN	36,177	56.88	2,057,747.76
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.98	6,330,689.44
SIEMENS	56,492	135.66	7,663,704.72

SIEMENS ENERGY AG	36,841	12.38	456,091.58
THALES SA	8,524	133.10	1,134,544.40
VINCI S.A.	39,327	105.02	4,130,121.54
WARTSILA OYJ	41,917	10.75	450,817.33
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.51	589,466.23
RANDSTAD NV	10,680	52.38	559,418.40
TELEPERFORMANCE	4,734	119.40	565,239.60
WOLTERS KLUWER	18,738	114.65	2,148,311.70
ADP	2,382	111.90	266,545.80
AENA SME SA	5,508	142.60	785,440.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.50	340,344.55
DHL GROUP	74,810	38.53	2,882,803.35
GETLINK	21,115	15.11	319,047.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,011	96.38	2,121,420.18
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	88.30	440,705.30
CONTINENTAL AG	8,168	66.76	545,295.68
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	89.00	652,459.00
FERRARI NV	9,370	279.70	2,620,789.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	65.89	3,947,008.67
MICHELIN	47,236	29.07	1,373,150.52
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	46.65	547,904.25
RENAULT SA	11,597	38.87	450,833.37
STELLANTIS NV	162,367	18.21	2,956,703.07
VALEO SA	16,596	16.33	271,012.68
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	108.94	1,669,832.32
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	124.70	310,004.20
ADIDAS AG	12,783	166.62	2,129,903.46
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,729.80	4,073,679.00
KERING	5,534	431.90	2,390,134.60
LVMH	20,525	716.40	14,704,110.00
MONCLER SPA	14,605	55.08	804,443.40
PUMA SE	9,220	58.80	542,136.00
SEB SA	2,282	88.65	202,299.30
ACCOR	14,436	31.94	461,085.84
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	57.28	1,838,974.40
DELIVERY HERO SE	13,414	27.17	364,458.38



FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	154.90	2,020,205.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	30.80	249,726.40
SODEXO	6,173	97.52	601,990.96
BOLLORE SE	83,646	5.09	425,758.14
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.76	1,235,491.92
SCOUT24 SE	3,716	65.66	243,992.56
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	24.73	1,627,876.98
VIVENDI SE	61,243	8.29	508,071.92
D' IETEREN GROUP	2,217	159.90	354,498.30
INDITEX	81,082	35.29	2,861,383.78
PROSUS	114,372	27.92	3,193,266.24
ZALANDO SE	17,664	21.13	373,240.32
CARREFOUR	39,746	16.28	647,263.61
HELLOFRESH SE	13,805	28.28	390,405.40
JERONIMO MARTINS	27,312	21.26	580,653.12
KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.97	340,808.51
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	28.52	2,022,068.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	52.51	3,330,289.22
DANONE (GROUPE)	47,639	52.26	2,489,614.14
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	11.16	378,080.39
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	71.40	679,156.80
HEINEKEN NV	23,160	83.46	1,932,933.60
JDE PEET'S BV	7,000	26.42	184,940.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	79.18	838,674.56
LOTUS BAKERIES	50	7,690.00	384,500.00
PERNOD-RICARD	15,339	157.85	2,421,261.15
REMY COINTREAU	1,032	115.65	119,350.80
BEIERSDORF AG	7,430	122.15	907,574.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	59.72	524,341.60
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	67.46	770,055.90
LOREAL	17,902	393.20	7,039,066.40
AMPLIFON SPA	11,650	28.12	327,598.00
BIOMERIEUX	3,044	91.82	279,500.08
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	82.82	284,072.60
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	86.42	178,889.40
ESSILORLUXOTTICA	21,384	165.16	3,531,781.44

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	40.84	693,667.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.46	992,477.94
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.96	1,362,232.95
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.00	1,035,216.00
ARGENX SE	4,177	460.60	1,923,926.20
BAYER	72,310	45.45	3,286,489.50
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	53.50	546,770.00
GRIFOLS SA	27,685	12.29	340,387.07
IPSEN	3,532	124.20	438,674.40
MERCK KGAA	9,080	158.15	1,436,002.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	37.22	116,461.38
QIAGEN N.V.	17,038	38.27	652,044.26
RECORDATI SPA	5,163	44.71	230,837.73
SANOFI	84,347	101.48	8,559,533.56
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	321.80	586,963.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	226.00	355,724.00
UCB (GROUPE)	9,389	77.54	728,023.06
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.44	372,086.40
AIB GROUP PLC	88,299	4.26	376,153.74
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.71	3,403,140.03
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.61	4,425,537.67
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.29	821,031.62
BNP PARIBAS	77,654	60.43	4,692,631.22
CAIXABANK	336,789	3.78	1,275,083.15
COMMERZBANK AG	81,889	10.79	883,582.31
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.69	1,162,804.47
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.82	832,840.32
FINECOBANK SPA	41,585	11.51	478,851.27
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.55	3,376,452.00
INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.44	2,794,036.68
KBC GROEP NV	18,057	59.14	1,067,890.98
MEDIOBANCA	53,422	12.53	669,377.66
SOCIETE GENERALE	53,019	23.04	1,221,822.85
UNICREDIT SPA	139,080	22.73	3,161,288.40
ADYEN NV	1,609	705.70	1,135,471.30
AMUNDI SA	4,626	53.35	246,797.10

DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	10.45	1,404,950.25
DEUTSCHE BOERSE	14,123	163.70	2,311,935.10
EDENRED	20,131	59.28	1,193,365.68
EURAZEO SA	3,357	56.45	189,502.65
EURONEXT NV	6,480	66.00	427,680.00
EXOR NV	7,825	83.94	656,830.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.56	600,818.40
NEXI SPA	48,458	5.78	280,474.90
SOFINA	1,238	191.80	237,448.40
WENDEL	2,023	75.05	151,826.15
WORLDLINE SA	20,332	26.65	541,847.80
AEGON	148,741	4.58	681,531.26
AGEAS	11,086	39.03	432,686.58
ALLIANZ SE-REG	29,979	225.70	6,766,260.30
ASR NEDERLAND NV	11,959	35.52	424,783.68
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	19.36	1,379,485.14
AXA SA	136,364	28.18	3,842,737.52
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	207.90	926,194.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	369.10	3,843,807.40
NN GROUP NV	16,208	30.44	493,371.52
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.96	458,876.88
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.98	1,357,749.36
TALANX AG	5,053	60.00	303,180.00
BECHTLE AG	7,659	44.24	338,834.16
CAPGEMINI SA	12,235	165.80	2,028,563.00
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	35.29	1,671,324.13
NEMETSCHEK SE	5,455	57.88	315,735.40
SAP SE	77,618	122.82	9,533,042.76
NOKIA OYJ	396,129	3.56	1,413,388.27
CELLNEX TELECOM SA	41,890	32.97	1,381,113.30
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.86	4,786,598.56
ELISA A	10,227	43.89	448,863.03
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.26	342,174.37
KPN (KON.)	216,358	3.11	674,820.60
ORANGE	153,281	10.86	1,664,631.66
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.29	252,440.64

	TELEFONICA	373,259	3.86	1,443,765.81
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.69	167,321.92
	ACCIONA SA	2,181	120.70	263,246.70
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	24.40	132,662.80
	E.ON SE	166,881	11.20	1,869,067.20
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	15.51	337,482.28
	ELIA GROUP SA/NV	987	92.65	91,445.55
	ENAGAS	21,663	15.68	339,675.84
	ENDESA	25,972	19.27	500,610.30
	ENEL	596,378	5.82	3,470,919.96
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	223,128	3.93	878,231.80
	ENGIE	146,393	14.53	2,127,090.29
	FORTUM OYJ	32,550	10.99	357,887.25
	IBERDROLA SA	444,395	10.59	4,708,365.02
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	25.76	257,857.60
	REDEIA CORP SA	30,678	14.89	456,948.81
	RWE STAMM	44,929	35.15	1,579,254.35
	SNAM SPA	147,559	4.44	656,489.99
	TERNA SPA	95,819	7.12	682,997.83
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	27.43	1,365,492.83
	VERBUND AG	6,430	77.05	495,431.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	397.50	1,351,500.00
	ASML HOLDING NV	29,993	559.10	16,769,086.30
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	93.00	591,201.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	31.35	3,043,629.85
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	40.98	2,060,971.71
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	65.34	344,668.50
	VONOVIA SE	52,580	22.81	1,199,349.80
	ユーロ 小計	13,592,223		337,897,007.86 (53,478,959,434)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	5.31	6,989,296.95
	SHELL PLC-NEW	499,932	26.06	13,028,227.92
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	22.65	2,114,323.18
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.29	426,642.24
	CRH PLC	55,581	45.42	2,524,489.02
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	49.15	536,914.60

ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	15.86	279,199.44
GLENCORE PLC	793,369	4.69	3,728,040.93
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	16.28	274,285.44
MONDI PLC	41,710	13.72	572,469.75
RIO TINTO PLC REG	83,678	51.74	4,329,499.72
ASHTED GROUP PLC	33,317	50.02	1,666,516.34
BAE SYSTEMS PLC	219,532	9.97	2,190,490.29
BUNZL PLC	22,799	29.26	667,098.74
DCC PLC	6,622	46.09	305,207.98
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.69	474,436.27
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.20	1,404,722.98
SMITHS GROUP PLC	26,476	16.19	428,778.82
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	95.26	525,263.64
EXPERIAN PLC	67,859	26.91	1,826,085.69
INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.12	571,156.80
RELX PLC	141,442	27.75	3,925,015.50
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	6.10	1,109,551.06
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.41	322,894.02
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	41.07	285,518.64
BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.08	568,274.96
PERSIMMON PLC	25,686	10.77	276,766.65
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.17	309,793.99
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.00	2,594,020.00
ENTAIN PLC	49,630	9.32	462,948.64
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	60.74	690,188.62
PEARSON	55,305	8.68	480,268.62
WHITBREAD PLC	17,434	34.64	603,913.76
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.17	447,525.31
INFORMA PLC	110,598	7.50	829,927.39
WPP PLC	85,821	7.33	629,067.93
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.49	309,617.02
KINGFISHER PLC	153,717	2.23	343,250.06
NEXT PLC	7,832	72.96	571,422.72
OCADO GROUP PLC	54,753	6.00	328,737.01
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.52	374,990.88
TESCO PLC	525,585	2.64	1,388,595.57

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	20.68	532,303.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.77	4,068,773.76
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.49	403,920.40
DIAGEO	167,595	30.34	5,084,832.30
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	16.67	1,141,528.26
HALEON PLC	452,525	3.40	1,542,431.46
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	57.94	3,064,156.90
UNILEVER PLC	187,760	40.62	7,626,811.20
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.23	701,726.85
ASTRAZENECA	115,201	111.02	12,789,615.02
GSK PLC	304,379	14.92	4,541,334.68
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	20.88	138,225.60
BARCLAYS	1,129,529	1.58	1,795,273.39
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	6.44	9,576,952.02
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.44	2,142,394.80
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.35	1,004,657.10
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.58	1,441,405.22
3I GROUP PLC	74,757	20.73	1,549,712.61
ABRDN PLC	153,430	1.55	238,967.22
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.73	255,766.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	82.34	2,457,766.66
M&G PLC	131,539	1.97	259,526.44
SCHRODERS PLC	39,932	4.07	162,603.10
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	8.32	340,652.74
WISE PLC - A	49,048	6.85	336,273.08
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.77	386,381.35
AVIVA PLC	193,334	3.89	753,615.93
LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.22	909,766.90
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.82	245,926.82
PRUDENTIAL	212,226	8.88	1,886,264.68
SAGE GROUP PLC	76,660	9.89	758,167.40
HALMA PLC	31,069	19.38	602,272.56
BT GROUP PLC	464,863	1.16	542,495.12
VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.76	1,202,117.77
CENTRICA PLC	453,631	1.54	700,633.07
NATIONAL GRID PLC	260,089	9.80	2,548,872.20

	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.65	413,118.20
	SSE PLC	81,692	16.10	1,315,241.20
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.48	479,599.56
	イギリスポンド 小計	20,563,714		137,657,518.68 (25,141,769,211)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.50	252,271.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	623.00	357,602.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,994.00	2,029,932.00
	HOLCIM LTD	38,804	58.78	2,280,899.12
	SIG GROUP AG	26,203	22.64	593,235.92
	SIKA AG-BR	10,856	233.10	2,530,533.60
	ABB LTD	116,833	32.80	3,832,122.40
	GEBERIT AG-REG	2,530	459.00	1,161,270.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	176.80	362,086.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	183.00	565,836.00
	VAT GROUP AG	1,956	329.00	643,524.00
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	37.76	560,962.56
	SGS SA	10,147	77.02	781,521.94
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	261.00	986,841.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	112.00	4,339,776.00
	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	235.40	584,498.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.85	176,619.30
	DUFREY AG-REG	7,820	34.91	272,996.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,458.00	408,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	100,400.00	803,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,190.00	835,580.00
	NESTLE SA - REGISTERED	199,766	103.74	20,723,724.84
	ALCON INC	38,399	70.94	2,724,025.06
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	217.70	846,199.90
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	117.20	1,000,888.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	68.00	125,800.00
LONZA GROUP AG-REG	5,536	425.60	2,356,121.60	
NOVARTIS	152,294	93.87	14,295,837.78	
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	269.40	596,721.00	
ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	250.45	13,078,999.90	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.05	238,876.35	

	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	58.86	899,910.54
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	1,034.50	1,628,303.00
	UBS GROUP AG	249,657	22.69	5,664,717.33
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	132.90	316,169.10
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	128.40	379,422.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	571.60	1,211,220.40
	SWISS RE LTD	22,063	94.32	2,080,982.16
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	420.10	4,698,398.40
	TEMENOS AG - REG	5,150	64.42	331,763.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	63.28	677,222.56
	SWISSCOM	1,856	544.20	1,010,035.20
	BKW AG	1,744	161.50	281,656.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	83.95	476,752.05
	スイスフラン 小計	1,102,662		100,003,293.81 (16,351,538,570)
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	314.45	6,997,141.40
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	425.80	2,292,081.40
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	149.95	5,366,710.50
	ALFA LAVAL AB	18,955	375.80	7,123,289.00
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	238.20	18,097,721.40
	ATLAS COPCO A	207,097	147.25	30,495,033.25
	ATLAS COPCO B	108,178	128.20	13,868,419.60
	BEIJER REF AB	26,868	115.50	3,103,254.00
	EPIROC AB-A	53,479	208.00	11,123,632.00
	EPIROC AB-B	28,804	175.20	5,046,460.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	83.74	3,241,742.88
	INDUTRADE AB	22,644	202.70	4,589,938.80
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	192.75	2,698,885.50
	LIFCO AB-B SHS	17,970	191.95	3,449,341.50
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	71.80	8,820,486.40
	SAAB AB-B	6,388	556.80	3,556,838.40
	SANDVIK AB	75,334	201.60	15,187,334.40
	SKANSKA B	25,507	180.00	4,591,260.00
	SKF AB-B	21,050	182.15	3,834,257.50
	VOLVO AB-A SHS	13,514	227.40	3,073,083.60
	VOLVO B	114,238	225.60	25,772,092.80



	SECURITAS B	28,375	86.66	2,458,977.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	44.44	2,214,845.16	
	EVOLUTION AB	13,186	1,106.40	14,588,990.40	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	155.46	6,428,426.46	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	235.90	11,670,916.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	192.70	3,429,289.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	223.40	3,202,439.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	120.12	28,424,716.32	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	130.65	14,371,630.65	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	97.56	11,779,004.16	
	SWEDBANK AB-A	58,652	201.30	11,806,647.60	
	EQT AB	31,471	216.90	6,826,059.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	288.80	3,413,038.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	288.60	3,223,084.80	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	209.80	26,967,272.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	457.00	3,326,960.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	53.33	11,449,364.37	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	93.38	13,902,227.64	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	83.68	3,913,044.16	
	TELIA CO AB	123,760	22.57	2,793,263.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	49.30	2,795,310.00	
	SAGAX AB-B	17,402	208.50	3,628,317.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,593,837		374,942,830.05 (5,136,716,771)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	296.00	5,359,080.00	
	EQUINOR ASA	66,436	351.15	23,329,001.40	
	NORSK HYDRO	100,517	67.20	6,754,742.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	405.30	5,065,439.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	441.20	3,814,174.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	105.90	2,024,490.30	
	MOWI ASA	31,968	189.55	6,059,534.40	
	ORKLA	77,073	79.98	6,164,298.54	
	SALMAR ASA	5,423	543.40	2,946,858.20	
	DNB BANK ASA	71,795	215.60	15,479,002.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	157.50	2,925,405.00	
	TELENOR ASA	51,193	121.50	6,219,949.50	

	ノルウェークローネ 小計	481,344		86,141,975.14 (1,204,264,812)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	432.40	3,668,049.20
	NOVOZYMES A/S	17,111	284.70	4,871,501.70
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,712.50	1,292,937.50
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	151.56	11,030,233.68
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,530.00	2,744,070.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,735.00	3,896,910.00
	DSV A/S	14,203	1,319.00	18,733,757.00
	PANDORA A/S	7,957	731.60	5,821,341.20
	CARLSBERG AS-B	6,810	891.40	6,070,434.00
	COLOPLAST-B	9,208	747.60	6,883,900.80
	DEMANT A/S	8,512	292.60	2,490,611.20
	GENMAB A/S	4,628	2,508.00	11,607,024.00
	NOVO NORDISK A/S-B	246,100	643.90	158,463,790.00
	DANSKE BANK A/S	58,346	164.35	9,589,165.10
	TRYG A/S	29,772	129.35	3,851,008.20
ORSTED A/S	12,910	385.10	4,971,641.00	
	デンマーククローネ 小計	498,098		255,986,374.58 (5,432,030,868)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.80	697,260.20
	SANTOS	218,974	7.90	1,729,894.60
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	36.49	5,150,016.15
	BHP GROUP LTD	377,956	44.25	16,724,553.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.44	675,928.80
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.92	2,562,804.60
	IGO LTD	56,345	12.66	713,327.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	40.79	1,543,983.08
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	67.63	974,480.67
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	24.52	1,494,886.32
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	10.46	770,713.72
	ORICA LTD	38,288	15.59	596,909.92
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.30	900,785.50
	RIO TINTO LTD	28,272	113.55	3,210,285.60
	SOUTH32 LTD	346,773	3.39	1,175,560.47
REECE LTD	16,814	18.63	313,244.82	

BRAMBLES LTD	108,007	14.32	1,546,660.24	
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.96	1,152,000.96	
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.49	417,372.59	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.18	440,300.00	
TRANSURBAN GROUP	224,973	12.69	2,854,907.37	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	40.85	1,887,678.50	
IDP EDUCATION LTD	17,793	21.38	380,414.34	
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.72	859,101.36	
REA GROUP LTD	3,586	154.32	553,391.52	
SEEK LTD	28,001	22.07	617,982.07	
WESFARMERS LTD	84,329	52.86	4,457,630.94	
COLES GROUP LTD	108,486	15.56	1,688,042.16	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.27	579,178.27	
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.32	3,436,089.72	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.33	788,626.80	
COCHLEAR LIMITED	4,783	255.32	1,221,195.56	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	51.87	627,990.09	
SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	29.80	811,752.00	
CSL LIMITED	35,855	250.80	8,992,434.00	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	25.66	5,686,486.94	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.97	12,546,334.97	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	29.07	6,781,972.86	
WESTPAC BANKING	255,840	21.15	5,411,016.00	
ASX LTD	14,549	57.12	831,038.88	
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	167.73	4,546,321.65	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.59	450,133.08	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.68	946,640.16	
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.44	798,709.52	
QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.71	1,635,143.93	
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.97	1,325,250.08	
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	65.05	897,755.05	
XERO LTD	11,340	112.43	1,274,956.20	
TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.85	1,187,597.95	
ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.78	961,243.18	
オーストラリアドル 小計	5,129,732		117,827,984.09 (11,351,547,987)	

ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.91	652,266.51
	EBOS GROUP LTD	14,283	34.20	488,478.60
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.58	862,768.40
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	4.81	467,565.67
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.10	394,139.30
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.14	568,196.16
ニュージーランドドル 小計		409,088		3,433,414.64 (308,217,632)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.90	7,353,282.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	76.00	8,132,000.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	10.14	932,880.00
	MTR CORP	125,000	31.00	3,875,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.16	1,579,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	47.15	8,204,100.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	24.00	4,752,000.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	15.46	2,255,614.00
	WH GROUP LTD	658,301	4.11	2,705,617.11
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	21.45	6,038,175.00
	HANG SENG BANK	59,400	97.45	5,788,530.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	292.60	25,836,580.00
	AIA GROUP LTD	865,600	63.85	55,268,560.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	37.05	1,389,375.00
	CLP HOLDINGS	102,000	57.95	5,910,900.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.46	4,939,427.22
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	37.90	4,244,800.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	41.25	5,032,335.00
	ESR GROUP LTD	157,000	11.00	1,727,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.72	1,854,560.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	20.65	2,585,958.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	15.24	2,078,355.00
	SINO LAND CO	315,400	8.83	2,784,982.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	83.80	8,799,000.00
SWIRE PACIFIC A	44,500	52.85	2,351,825.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	16.34	1,571,908.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	30.25	3,720,750.00	
香港ドル 小計		5,644,353		181,712,713.93

				(3,476,164,217)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	31.93	255,440.00
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.80	767,040.00
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.13	288,473.99
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.91	576,334.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.46	699,824.72
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.84	247,416.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.73	666,178.00
	DBS GROUP	141,600	33.64	4,763,424.00
	OCBC BANK	257,100	12.81	3,293,451.00
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	28.50	2,679,000.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.75	643,500.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.42	1,344,656.06
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.09	428,069.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.10	394,320.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.61	282,908.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.42	304,950.00
シンガポールドル 小計		4,416,666		17,634,984.77 (1,931,559,881)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	21.45	1,274,709.15
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	762.70	1,636,754.20
	BANK HAPOALIM BM	98,310	34.63	3,404,475.30
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	32.29	3,633,012.48
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.35	2,124,325.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	139.50	1,744,168.50
	NICE LTD	4,991	657.20	3,280,085.20
	AZRIELI GROUP	1,537	201.20	309,244.40
イスラエルシェケル 小計		390,926		17,406,774.23 (683,203,703)
合 計		83,505,271		561,335,259,536 (561,335,259,536)

(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
新株予約権 証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	—	
	カナダドル 小計		1,490.00	—	

				(-)
新株予約権証券合計				-
				(-)
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	691,307.00
		LENDLEASE GROUP	64,786	465,163.48
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,156,470.48
				(111,414,366)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,576,700.00
香港ドル 小計		315,000	2,576,700.00	(49,292,271)
投資信託受益証券合計			463,076	160,706,637
				(160,706,637)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,251,550.30
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	841,374.06
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	5,696,712.45
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	703,531.62
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,731,654.42
		BOSTON PROPERTIES	11,259	669,685.32
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	732,900.42
		CROWN CASTLE INC	32,235	2,966,587.05
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,585,713.32
		EQUINIX INC	6,951	5,048,233.26
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	897,673.90
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,519,708.35
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,103,928.45
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	1,907,954.94
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	824,227.25
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	464,208.00
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	831,065.40
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	912,342.11
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,426,303.52
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,386,730.70
KIMCO REALTY CORP	47,897	842,508.23		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,182,936.75		
PROLOGIS INC	68,641	7,702,206.61		

	PUBLIC STORAGE	11,847	3,121,921.44	
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,452,004.06	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	743,653.84	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,514,686.39	
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,532,115.17	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	996,777.82	
	UDR INC	23,815	849,481.05	
	VENTAS INC	31,565	1,329,833.45	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,172,111.30	
	WELLTOWER INC	36,855	3,019,161.60	
	WP CAREY INC	16,024	866,577.92	
	アメリカドル 小計	900,424	62,828,060.47 (9,411,015,177)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	220,305.96	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	279,904.30	
	カナダドル 小計	20,377	500,210.26 (55,198,202)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	208,900.20	
	GECINA SA	3,139	303,698.25	
	KLEPIERRE	17,225	400,136.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	488,771.25	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	302,704.16	
	ユーロ 小計	48,695	1,704,210.61 (269,725,413)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	331,992.52	
	SEGRO PLC	78,133	562,088.80	
	イギリスポンド 小計	134,422	894,081.32 (163,295,012)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	686,857.00	
	GOODMAN GROUP	135,303	2,902,249.35	
	GPT GROUP	167,884	654,747.60	
	MIRVAC GROUP	266,683	568,034.79	
	SCENTRE GROUP	381,283	937,956.18	
	STOCKLAND	207,412	813,055.04	
	VICINITY CENTERS	305,149	517,227.55	
	オーストラリアドル 小計	1,557,804	7,080,127.51	

				(682,099,484)
	香港ドル	LINK REIT	166,900	6,408,960.00
	香港ドル 小計		166,900	6,408,960.00 (122,603,404)
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	781,379.50
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	626,278.65
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	475,757.52
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	314,600.00
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,198,015.67 (240,748,656)
投資証券合計			3,954,478	10,944,685,348 (10,944,685,348)
合計				11,105,391,985 (11,105,391,985)

有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 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 606 銘柄	97.8%	—	—	—	72.9%
	投資証券 34 銘柄	—	—	—	2.2%	1.6%
カナダド ル	株式 86 銘柄	99.7%	—	—	—	3.4%
	新株予約権 1 銘柄 証券	—	—	—	—	—
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 222 銘柄	99.5%	—	—	—	9.3%
	投資証券 5 銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリス ポンド	株式 81 銘柄	99.4%	—	—	—	4.4%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.6%	0.0%
スイスフ ラン	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	—	2.9%
スウェー デンクロ ーナ	株式 43 銘柄	100.0%	—	—	—	0.9%
ノルウェ ークロー	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%



ネ						
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	93.5%	—	—	—	2.0%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	—	0.9%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	—	5.6%	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	95.3%	—	—	—	0.6%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	—	3.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	88.9%	—	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	—	11.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8 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。

## 2【ファンドの現況】

### 【DC外国株式インデックス・オープン】

#### 【純資産額計算書】

(2023年10月31日現在)

I 資産総額	63,324,372,256円
II 負債総額	72,375,124円
III 純資産総額 (I - II)	63,251,997,132円
IV 発行済口数	12,287,116,472口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	5.1478円
(1万口当たり純資産額)	(51,478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10月31日現在)

I 資産総額	578,338,998,456円
II 負債総額	689,723,638円
III 純資産総額 (I - II)	577,649,274,818円
IV 発行済口数	116,065,093,516口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.9769円
(1万口当たり純資産額)	(49,769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10月31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 2023 年 12 月 28 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 10 月 31 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	523	14,081,139
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	66	208,014
単位型公社債投資信託	51	169,813
合計	640	14,458,966

### 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。

なお、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、当事業年度（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。

## 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記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おります。

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おりません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	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

#### 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

2023年12月28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  
DC 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 18 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、確定拠出年金法（平成 13 年法律第 88 号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

外国株式インデックス マザーファンドの受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）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、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運用の効率化をはかるため、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有価証券等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、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効率的な運用ならびに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（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効率的な運用に資するため、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マザーファンド受益証券以外の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および売買益(評価益を含みます。)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、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

##### (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  
DC 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2条 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3条 委託者は、当初設定日に金100,000円を信託し、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4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第50条第1項、同条第2項、第51条第1項、第52条第1項および第54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5条 委託者は、第3条第1項による受益権については100,000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8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6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。

②受益権の取得申込みの勧誘は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条第1項に規定される契約に基づいて受益権の取得申込みを企図する者および同法第55条に規定される規約に基づいて受益権の取得申込みを企図する同法第2条第5項に定める連合会（同法第61条に基づき連合会が事務を委託した者を含みます。）に対してのみ行うものとします。

**(受益者)**

第7条 この投資信託契約締結当初の受益者は委託者のみとします。なお委託者は確定拠出年金法第86条に規定される税制上の措置の対象外となります。

②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5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。

③受益権取得申込者は、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。)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。)を締結するものとします。

#### (追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じて得た金額とします。

②この投資信託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 28 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 9 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 10 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、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 5 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まず。)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 11 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 12 条 指定販売会社は、第 5 条第 1 項の規定により分割された受益権を、その取得申込者に対しては、1 口の整数倍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。なお、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け付けられないものとします。

- ②第 1 項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- 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、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第 3 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 39 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- 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 12 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13条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**(受益証券を毀損した場合等の再交付)**

第14条 (削除)

**(受益証券の再交付の費用)**

第15条 (削除)

**(投資の対象とする資産の種類)**

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

**(運用の指図範囲等)**

第17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. 投資証券もしくは投資法人債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、および第 14 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 13 号および第 14 号の証券(「投資法人債券」を除きます。)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

- 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 18 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 19 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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ②前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

- 第 20 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 21 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22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、

- 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、

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券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券の新株予約権(前号に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### (先物取引等の運用指図、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効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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。)ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等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、(以下同じ。)

- ②委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、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委託者が適当と認める外国の取引所等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24条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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(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4条に定める信託期間を超えないものとし、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ます。

#### (為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 25 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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、当該取引の決済日が原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約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、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 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26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27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28条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ③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の買予約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の買予約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。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約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の売予約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。
- ④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。



#### (保管業務の委任)

第 29 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。保管費用は、受益者の負担とし、投資信託財産中より支弁します。

#### (有価証券等の保管)

第 30 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 31 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 32 条 (削除)

#### (投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 33 条 信託の登記または登録をすることができる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 34 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 35 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 36 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって

有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、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%を超えないこととします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第37条 委託者の指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38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39条 この信託の計算期間は、毎年10月1日から翌年9月30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4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40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41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39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 42 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 39 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 25 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 43 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. 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（以下「配当等収益」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 44 条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における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 46 条第 1 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 46 条第 2 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 45 条 収益分配金は、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、指定販売会社に交付します。

②指定販売会社は、別に定める契約に基づき、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けを行います。当該売付により増加した受益権は、第 10 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収益分配金に係る収益調整金は、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ます。

#### (償還金および一部解約金の支払い)

第 46 条 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、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て）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関

等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。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。

- ②一部解約金は、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。
- ③前各項に規定する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、
- ④償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、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、
- ⑤第 45 条第 3 項および前項に規定する「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との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、

#### (受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

##### 第 47 条 (削除)

#### (償還金の時効)

第 48 条 受益者が、信託終了による償還金について第 46 条第 1 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 49 条 委託者は、自己に帰属するすべての受益権につき、最初に追加信託が行われた日以降、この投資信託契約の円滑な運営に支障がないと判断し次第、すみやかに一部解約します。

- ②受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。なお、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けないものとします。
- ③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 日前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。
- ④委託者は、第 2 項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項および第 2 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。

- ⑤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とします。
- ⑥委託者は、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、第2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。
- ⑦前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行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5項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第49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け付け、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がって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第50条 委託者は、第4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、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。
- ③委託者は、前2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。
- ④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。
- ⑤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項および第2項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑥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。
- ⑦第4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4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51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55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 52 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 55 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 53 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 54 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 55 条の規定に従い、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 55 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 56 条 第 50 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 50 条第 4 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す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 56 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 57 条 委託者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。

**(投資信託約款に関する疑義の取扱い)**

第 58 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、委託者と受託者との協議により定めま

す。

**(付則)**

第 1 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の投資信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 15 条、第 47 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 13 年 10 月 1 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