

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月19日提出
【計算期間】	第30特定期間(自 2019年5月21日至 2019年11月19日)
【ファンド名】	グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
【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
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<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公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、日本の株式にも投資し分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

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
<u>追加型</u>	海外	債券	MRF	特殊型
	<u>内外</u>	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		<u>資産複合</u>		

(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 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル (日本を 含む)	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 T O P I X その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、短期 金融資産)資産 配分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://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

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

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。

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。

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

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。

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。

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。

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。

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 から 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 から 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。

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。

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。

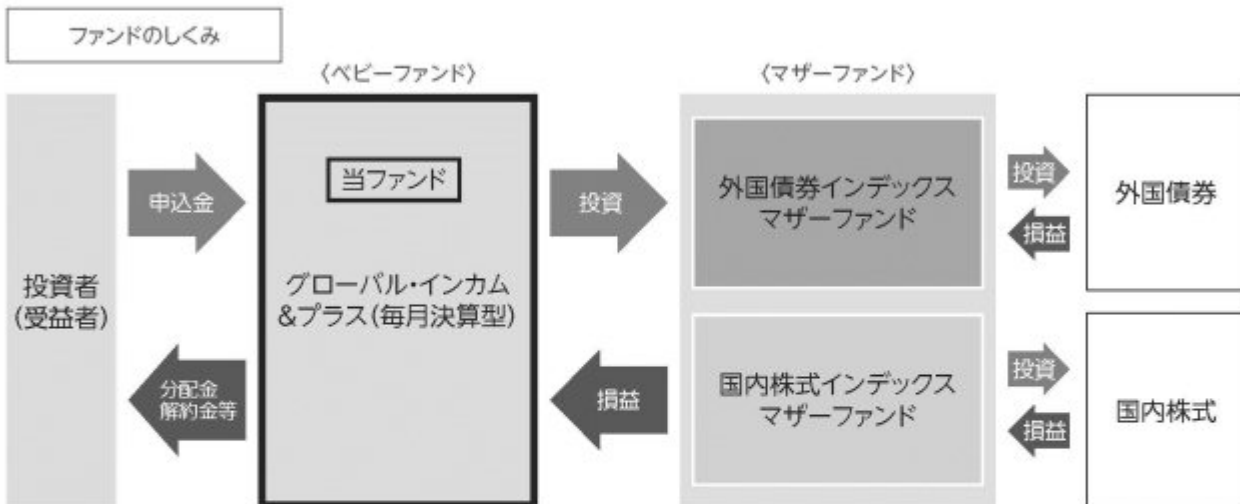
[特殊型]

- (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。

< ファンドの特色 >

1. 日本を除く世界の主要国の公社債および日本の株式に分散投資し、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。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
外国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース） 1

国内株式	TOPIX（東証株価指数） 2
------	-----------------

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

※1 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

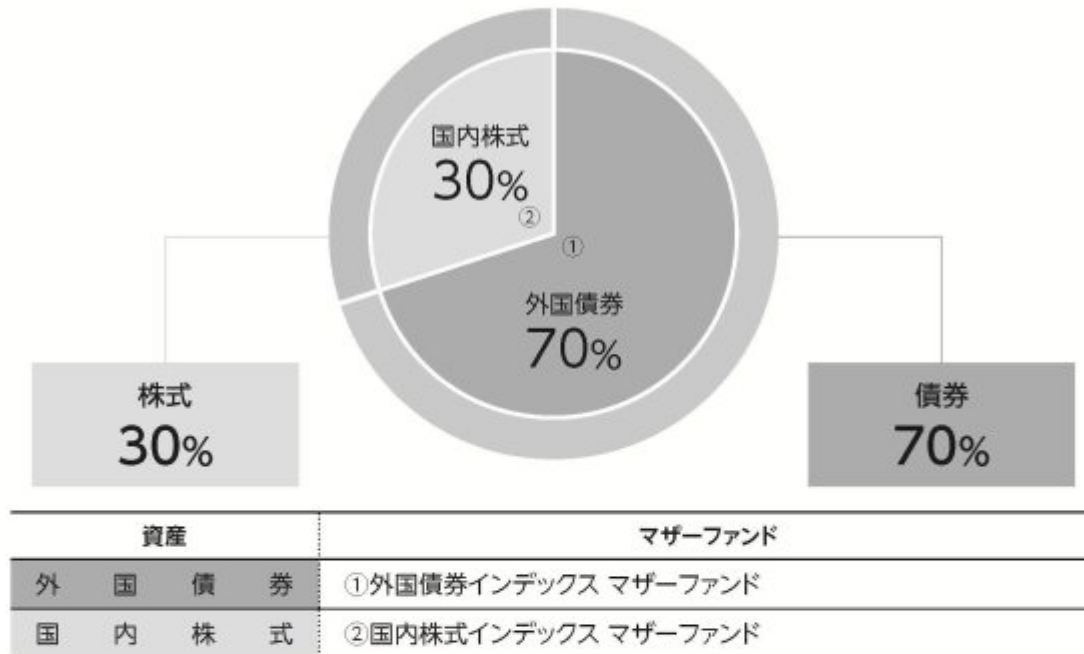
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※2 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3. 債券70%、株式30%を基本資産配分比率として運用します。

基本資産配分比率



- 資産配分比率が、時価の変動等によって基本資産配分比率から変化した場合（最大で±5%程度）、一定のルールに基づいて基本資産配分比率に戻します。
- 外国債券には3%程度の円短期金融資産を含みます。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本資産配分比率に基づき、各マザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

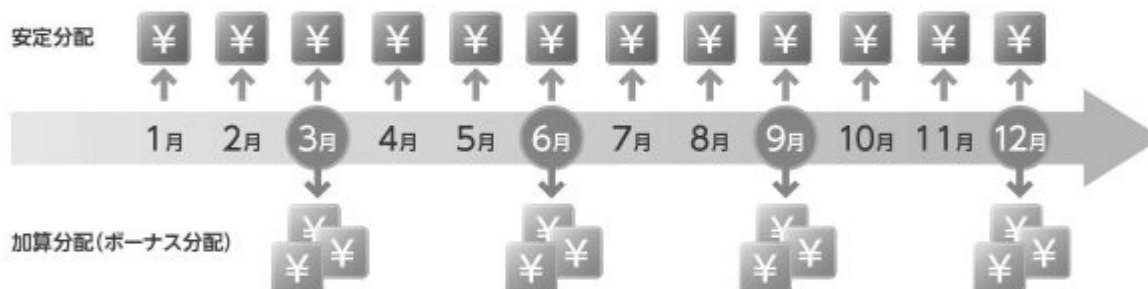
4.

原則として、毎決算時(年12回)に収益の分配を目指します。また、年4回(3月、6月、9月、12月)の決算時には、加算分配(以下「ボーナス分配」ということがあります。)を目指します。

分配方針

- 原則として、毎月19日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、毎決算時に安定した分配を行うことを目指します。
- 年4回(3月、6月、9月、12月)の決算時には、売買益を配当等収益に加算して分配することを目指します。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。

収益分配のイメージ



※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

- 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。
- 売買益が確保できた場合でも、基準価額水準、市況動向等を勘案して、ボーナス分配を行わないことがあります。

主な投資制限

- 株式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35%以下とします。
- 外貨建資産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75%以下とします。

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。

【収益分配金に関する留意事項】

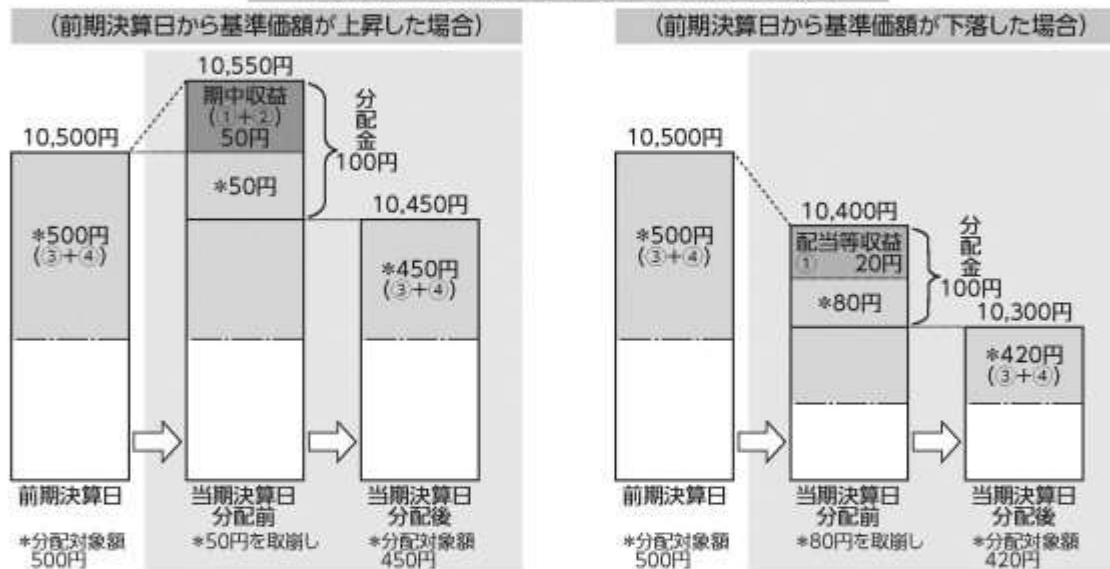
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 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。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



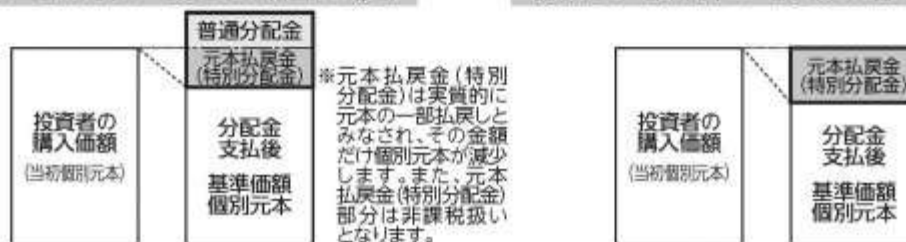
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

- 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率が小さかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)

(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、後掲「4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2004年12月1日

本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

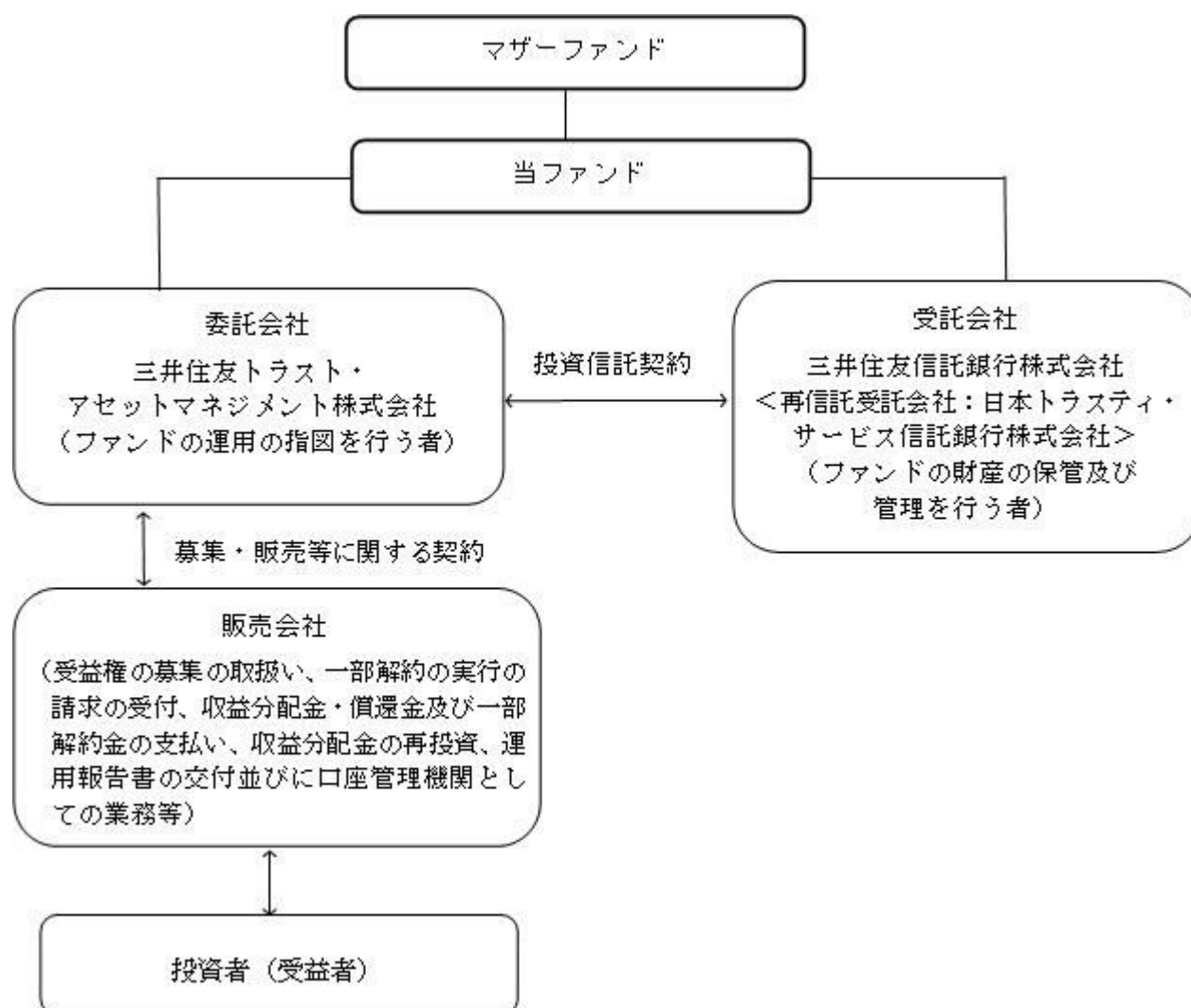
2012年4月1日

本ファンドの名称を「住信 グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)」から「グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)」に変更

本ファンドの主要投資対象である「住信 外国債券インデックス マザーファンド」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」および「国内株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況(2019年12月30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

八．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

本ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、日本の株式にも投資し分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中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

投資対象

外国債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンド（以下総称して、またはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して、またはそれぞれを「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。

投資態度

- 1)主として、外国債券インデックス マザーファンドの受益証券および国内株式インデックス マザーファンドの受益証券への投資を通して、外国債券と国内株式への分散投資を行います。
- 2)基本資産配分比率は、外国債券70%（円短期金融資産3%程度を含みます。）、国内株式30%とし、各資産ごとの許容乖離幅は±5%とします。
- 3)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 4)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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引および通貨に係る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（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。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- 5)ただし、資金動向、市況動向、投資信託財産の規模等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（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26条、第27条および第28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、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債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（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. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

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. 預託証券（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券

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。

（八）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（八）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

「外国債券インデックス 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公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、そ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。

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、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券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。

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。

有価証券等の価格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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、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、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

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。

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、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。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と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

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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。

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。

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。

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。

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、国内外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を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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。

前各号の規定にかかわらず、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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

・ 分配対象額についての分配方針

原則として、外国債券インデックス マザーファンドからのみなし配当等収益を原資とし

て、毎決算期に安定した分配を行うことを目指します。また3月、6月、9月、12月の決算時には国内株式インデックス マザーファンドからのみなし売買益を外国債券インデックス マザーファンドからの配当等収益に加算して分配することを目指します。ただし、国内株式インデックス マザーファンドからのみなし売買益が確保できた場合でも、外国債券インデックス マザーファンドの基準価額が下落した場合には、加算分配を行わないことがあります。委託者はこのほか、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

・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>

株式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35%以下とします。

（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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」）

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」）

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」）

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」）

投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）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」）

外貨建資産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75%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、わが国の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。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22条）

委託者は、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、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るものとします。信用取引の指図は、当該売付に係る建玉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売付に係る建玉の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額の合計額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第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号八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を指図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オプション取引を行うことを指図することができます。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金利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これらの取引と類似の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26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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図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係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27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および為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引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。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利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金利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、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」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係るヘッジ対象金利商品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を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係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、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産(以下「ヘッジ対象外貨建資産」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係るヘッジ対象外貨建資産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を超えないものとします。(投資信託約款第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、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29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。

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債(投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。(投資信託約款第30条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第31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。この指図は、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につき円換算した額が、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33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。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40条）

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」）

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 から 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 から 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 、 、 および 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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

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。

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。

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等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。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

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。

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。

カンントリーリスク

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>

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。

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。

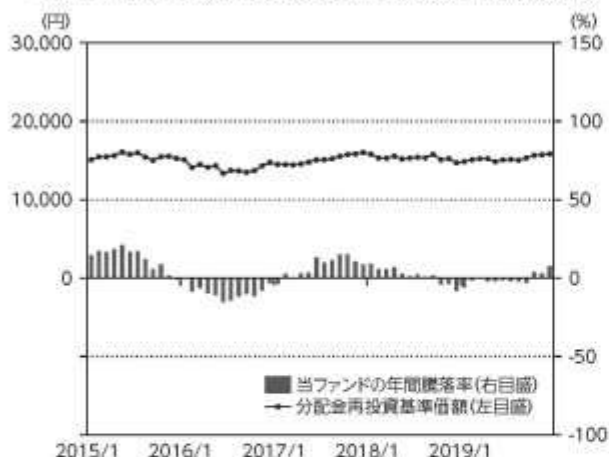
(2)リスクの管理体制

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視部が、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〕

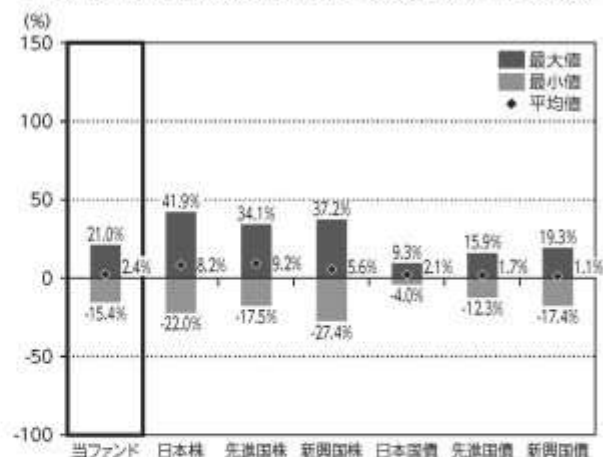
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2015年1月～2019年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式を総額を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「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。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
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 Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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、野村證券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野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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および完全性を保証せず、またデータの誤差、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index Emerging Markets インデックス(除く日本、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されていますが、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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜 2.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対

価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、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せん。

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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 1.32%（税抜 1.2%）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 0.583% （税抜 0.53%）	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 0.66% （税抜 0.6%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% （税抜 0.07%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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。

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】

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。）。

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。

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。）。

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。

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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま
す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りで
す。

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所

得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2019年12月30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。

5【運用状況】

以下は、2019年12月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）】

(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	2,882,845,589	98.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		32,417,020	1.11
合計(純資産総額)		2,915,262,609	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】

【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	外国債券インデックス マザーファンド	691,493,186	2.8463	1,968,197,056	2.8569	1,975,526,883	67.76
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	565,519,014	1.6157	913,709,071	1.6044	907,318,706	31.12

(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	98.89
合計	98.89

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		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11特定期間末	(2010年 5月19日)	18,917,284,466	18,945,437,343	6,719	6,729
第12特定期間末	(2010年11月19日)	14,727,139,464	14,749,825,713	6,492	6,502
第13特定期間末	(2011年 5月19日)	11,752,276,627	11,770,784,289	6,350	6,360
第14特定期間末	(2011年11月21日)	8,893,416,845	8,908,744,163	5,802	5,812
第15特定期間末	(2012年 5月21日)	7,706,373,531	7,719,351,627	5,938	5,948
第16特定期間末	(2012年11月19日)	7,027,296,398	7,038,630,742	6,200	6,210
第17特定期間末	(2013年 5月20日)	8,355,696,022	8,365,533,163	8,494	8,504
第18特定期間末	(2013年11月19日)	7,086,429,852	7,095,014,692	8,255	8,265
第19特定期間末	(2014年 5月19日)	6,225,643,060	6,233,124,547	8,321	8,331
第20特定期間末	(2014年11月19日)	6,141,678,470	6,148,136,758	9,510	9,520
第21特定期間末	(2015年 5月19日)	5,510,603,193	5,516,194,852	9,855	9,865
第22特定期間末	(2015年11月19日)	4,914,724,750	4,919,765,815	9,749	9,759
第23特定期間末	(2016年 5月19日)	4,141,974,161	4,146,719,038	8,729	8,739
第24特定期間末	(2016年11月21日)	3,774,731,381	3,779,110,340	8,620	8,630
第25特定期間末	(2017年 5月19日)	3,631,064,374	3,635,099,419	8,999	9,009
第26特定期間末	(2017年11月20日)	3,542,257,330	3,545,979,493	9,517	9,527
第27特定期間末	(2018年 5月21日)	3,521,297,931	3,525,050,764	9,383	9,393
第28特定期間末	(2018年11月19日)	3,128,759,601	3,132,233,675	9,006	9,016
第29特定期間末	(2019年 5月20日)	2,950,960,395	2,954,274,243	8,905	8,915
第30特定期間末	(2019年11月19日)	2,913,847,466	2,917,008,272	9,219	9,229
	2018年12月末日	3,034,709,800		8,777	
	2019年 1月末日	3,055,500,166		8,859	
	2月末日	3,065,685,981		8,995	
	3月末日	3,066,298,453		9,058	
	4月末日	3,006,762,160		9,066	
	5月末日	2,908,328,904		8,817	
	6月末日	2,938,451,037		8,946	
	7月末日	2,917,931,290		8,969	
	8月末日	2,853,634,055		8,899	
	9月末日	2,893,002,106		9,063	
	10月末日	2,933,541,662		9,245	
	11月末日	2,927,947,075		9,280	
	12月末日	2,915,262,609		9,331	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第11特定期間	2009年11月20日～2010年 5月19日	75
第12特定期間	2010年 5月20日～2010年11月19日	60

第13特定期間	2010年11月20日～2011年 5月19日	60
第14特定期間	2011年 5月20日～2011年11月21日	60
第15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	60
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	60
第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	60
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	60
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	60
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	60
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	60
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	60
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	60
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	60
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	60
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	60
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	60
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	60
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	60
第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	60

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第11特定期間	2009年11月20日～2010年 5月19日	2.3
第12特定期間	2010年 5月20日～2010年11月19日	2.5
第13特定期間	2010年11月20日～2011年 5月19日	1.3
第14特定期間	2011年 5月20日～2011年11月21日	7.7
第15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	3.4
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	5.4
第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	38.0
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	2.1
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	1.5
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	15.0
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	4.3
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	0.5
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	9.8
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	0.6
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	5.1
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	6.4
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	0.8
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	3.4
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	0.5

第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	4.2
---------	-------------------------	-----

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(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11特定期間	2009年11月20日～2010年 5月19日	65,952,926	9,889,678,417	28,152,877,135
第12特定期間	2010年 5月20日～2010年11月19日	64,112,475	5,530,740,099	22,686,249,511
第13特定期間	2010年11月20日～2011年 5月19日	30,814,885	4,209,401,837	18,507,662,559
第14特定期間	2011年 5月20日～2011年11月21日	32,114,595	3,212,458,498	15,327,318,656
第15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	24,470,201	2,373,692,339	12,978,096,518
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	21,751,501	1,665,503,835	11,334,344,184
第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	30,551,318	1,527,753,571	9,837,141,931
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	18,582,737	1,270,884,312	8,584,840,356
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	19,874,914	1,123,227,709	7,481,487,561
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	16,229,854	1,039,428,546	6,458,288,869
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	26,204,502	892,833,400	5,591,659,971
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	14,940,340	565,534,341	5,041,065,970
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	11,974,884	308,163,096	4,744,877,758
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	10,418,827	376,336,749	4,378,959,836
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	8,607,056	352,521,557	4,035,045,335
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	10,872,907	323,754,271	3,722,163,971
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	246,694,847	216,025,727	3,752,833,091
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	8,083,059	286,841,845	3,474,074,305
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	8,367,199	168,593,378	3,313,848,126
第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	8,156,132	161,198,091	3,160,806,167

(注)当該特定期間中において、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)

外国債券インデックス 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(%)
国債証券	アメリカ	186,820,306,659	47.48
	フランス	38,520,629,612	9.79
	イタリア	34,823,469,268	8.85
	イギリス	25,218,587,197	6.41

ドイツ	24,746,767,064	6.29
スペイン	22,015,724,693	5.60
ベルギー	9,259,642,038	2.35
オーストラリア	7,683,283,981	1.95
カナダ	7,476,981,948	1.90
オランダ	7,278,283,134	1.85
オーストリア	5,428,747,621	1.38
メキシコ	3,446,597,590	0.88
アイルランド	2,752,641,484	0.70
南アフリカ	2,401,697,413	0.61
ポーランド	2,306,779,277	0.59
フィンランド	2,191,884,699	0.56
デンマーク	1,941,401,031	0.49
マレーシア	1,818,820,899	0.46
シンガポール	1,657,272,680	0.42
スウェーデン	1,359,179,442	0.35
ノルウェー	951,342,849	0.24
小計	390,100,040,579	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,360,100,350	0.85
合計(純資産総額)	393,460,140,929	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(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	3,051,550,713	0.78
	買建	ドイツ	3,485,358,654	0.89

(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		8,887,170,900	2.26

(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	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	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	20,000,000	11,536.31	2,307,262,386	11,652.73	2,330,546,625	2.625	2029/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/23	20,000,000	11,323.68	2,264,736,672	11,362.57	2,272,514,073	2.750	2023/5/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	18,750,000	11,196.98	2,099,434,071	11,388.24	2,135,296,591	2.375	2027/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 01/31/26	18,000,000	11,387.66	2,049,779,952	11,503.37	2,070,606,971	2.625	2026/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/29	18,010,000	11,438.10	2,060,002,982	11,431.04	2,058,731,270	2.375	2029/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 12/31/21	18,500,000	11,027.31	2,040,054,104	11,067.69	2,047,524,465	2.125	2021/12/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	18,760,000	10,099.24	1,894,617,574	10,802.78	2,026,602,886	2.250	2046/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	17,500,000	10,826.32	1,894,606,953	11,000.08	1,925,014,142	1.750	2023/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/31/25	16,700,000	11,275.26	1,882,969,212	11,500.37	1,920,562,834	2.625	2025/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	15,920,000	11,520.06	1,833,994,007	11,849.59	1,886,456,121	2.875	2028/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	14,970,000	11,792.57	1,765,348,178	12,544.62	1,877,929,614	3.000	2049/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	16,500,000	10,536.59	1,738,537,453	11,341.17	1,871,293,359	2.500	2046/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/46	16,000,000	10,529.74	1,684,758,900	11,342.88	1,814,861,400	2.500	2046/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	15,900,000	11,367.07	1,807,365,593	11,339.46	1,802,974,140	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 09/30/25	15,000,000	11,511.93	1,726,789,715	11,713.07	1,756,961,504	3.000	2025/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	14,400,000	11,759.72	1,693,400,453	12,087.54	1,740,607,110	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	14,260,000	11,516.63	1,642,272,737	11,831.62	1,687,189,598	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 04/30/24	15,000,000	11,143.34	1,671,502,140	11,223.05	1,683,457,875	2.250	2024/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 01/31/23	15,000,000	11,173.03	1,675,955,754	11,205.07	1,680,761,680	2.375	2023/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.5% 01/15/22	15,000,000	11,074.11	1,661,117,906	11,150.29	1,672,544,680	2.500	2022/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.375% 04/30/26	14,600,000	11,270.03	1,645,424,695	11,354.43	1,657,748,084	2.375	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	14,650,000	10,975.68	1,607,938,089	11,297.51	1,655,086,550	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 11/30/21	15,050,000	10,926.96	1,644,508,473	10,986.17	1,653,418,861	1.750	2021/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	14,950,000	11,032.18	1,649,311,156	11,045.01	1,651,230,116	2.125	2021/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/22	15,000,000	10,897.60	1,634,640,678	10,963.27	1,644,491,316	1.625	2022/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 10/31/22	14,650,000	10,892.23	1,595,712,087	11,036.03	1,616,778,421	1.875	2022/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 3% 05/15/47	12,750,000	12,299.82	1,568,228,010	12,478.71	1,591,035,890	3.000	2047/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	13,900,000	11,371.32	1,580,614,138	11,406.22	1,585,465,014	2.750	2023/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	12,000,000	11,955.92	1,434,711,208	12,626.79	1,515,214,800	3.125	2044/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000	20,999.74	1,440,582,754	21,903.41	1,502,574,084	4.500	2041/4/25	0.38

(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. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.15
合計	99.15

(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 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	102	アメリカドル	12,103,837.69	1,326,096,457	12,102,937.5	1,325,997,832	0.34
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	59	アメリカドル	7,592,408.17	831,824,239	7,590,718.75	831,639,146	0.21
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	52	アメリカドル	8,161,739.25	894,200,152	8,159,125	893,913,735	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	45	ユーロ	5,038,635	617,434,333	5,038,200	617,381,028	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	53	ユーロ	7,102,972	870,398,188	7,101,470	870,214,133	0.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	95	ユーロ	16,308,520	1,998,446,041	16,302,950	1,997,763,493	0.51

(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	40,740,000.00	4,457,204,514	4,458,178,200	1.13
	カナダドル	買建	4,390,000.00	367,473,055	367,443,000	0.09
	ユーロ	買建	28,340,000.00	3,472,452,022	3,472,216,800	0.88
	イギリスポンド	買建	4,110,000.00	589,352,628	589,332,900	0.15

(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。

国内株式インデックス 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	日本	320,001,386,770	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,485,312,658	1.08

合計(純資産総額)	323,486,699,428	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	日本	3,407,580,000	1.05

(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。

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(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,468,300	6,651.56	9,766,485,548	7,714.00	11,326,466,200	3.50
日本	株式	ソニー	電気機器	832,700	5,414.15	4,508,362,705	7,401.00	6,162,812,700	1.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,945,600	509.04	4,553,668,224	593.20	5,306,529,920	1.64
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,025,900	5,183.40	5,317,650,060	4,756.00	4,879,180,400	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,728,400	2,470.20	4,269,502,322	2,757.00	4,765,198,800	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,096,200	3,830.72	4,199,235,264	4,332.00	4,748,738,400	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	119,400	31,482.29	3,758,985,426	38,490.00	4,595,706,000	1.42
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	901,900	3,595.75	3,243,006,925	4,099.00	3,696,888,100	1.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	902,400	3,802.89	3,431,728,620	4,038.00	3,643,891,200	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	80,800	39,075.84	3,157,327,872	43,970.00	3,552,776,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,037,400	2,753.92	2,856,916,608	3,099.00	3,214,902,600	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	963,600	2,793.08	2,691,411,888	3,253.00	3,134,590,800	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,658,100	155.90	2,752,897,790	168.30	2,971,858,230	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	633,100	3,822.54	2,420,050,074	4,626.00	2,928,720,600	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	955,100	2,591.23	2,474,883,773	3,038.00	2,901,593,800	0.90
日本	株式	花王	化学	315,500	8,599.83	2,713,246,365	9,025.00	2,847,387,500	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	464,700	5,569.19	2,588,002,593	6,119.00	2,843,499,300	0.88
日本	株式	HOYA	精密機器	263,100	7,988.60	2,101,800,660	10,450.00	2,749,395,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	377,000	5,573.93	2,101,371,610	7,228.00	2,724,956,000	0.84

日本	株式	信越化学工業	化学	221,600	9,465.15	2,097,477,240	12,060.00	2,672,496,000	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	910,600	2,830.47	2,577,425,982	2,900.00	2,640,740,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	387,200	4,700.12	1,819,886,464	6,746.00	2,612,051,200	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	167,900	13,804.62	2,317,795,698	15,450.00	2,594,055,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	125,200	18,496.72	2,315,789,344	20,330.00	2,545,316,000	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	109,500	22,633.35	2,478,351,825	22,000.00	2,409,000,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	158,600	13,793.56	2,187,658,616	15,005.00	2,379,793,000	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	907,600	2,023.31	1,836,356,156	2,534.50	2,300,312,200	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	231,900	10,401.73	2,412,161,187	9,858.00	2,286,070,200	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	1,140,600	1,686.29	1,923,382,374	1,946.00	2,219,607,600	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,159,000	1,540.72	1,785,694,480	1,870.00	2,167,330,000	0.67

(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	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.76
		食料品	3.74
		繊維製品	0.59
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.06
		医薬品	5.96
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.59
		機械	5.06
		電気機器	14.24
		輸送用機器	7.63
		精密機器	2.35
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.52
		陸運業	4.34
海運業	0.18		
空運業	0.49		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	8.62		
卸売業	4.94		

	小売業	4.59
	銀行業	5.80
	証券、商品先物取引業	0.82
	保険業	2.29
	その他金融業	1.17
	不動産業	2.39
	サービス業	5.12
	小計	98.92
合計		98.92

(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	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	198	円	3,411,018,500	3,407,580,000	1.05

(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。

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：2004年12月1日
作成基準日：2019年12月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額 9,331円
純資産総額 29.15億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	10円
2019年9月	10円
2019年10月	10円
2019年11月	10円
2019年12月	10円
最近1年間 分配金合計額	120円
設定来 分配金合計額	4,906円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	67.8%	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.4%
		T 2.75% 05/31/23	アメリカ	国債	-	2.750%	2023/05/31	0.4%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.4%
		T 2.625% 01/31/26	アメリカ	国債	-	2.625%	2026/01/31	0.4%
		T 2.125% 12/31/21	アメリカ	国債	-	2.125%	2021/12/31	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	31.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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。

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（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 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

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、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。

< 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。受託会社は、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なります。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

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、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。

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及び借入公社債を除きます。）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>

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。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1)わが国の取引所に上場されている株式

原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における最終相場で評価します。

2)公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（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）の次のいずれかから入手した価額で評

価します。

(a)価格情報会社の提供する価額

(b)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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。（2004年12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、毎月20日から翌月19日までとします。（第1計算期間は、2004年12月1日から2005年2月21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）

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10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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。

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。

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）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。

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。

上記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。

上記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、ファンドの繰上償還を行いません。

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。

ファンドの繰上償還において、上記 から 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、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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。

上記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。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

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 >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、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。

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、販売会社を經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、毎年5月及び11月の決算時並びに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シャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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。

上記 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。

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。

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

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。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

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。

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て）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。

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。

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)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3)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30特定期間(2019年5月21日から2019年11月19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。

1【財務諸表】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第29特定期間 （2019年 5月20日現在）	第30特定期間 （2019年11月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,014,189	32,972,984
親投資信託受益証券	2,918,551,002	2,881,193,361
未収入金	-	12,200,000
流動資産合計	2,957,565,191	2,926,366,345
資産合計	2,957,565,191	2,926,366,345
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,313,848	3,160,806
未払解約金	-	6,285,611
未払受託者報酬	191,172	178,478
未払委託者報酬	3,086,033	2,881,178
未払利息	96	65
その他未払費用	13,647	12,741
流動負債合計	6,604,796	12,518,879
負債合計	6,604,796	12,518,879
純資産の部		
元本等		
元本	3,313,848,126	3,160,806,167
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	362,887,731	246,958,701
（分配準備積立金）	97,797,313	98,144,688
元本等合計	2,950,960,395	2,913,847,466
純資産合計	2,950,960,395	2,913,847,466
負債純資産合計	2,957,565,191	2,926,366,345

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29特定期間 自 2018年11月20日 至 2019年 5月20日	第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日
営業収益		
受取利息	6	13
有価証券売買等損益	6,691,758	138,842,359
営業収益合計	6,691,764	138,842,372
営業費用		
支払利息	17,907	10,515
受託者報酬	1,150,040	1,104,235
委託者報酬	18,564,864	17,825,526
その他費用	83,293	78,834
営業費用合計	19,816,104	19,019,110
営業利益又は営業損失（ ）	13,124,340	119,823,262
経常利益又は経常損失（ ）	13,124,340	119,823,262
当期純利益又は当期純損失（ ）	13,124,340	119,823,262
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（ ）	531,343	353,965
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	345,314,704	362,887,731
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,298,501	16,610,103
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,298,501	16,610,103
剰余金減少額又は欠損金増加額	852,211	835,708
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	852,211	835,708
分配金	20,363,634	19,314,662
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	362,887,731	246,958,701

(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 第30特定期間は前特定期間末日が休業日のため、2019年 5月21日から2019年11月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第29特定期間 (2019年 5月20日現在)	第30特定期間 (2019年11月19日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	3,313,848,126口	3,160,806,167口
2. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 362,887,731円	元本の欠損 246,958,701円
3. 特定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 0.8905円 (1万口当たり純資産額) (8,905円)	1口当たり純資産額 0.9219円 (1万口当たり純資産額) (9,219円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第29特定期間 自 2018年11月20日 至 2019年 5月20日	第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日																														
分配金の計算過程 第167期 自 2018年11月20日 至 2018年12月19日	分配金の計算過程 第173期 自 2019年 5月21日 至 2019年 6月19日																														
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,047,442円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,752,390円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>98,541,171円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,047,442円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	9,752,390円	分配準備積立金額	D	98,541,171円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,065,882円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,475,553円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>96,987,671円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,065,882円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	9,475,553円	分配準備積立金額	D	96,987,671円
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	1,047,442円																													
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																													
収益調整金額	C	9,752,390円																													
分配準備積立金額	D	98,541,171円																													
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	3,065,882円																													
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																													
収益調整金額	C	9,475,553円																													
分配準備積立金額	D	96,987,671円																													

第29特定期間 自 2018年11月20日 至 2019年 5月20日			第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日		
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,341,003円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,529,106円
当ファンドの期末残存口数	F	3,462,867,191口	当ファンドの期末残存口数	F	3,288,335,460口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	315円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	333円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,462,867円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,288,335円
第168期 自 2018年12月20日 至 2019年 1月21日			第174期 自 2019年 6月20日 至 2019年 7月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,217,550円	費用控除後の配当等収益額	A	3,074,253円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,753,615円	収益調整金額	C	9,449,521円
分配準備積立金額	D	95,814,348円	分配準備積立金額	D	95,865,218円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	107,785,513円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	108,388,992円
当ファンドの期末残存口数	F	3,452,704,674口	当ファンドの期末残存口数	F	3,259,662,285口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	312円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	332円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,452,704円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,259,662円
第169期 自 2019年 1月22日 至 2019年 2月19日			第175期 自 2019年 7月20日 至 2019年 8月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,734,032円	費用控除後の配当等収益額	A	694,832円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,672,251円	収益調整金額	C	9,375,158円
分配準備積立金額	D	93,425,948円	分配準備積立金額	D	94,667,934円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	106,832,231円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	104,737,924円
当ファンドの期末残存口数	F	3,411,833,006口	当ファンドの期末残存口数	F	3,225,973,244口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	313円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	324円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,411,833円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,225,973円
第170期 自 2019年 2月20日 至 2019年 3月19日			第176期 自 2019年 8月20日 至 2019年 9月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,670,255円	費用控除後の配当等収益額	A	3,778,257円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,666,047円	収益調整金額	C	9,355,037円

第29特定期間 自 2018年11月20日 至 2019年 5月20日			第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日		
分配準備積立金額	D	93,339,063円	分配準備積立金額	D	91,346,362円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	106,675,365円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	104,479,656円
当ファンドの期末残存口数	F	3,398,119,838口	当ファンドの期末残存口数	F	3,200,209,850口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	313円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	326円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,398,119円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,200,209円
第171期 自 2019年 3月20日 至 2019年 4月19日			第177期 自 2019年 9月20日 至 2019年10月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,989,122円	費用控除後の配当等収益額	A	10,747,028円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,496,749円	収益調整金額	C	9,319,225円
分配準備積立金額	D	91,538,090円	分配準備積立金額	D	91,312,168円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	113,023,961円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	111,378,421円
当ファンドの期末残存口数	F	3,324,263,736口	当ファンドの期末残存口数	F	3,179,677,016口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	339円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	350円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,324,263円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,179,677円
第172期 自 2019年 4月20日 至 2019年 5月20日			第178期 自 2019年10月22日 至 2019年11月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,246,577円	費用控除後の配当等収益額	A	3,038,216円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,491,517円	収益調整金額	C	9,289,604円
分配準備積立金額	D	99,864,584円	分配準備積立金額	D	98,267,278円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	110,602,678円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	110,595,098円
当ファンドの期末残存口数	F	3,313,848,126口	当ファンドの期末残存口数	F	3,160,806,167口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	333円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	349円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,313,848円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	3,160,806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30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第30特定期間 (2019年11月19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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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29特定期間 自 2018年11月20日 至 2019年 5月20日	第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,474,074,305円	3,313,848,126円
期中追加設定元本額	8,367,199円	8,156,132円
期中一部解約元本額	168,593,378円	161,198,091円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第29特定期間 (2019年 5月20日現在)	第30特定期間 (2019年11月19日現在)
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の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	58,233,064	20,469,662
合計	58,233,064	20,469,662

（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	国内株式インデックス マザーファンド	575,931,961	909,396,566	
	外国債券インデックス マザーファンド	700,087,625	1,971,796,795	
合計		1,276,019,586	2,881,193,361	

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年11月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	702,274,915
コール・ローン	2,367,980,957
国債証券	385,829,986,185
派生商品評価勘定	1,939,835
未収入金	51,528
未収利息	2,313,169,901
前払金	13,523,467
前払費用	157,924,164
差入委託証拠金	228,970,028
流動資産合計	391,615,820,980
資産合計	391,615,820,980
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,076,896
未払金	604,661
未払解約金	302,739,599
未払利息	4,738
その他未払費用	202
流動負債合計	320,426,096
負債合計	320,426,096
純資産の部	
元本等	
元本	138,928,212,558
剰余金	

	2019年11月19日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	252,367,182,326
元本等合計	391,295,394,884
純資産合計	391,295,394,884
負債純資産合計	391,615,820,980

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まででは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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で評価しております。</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</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>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）

	2019年11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		138,928,212,558口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8165円 (28,165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

	2019年11月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月19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

	2019年11月19日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月21日
期首元本額	113,453,225,675円
期中追加設定元本額	32,251,125,696円
期中一部解約元本額	6,776,138,813円
期末元本額	138,928,212,558円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,717,590,234円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	700,087,625円

区分	2019年11月19日現在
財産四分法ファンド（毎月決算型）	476,264,879円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,015,789,095円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,285,114円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,172,061,935円
世界経済インデックスファンド	6,654,353,048円
D C マイセレクション 2 5	1,702,076,585円
D C マイセレクション 5 0	1,294,867,794円
D C マイセレクション 7 5	829,240,263円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,904,981,047円
D C マイセレクション S 2 5	685,915,980円
D C マイセレクション S 5 0	531,262,675円
D C マイセレクション S 7 5	239,982,310円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	48,061,316円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	67,152,334円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	32,009,451円
D C 世界経済インデックスファンド	5,938,999,644円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	621,914,721円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	32,212,998円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,758,571円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,138,242円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	48,108,993円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	94,089,537円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	166,363,327円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	153,081,868円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	383,900,987円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,059,239,963円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	597,663,118円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,130,635,290円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	850,453,487円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	79,141,244円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	602,186,480円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	36,228,296円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	223,345,967円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	292,272,453円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	944,359,195円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,057,865,171円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	845,689,534円
外国債券ファンド・シリーズ 1	562,332,214円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,265,058,338円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,262,757,947円
分散投資コア戦略ファンド A	1,695,587,483円
分散投資コア戦略ファンド S	5,824,566,680円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	276,946,828円

区分	2019年11月19日現在
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,748,500,260円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,067,919,695円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	225,938,818円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	110,526,279円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,038,798,626円
S M T インデックスバランス・オープン	221,521,042円
外国債券S M T Bセレクション（S M A専用）	23,290,184,571円
S M T 世界経済インデックス・オープン	78,699,577円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	98,721,224円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	138,214,101円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,471,074円
グローバル経済コア	880,234,423円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	6,636,957円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	106,835円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	232,287,581円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,638,377円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 3 0	16,800円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 4 0	22,219円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 5 0	27,638円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 6 0	32,515円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	779,672,120円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,179,746,243円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	347,693,406円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	40,332,721,916円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	9,219,327,722	
合計	9,219,327,722	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス 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）

債券関連

(2019年11月19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	債券先物取引 買建	1,982,577,154	-	1,969,053,687	13,523,467
合計		1,982,577,154	-	1,969,053,687	13,523,467

(注)1. 時価の算定方法

債券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。

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年11月19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	2,370,731,394	-	2,369,117,800	1,613,594
	アメリカドル	1,216,207,731	-	1,212,772,200	3,435,531
	カナダドル	100,172,580	-	100,064,400	108,180
	ユーロ	887,870,148	-	889,110,000	1,239,852
	イギリスポンド	166,480,935	-	167,171,200	690,265
合計		2,370,731,394	-	2,369,117,800	1,613,594

(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。

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。

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

該当事項はありません。

(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
国債証券	アメリカドル	T 1.125% 02/28/21	6,500,000.00	6,458,486.32	
		T 1.125% 06/30/21	9,800,000.00	9,722,480.43	

T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	4,958,398.45	
T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,774,625.00	
T 1.25% 03/31/21	3,500,000.00	3,482,363.29	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,491,525.40	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	9,930,468.80	
T 1.375% 01/31/21	11,000,000.00	10,964,980.51	
T 1.375% 04/30/21	9,500,000.00	9,466,044.91	
T 1.375% 05/31/21	7,700,000.00	7,670,222.63	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,959,765.65	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,478,808.60	
T 1.375% 09/30/23	8,000,000.00	7,928,437.52	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,985,000.00	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,490,156.25	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,774,710.91	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	3,987,031.24	
T 1.5% 08/15/26	13,200,000.00	13,011,281.31	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,058,550.76	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,502,050.79	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,222,512.08	
T 1.625% 05/31/23	5,000,000.00	5,002,929.70	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,502,343.75	
T 1.625% 08/15/29	4,000,000.00	3,930,312.52	
T 1.625% 08/31/22	15,000,000.00	15,012,304.65	
T 1.625% 10/31/23	9,000,000.00	9,004,570.29	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,159,492.18	
T 1.625% 11/30/20	3,050,000.00	3,049,642.57	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,583,326.15	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,508,300.77	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,585,066.45	
T 1.75% 04/30/22	11,200,000.00	11,242,437.47	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,814,992.17	
T 1.75% 05/15/23	17,500,000.00	17,582,714.80	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,586,558.64	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,029,257.83	
T 1.75% 06/30/24	12,600,000.00	12,664,968.75	
T 1.75% 07/15/22	13,320,000.00	13,372,031.25	
T 1.75% 09/30/22	10,150,000.00	10,193,613.33	
T 1.75% 10/31/20	9,200,000.00	9,209,343.79	
T 1.75% 11/30/21	15,050,000.00	15,094,091.83	
T 1.75% 12/31/20	8,200,000.00	8,209,609.41	
T 1.875% 01/31/22	12,000,000.00	12,068,906.28	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,514,941.40	

T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,535,019.54
T 1.875% 04/30/22	10,450,000.00	10,518,986.30
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,064,335.96
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,239,872.68
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,030,156.24
T 1.875% 10/31/22	14,650,000.00	14,765,597.72
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,429,109.40
T 1.875% 12/15/20	10,000,000.00	10,024,609.40
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,017,109.39
T 2.125% 02/29/24	9,100,000.00	9,285,910.17
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,552,914.04
T 2.125% 05/15/22	10,000,000.00	10,128,125.00
T 2.125% 05/15/25	12,000,000.00	12,283,125.00
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	8,815,000.00
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,560,351.60
T 2.125% 06/30/22	11,600,000.00	11,758,140.59
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,905,562.51
T 2.125% 08/15/21	14,950,000.00	15,076,724.56
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,394,349.64
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,180,000.00
T 2.125% 11/30/23	12,680,000.00	12,929,142.21
T 2.125% 12/31/21	18,500,000.00	18,698,730.51
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,403,956.25
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,100,781.24
T 2.25% 02/15/21	13,280,000.00	13,380,637.56
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,267,445.31
T 2.25% 03/31/21	3,050,000.00	3,075,257.81
T 2.25% 04/15/22	10,000,000.00	10,152,343.80
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,530,761.71
T 2.25% 04/30/24	15,000,000.00	15,398,437.50
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,030,937.50
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,863,277.38
T 2.25% 08/15/46	19,200,000.00	18,991,500.09
T 2.25% 08/15/49	5,200,000.00	5,147,187.50
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,481,863.29
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,441,019.58
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,537,500.00
T 2.25% 11/15/27	14,650,000.00	15,191,363.35
T 2.25% 12/31/23	11,500,000.00	11,787,949.19
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,645,765.60
T 2.375% 01/31/23	15,000,000.00	15,356,250.00
T 2.375% 03/15/21	10,000,000.00	10,096,679.70
T 2.375% 04/15/21	11,500,000.00	11,619,042.94

T 2.375% 04/30/26	14,600,000.00	15,185,140.69
T 2.375% 05/15/27	18,750,000.00	19,595,214.93
T 2.375% 05/15/29	18,010,000.00	18,886,580.55
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	12,919,433.62
T 2.375% 12/31/20	11,000,000.00	11,087,656.25
T 2.5% 01/15/22	15,000,000.00	15,281,835.90
T 2.5% 01/31/21	10,000,000.00	10,100,781.30
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,521,484.37
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,210,351.55
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	7,952,648.41
T 2.5% 02/15/45	7,300,000.00	7,581,164.09
T 2.5% 02/15/46	16,500,000.00	17,148,398.52
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,168,177.74
T 2.5% 05/15/24	15,900,000.00	16,495,628.94
T 2.5% 05/15/46	16,000,000.00	16,631,250.08
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,695,742.18
T 2.5% 12/31/20	10,000,000.00	10,093,750.00
T 2.625% 01/31/26	18,000,000.00	18,966,796.92
T 2.625% 02/15/29	20,000,000.00	21,389,062.60
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,445,226.56
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,605,703.12
T 2.625% 05/15/21	10,580,000.00	10,735,807.00
T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,152,929.70
T 2.625% 06/30/23	6,200,000.00	6,419,906.25
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,404,437.50
T 2.625% 11/15/20	11,000,000.00	11,105,488.24
T 2.625% 12/31/23	11,500,000.00	11,955,058.56
T 2.625% 12/31/25	16,700,000.00	17,589,796.87
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,138,281.25
T 2.75% 02/15/28	10,400,000.00	11,184,062.55
T 2.75% 04/30/23	7,600,000.00	7,888,265.64
T 2.75% 05/31/23	20,000,000.00	20,775,781.20
T 2.75% 06/30/25	10,500,000.00	11,099,648.49
T 2.75% 07/31/23	6,000,000.00	6,242,109.36
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,210,976.59
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,255,000.00
T 2.75% 08/15/47	9,950,000.00	10,867,265.62
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,301,871.11
T 2.75% 11/15/23	13,900,000.00	14,503,238.31
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,555,359.39
T 2.75% 11/15/47	9,050,000.00	9,892,074.26
T 2.875% 04/30/25	10,000,000.00	10,626,171.90

T 2.875% 05/15/28	14,260,000.00	15,493,267.25
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	12,743,437.50
T 2.875% 05/15/49	3,800,000.00	4,272,031.25
T 2.875% 05/31/25	9,800,000.00	10,418,242.21
T 2.875% 07/31/25	9,460,000.00	10,070,096.11
T 2.875% 08/15/28	15,920,000.00	17,314,243.82
T 2.875% 08/15/45	10,900,000.00	12,132,210.99
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,972,841.78
T 2.875% 10/15/21	12,250,000.00	12,537,109.37
T 2.875% 10/31/20	13,000,000.00	13,149,804.72
T 2.875% 10/31/23	11,000,000.00	11,522,929.66
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,554,999.01
T 2% 01/15/21	8,000,000.00	8,032,656.24
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,521,679.70
T 2% 02/15/23	12,000,000.00	12,148,125.00
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,543,390.60
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,018,750.00
T 2% 04/30/24	10,000,000.00	10,158,593.80
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,821,078.14
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,132,187.52
T 2% 06/30/24	10,500,000.00	10,669,394.50
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,032,109.39
T 2% 08/15/25	12,300,000.00	12,509,484.37
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,844,625.00
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,691,271.49
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,418,656.25
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,406,035.98
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,520,195.34
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,023,125.00
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,217,789.06
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	2,710,210.93
T 3.125% 02/15/43	5,000,000.00	5,765,625.00
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,415,937.50
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	5,515,156.25
T 3.125% 08/15/44	12,000,000.00	13,895,625.00
T 3.125% 11/15/28	14,400,000.00	15,981,750.00
T 3.125% 11/15/41	3,250,000.00	3,747,148.43
T 3.375% 05/15/44	6,610,000.00	7,959,885.93
T 3.375% 11/15/48	8,300,000.00	10,209,000.00
T 3.5% 02/15/39	3,930,000.00	4,784,160.93
T 3.625% 02/15/21	11,100,000.00	11,369,912.15
T 3.625% 02/15/44	7,500,000.00	9,376,171.87
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,494,843.76

T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,522,187.50	
T 3.75% 11/15/43	8,500,000.00	10,815,585.98	
T 3.875% 08/15/40	3,150,000.00	4,035,199.23	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,098,031.25	
T 3% 02/15/49	14,970,000.00	17,214,330.54	
T 3% 05/15/42	2,950,000.00	3,333,039.06	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,980,976.58	
T 3% 05/15/47	12,750,000.00	14,585,800.84	
T 3% 08/15/48	11,950,000.00	13,716,359.37	
T 3% 09/30/25	15,000,000.00	16,091,015.70	
T 3% 10/31/25	10,000,000.00	10,733,984.40	
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	6,866,750.00	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,204,031.25	
T 4.25% 11/15/40	4,350,000.00	5,851,429.68	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,350,625.00	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,592,460.94	
T 4.375% 05/15/41	2,650,000.00	3,629,257.81	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,677,062.50	
T 4.5% 02/15/36	3,840,000.00	5,172,000.00	
T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,195,500.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,346,664.07	
T 4.625% 02/15/40	8,700,000.00	12,223,500.00	
T 4.75% 02/15/41	2,950,000.00	4,228,410.17	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,582,539.06	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,617,578.12	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,672,531.25	
T 5.375% 02/15/31	3,300,000.00	4,483,617.20	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,559,906.25	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,132,238.27	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,923,628.91	
T 6.25% 05/15/30	1,900,000.00	2,702,898.44	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,926,310.55	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,911,105.47	
アメリカドル 小計		1,644,710,000.00	1,721,890,388.89 (186,911,201,714)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	3,100,000.00	3,028,312.50
	CAN 0.75% 03/01/21	5,690,000.00	5,627,153.95
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,662,294.50
	CAN 1.25% 06/01/30	460,000.00	448,730.00
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,869,763.40
	CAN 1.5% 06/01/23	3,200,000.00	3,198,832.00
	CAN 1.5% 06/01/26	2,300,000.00	2,303,680.00

	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	600,573.00
	CAN 1.75% 03/01/23	4,000,000.00	4,028,480.00
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,706,142.50
	CAN 1% 06/01/27	1,970,000.00	1,902,478.25
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,478,392.50
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,371,231.00
	CAN 2.25% 06/01/25	3,800,000.00	3,955,325.00
	CAN 2.25% 06/01/29	2,860,000.00	3,055,180.70
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,761,802.80
	CAN 2.75% 06/01/22	4,910,000.00	5,057,987.40
	CAN 2.75% 12/01/48	2,870,000.00	3,615,913.00
	CAN 2.75% 12/01/64	1,150,000.00	1,569,899.50
	CAN 2% 06/01/28	2,140,000.00	2,228,360.60
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,148,148.80
	CAN 2% 11/01/20	2,110,000.00	2,116,446.05
	CAN 2% 12/01/51	950,000.00	1,042,069.25
	CAN 3.25% 06/01/21	5,630,000.00	5,771,031.50
	CAN 3.5% 12/01/45	3,330,000.00	4,641,587.10
	CAN 4.0% 06/01/41	2,730,000.00	3,894,276.75
	CAN 5.75% 06/01/29	2,170,000.00	2,982,241.85
	CAN 5.75% 06/01/33	2,280,000.00	3,440,907.60
	CAN 5% 06/01/37	2,320,000.00	3,515,600.40
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,703,377.25
	カナダドル 小計	80,170,000.00	88,726,219.15 (7,287,971,640)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,950,000.00	21,644,556.75
	MBONO 10% 12/05/24	38,840,000.00	44,265,753.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,070,000.00	36,070,753.95
	MBONO 6.5% 06/09/22	46,700,000.00	46,597,260.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	77,190,000.00	77,068,039.80
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	30,549,252.30
	MBONO 7.5% 06/03/27	54,070,000.00	56,140,340.30
	MBONO 7.75% 05/29/31	33,600,000.00	35,627,760.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	35,990,000.00	37,899,809.35
	MBONO 7.75% 11/23/34	19,630,000.00	20,799,849.85
	MBONO 8.5% 05/31/29	44,000,000.00	48,919,420.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	24,110,000.00	27,279,982.80
	MBONO 8% 09/05/24	20,270,000.00	21,340,560.05
	MBONO 8% 11/07/47	26,770,000.00	29,046,788.50
	MBONO 8% 12/07/23	45,700,000.00	47,841,502.00
	メキシコペソ 小計	552,070,000.00	581,091,629.45 (3,265,734,957)
ユーロ	BGB 0.2% 10/22/23	2,200,000.00	2,260,247.00

BGB 0.5% 10/22/24	2,270,000.00	2,371,673.30
BGB 0.8% 06/22/25	3,100,000.00	3,301,035.00
BGB 0.8% 06/22/27	3,110,000.00	3,348,054.95
BGB 0.8% 06/22/28	3,910,000.00	4,224,891.85
BGB 0.9% 06/22/29	2,040,000.00	2,227,027.20
BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	970,759.50
BGB 1.45% 06/22/37	980,000.00	1,151,387.30
BGB 1.6% 06/22/47	2,260,000.00	2,781,348.10
BGB 1.7% 06/22/50	1,250,000.00	1,565,187.50
BGB 1.9% 06/22/38	1,610,000.00	2,028,060.65
BGB 1% 06/22/26	2,930,000.00	3,180,617.55
BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,648,766.95
BGB 2.15% 06/22/66	1,000,000.00	1,440,210.00
BGB 2.25% 06/22/23	2,660,000.00	2,930,189.50
BGB 2.25% 06/22/57	820,000.00	1,174,867.30
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,783,857.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,600,000.00	2,781,872.00
BGB 3% 06/22/34	2,220,000.00	3,105,014.10
BGB 4.25% 03/28/41	3,370,000.00	5,893,119.00
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,564,801.75
BGB 4.25% 09/28/22	3,290,000.00	3,749,728.15
BGB 4.5% 03/28/26	1,610,000.00	2,106,161.75
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,439,992.50
BGB 4% 03/28/32	1,580,000.00	2,339,403.30
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,112,732.00
BGB 5% 03/28/35	3,580,000.00	6,117,468.20
BKO 0% 03/12/21	2,960,000.00	2,984,878.80
BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,666,334.00
BTPS 0.05% 04/15/21	4,910,000.00	4,920,139.15
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,596,241.10
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,410,857.00
BTPS 0.65% 10/15/23	3,220,000.00	3,256,611.40
BTPS 0.65% 11/01/20	1,550,000.00	1,561,989.25
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,243,536.40
BTPS 0.95% 03/01/23	3,500,000.00	3,573,342.50
BTPS 0.95% 03/15/23	6,500,000.00	6,638,157.50
BTPS 1.2% 04/01/22	4,010,000.00	4,115,342.70
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,000,982.75
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,984,912.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,392,023.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,087,359.00
BTPS 1.45% 11/15/24	1,300,000.00	1,354,346.50
BTPS 1.5% 06/01/25	4,210,000.00	4,390,609.00

BTPS 1.6% 06/01/26	3,600,000.00	3,781,098.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	6,650,000.00	6,816,516.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	4,000,000.00	4,216,160.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,119,220.00	
BTPS 1% 07/15/22	3,600,000.00	3,680,514.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	3,850,000.00	4,155,786.25	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,608,825.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	6,300,000.00	6,867,283.50	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,650,000.00	2,830,491.50	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,816,275.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,762,962.50	
BTPS 2.45% 10/01/23	3,960,000.00	4,267,236.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,245,988.25	
BTPS 2.5% 12/01/24	6,400,000.00	6,992,512.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	3,000,000.00	3,341,790.00	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,870,000.00	2,028,837.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	5,700,000.00	6,527,925.00	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,860,000.00	3,314,325.30	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,778,889.75	
BTPS 2% 12/01/25	3,150,000.00	3,380,312.25	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,070,000.00	1,258,036.45	
BTPS 3.25% 09/01/46	3,500,000.00	4,263,787.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,740,000.00	3,329,264.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,840,000.00	3,575,801.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	6,430,000.00	7,794,767.50	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	3,989,525.00	
BTPS 3.75% 05/01/21	3,570,000.00	3,768,938.25	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,990,000.00	8,498,124.05	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,467,716.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,270,000.00	3,033,650.70	
BTPS 3% 08/01/29	2,100,000.00	2,444,956.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	4,650,000.00	5,434,757.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	6,160,000.00	7,564,079.60	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,900,000.00	4,455,165.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,200,000.00	4,873,722.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,283,024.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,490,000.00	4,568,619.40	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,650,000.00	5,441,730.25	
BTPS 4% 02/01/37	5,220,000.00	6,843,211.20	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	6,406,699.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,760,000.00	6,536,217.80	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,400,000.00	3,902,588.00	

BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,982,956.00
BTPS 5.75% 02/01/33	3,930,000.00	5,883,858.45
BTPS 5% 03/01/22	6,600,000.00	7,344,018.00
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,918,283.75
BTPS 5% 08/01/34	4,240,000.00	6,058,938.80
BTPS 5% 09/01/40	4,020,000.00	6,001,679.10
BTPS 6.5% 11/01/27	7,520,000.00	10,661,555.20
BTPS 6% 05/01/31	4,800,000.00	7,142,808.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,999,242.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,069,660.00
DBR 0.25% 02/15/27	5,690,000.00	6,005,112.20
DBR 0.25% 02/15/29	3,510,000.00	3,716,633.70
DBR 0.25% 08/15/28	4,160,000.00	4,405,065.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,790,000.00	4,007,375.45
DBR 0.5% 02/15/26	5,000,000.00	5,330,025.00
DBR 0.5% 02/15/28	5,820,000.00	6,283,795.80
DBR 0.5% 08/15/27	4,650,000.00	5,009,445.00
DBR 0% 08/15/26	4,960,000.00	5,135,807.20
DBR 0% 08/15/29	2,400,000.00	2,480,220.00
DBR 0% 08/15/50	900,000.00	851,364.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,100,000.00	4,054,955.00
DBR 1.5% 02/15/23	5,270,000.00	5,643,405.85
DBR 1.5% 05/15/23	2,950,000.00	3,173,993.50
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,509,771.30
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,971,934.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,817,904.00
DBR 1.75% 07/04/22	6,150,000.00	6,544,522.50
DBR 1% 08/15/24	3,200,000.00	3,445,920.00
DBR 1% 08/15/25	4,920,000.00	5,368,261.20
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,052,111.75
DBR 2.5% 01/04/21	2,900,000.00	3,005,545.50
DBR 2.5% 07/04/44	5,120,000.00	8,141,670.40
DBR 2.5% 08/15/46	5,200,000.00	8,455,304.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,490,492.50
DBR 2% 08/15/23	3,850,000.00	4,235,693.00
DBR 3.25% 07/04/21	10,190,000.00	10,838,338.75
DBR 3.25% 07/04/42	2,840,000.00	4,909,579.00
DBR 4.0% 01/04/37	4,360,000.00	7,461,311.60
DBR 4.25% 07/04/39	2,700,000.00	4,992,057.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,710,326.50
DBR 4.75% 07/04/34	4,130,000.00	7,164,125.15
DBR 4.75% 07/04/40	2,960,000.00	5,892,960.40
DBR 5.5% 01/04/31	3,460,000.00	5,744,534.20

DBR 5.625% 01/04/28	2,460,000.00	3,699,630.90	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,575,670.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,103,075.00	
DBR 6.5% 07/04/27	650,000.00	1,002,556.75	
FRTR 0.25% 11/25/20	5,000,000.00	5,044,025.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	5,850,000.00	6,065,338.50	
FRTR 0.5% 05/25/25	6,890,000.00	7,232,329.65	
FRTR 0.5% 05/25/26	10,400,000.00	10,953,124.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	7,000,000.00	7,383,985.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	9,010,000.00	9,719,087.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	6,360,000.00	6,861,835.80	
FRTR 0% 02/25/21	6,000,000.00	6,047,070.00	
FRTR 0% 03/25/23	11,000,000.00	11,214,775.00	
FRTR 0% 03/25/24	11,240,000.00	11,481,379.00	
FRTR 0% 03/25/25	2,530,000.00	2,582,699.90	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,138,458.00	
FRTR 0% 05/25/22	5,550,000.00	5,636,691.00	
FRTR 0% 11/25/29	1,600,000.00	1,605,024.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,950,000.00	4,522,730.25	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,950,000.00	6,816,587.75	
FRTR 1.5% 05/25/31	8,820,000.00	10,284,869.70	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,640,000.00	4,376,171.80	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,969,340.55	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,860,000.00	2,445,416.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	4,040,000.00	5,027,113.40	
FRTR 1.75% 11/25/24	8,710,000.00	9,674,980.90	
FRTR 1% 05/25/27	6,650,000.00	7,274,235.50	
FRTR 1% 11/25/25	7,200,000.00	7,790,472.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,612,787.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,225,546.60	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,960,000.00	10,071,191.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,000,000.00	6,195,425.00	
FRTR 2% 05/25/48	4,840,000.00	6,455,906.60	
FRTR 3.25% 05/25/45	5,070,000.00	8,207,848.35	
FRTR 3.25% 10/25/21	10,850,000.00	11,666,354.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	7,550,000.00	9,434,442.25	
FRTR 3.75% 04/25/21	11,370,000.00	12,085,116.15	
FRTR 3% 04/25/22	8,520,000.00	9,276,405.60	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,443,375.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	6,860,000.00	12,488,492.80	
FRTR 4.75% 04/25/35	5,730,000.00	9,639,865.50	
FRTR 4% 04/25/55	3,480,000.00	6,893,010.00	

FRTR 4% 04/25/60	2,450,000.00	5,081,324.50
FRTR 4% 10/25/38	4,880,000.00	8,098,530.80
FRTR 5.5% 04/25/29	5,150,000.00	7,894,538.00
FRTR 5.75% 10/25/32	6,340,000.00	10,951,240.50
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,624,508.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,315,485.00
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	844,518.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,710,000.00	1,843,722.00
IRISH 0% 10/18/22	1,340,000.00	1,357,775.10
IRISH 1.1% 05/15/29	1,220,000.00	1,340,066.30
IRISH 1.3% 05/15/33	780,000.00	877,441.50
IRISH 1.35% 03/18/31	890,000.00	1,003,844.35
IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	1,008,021.15
IRISH 1.7% 05/15/37	1,050,000.00	1,247,809.50
IRISH 1% 05/15/26	2,040,000.00	2,191,174.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,990,000.00	2,461,779.25
IRISH 2% 02/18/45	1,480,000.00	1,906,447.20
IRISH 3.4% 03/18/24	1,470,000.00	1,710,198.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,290,000.00	1,477,404.75
IRISH 5.4% 03/13/25	2,370,000.00	3,082,362.75
NETHER 0.25% 07/15/25	2,880,000.00	2,995,099.20
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,669,864.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,280,000.00	1,367,417.60
NETHER 0.5% 07/15/26	3,070,000.00	3,254,537.70
NETHER 0.75% 07/15/27	4,530,000.00	4,905,491.70
NETHER 0.75% 07/15/28	2,540,000.00	2,767,203.00
NETHER 0% 01/15/22	3,500,000.00	3,547,250.00
NETHER 0% 01/15/24	2,830,000.00	2,894,057.05
NETHER 1.75% 07/15/23	2,950,000.00	3,206,605.75
NETHER 2.25% 07/15/22	1,660,000.00	1,789,073.30
NETHER 2.5% 01/15/33	2,670,000.00	3,572,112.90
NETHER 2.75% 01/15/47	2,750,000.00	4,609,563.75
NETHER 2% 07/15/24	3,010,000.00	3,367,001.05
NETHER 3.25% 07/15/21	2,930,000.00	3,119,702.85
NETHER 3.75% 01/15/23	3,170,000.00	3,614,671.75
NETHER 3.75% 01/15/42	2,900,000.00	5,202,933.50
NETHER 4% 01/15/37	3,000,000.00	5,028,915.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,041,109.70
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	251,927.00
OBL 0% 04/05/24	5,900,000.00	6,058,267.50
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,692,188.00
OBL 0% 04/09/21	4,450,000.00	4,490,228.00
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,270,360.70

OBL 0% 10/07/22	3,490,000.00	3,557,688.55	
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,632,305.00	
OBL 0% 10/13/23	3,710,000.00	3,804,011.40	
OBL 0% 10/18/24	960,000.00	987,897.60	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,190,000.00	1,257,127.90	
RAGB 0.5% 04/20/27	2,100,000.00	2,215,573.50	
RAGB 0.75% 02/20/28	2,870,000.00	3,090,846.50	
RAGB 0.75% 10/20/26	3,040,000.00	3,259,412.00	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,529,017.50	
RAGB 0% 07/15/24	370,000.00	377,644.20	
RAGB 0% 09/20/22	1,100,000.00	1,118,150.00	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,710,000.00	1,869,722.55	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,230,000.00	1,555,175.10	
RAGB 1.5% 11/02/86	640,000.00	859,619.20	
RAGB 1.65% 10/21/24	1,870,000.00	2,062,993.35	
RAGB 1.75% 10/20/23	2,330,000.00	2,539,303.90	
RAGB 2.1% 09/20/17	1,000,000.00	1,719,785.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,550,000.00	2,048,162.25	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,270,000.00	2,096,420.75	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,550,000.00	2,857,083.75	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,170,000.00	2,332,977.85	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,310,000.00	2,549,235.15	
RAGB 3.8% 01/26/62	680,000.00	1,482,005.60	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,640,000.00	4,396,048.80	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,120,000.00	2,821,783.60	
RAGB 6.25% 07/15/27	130,000.00	195,169.65	
RFGB 0.5% 04/15/26	1,170,000.00	1,231,793.55	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,050,000.00	1,109,771.25	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	709,117.95	
RFGB 0.5% 09/15/29	580,000.00	613,651.60	
RFGB 0.75% 04/15/31	870,000.00	943,201.80	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	740,204.40	
RFGB 0% 04/15/22	850,000.00	862,320.75	
RFGB 0% 09/15/23	1,460,000.00	1,489,813.20	
RFGB 0% 09/15/24	750,000.00	765,952.50	
RFGB 1.125% 04/15/34	770,000.00	877,287.95	
RFGB 1.375% 04/15/47	550,000.00	689,075.75	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	696,449.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,260,000.00	1,339,543.80	
RFGB 2.625% 07/04/42	870,000.00	1,314,635.25	
RFGB 2.75% 07/04/28	920,000.00	1,153,937.60	
RFGB 2% 04/15/24	600,000.00	666,417.00	

RFGB 3.5% 04/15/21	990,000.00	1,047,781.35
RFGB 4% 07/04/25	1,130,000.00	1,415,115.95
SPGB 0.05% 01/31/21	3,600,000.00	3,620,682.00
SPGB 0.05% 10/31/21	4,700,000.00	4,739,033.50
SPGB 0.25% 07/30/24	1,790,000.00	1,819,785.60
SPGB 0.35% 07/30/23	4,780,000.00	4,877,679.30
SPGB 0.4% 04/30/22	3,280,000.00	3,339,876.40
SPGB 0.45% 10/31/22	2,850,000.00	2,912,714.25
SPGB 0.6% 10/31/29	2,330,000.00	2,372,930.25
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,243,450.00
SPGB 1.3% 10/31/26	5,090,000.00	5,493,306.15
SPGB 1.4% 04/30/28	5,830,000.00	6,366,534.90
SPGB 1.4% 07/30/28	5,900,000.00	6,444,658.50
SPGB 1.45% 04/30/29	6,540,000.00	7,187,525.40
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,844,153.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,340,192.25
SPGB 1.6% 04/30/25	4,910,000.00	5,345,517.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,410,000.00	2,777,657.55
SPGB 1.95% 04/30/26	4,020,000.00	4,495,807.20
SPGB 1.95% 07/30/30	4,580,000.00	5,286,854.30
SPGB 2.15% 10/31/25	4,570,000.00	5,145,774.30
SPGB 2.35% 07/30/33	3,540,000.00	4,311,578.40
SPGB 2.7% 10/31/48	2,320,000.00	3,102,872.40
SPGB 2.75% 10/31/24	4,400,000.00	5,018,310.00
SPGB 2.9% 10/31/46	3,430,000.00	4,721,240.65
SPGB 3.45% 07/30/66	2,040,000.00	3,250,097.40
SPGB 3.8% 04/30/24	3,310,000.00	3,888,736.95
SPGB 4.2% 01/31/37	3,490,000.00	5,371,162.35
SPGB 4.4% 10/31/23	4,250,000.00	5,020,418.75
SPGB 4.65% 07/30/25	3,970,000.00	5,015,896.50
SPGB 4.7% 07/30/41	3,980,000.00	6,784,825.40
SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,684,796.50
SPGB 4.85% 10/31/20	3,950,000.00	4,150,423.00
SPGB 4.9% 07/30/40	3,490,000.00	6,026,008.50
SPGB 5.15% 10/31/28	3,240,000.00	4,615,282.80
SPGB 5.15% 10/31/44	2,590,000.00	4,822,787.20
SPGB 5.4% 01/31/23	4,860,000.00	5,741,604.00
SPGB 5.5% 04/30/21	5,980,000.00	6,493,024.20
SPGB 5.75% 07/30/32	4,300,000.00	7,035,402.00
SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,868,350.20
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,817,677.20
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,587,841.50

	ユーロ 小計	1,005,440,000.00	1,201,077,936.50 (144,297,503,291)
イギリスポンド	UKT 0.5% 07/22/22	5,730,000.00	5,726,819.85
	UKT 0.75% 07/22/23	5,930,000.00	5,978,685.30
	UKT 0.875% 10/22/29	1,430,000.00	1,447,853.55
	UKT 1.25% 07/22/27	4,900,000.00	5,147,254.00
	UKT 1.5% 01/22/21	7,380,000.00	7,450,257.60
	UKT 1.5% 07/22/26	4,100,000.00	4,362,871.50
	UKT 1.5% 07/22/47	5,040,000.00	5,302,357.20
	UKT 1.625% 10/22/28	6,650,000.00	7,210,129.50
	UKT 1.625% 10/22/54	1,950,000.00	2,163,603.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,200,000.00	1,419,216.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,790,000.00	1,995,375.65
	UKT 1.75% 07/22/57	2,750,000.00	3,207,875.00
	UKT 1.75% 09/07/22	4,170,000.00	4,311,050.25
	UKT 1.75% 09/07/37	4,920,000.00	5,382,184.80
	UKT 1% 04/22/24	5,030,000.00	5,132,511.40
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,662,862.50
	UKT 2.5% 07/22/65	4,170,000.00	6,109,133.40
	UKT 2.75% 09/07/24	2,450,000.00	2,707,384.75
	UKT 2% 09/07/25	2,170,000.00	2,358,019.65
	UKT 3.25% 01/22/44	4,670,000.00	6,594,903.95
	UKT 3.5% 01/22/45	3,360,000.00	4,972,783.20
	UKT 3.5% 07/22/68	3,670,000.00	6,797,372.15
	UKT 3.75% 07/22/52	3,280,000.00	5,493,016.00
	UKT 3.75% 09/07/21	3,770,000.00	3,984,588.40
	UKT 4.25% 03/07/36	4,290,000.00	6,324,210.75
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	4,193,070.00
	UKT 4.25% 09/07/39	2,990,000.00	4,613,315.85
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	864,196.15
	UKT 4.25% 12/07/40	3,050,000.00	4,770,977.75
	UKT 4.25% 12/07/46	3,400,000.00	5,717,423.00
	UKT 4.25% 12/07/49	2,170,000.00	3,784,121.95
	UKT 4.25% 12/07/55	2,740,000.00	5,166,160.40
	UKT 4.5% 09/07/34	2,820,000.00	4,174,093.50
	UKT 4.5% 12/07/42	3,600,000.00	5,953,158.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,710,000.00	3,852,441.15
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,075,644.00	
UKT 4% 01/22/60	2,950,000.00	5,594,571.75	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,104,693.50	
UKT 5% 03/07/25	2,500,000.00	3,083,512.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,839,668.75	
UKT 8% 06/07/21	740,000.00	824,408.10	

イギリスポンド 小計		135,740,000.00	173,853,775.70 (24,442,102,325)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	7,490,000.00	8,046,095.05
	SGB 0.75% 11/12/29	7,590,000.00	8,169,838.05
	SGB 1.5% 11/13/23	16,650,000.00	17,885,430.00
	SGB 1% 11/12/26	13,470,000.00	14,612,323.35
	SGB 2.5% 05/12/25	12,740,000.00	14,706,291.60
	SGB 3.5% 03/30/39	8,580,000.00	13,655,413.20
	SGB 3.5% 06/01/22	16,620,000.00	18,267,291.30
	SGB 5% 12/01/20	18,910,000.00	19,956,195.75
スウェーデンクローナ 小計		102,050,000.00	115,298,878.30 (1,298,265,369)
ノルウェークローネ	NGB 1.5% 02/19/26	7,460,000.00	7,552,988.90
	NGB 1.75% 02/17/27	8,210,000.00	8,440,495.75
	NGB 1.75% 03/13/25	5,800,000.00	5,951,148.00
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	5,576,285.70
	NGB 2% 04/26/28	6,190,000.00	6,487,739.00
	NGB 2% 05/24/23	13,440,000.00	13,778,822.40
	NGB 3.75% 05/25/21	16,540,000.00	17,156,528.50
	NGB 3% 03/14/24	9,950,000.00	10,679,335.00
ノルウェークローネ 小計		73,010,000.00	75,623,343.25 (899,917,784)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/20	9,400,000.00	9,497,337.00
	DGB 0.5% 11/15/27	17,460,000.00	18,815,419.80
	DGB 0.5% 11/15/29	7,700,000.00	8,334,672.50
	DGB 1.5% 11/15/23	13,440,000.00	14,612,304.00
	DGB 1.75% 11/15/25	11,230,000.00	12,802,705.35
	DGB 3% 11/15/21	12,960,000.00	13,934,008.80
	DGB 4.5% 11/15/39	24,490,000.00	47,267,781.65
デンマーククローネ 小計		96,680,000.00	125,264,229.10 (2,014,248,803)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	7,560,000.00	7,608,535.20
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,790,140.65
	POLGB 2.25% 10/25/24	560,000.00	571,379.20
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,017,135.90
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,810,000.00	7,020,020.40
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,410,000.00	7,651,566.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	6,770,000.00	6,992,766.85
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,520,000.00	6,854,997.60
	POLGB 2.75% 10/25/29	3,540,000.00	3,747,727.20
	POLGB 2% 04/25/21	6,560,000.00	6,627,502.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,230,000.00	6,672,672.65

	POLGB 4% 10/25/23	4,390,000.00	4,770,042.30
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	798,018.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,750,000.00	5,297,128.75
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,680,891.00
ポーランドズロチ 小計		75,670,000.00	79,100,524.10 (2,213,232,664)
オーストラリアドル	ACGB 1.5% 06/21/31	2,470,000.00	2,548,496.60
	ACGB 1.75% 11/21/20	5,660,000.00	5,711,138.10
	ACGB 2.25% 05/21/28	5,790,000.00	6,321,261.45
	ACGB 2.25% 11/21/22	1,970,000.00	2,058,561.35
	ACGB 2.5% 05/21/30	4,390,000.00	4,964,190.05
	ACGB 2.75% 04/21/24	6,060,000.00	6,568,403.70
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	957,076.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,430,000.00	1,698,096.40
	ACGB 2.75% 11/21/27	5,750,000.00	6,483,182.50
	ACGB 2.75% 11/21/28	5,410,000.00	6,152,522.50
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,460,000.00	5,128,843.90
	ACGB 2% 12/21/21	2,720,000.00	2,789,700.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	4,980,000.00	5,601,827.70
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,090,000.00	4,853,705.25
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,890,000.00	2,422,186.20
	ACGB 3.75% 04/21/37	2,320,000.00	3,121,571.60
	ACGB 3% 03/21/47	2,480,000.00	3,138,799.60
	ACGB 4.25% 04/21/26	6,370,000.00	7,672,155.40
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,650,000.00	3,702,951.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	5,660,000.00	7,159,815.10
ACGB 5.5% 04/21/23	4,130,000.00	4,791,378.20	
ACGB 5.75% 05/15/21	3,930,000.00	4,217,125.80	
ACGB 5.75% 07/15/22	5,330,000.00	6,030,948.30	
オーストラリアドル 小計		90,740,000.00	104,093,936.70 (7,673,805,013)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	990,000.00	985,837.05
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	806,072.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	1,150,000.00	1,157,268.00
	SIGB 2.125% 06/01/26	850,000.00	872,737.50
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,590,000.00	1,608,459.90
	SIGB 2.25% 08/01/36	700,000.00	732,028.50
	SIGB 2.375% 06/01/25	630,000.00	654,214.05
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	274,782.30
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,122,129.75
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,320,000.00	1,482,228.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	1,060,000.00	1,185,196.60
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,600,000.00	1,666,568.00

	SIGB 2.875% 07/01/29	670,000.00	735,727.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	670,000.00	740,058.55
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	416,685.05
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,149,016.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,140,000.00	1,345,599.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,190,000.00	1,335,804.75
	SIGB 3% 09/01/24	1,570,000.00	1,669,608.65
	シンガポールドル 小計	18,750,000.00	19,940,020.65 (1,590,416,047)
マレーシアリングット	MGS 3.418% 08/15/22	2,500,000.00	2,520,375.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,700,000.00	2,727,877.50
	MGS 3.502% 05/31/27	2,710,000.00	2,717,777.70
	MGS 3.62% 11/30/21	2,690,000.00	2,719,711.05
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	1,972,865.30
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	357,080.50
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,527,652.50
	MGS 3.8% 08/17/23	3,160,000.00	3,230,910.40
	MGS 3.844% 04/15/33	2,810,000.00	2,854,510.40
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	764,422.50
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,059,561.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,160,103.20
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,029,730.40
	MGS 3.9% 11/30/26	3,560,000.00	3,672,246.80
	MGS 3.955% 09/15/25	2,700,000.00	2,788,924.50
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,085,895.50
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	1,968,932.00
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	2,145,929.75
	MGS 4.16% 07/15/21	3,700,000.00	3,766,674.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,611,488.50
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,116,640.00
	MGS 4.254% 05/31/35	1,400,000.00	1,475,684.00
	MGS 4.392% 04/15/26	3,530,000.00	3,734,122.25
	MGS 4.498% 04/15/30	3,040,000.00	3,292,563.20
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,648,777.50
	MGS 4.736% 03/15/46	2,270,000.00	2,530,777.60
	MGS 4.762% 04/07/37	3,370,000.00	3,831,117.10
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	919,224.00
	MGS 4.921% 07/06/48	1,550,000.00	1,785,716.25
	MGS 4.935% 09/30/43	1,440,000.00	1,649,930.40
	MGS 5.248% 09/15/28	600,000.00	676,632.00
	マレーシアリングット 小計	64,240,000.00	67,343,852.80 (1,756,327,681)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	46,150,000.00	51,246,113.75

	SAGB 6.25% 03/31/36	11,020,000.00	7,875,387.90	
	SAGB 6.5% 02/28/41	17,650,000.00	12,207,446.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	10,700,000.00	10,712,358.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	17,600,000.00	17,792,280.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,330,000.00	13,713,362.45	
	SAGB 8.25% 03/31/32	33,120,000.00	30,211,898.40	
	SAGB 8.5% 01/31/37	27,100,000.00	23,944,340.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	27,140,000.00	23,780,610.80	
	SAGB 8.75% 02/28/48	44,900,000.00	39,227,109.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	21,250,000.00	19,757,081.25	
	SAGB 8% 01/31/30	31,310,000.00	29,017,481.80	
	SAGB 9% 01/31/40	19,620,000.00	17,821,336.50	
	南アフリカランド 小計	323,890,000.00	297,306,807.35	(2,179,258,897)
	合計		385,829,986,185	(385,829,986,185)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 205銘柄	100.0%	48.4%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 298銘柄	100.0%	37.4%
イギリスポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%

(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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,882,518,794
株式	319,850,480,690
派生商品評価勘定	255,560,560
未収入金	226,437,850
未収配当金	2,950,279,172
差入委託証拠金	129,483,000
流動資産合計	326,294,760,066
資産合計	326,294,760,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,484,650
前受金	253,097,200
未払解約金	549,078,048
未払利息	5,768
その他未払費用	272
流動負債合計	804,665,938
負債合計	804,665,938
純資産の部	
元本等	
元本	206,137,046,461
剰余金	
剰余金又は欠損金()	119,353,047,667
元本等合計	325,490,094,128
純資産合計	325,490,094,128
負債純資産合計	326,294,760,066

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年11月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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又は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。

2019年11月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、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。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2019年11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	206,137,046,461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 1.5790円 (1万口当たり純資産額) (15,790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

2019年11月19日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ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。

	2019年11月19日現在
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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月19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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月21日
期首元本額	191,487,198,306円
期中追加設定元本額	31,420,697,892円
期中一部解約元本額	16,770,849,737円
期末元本額	206,137,046,461円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	575,931,961円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,047,939,275円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,789,066円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,286,741,479円
世界経済インデックスファンド	2,069,836,618円
日本株式インデックス・オープン	5,076,768,079円
DCマイセレクション25	6,827,811,293円
DCマイセレクション50	19,284,639,949円
DCマイセレクション75	17,432,662,365円
DC日本株式インデックス・オープン	5,674,538,424円
DCマイセレクションS25	2,748,321,375円
DCマイセレクションS50	7,834,433,780円
DCマイセレクションS75	5,063,535,968円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,530,763,158円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	389,564,035円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	705,218,286円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	465,348,408円
DC世界経済インデックスファンド	1,870,094,883円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,072,612,177円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,112,186円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,456,712円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,943,720円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	281,043,778円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,582,381円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,841,365円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	323,016,805円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	58,243,673円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	438,301,767円

区分	2019年11月19日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,689,238,279円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	705,884,756円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,092,035,273円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	621,285,642円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	41,297,735円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	783,749,839円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	35,821,422円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	433,933,077円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	567,369,751円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	54,644,620円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	845,769,205円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,011,550,659円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,929,767円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,356,898,799円
分散投資コア戦略ファンドA	5,961,437,227円
分散投資コア戦略ファンドS	15,951,269,188円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	265,500,425円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	284,146,114円
コア投資戦略ファンド（切替型）	753,826,857円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	214,227,487円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,141,018円
SMT インデックスバランス・オープン	71,794,569円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,618,669,091円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	617,139,588円
SMT 世界経済インデックス・オープン	16,244,765円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	61,346,736円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	9,175,738円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,643,020円
グローバル経済コア	286,456,711円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,898,717円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	41,851,496円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,948,063円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	353,247,293円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,765,656円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	48,577,255,075円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	596,475,083円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	6,414,074円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年11月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		29,573,600,448
合計		29,573,600,448

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス 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

(2019年11月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,241,942,800	-	5,495,040,000	253,097,200
	合計	5,241,942,800	-	5,495,040,000	253,097,200

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段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. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,300	2,938.00	18,509,400	
日本水産	181,300	641.00	116,213,300	
マルハニチロ	26,200	2,924.00	76,608,800	
カネコ種苗	5,500	1,532.00	8,426,000	
サカタのタネ	21,600	3,670.00	79,272,000	
ホクト	13,800	1,933.00	26,675,400	
ホクリヨウ	2,800	675.00	1,890,000	
住石ホールディングス	36,600	146.00	5,343,600	
日鉄鉱業	4,200	4,630.00	19,446,000	

三井松島ホールディングス	7,000	1,232.00	8,624,000
国際石油開発帝石	727,200	1,020.50	742,107,600
石油資源開発	23,700	2,903.00	68,801,100
K&Oエナジーグループ	8,800	1,615.00	14,212,000
ヒノキヤグループ	4,500	2,225.00	10,012,500
ショーボンドホールディングス	25,900	4,265.00	110,463,500
ミライト・ホールディングス	53,900	1,712.00	92,276,800
タマホーム	8,700	1,995.00	17,356,500
サンヨーホームズ	1,600	669.00	1,070,400
日本アクア	7,200	742.00	5,342,400
ファーストコーポレーション	5,500	714.00	3,927,000
ベステラ	3,100	1,261.00	3,909,100
TATERU	37,400	213.00	7,966,200
スペースバリューホールディングス	22,100	517.00	11,425,700
ダイセキ環境ソリューション	3,500	945.00	3,307,500
第一カッター興業	2,200	1,840.00	4,048,000
安藤・間	107,900	948.00	102,289,200
東急建設	53,100	823.00	43,701,300
コムシスホールディングス	64,300	3,205.00	206,081,500
ミサワホーム	12,500	1,200.00	15,000,000
ビーアールホールディングス	19,700	470.00	9,259,000
高松コンストラクショングループ	11,300	2,693.00	30,430,900
東建コーポレーション	5,600	7,250.00	40,600,000
ソネック	1,900	803.00	1,525,700
ヤマウラ	7,900	874.00	6,904,600
大成建設	139,600	4,175.00	582,830,000
大林組	418,600	1,179.00	493,529,400
清水建設	424,800	1,078.00	457,934,400
飛鳥建設	12,000	1,426.00	17,112,000
長谷工コーポレーション	162,000	1,422.00	230,364,000
松井建設	16,500	801.00	13,216,500
銭高組	1,800	4,035.00	7,263,000
鹿島建設	328,600	1,428.00	469,240,800
不動テトラ	10,900	1,549.00	16,884,100
大末建設	4,800	971.00	4,660,800
鉄建建設	9,100	2,966.00	26,990,600
西松建設	32,300	2,411.00	77,875,300
三井住友建設	101,100	596.00	60,255,600
大豊建設	9,400	3,030.00	28,482,000
前田建設工業	104,800	983.00	103,018,400
佐田建設	9,000	410.00	3,690,000
ナカノフドー建設	11,400	475.00	5,415,000

奥村組	22,700	2,947.00	66,896,900
東鉄工業	18,000	3,300.00	59,400,000
イチケン	3,000	1,804.00	5,412,000
富士ピー・エス	6,200	570.00	3,534,000
浅沼組	4,700	4,445.00	20,891,500
戸田建設	173,800	680.00	118,184,000
熊谷組	19,400	3,290.00	63,826,000
北野建設	2,500	2,772.00	6,930,000
植木組	1,900	2,596.00	4,932,400
矢作建設工業	18,500	767.00	14,189,500
ピーエス三菱	13,800	706.00	9,742,800
日本ハウスホールディングス	28,600	506.00	14,471,600
大東建託	50,100	13,685.00	685,618,500
新日本建設	17,800	975.00	17,355,000
N I P P O	34,600	2,229.00	77,123,400
東亜道路工業	2,600	3,625.00	9,425,000
前田道路	44,300	2,434.00	107,826,200
日本道路	4,000	6,940.00	27,760,000
東亜建設工業	13,100	1,549.00	20,291,900
日本国土開発	24,400	645.00	15,738,000
若築建設	7,500	1,704.00	12,780,000
東洋建設	46,900	509.00	23,872,100
五洋建設	165,900	638.00	105,844,200
世紀東急工業	20,100	854.00	17,165,400
福田組	4,800	4,820.00	23,136,000
住友林業	106,000	1,565.00	165,890,000
日本基礎技術	14,100	410.00	5,781,000
巴コーポレーション	18,600	424.00	7,886,400
大和ハウス工業	414,100	3,362.00	1,392,204,200
ライト工業	24,000	1,598.00	38,352,000
積水ハウス	458,000	2,358.00	1,079,964,000
日特建設	10,900	789.00	8,600,100
北陸電気工事	7,200	1,034.00	7,444,800
ユアテック	23,900	694.00	16,586,600
四電工	2,300	2,741.00	6,304,300
中電工	16,900	2,549.00	43,078,100
関電工	59,600	1,076.00	64,129,600
きんでん	99,400	1,670.00	165,998,000
東京エネシス	13,900	944.00	13,121,600
トーエネック	4,200	3,645.00	15,309,000
住友電設	11,800	2,360.00	27,848,000
日本電設工業	23,000	2,267.00	52,141,000

協和エクシオ	63,500	2,840.00	180,340,000
新日本空調	11,100	2,237.00	24,830,700
九電工	29,400	3,630.00	106,722,000
三機工業	30,200	1,454.00	43,910,800
日揮ホールディングス	128,900	1,696.00	218,614,400
中外炉工業	4,500	1,777.00	7,996,500
ヤマト	13,400	746.00	9,996,400
太平電業	10,100	2,332.00	23,553,200
高砂熱学工業	36,400	1,912.00	69,596,800
三晃金属工業	1,800	2,569.00	4,624,200
朝日工業社	2,800	3,260.00	9,128,000
明星工業	27,100	913.00	24,742,300
大気社	20,400	3,645.00	74,358,000
ダイダン	10,000	2,647.00	26,470,000
日比谷総合設備	13,500	1,938.00	26,163,000
東芝プラントシステム	32,400	2,664.00	86,313,600
OSJBホールディングス	66,000	274.00	18,084,000
東洋エンジニアリング	17,600	693.00	12,196,800
レイズネクスト	22,400	1,215.00	27,216,000
日本製粉	39,200	1,734.00	67,972,800
日清製粉グループ本社	151,400	2,189.00	331,414,600
日東富士製粉	1,000	6,360.00	6,360,000
昭和産業	12,300	3,190.00	39,237,000
鳥越製粉	11,900	951.00	11,316,900
中部飼料	16,400	1,337.00	21,926,800
フィード・ワン	90,000	167.00	15,030,000
東洋精糖	2,000	1,134.00	2,268,000
日本甜菜製糖	7,000	2,073.00	14,511,000
三井製糖	11,700	2,352.00	27,518,400
塩水港精糖	14,500	222.00	3,219,000
日新製糖	6,300	2,000.00	12,600,000
森永製菓	31,400	5,730.00	179,922,000
中村屋	3,500	4,600.00	16,100,000
江崎グリコ	39,700	5,120.00	203,264,000
名糖産業	6,400	1,316.00	8,422,400
井村屋グループ	5,700	2,094.00	11,935,800
不二家	7,500	2,134.00	16,005,000
山崎製パン	100,400	1,937.00	194,474,800
第一屋製パン	2,300	990.00	2,277,000
モロゾフ	2,300	5,000.00	11,500,000
亀田製菓	7,600	5,060.00	38,456,000
寿スピリッツ	12,900	7,780.00	100,362,000

カルビー	61,100	3,580.00	218,738,000
森永乳業	24,800	4,635.00	114,948,000
六甲バター	8,900	1,790.00	15,931,000
ヤクルト本社	92,100	6,310.00	581,151,000
明治ホールディングス	88,600	7,440.00	659,184,000
雪印メグミルク	32,300	2,659.00	85,885,700
プリマハム	20,900	2,581.00	53,942,900
日本ハム	51,200	4,795.00	245,504,000
林兼産業	4,400	724.00	3,185,600
丸大食品	14,300	2,405.00	34,391,500
S Foods	10,700	3,015.00	32,260,500
伊藤ハム米久ホールディングス	86,300	702.00	60,582,600
サッポロホールディングス	45,700	2,635.00	120,419,500
アサヒグループホールディングス	280,600	5,275.00	1,480,165,000
キリンホールディングス	568,100	2,481.50	1,409,740,150
宝ホールディングス	100,300	1,088.00	109,126,400
オエノンホールディングス	35,300	396.00	13,978,800
養命酒製造	4,100	1,962.00	8,044,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	94,000	2,714.00	255,116,000
サントリー食品インターナショナル	89,600	4,780.00	428,288,000
ダイドーグループホールディングス	6,900	4,550.00	31,395,000
伊藤園	40,700	5,390.00	219,373,000
キーコーヒー	13,200	2,458.00	32,445,600
ユニカフェ	3,400	1,048.00	3,563,200
ジャパンフーズ	1,900	1,234.00	2,344,600
日清オイリオグループ	17,200	4,055.00	69,746,000
不二製油グループ本社	32,700	3,235.00	105,784,500
かどや製油	1,500	3,840.00	5,760,000
J - オイルミルズ	6,900	4,480.00	30,912,000
キッコーマン	96,400	5,600.00	539,840,000
味の素	295,800	1,828.00	540,722,400
キューピー	74,600	2,485.00	185,381,000
ハウス食品グループ本社	50,100	3,885.00	194,638,500
カゴメ	50,800	2,730.00	138,684,000
焼津水産化学工業	6,500	1,045.00	6,792,500
アリアケジャパン	12,200	8,030.00	97,966,000
ピエトロ	1,800	1,638.00	2,948,400
エバラ食品工業	3,300	2,175.00	7,177,500
やまみ	600	1,994.00	1,196,400
ニチレイ	63,800	2,537.00	161,860,600
東洋水産	68,900	4,770.00	328,653,000
イトアンド	4,600	1,800.00	8,280,000

大冷	1,700	1,999.00	3,398,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,300	1,089.00	7,949,700
日清食品ホールディングス	56,900	8,340.00	474,546,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,177.00	14,150,500
一正蒲鉾	5,200	1,092.00	5,678,400
フジッコ	14,500	1,988.00	28,826,000
ロック・フィールド	14,400	1,520.00	21,888,000
日本たばこ産業	773,500	2,488.50	1,924,854,750
ケンコーマヨネーズ	7,500	2,774.00	20,805,000
わらべや日洋ホールディングス	8,800	1,865.00	16,412,000
なとり	7,500	1,702.00	12,765,000
イフジ産業	2,300	764.00	1,757,200
ピクルスコーポレーション	2,900	2,708.00	7,853,200
北の達人コーポレーション	46,800	680.00	31,824,000
ユーグレナ	57,100	788.00	44,994,800
ミヨシ油脂	5,100	1,285.00	6,553,500
理研ビタミン	6,300	4,030.00	25,389,000
片倉工業	19,300	1,418.00	27,367,400
ゲンゼ	9,700	5,190.00	50,343,000
東洋紡	52,000	1,593.00	82,836,000
ユニチカ	39,500	370.00	14,615,000
富士紡ホールディングス	6,500	3,355.00	21,807,500
倉敷紡績	13,600	2,582.00	35,115,200
シキボウ	6,900	949.00	6,548,100
日本毛織	43,400	1,082.00	46,958,800
トーア紡コーポレーション	5,200	540.00	2,808,000
帝国繊維	14,900	2,013.00	29,993,700
帝人	106,900	2,064.00	220,641,600
東レ	947,100	738.20	699,149,220
サカイオーベックス	3,700	1,809.00	6,693,300
住江織物	3,800	2,887.00	10,970,600
日本フェルト	8,400	494.00	4,149,600
イチカワ	2,200	1,533.00	3,372,600
日東製網	1,500	1,598.00	2,397,000
アツギ	10,900	817.00	8,905,300
ダイニック	4,900	797.00	3,905,300
セーレン	32,400	1,533.00	49,669,200
ソトー	5,300	975.00	5,167,500
東海染工	1,900	1,128.00	2,143,200
小松マテーレ	21,600	844.00	18,230,400
ワコールホールディングス	34,200	2,888.00	98,769,600
ホギメディカル	14,900	3,610.00	53,789,000

レナウン	33,600	113.00	3,796,800
クラウドホールディングス	3,500	478.00	1,673,000
T S Iホールディングス	44,000	574.00	25,256,000
マツオカコーポレーション	3,800	2,307.00	8,766,600
ワールド	18,600	2,855.00	53,103,000
三陽商会	6,900	1,460.00	10,074,000
ナイガイ	5,000	444.00	2,220,000
オンワードホールディングス	78,700	631.00	49,659,700
ルックホールディングス	4,600	1,123.00	5,165,800
ゴールドウイン	23,700	7,440.00	176,328,000
デサント	25,600	1,546.00	39,577,600
キング	6,400	552.00	3,532,800
ヤマトインターナショナル	8,300	394.00	3,270,200
特種東海製紙	8,300	4,020.00	33,366,000
王子ホールディングス	546,500	617.00	337,190,500
日本製紙	57,800	1,881.00	108,721,800
三菱製紙	14,800	512.00	7,577,600
北越コーポレーション	86,700	562.00	48,725,400
中越パルプ工業	5,500	1,660.00	9,130,000
巴川製紙所	3,900	873.00	3,404,700
大王製紙	57,300	1,494.00	85,606,200
阿波製紙	3,400	497.00	1,689,800
レンゴー	123,600	794.00	98,138,400
トモク	8,000	1,818.00	14,544,000
ザ・パック	9,900	3,790.00	37,521,000
クラレ	205,900	1,323.00	272,405,700
旭化成	871,900	1,201.50	1,047,587,850
共和レザー	7,100	807.00	5,729,700
昭和電工	93,100	3,135.00	291,868,500
住友化学	960,400	509.00	488,843,600
住友精化	5,800	3,690.00	21,402,000
日産化学	73,100	4,485.00	327,853,500
ラサ工業	4,600	1,505.00	6,923,000
クレハ	11,200	6,710.00	75,152,000
多木化学	3,800	4,485.00	17,043,000
テイカ	9,600	1,962.00	18,835,200
石原産業	23,400	1,193.00	27,916,200
片倉コープアグリ	3,400	1,182.00	4,018,800
日本曹達	19,300	2,949.00	56,915,700
東ソー	202,100	1,622.00	327,806,200
トクヤマ	37,700	2,976.00	112,195,200
セントラル硝子	26,700	2,693.00	71,903,100

東亜合成	82,000	1,249.00	102,418,000
大阪ソーダ	13,300	3,035.00	40,365,500
関東電化工業	31,000	1,084.00	33,604,000
デンカ	47,700	3,335.00	159,079,500
信越化学工業	230,400	11,725.00	2,701,440,000
日本カーバイド工業	4,400	1,503.00	6,613,200
堺化学工業	8,500	2,576.00	21,896,000
第一稀元素化学工業	14,200	845.00	11,999,000
エア・ウォーター	107,000	2,082.00	222,774,000
大陽日酸	125,600	2,602.00	326,811,200
日本化学工業	4,100	3,330.00	13,653,000
東邦アセチレン	2,000	1,388.00	2,776,000
日本パーカライズン	65,900	1,195.00	78,750,500
高压ガス工業	20,700	826.00	17,098,200
チタン工業	1,600	2,628.00	4,204,800
四国化成工業	20,200	1,275.00	25,755,000
戸田工業	3,000	2,264.00	6,792,000
ステラ ケミファ	7,100	3,285.00	23,323,500
保土谷化学工業	4,900	3,715.00	18,203,500
日本触媒	20,300	6,810.00	138,243,000
大日精化工業	11,600	3,285.00	38,106,000
カネカ	33,800	3,645.00	123,201,000
三菱瓦斯化学	123,400	1,639.00	202,252,600
三井化学	118,700	2,660.00	315,742,000
J S R	121,800	1,988.00	242,138,400
東京応化工業	22,400	3,960.00	88,704,000
大阪有機化学工業	12,100	1,279.00	15,475,900
三菱ケミカルホールディングス	873,900	835.10	729,793,890
K Hネオケム	23,000	2,486.00	57,178,000
ダイセル	178,800	1,098.00	196,322,400
住友ベークライト	20,600	4,555.00	93,833,000
積水化学工業	281,100	1,889.00	530,997,900
日本ゼオン	117,900	1,399.00	164,942,100
アイカ工業	39,200	3,400.00	133,280,000
宇部興産	66,000	2,352.00	155,232,000
積水樹脂	23,500	2,347.00	55,154,500
タキロンシーアイ	28,300	673.00	19,045,900
旭有機材	7,400	1,749.00	12,942,600
日立化成	60,400	3,400.00	205,360,000
ニチバン	6,900	1,941.00	13,392,900
リケンテクノス	32,900	519.00	17,075,100
大倉工業	6,200	1,941.00	12,034,200

積水化成成品工業	17,500	808.00	14,140,000
群栄化学工業	3,000	2,476.00	7,428,000
タイガースポリマー	6,900	585.00	4,036,500
ミライアル	4,600	1,377.00	6,334,200
ダイキアクシス	4,600	1,023.00	4,705,800
ダイキョーニシカワ	27,600	866.00	23,901,600
竹本容器	4,700	997.00	4,685,900
森六ホールディングス	7,000	2,411.00	16,877,000
日本化薬	80,900	1,363.00	110,266,700
カーリットホールディングス	14,000	625.00	8,750,000
日本精化	10,500	1,269.00	13,324,500
扶桑化学工業	13,200	3,160.00	41,712,000
トリケミカル研究所	2,900	8,400.00	24,360,000
A D E K A	60,200	1,686.00	101,497,200
日油	49,200	3,660.00	180,072,000
新日本理化	21,600	219.00	4,730,400
ハリマ化成グループ	10,800	1,223.00	13,208,400
花王	319,600	8,424.00	2,692,310,400
第一工業製薬	4,900	3,735.00	18,301,500
石原ケミカル	3,500	1,770.00	6,195,000
日華化学	4,400	897.00	3,946,800
ニイタカ	2,000	1,750.00	3,500,000
三洋化成工業	7,800	5,410.00	42,198,000
有機合成薬品工業	10,000	295.00	2,950,000
大日本塗料	14,800	1,147.00	16,975,600
日本ペイントホールディングス	107,900	6,110.00	659,269,000
関西ペイント	146,900	2,719.00	399,421,100
神東塗料	10,300	193.00	1,987,900
中国塗料	37,200	1,031.00	38,353,200
日本特殊塗料	9,800	1,436.00	14,072,800
藤倉化成	17,600	584.00	10,278,400
太陽ホールディングス	9,600	4,275.00	41,040,000
D I C	55,200	2,995.00	165,324,000
サカタインクス	28,500	1,177.00	33,544,500
東洋インキ S C ホールディングス	27,600	2,682.00	74,023,200
T & K T O K A	10,100	1,001.00	10,110,100
富士フイルムホールディングス	255,900	5,178.00	1,325,050,200
資生堂	265,200	8,040.00	2,132,208,000
ライオン	173,500	2,174.00	377,189,000
高砂香料工業	8,400	2,543.00	21,361,200
マンダム	30,000	2,905.00	87,150,000
ミルボン	17,800	6,010.00	106,978,000

ファンケル	54,000	3,055.00	164,970,000
コーセー	25,100	17,620.00	442,262,000
コタ	7,000	1,398.00	9,786,000
シーボン	1,600	2,510.00	4,016,000
ポーラ・オルビスホールディングス	57,000	2,580.00	147,060,000
ノエビアホールディングス	12,700	6,160.00	78,232,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	952.00	2,856,000
エステー	8,600	1,661.00	14,284,600
アグロ カネショウ	4,200	1,425.00	5,985,000
コニシ	21,900	1,497.00	32,784,300
長谷川香料	17,700	1,956.00	34,621,200
星光PMC	7,600	1,006.00	7,645,600
小林製薬	37,400	8,810.00	329,494,000
荒川化学工業	12,000	1,566.00	18,792,000
メック	9,100	1,813.00	16,498,300
日本高純度化学	3,700	2,635.00	9,749,500
タカラバイオ	34,900	2,163.00	75,488,700
JCU	16,200	2,704.00	43,804,800
新田ゼラチン	8,400	728.00	6,115,200
OATアグリオ	2,300	1,586.00	3,647,800
デクセリアルズ	34,400	1,095.00	37,668,000
アース製薬	10,100	5,700.00	57,570,000
北興化学工業	13,700	616.00	8,439,200
大成ラミック	4,400	2,951.00	12,984,400
クミアイ化学工業	55,200	1,011.00	55,807,200
日本農薬	23,800	554.00	13,185,200
アキレス	9,200	1,857.00	17,084,400
有沢製作所	21,100	996.00	21,015,600
日東電工	92,100	6,180.00	569,178,000
レック	14,200	1,256.00	17,835,200
三光合成	15,300	430.00	6,579,000
きもと	22,700	181.00	4,108,700
藤森工業	12,000	3,515.00	42,180,000
前澤化成工業	8,500	1,221.00	10,378,500
未来工業	7,200	2,161.00	15,559,200
ウェーブロックホールディングス	4,600	793.00	3,647,800
JSP	7,800	1,974.00	15,397,200
エフピコ	14,700	6,520.00	95,844,000
天馬	8,900	1,980.00	17,622,000
信越ポリマー	24,000	972.00	23,328,000
東リ	33,200	302.00	10,026,400
ニフコ	49,000	3,005.00	147,245,000

バルカー	10,800	2,562.00	27,669,600
ユニ・チャーム	257,300	3,406.00	876,363,800
ショーエイコーポレーション	1,500	737.00	1,105,500
協和キリン	134,300	2,231.00	299,623,300
武田薬品工業	1,110,500	4,562.00	5,066,101,000
アステラス製薬	1,174,100	1,832.50	2,151,538,250
大日本住友製薬	98,900	2,001.00	197,898,900
塩野義製薬	170,700	6,363.00	1,086,164,100
田辺三菱製薬	162,900	1,638.00	266,830,200
わかもと製薬	15,900	278.00	4,420,200
あすか製薬	15,200	1,160.00	17,632,000
日本新薬	34,900	9,650.00	336,785,000
ピオフェルミン製薬	2,300	2,271.00	5,223,300
中外製薬	139,200	9,271.00	1,290,523,200
科研製薬	22,800	5,820.00	132,696,000
エーザイ	159,800	7,686.00	1,228,222,800
ロート製薬	68,500	3,485.00	238,722,500
小野薬品工業	315,200	2,407.00	758,686,400
久光製薬	39,400	5,220.00	205,668,000
持田製薬	18,500	4,420.00	81,770,000
参天製薬	248,500	2,054.00	510,419,000
扶桑薬品工業	4,700	2,108.00	9,907,600
日本ケミファ	1,800	2,880.00	5,184,000
ツムラ	41,400	3,185.00	131,859,000
日医工	37,800	1,272.00	48,081,600
キッセイ薬品工業	23,600	2,849.00	67,236,400
生化学工業	25,900	1,254.00	32,478,600
栄研化学	23,500	1,905.00	44,767,500
日水製薬	5,600	1,300.00	7,280,000
鳥居薬品	8,400	2,844.00	23,889,600
JCRファーマ	9,400	8,990.00	84,506,000
東和薬品	17,100	2,752.00	47,059,200
富士製薬工業	9,100	1,368.00	12,448,800
沢井製薬	27,400	6,410.00	175,634,000
ゼリア新薬工業	24,200	2,090.00	50,578,000
第一三共	382,000	6,822.00	2,606,004,000
キョーリン製薬ホールディングス	29,500	1,853.00	54,663,500
大幸薬品	5,400	2,997.00	16,183,800
ダイト	7,800	3,210.00	25,038,000
大塚ホールディングス	254,300	4,851.00	1,233,609,300
大正製薬ホールディングス	28,200	7,820.00	220,524,000
ペプチドリーム	67,500	5,040.00	340,200,000

日本コークス工業	112,800	83.00	9,362,400
ニチレキ	15,800	1,319.00	20,840,200
ユシロ化学工業	7,500	1,392.00	10,440,000
ビーピー・カストロール	4,800	1,531.00	7,348,800
富士石油	35,600	238.00	8,472,800
MORESCO	4,800	1,369.00	6,571,200
出光興産	150,100	3,000.00	450,300,000
JXTGホールディングス	2,070,100	492.60	1,019,731,260
コスモエネルギーホールディングス	38,600	2,304.00	88,934,400
横浜ゴム	77,300	2,299.00	177,712,700
TOYO TIRE	76,600	1,547.00	118,500,200
ブリヂストン	410,300	4,349.00	1,784,394,700
住友ゴム工業	119,900	1,385.00	166,061,500
藤倉コンポジット	11,700	482.00	5,639,400
オカモト	8,100	4,235.00	34,303,500
フコク	5,800	722.00	4,187,600
ニッタ	15,100	3,200.00	48,320,000
住友理工	25,900	989.00	25,615,100
三ツ星ベルト	17,600	2,120.00	37,312,000
バンドー化学	23,500	958.00	22,513,000
日東紡績	19,900	3,800.00	75,620,000
AGC	132,000	4,010.00	529,320,000
日本板硝子	63,800	646.00	41,214,800
石塚硝子	2,400	2,257.00	5,416,800
日本山村硝子	5,600	1,272.00	7,123,200
日本電気硝子	53,600	2,365.00	126,764,000
オハラ	5,300	1,500.00	7,950,000
住友大阪セメント	25,300	4,735.00	119,795,500
太平洋セメント	84,300	3,225.00	271,867,500
日本ヒューム	13,400	802.00	10,746,800
日本コンクリート工業	28,800	273.00	7,862,400
三谷セキサン	6,200	3,580.00	22,196,000
アジアパイルホールディングス	19,000	565.00	10,735,000
東海カーボン	139,900	1,063.00	148,713,700
日本カーボン	6,900	4,235.00	29,221,500
東洋炭素	7,800	2,430.00	18,954,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	4,590.00	33,966,000
TOTO	95,400	4,660.00	444,564,000
日本碍子	162,900	1,795.00	292,405,500
日本特殊陶業	103,900	2,165.00	224,943,500
MARUWA	5,100	7,620.00	38,862,000
品川リフラクトリーズ	3,500	3,160.00	11,060,000

黒崎播磨	2,700	5,980.00	16,146,000
ヨータイ	10,700	735.00	7,864,500
イソライト工業	6,900	685.00	4,726,500
東京窯業	17,100	346.00	5,916,600
ニッカトー	6,100	766.00	4,672,600
フジインコーポレーテッド	11,900	2,910.00	34,629,000
クニミネ工業	5,400	1,323.00	7,144,200
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,255.00	2,886,500
ニチアス	36,500	2,512.00	91,688,000
ニチハ	18,600	3,010.00	55,986,000
日本製鉄	590,800	1,580.50	933,759,400
神戸製鋼所	241,700	551.00	133,176,700
中山製鋼所	18,400	490.00	9,016,000
合同製鐵	7,100	2,547.00	18,083,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	356,500	1,300.00	463,450,000
東京製鐵	64,300	832.00	53,497,600
共英製鋼	14,900	2,008.00	29,919,200
大和工業	28,100	2,708.00	76,094,800
東京鐵鋼	5,500	1,587.00	8,728,500
大阪製鐵	7,100	1,417.00	10,060,700
淀川製鋼所	17,900	2,101.00	37,607,900
丸一鋼管	42,900	3,240.00	138,996,000
モリ工業	4,000	2,344.00	9,376,000
大同特殊鋼	21,600	5,150.00	111,240,000
日本高周波鋼業	5,000	429.00	2,145,000
日本冶金工業	10,900	2,341.00	25,516,900
山陽特殊製鋼	9,600	1,503.00	14,428,800
愛知製鋼	7,400	3,530.00	26,122,000
日立金属	142,200	1,450.00	206,190,000
日本金属	3,100	961.00	2,979,100
大太平洋金属	9,000	2,316.00	20,844,000
新日本電工	85,400	169.00	14,432,600
栗本鐵工所	6,700	1,913.00	12,817,100
虹技	2,000	1,417.00	2,834,000
三菱製鋼	9,800	1,104.00	10,819,200
日亜鋼業	19,500	351.00	6,844,500
日本精線	2,200	2,908.00	6,397,600
エンビプロ・ホールディングス	5,100	760.00	3,876,000
シンニッタン	20,700	442.00	9,149,400
新家工業	3,000	1,414.00	4,242,000
大紀アルミニウム工業所	21,900	788.00	17,257,200
日本軽金属ホールディングス	334,600	233.00	77,961,800

三井金属鉱業	35,700	2,725.00	97,282,500
東邦亜鉛	6,800	2,042.00	13,885,600
三菱マテリアル	87,200	3,010.00	262,472,000
住友金属鉱山	168,800	3,301.00	557,208,800
DOWAホールディングス	33,400	3,965.00	132,431,000
古河機械金属	23,600	1,532.00	36,155,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,800	1,682.00	23,211,600
東邦チタニウム	23,800	953.00	22,681,400
UACJ	20,100	2,458.00	49,405,800
CKサンエツ	2,500	3,100.00	7,750,000
古河電気工業	41,000	2,994.00	122,754,000
住友電気工業	493,600	1,538.50	759,403,600
フジクラ	159,700	459.00	73,302,300
昭和電線ホールディングス	15,300	1,037.00	15,866,100
東京特殊電線	2,000	2,126.00	4,252,000
タツタ電線	26,400	570.00	15,048,000
カナレ電気	2,300	1,867.00	4,294,100
平河ヒューテック	5,000	1,258.00	6,290,000
リョービ	16,300	2,145.00	34,963,500
アーレスティ	17,500	551.00	9,642,500
アサヒホールディングス	23,200	2,533.00	58,765,600
稲葉製作所	7,400	1,451.00	10,737,400
宮地エンジニアリンググループ	4,000	2,114.00	8,456,000
トーカロ	36,700	1,117.00	40,993,900
アルファC o	4,600	1,312.00	6,035,200
SUMCO	158,000	1,695.00	267,810,000
川田テクノロジーズ	2,700	6,730.00	18,171,000
RS Technologies	3,700	3,860.00	14,282,000
信和	5,700	1,049.00	5,979,300
東洋製罐グループホールディングス	84,100	1,923.00	161,724,300
ホッカンホールディングス	7,300	1,894.00	13,826,200
コロナ	7,300	1,158.00	8,453,400
横河ブリッジホールディングス	24,500	1,929.00	47,260,500
駒井ハルテック	2,500	1,716.00	4,290,000
高田機工	1,200	2,612.00	3,134,400
三和ホールディングス	126,600	1,264.00	160,022,400
文化シャッター	38,900	1,004.00	39,055,600
三協立山	18,300	1,224.00	22,399,200
アルインコ	9,600	1,190.00	11,424,000
東洋シャッター	3,200	744.00	2,380,800
LIXILグループ	194,800	2,023.00	394,080,400
日本ファイルコン	10,100	561.00	5,666,100

ノーリツ	27,400	1,431.00	39,209,400
長府製作所	13,400	2,402.00	32,186,800
リンナイ	25,700	8,550.00	219,735,000
ダイニチ工業	7,100	693.00	4,920,300
日東精工	18,200	562.00	10,228,400
三洋工業	1,800	2,066.00	3,718,800
岡部	26,700	923.00	24,644,100
ジーテクト	16,400	1,917.00	31,438,800
東プレ	24,600	1,820.00	44,772,000
高周波熱錬	25,400	908.00	23,063,200
東京製綱	9,400	1,159.00	10,894,600
サンコール	7,400	493.00	3,648,200
モリテック スチール	10,300	423.00	4,356,900
パイオラックス	19,500	2,182.00	42,549,000
エイチワン	12,900	714.00	9,210,600
日本発條	141,600	956.00	135,369,600
中央発條	1,600	2,853.00	4,564,800
アドバネクス	1,900	1,680.00	3,192,000
立川ブラインド工業	5,800	1,457.00	8,450,600
三益半導体工業	11,800	2,069.00	24,414,200
日本ドライケミカル	3,400	1,300.00	4,420,000
日本製鋼所	40,100	2,248.00	90,144,800
三浦工業	57,100	3,650.00	208,415,000
タクマ	44,800	1,229.00	55,059,200
ツガミ	27,500	1,037.00	28,517,500
オークマ	15,400	6,150.00	94,710,000
東芝機械	15,000	2,706.00	40,590,000
アマダホールディングス	167,900	1,238.00	207,860,200
アイダエンジニアリング	35,800	980.00	35,084,000
滝澤鉄工所	4,200	1,401.00	5,884,200
F U J I	56,800	2,009.00	114,111,200
牧野フライス製作所	15,500	5,290.00	81,995,000
オーエスジー	61,000	2,282.00	139,202,000
ダイジェット工業	1,600	1,487.00	2,379,200
旭ダイヤモンド工業	34,800	664.00	23,107,200
D M G 森精機	83,600	1,733.00	144,878,800
ソディック	31,200	972.00	30,326,400
ディスコ	17,900	23,740.00	424,946,000
日東工器	7,300	2,361.00	17,235,300
日進工具	4,000	2,300.00	9,200,000
パンチ工業	12,300	550.00	6,765,000
富士ダイス	6,100	651.00	3,971,100

豊和工業	7,400	747.00	5,527,800
OKK	5,600	683.00	3,824,800
東洋機械金属	9,700	571.00	5,538,700
津田駒工業	2,600	1,374.00	3,572,400
エンシュウ	3,200	1,377.00	4,406,400
島精機製作所	21,300	2,777.00	59,150,100
オプトラン	14,800	2,958.00	43,778,400
NCホールディングス	4,300	549.00	2,360,700
イワキポンプ	6,500	1,153.00	7,494,500
フリー	13,100	1,023.00	13,401,300
ヤマシンフィルタ	28,900	969.00	28,004,100
日阪製作所	16,500	990.00	16,335,000
やまびこ	25,700	1,147.00	29,477,900
平田機工	6,300	7,430.00	46,809,000
ペガサスミシン製造	13,700	515.00	7,055,500
マルマエ	5,600	1,073.00	6,008,800
タツモ	6,300	1,218.00	7,673,400
ナプテスコ	77,800	3,345.00	260,241,000
三井海洋開発	14,100	2,525.00	35,602,500
レオン自動機	13,000	1,694.00	22,022,000
SMC	41,900	48,440.00	2,029,636,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	11,800	537.00	6,336,600
ホソカワミクロン	4,700	4,255.00	19,998,500
ユニオンツール	5,000	3,285.00	16,425,000
オイレス工業	17,200	1,711.00	29,429,200
日精エー・エス・ビー機械	4,500	4,715.00	21,217,500
サトーホールディングス	18,900	3,290.00	62,181,000
技研製作所	11,600	4,040.00	46,864,000
日本エアーテック	4,400	707.00	3,110,800
カワタ	4,000	1,150.00	4,600,000
日精樹脂工業	11,200	1,012.00	11,334,400
オカダアイヨン	4,300	1,290.00	5,547,000
ワイエイシイホールディングス	5,700	710.00	4,047,000
小松製作所	604,600	2,602.00	1,573,169,200
住友重機械工業	76,400	3,140.00	239,896,000
日立建機	53,500	2,785.00	148,997,500
日工	18,400	709.00	13,045,600
巴工業	5,800	2,313.00	13,415,400
井関農機	13,400	1,620.00	21,708,000
TOWA	13,600	1,200.00	16,320,000
丸山製作所	3,000	1,257.00	3,771,000
北川鉄工所	6,100	2,263.00	13,804,300

ローツェ	5,900	3,840.00	22,656,000
タカキタ	4,900	568.00	2,783,200
クボタ	708,200	1,687.50	1,195,087,500
荏原実業	3,400	2,135.00	7,259,000
三菱化工機	4,600	2,016.00	9,273,600
月島機械	24,600	1,708.00	42,016,800
帝国電機製作所	11,100	1,306.00	14,496,600
新東工業	31,800	1,032.00	32,817,600
澁谷工業	11,700	3,045.00	35,626,500
アイチ コーポレーション	23,200	688.00	15,961,600
小森コーポレーション	33,900	1,172.00	39,730,800
鶴見製作所	10,400	2,083.00	21,663,200
住友精密工業	2,000	3,420.00	6,840,000
日本ギア工業	4,400	416.00	1,830,400
酒井重工業	2,500	3,095.00	7,737,500
荏原製作所	59,200	3,300.00	195,360,000
石井鐵工所	1,800	2,468.00	4,442,400
西島製作所	13,600	991.00	13,477,600
北越工業	13,900	1,268.00	17,625,200
ダイキン工業	170,100	15,490.00	2,634,849,000
オルガノ	4,800	6,810.00	32,688,000
トーヨーカネツ	5,900	2,320.00	13,688,000
栗田工業	72,300	3,090.00	223,407,000
椿本チエイン	19,100	3,800.00	72,580,000
大同工業	6,500	862.00	5,603,000
木村化工機	11,400	522.00	5,950,800
アネスト岩田	20,900	1,001.00	20,920,900
ダイフク	68,200	6,200.00	422,840,000
サムコ	3,800	1,130.00	4,294,000
加藤製作所	7,400	1,855.00	13,727,000
油研工業	2,300	1,715.00	3,944,500
タダノ	64,500	1,035.00	66,757,500
フジテック	48,600	1,690.00	82,134,000
C K D	37,200	1,830.00	68,076,000
キトー	10,200	1,655.00	16,881,000
平和	37,300	2,298.00	85,715,400
理想科学工業	11,900	1,935.00	23,026,500
S A N K Y O	29,800	3,775.00	112,495,000
日本金銭機械	15,000	947.00	14,205,000
マースグループホールディングス	8,600	2,020.00	17,372,000
福島工業	8,300	3,690.00	30,627,000
オーイズミ	5,900	600.00	3,540,000

ダイコク電機	6,200	1,582.00	9,808,400
竹内製作所	22,400	1,708.00	38,259,200
アマノ	35,000	3,215.00	112,525,000
J U K I	18,600	945.00	17,577,000
蛇の目ミシン工業	12,600	409.00	5,153,400
マックス	20,500	2,190.00	44,895,000
グローリー	37,000	3,385.00	125,245,000
新晃工業	12,500	2,032.00	25,400,000
大和冷機工業	19,400	1,267.00	24,579,800
セガサミーホールディングス	132,500	1,587.00	210,277,500
日本ピストンリング	5,000	1,441.00	7,205,000
リケン	6,200	4,190.00	25,978,000
T P R	18,000	2,099.00	37,782,000
ツバキ・ナカシマ	27,300	1,807.00	49,331,100
ホシザキ	39,000	9,560.00	372,840,000
大豊工業	11,100	875.00	9,712,500
日本精工	251,500	1,049.00	263,823,500
N T N	309,400	335.00	103,649,000
ジェイテクト	128,200	1,395.00	178,839,000
不二越	12,400	5,080.00	62,992,000
日本トムソン	40,000	489.00	19,560,000
T H K	77,700	2,989.00	232,245,300
ユーシン精機	10,500	1,010.00	10,605,000
前澤給装工業	4,900	2,108.00	10,329,200
イーグル工業	16,700	1,124.00	18,770,800
前澤工業	9,300	398.00	3,701,400
日本ピラー工業	13,600	1,451.00	19,733,600
キッツ	54,300	758.00	41,159,400
マキタ	174,100	3,625.00	631,112,500
日立造船	106,100	415.00	44,031,500
三菱重工業	223,700	4,273.00	955,870,100
I H I	96,200	2,552.00	245,502,400
スター精密	21,000	1,522.00	31,962,000
日清紡ホールディングス	89,100	992.00	88,387,200
イビデン	82,000	2,536.00	207,952,000
コニカミノルタ	292,500	733.00	214,402,500
ブラザー工業	163,300	2,228.00	363,832,400
ミネベアミツミ	248,100	2,096.00	520,017,600
日立製作所	641,400	4,093.00	2,625,250,200
三菱電機	1,334,800	1,519.00	2,027,561,200
富士電機	80,500	3,295.00	265,247,500
東洋電機製造	5,300	1,560.00	8,268,000

安川電機	143,700	4,105.00	589,888,500
シンフォニアテクノロジー	17,400	1,380.00	24,012,000
明電舎	24,600	2,084.00	51,266,400
オリジン	3,700	1,494.00	5,527,800
山洋電気	6,600	5,320.00	35,112,000
デンヨー	11,400	2,054.00	23,415,600
東芝テック	16,800	4,140.00	69,552,000
芝浦メカトロニクス	2,500	4,030.00	10,075,000
マブチモーター	37,100	4,380.00	162,498,000
日本電産	160,700	15,975.00	2,567,182,500
トレックス・セミコンダクター	8,100	1,433.00	11,607,300
東光高岳	8,000	1,148.00	9,184,000
ダイヘン	14,600	3,620.00	52,852,000
ヤーマン	20,300	683.00	13,864,900
JVCケンウッド	111,200	274.00	30,468,800
ミマキエンジニアリング	13,200	538.00	7,101,600
第一精工	5,100	2,682.00	13,678,200
日新電機	31,400	1,145.00	35,953,000
大崎電気工業	26,700	730.00	19,491,000
オムロン	124,200	6,560.00	814,752,000
日東工業	19,700	2,342.00	46,137,400
I D E C	19,300	2,312.00	44,621,600
正興電機製作所	3,900	803.00	3,131,700
不二電機工業	1,900	1,257.00	2,388,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,900	2,222.00	99,767,800
サクサホールディングス	3,200	1,988.00	6,361,600
メルコホールディングス	4,800	3,010.00	14,448,000
テクノメディカ	3,300	2,104.00	6,943,200
日本電気	161,900	4,400.00	712,360,000
富士通	128,700	9,809.00	1,262,418,300
沖電気工業	54,300	1,531.00	83,133,300
岩崎通信機	5,800	812.00	4,709,600
電気興業	6,500	3,260.00	21,190,000
サンケン電気	14,600	3,175.00	46,355,000
ナカヨ	2,700	1,715.00	4,630,500
アイホン	7,600	1,886.00	14,333,600
ルネサスエレクトロニクス	637,400	728.00	464,027,200
セイコーエプソン	165,700	1,578.00	261,474,600
ワコム	91,300	440.00	40,172,000
アルバック	26,600	4,360.00	115,976,000
アクセル	6,600	671.00	4,428,600
E I Z O	10,400	4,180.00	43,472,000

日本信号	34,100	1,267.00	43,204,700
京三製作所	31,500	504.00	15,876,000
能美防災	17,900	2,266.00	40,561,400
ホーチキ	10,100	1,581.00	15,968,100
星和電機	7,700	564.00	4,342,800
エレコム	14,600	4,095.00	59,787,000
パナソニック	1,525,100	1,001.50	1,527,387,650
シャープ	154,500	1,695.00	261,877,500
アンリツ	86,000	2,125.00	182,750,000
富士通ゼネラル	36,300	2,052.00	74,487,600
ソニー	843,600	6,755.00	5,698,518,000
T D K	64,500	11,240.00	724,980,000
帝国通信工業	6,400	1,204.00	7,705,600
タムラ製作所	44,800	649.00	29,075,200
アルプスアルパイン	118,400	2,393.00	283,331,200
池上通信機	4,200	1,065.00	4,473,000
鈴木	8,000	804.00	6,432,000
日本トリム	1,900	5,000.00	9,500,000
ローランド ディー . ジー .	7,700	2,140.00	16,478,000
フォスター電機	14,100	2,010.00	28,341,000
S M K	3,500	3,035.00	10,622,500
ヨコオ	8,900	3,155.00	28,079,500
ホシデン	37,000	1,292.00	47,804,000
ヒロセ電機	20,700	13,630.00	282,141,000
日本航空電子工業	30,700	2,130.00	65,391,000
T O A	14,400	1,099.00	15,825,600
マクセルホールディングス	29,200	1,500.00	43,800,000
古野電気	17,700	1,228.00	21,735,600
ユニデンホールディングス	3,700	1,804.00	6,674,800
スミダコーポレーション	10,800	1,286.00	13,888,800
アイコム	7,400	2,710.00	20,054,000
リオン	5,900	2,591.00	15,286,900
本多通信工業	12,700	496.00	6,299,200
横河電機	122,500	1,856.00	227,360,000
新電元工業	4,800	3,695.00	17,736,000
アズビル	84,300	3,185.00	268,495,500
東亜ディーケーケー	7,300	858.00	6,263,400
日本光電工業	55,400	2,949.00	163,374,600
チノー	4,700	1,438.00	6,758,600
共和電業	14,300	424.00	6,063,200
日本電子材料	5,500	801.00	4,405,500
堀場製作所	26,500	7,330.00	194,245,000

アドバンテスト	99,300	5,560.00	552,108,000
小野測器	6,800	531.00	3,610,800
エスベック	12,200	2,042.00	24,912,400
キーエンス	121,000	36,560.00	4,423,760,000
日置電機	7,200	3,770.00	27,144,000
シスメックス	95,400	7,764.00	740,685,600
日本マイクロニクス	23,900	1,173.00	28,034,700
メガチップス	12,700	2,411.00	30,619,700
O B A R A G R O U P	7,100	3,995.00	28,364,500
澤藤電機	2,000	2,128.00	4,256,000
原田工業	7,100	937.00	6,652,700
コーセル	16,800	1,273.00	21,386,400
イリソ電子工業	11,300	5,240.00	59,212,000
オブテックスグループ	22,300	1,580.00	35,234,000
千代田インテグレ	6,500	2,365.00	15,372,500
アイ・オー・データ機器	5,600	959.00	5,370,400
レーザーテック	27,400	8,840.00	242,216,000
スタンレー電気	94,400	3,000.00	283,200,000
岩崎電気	5,600	1,413.00	7,912,800
ウシオ電機	77,900	1,649.00	128,457,100
岡谷電機産業	10,900	379.00	4,131,100
ヘリオス テクノ ホールディング	13,500	486.00	6,561,000
エノモト	4,500	1,144.00	5,148,000
日本セラミック	13,800	2,809.00	38,764,200
遠藤照明	7,700	696.00	5,359,200
古河電池	10,400	777.00	8,080,800
双信電機	7,900	452.00	3,570,800
山一電機	10,100	1,599.00	16,149,900
図研	9,000	2,278.00	20,502,000
日本電子	26,500	3,010.00	79,765,000
カシオ計算機	118,100	1,986.00	234,546,600
ファナック	126,800	20,820.00	2,639,976,000
日本シイエムケイ	32,300	697.00	22,513,100
エンプラス	7,000	3,625.00	25,375,000
大真空	5,500	1,077.00	5,923,500
ローム	59,300	8,770.00	520,061,000
浜松ホトニクス	95,900	4,585.00	439,701,500
三井ハイテック	15,100	2,049.00	30,939,900
新光電気工業	45,400	1,117.00	50,711,800
京セラ	187,900	7,039.00	1,322,628,100
太陽誘電	59,600	2,845.00	169,562,000
村田製作所	392,200	6,172.00	2,420,658,400

双葉電子工業	21,600	1,385.00	29,916,000
北陸電気工業	5,900	1,115.00	6,578,500
ニチコン	45,800	1,121.00	51,341,800
日本ケミコン	10,100	1,928.00	19,472,800
K O A	20,600	1,409.00	29,025,400
市光工業	20,800	824.00	17,139,200
小糸製作所	80,100	5,530.00	442,953,000
ミツバ	25,400	741.00	18,821,400
S C R E E Nホールディングス	23,200	7,470.00	173,304,000
キャノン電子	14,300	1,996.00	28,542,800
キャノン	718,600	3,023.00	2,172,327,800
リコー	339,700	1,119.00	380,124,300
象印マホービン	39,500	1,749.00	69,085,500
M U T O Hホールディングス	2,200	1,821.00	4,006,200
東京エレクトロン	89,000	22,870.00	2,035,430,000
トヨタ紡織	38,900	1,736.00	67,530,400
芦森工業	2,800	1,413.00	3,956,400
ユニプレス	25,900	1,660.00	42,994,000
豊田自動織機	108,000	6,420.00	693,360,000
モリタホールディングス	23,400	1,776.00	41,558,400
三櫻工業	17,000	1,483.00	25,211,000
デンソー	293,900	4,940.00	1,451,866,000
東海理化電機製作所	35,200	2,073.00	72,969,600
三井E & Sホールディングス	48,200	869.00	41,885,800
川崎重工業	103,900	2,491.00	258,814,900
名村造船所	43,000	283.00	12,169,000
日本車輛製造	4,900	2,947.00	14,440,300
三菱ロジスネクスト	17,700	1,088.00	19,257,600
近畿車輛	2,000	1,458.00	2,916,000
日産自動車	1,574,200	680.30	1,070,928,260
いすゞ自動車	386,700	1,287.50	497,876,250
トヨタ自動車	1,487,400	7,754.00	11,533,299,600
日野自動車	166,700	1,051.00	175,201,700
三菱自動車工業	494,100	494.00	244,085,400
エフテック	9,400	718.00	6,749,200
レシップホールディングス	5,200	664.00	3,452,800
G M B	2,500	796.00	1,990,000
ファルテック	2,400	859.00	2,061,600
武蔵精密工業	29,800	1,527.00	45,504,600
日産車体	26,100	1,049.00	27,378,900
新明和工業	36,000	1,383.00	49,788,000
極東開発工業	24,800	1,576.00	39,084,800

日信工業	27,200	2,230.00	60,656,000
トピー工業	11,000	2,108.00	23,188,000
ティラド	4,900	2,137.00	10,471,300
曙ブレーキ工業	73,300	251.00	18,398,300
タチエス	22,000	1,444.00	31,768,000
N O K	71,800	1,667.00	119,690,600
フタバ産業	37,200	837.00	31,136,400
K Y B	14,900	3,320.00	49,468,000
大同メタル工業	25,700	701.00	18,015,700
プレス工業	66,300	463.00	30,696,900
ミクニ	17,200	342.00	5,882,400
太平洋工業	28,000	1,561.00	43,708,000
ケーヒン	30,700	2,574.00	79,021,800
河西工業	18,100	890.00	16,109,000
アイシン精機	109,900	4,090.00	449,491,000
マツダ	392,700	969.00	380,526,300
今仙電機製作所	12,500	953.00	11,912,500
本田技研工業	1,050,900	3,134.00	3,293,520,600
スズキ	264,500	4,946.00	1,308,217,000
S U B A R U	414,400	2,915.00	1,207,976,000
安永	6,500	1,297.00	8,430,500
ヤマハ発動機	174,100	2,297.00	399,907,700
ショーワ	31,500	2,273.00	71,599,500
T B K	16,000	427.00	6,832,000
エクセディ	18,200	2,425.00	44,135,000
豊田合成	43,100	2,499.00	107,706,900
愛三工業	21,000	901.00	18,921,000
盟和産業	2,100	1,170.00	2,457,000
日本プラスト	10,600	694.00	7,356,400
ヨロズ	12,500	1,435.00	17,937,500
エフ・シー・シー	21,800	2,337.00	50,946,600
シマノ	50,000	17,320.00	866,000,000
テイ・エス テック	31,000	3,435.00	106,485,000
ジャムコ	6,700	1,439.00	9,641,300
テルモ	377,700	3,822.00	1,443,569,400
クリエートメディック	4,400	1,059.00	4,659,600
日機装	40,100	1,280.00	51,328,000
日本エム・ディ・エム	7,700	2,143.00	16,501,100
島津製作所	159,500	3,195.00	509,602,500
J M S	11,300	698.00	7,887,400
長野計器	9,700	734.00	7,119,800
ブイ・テクノロジー	6,300	5,960.00	37,548,000

東京計器	8,500	1,014.00	8,619,000
愛知時計電機	1,800	4,205.00	7,569,000
インターアクション	7,200	2,302.00	16,574,400
オーバル	12,100	254.00	3,073,400
東京精密	24,200	3,930.00	95,106,000
マニー	53,200	2,916.00	155,131,200
ニコン	216,000	1,521.00	328,536,000
トプコン	67,200	1,443.00	96,969,600
オリンパス	738,600	1,685.00	1,244,541,000
理研計器	11,800	2,320.00	27,376,000
タムロン	10,800	2,440.00	26,352,000
H O Y A	268,700	9,724.00	2,612,838,800
シード	5,700	982.00	5,597,400
ノーリツ鋼機	9,000	1,709.00	15,381,000
エー・アンド・デイ	12,200	818.00	9,979,600
朝日インテック	113,300	3,145.00	356,328,500
シチズン時計	156,400	593.00	92,745,200
リズム時計工業	4,200	917.00	3,851,400
大研医器	9,300	529.00	4,919,700
メニコン	18,300	4,420.00	80,886,000
シンシア	1,500	608.00	912,000
松風	6,000	1,668.00	10,008,000
セイコーホールディングス	18,900	2,768.00	52,315,200
ニプロ	92,400	1,286.00	118,826,400
中本パックス	3,400	1,500.00	5,100,000
スノーピーク	6,100	1,080.00	6,588,000
パラマウントベッドホールディングス	14,100	4,205.00	59,290,500
トランザクション	8,500	979.00	8,321,500
S H O - B I	3,900	396.00	1,544,400
ニホンフラッシュ	6,200	2,500.00	15,500,000
前田工織	14,700	1,819.00	26,739,300
永大産業	17,400	346.00	6,020,400
アートネイチャー	14,300	739.00	10,567,700
バンダイナムコホールディングス	138,000	6,604.00	911,352,000
アイフィスジャパン	3,400	772.00	2,624,800
共立印刷	22,300	166.00	3,701,800
S H O E I	6,400	5,090.00	32,576,000
フランスベッドホールディングス	18,900	1,018.00	19,240,200
パイロットコーポレーション	23,300	4,220.00	98,326,000
萩原工業	7,400	1,637.00	12,113,800
トッパン・フォームズ	28,600	1,087.00	31,088,200
フジシールインターナショナル	29,900	2,450.00	73,255,000

タカラトミー	59,900	1,271.00	76,132,900
廣濟堂	9,300	769.00	7,151,700
エステールホールディングス	3,600	673.00	2,422,800
アーク	50,900	94.00	4,784,600
タカノ	5,200	798.00	4,149,600
プロネクサス	11,500	1,228.00	14,122,000
ホクシン	8,200	165.00	1,353,000
ウッドワン	4,500	1,197.00	5,386,500
大建工業	9,000	1,920.00	17,280,000
凸版印刷	188,400	2,177.00	410,146,800
大日本印刷	174,700	2,997.00	523,575,900
共同印刷	4,100	2,896.00	11,873,600
N I S S H A	27,400	1,161.00	31,811,400
光村印刷	1,200	1,732.00	2,078,400
宝印刷	6,400	1,747.00	11,180,800
アシックス	110,200	1,708.00	188,221,600
ツツミ	4,200	2,117.00	8,891,400
小松ウオール工業	4,100	2,374.00	9,733,400
ヤマハ	79,400	6,030.00	478,782,000
河合楽器製作所	4,100	3,600.00	14,760,000
クリナップ	12,400	653.00	8,097,200
ピジョン	80,700	5,070.00	409,149,000
兼松サステック	900	1,776.00	1,598,400
キングジム	11,100	888.00	9,856,800
リンテック	31,700	2,373.00	75,224,100
イトーキ	28,400	515.00	14,626,000
任天堂	81,800	42,330.00	3,462,594,000
三菱鉛筆	22,000	1,741.00	38,302,000
タカラスタANDARD	27,600	1,966.00	54,261,600
コクヨ	64,000	1,610.00	103,040,000
ナカバヤシ	13,100	598.00	7,833,800
グローブライド	6,000	2,793.00	16,758,000
オカムラ	46,600	1,064.00	49,582,400
美津濃	12,100	2,883.00	34,884,300
東京電力ホールディングス	1,065,500	488.00	519,964,000
中部電力	408,400	1,506.00	615,050,400
関西電力	505,700	1,226.50	620,241,050
中国電力	184,500	1,452.00	267,894,000
北陸電力	122,000	765.00	93,330,000
東北電力	333,400	1,078.00	359,405,200
四国電力	120,200	1,033.00	124,166,600
九州電力	275,100	936.00	257,493,600

北海道電力	124,900	524.00	65,447,600
沖縄電力	24,700	1,977.00	48,831,900
電源開発	106,200	2,592.00	275,270,400
エフオン	6,300	747.00	4,706,100
イーレックス	19,000	1,717.00	32,623,000
レノバ	22,000	1,220.00	26,840,000
東京瓦斯	256,700	2,581.00	662,542,700
大阪瓦斯	259,000	2,054.00	531,986,000
東邦瓦斯	66,100	4,050.00	267,705,000
北海道瓦斯	7,200	1,607.00	11,570,400
広島ガス	27,500	363.00	9,982,500
西部瓦斯	15,000	2,538.00	38,070,000
静岡ガス	37,900	897.00	33,996,300
メタウォーター	6,400	4,000.00	25,600,000
SBSホールディングス	11,500	1,963.00	22,574,500
東武鉄道	140,800	3,985.00	561,088,000
相鉄ホールディングス	42,700	3,045.00	130,021,500
東急	336,600	2,154.00	725,036,400
京浜急行電鉄	171,400	2,270.00	389,078,000
小田急電鉄	198,500	2,745.00	544,882,500
京王電鉄	69,300	7,080.00	490,644,000
京成電鉄	92,900	4,565.00	424,088,500
富士急行	18,200	4,285.00	77,987,000
新京成電鉄	3,400	2,279.00	7,748,600
東日本旅客鉄道	234,900	10,115.00	2,376,013,500
西日本旅客鉄道	118,900	9,770.00	1,161,653,000
東海旅客鉄道	111,000	22,400.00	2,486,400,000
西武ホールディングス	179,100	1,950.00	349,245,000
鴻池運輸	21,200	1,663.00	35,255,600
西日本鉄道	37,000	2,551.00	94,387,000
ハマキョウレックス	10,200	3,710.00	37,842,000
サカイ引越センター	7,000	6,820.00	47,740,000
近鉄グループホールディングス	126,400	6,230.00	787,472,000
阪急阪神ホールディングス	168,600	4,720.00	795,792,000
南海電気鉄道	59,900	2,962.00	177,423,800
京阪ホールディングス	56,300	5,410.00	304,583,000
神戸電鉄	3,000	3,980.00	11,940,000
名古屋鉄道	103,900	3,565.00	370,403,500
山陽電気鉄道	9,000	2,247.00	20,223,000
日本通運	44,700	6,830.00	305,301,000
ヤマトホールディングス	221,600	1,825.00	404,420,000
山九	35,100	5,910.00	207,441,000

丸運	7,200	275.00	1,980,000
丸全昭和運輸	10,300	3,155.00	32,496,500
センコーグループホールディングス	69,700	923.00	64,333,100
トナミホールディングス	3,000	5,160.00	15,480,000
ニッコンホールディングス	45,200	2,745.00	124,074,000
日本石油輸送	1,400	2,732.00	3,824,800
福山通運	16,200	4,140.00	67,068,000
セイノーホールディングス	94,700	1,539.00	145,743,300
エスライン	3,800	987.00	3,750,600
神奈川中央交通	3,100	3,985.00	12,353,500
日立物流	23,200	3,180.00	73,776,000
丸和運輸機関	13,300	2,497.00	33,210,100
C & F ロジホールディングス	12,800	1,396.00	17,868,800
九州旅客鉄道	112,700	3,790.00	427,133,000
S Gホールディングス	132,700	2,753.00	365,323,100
日本郵船	106,200	1,988.00	211,125,600
商船三井	80,300	3,030.00	243,309,000
川崎汽船	38,900	1,845.00	71,770,500
N S ユナイテッド海運	7,400	2,348.00	17,375,200
飯野海運	62,400	365.00	22,776,000
共栄タンカー	1,700	1,446.00	2,458,200
乾汽船	7,300	1,203.00	8,781,900
日本航空	231,400	3,320.00	768,248,000
A N Aホールディングス	231,100	3,717.00	858,998,700
パスコ	2,400	1,518.00	3,643,200
ランコム	3,500	7,390.00	25,865,000
日新	10,900	1,752.00	19,096,800
三菱倉庫	40,100	2,858.00	114,605,800
三井倉庫ホールディングス	14,400	1,976.00	28,454,400
住友倉庫	46,500	1,513.00	70,354,500
澁澤倉庫	6,900	2,210.00	15,249,000
東陽倉庫	22,800	339.00	7,729,200
日本トランスシティ	27,800	548.00	15,234,400
ケイヒン	2,400	1,367.00	3,280,800
中央倉庫	7,700	1,249.00	9,617,300
川西倉庫	2,300	1,136.00	2,612,800
安田倉庫	10,400	1,011.00	10,514,400
ファイズホールディングス	2,700	636.00	1,717,200
東洋埠頭	3,800	1,415.00	5,377,000
宇徳	10,800	524.00	5,659,200
上組	72,400	2,564.00	185,633,600
サンリツ	3,000	705.00	2,115,000

キムラユニティー	3,400	1,102.00	3,746,800
キューソー流通システム	3,200	1,999.00	6,396,800
近鉄エクスプレス	26,900	1,948.00	52,401,200
東海運	7,200	288.00	2,073,600
エーアイティー	8,900	964.00	8,579,600
内外トランスライン	4,400	1,474.00	6,485,600
日本コンセプト	4,000	1,430.00	5,720,000
NEC ネットエスアイ	12,500	3,500.00	43,750,000
クロスキャット	3,700	1,023.00	3,785,100
システナ	46,900	1,742.00	81,699,800
デジタルアーツ	6,500	6,020.00	39,130,000
日鉄ソリューションズ	19,700	3,705.00	72,988,500
キューブシステム	7,300	801.00	5,847,300
エイジア	2,600	1,318.00	3,426,800
コア	5,700	1,438.00	8,196,600
ソリトンシステムズ	6,000	1,071.00	6,426,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,900	1,817.00	10,720,300
T I S	43,700	6,290.00	274,873,000
ネオス	5,200	858.00	4,461,600
電算システム	5,100	2,978.00	15,187,800
グリー	90,800	523.00	47,488,400
コーエーテクモホールディングス	26,900	2,564.00	68,971,600
三菱総合研究所	5,700	3,825.00	21,802,500
電算	1,600	2,112.00	3,379,200
A G S	7,700	734.00	5,651,800
ファインデックス	11,300	954.00	10,780,200
ブレインパッド	2,600	5,340.00	13,884,000
K L a b	25,300	870.00	22,011,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,000	1,061.00	16,976,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,038.00	4,076,000
ネクソン	372,800	1,492.00	556,217,600
アイスタイル	34,100	884.00	30,144,400
エムアップ	3,900	2,090.00	8,151,000
エイチーム	9,300	1,068.00	9,932,400
エニグモ	9,500	1,025.00	9,737,500
テクノスジャパン	10,700	499.00	5,339,300
コロプラ	43,100	1,250.00	53,875,000
ブロードリーフ	65,300	635.00	41,465,500
クロス・マーケティンググループ	6,500	387.00	2,515,500
デジタルハーツホールディングス	7,200	1,125.00	8,100,000
システム情報	6,900	983.00	6,782,700
メディアドゥホールディングス	4,200	3,545.00	14,889,000

じげん	32,800	523.00	17,154,400
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	804.00	2,010,000
サイバーリンクス	2,200	1,163.00	2,558,600
フィックスターズ	14,100	1,399.00	19,725,900
CARTA HOLDINGS	6,500	1,388.00	9,022,000
オブティム	3,500	3,225.00	11,287,500
セレス	4,500	1,187.00	5,341,500
ティーガイア	11,700	2,632.00	30,794,400
セック	2,000	3,375.00	6,750,000
日本アジアグループ	13,800	373.00	5,147,400
豆蔵ホールディングス	9,100	1,535.00	13,968,500
テクマトリックス	9,300	2,256.00	20,980,800
プロシップ	4,000	1,352.00	5,408,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,700	2,315.00	73,385,500
GMOペイメントゲートウェイ	21,600	7,280.00	157,248,000
ザッパラス	7,500	403.00	3,022,500
システムリサーチ	3,600	1,765.00	6,354,000
インターネットイニシアティブ	19,500	2,540.00	49,530,000
さくらインターネット	14,400	684.00	9,849,600
ヴィンクス	3,900	1,189.00	4,637,100
GMOクラウド	2,500	2,857.00	7,142,500
SRAホールディングス	7,100	2,559.00	18,168,900
Minor iソリューションズ	2,600	2,695.00	7,007,000
システムインテグレータ	4,500	773.00	3,478,500
朝日ネット	9,700	627.00	6,081,900
eBASE	8,000	1,202.00	9,616,000
アバント	4,800	2,059.00	9,883,200
アドソル日進	4,800	2,220.00	10,656,000
フリービット	8,100	908.00	7,354,800
コムチュア	14,800	2,331.00	34,498,800
サイバーコム	2,400	2,208.00	5,299,200
アステリア	8,400	629.00	5,283,600
アイル	4,900	1,438.00	7,046,200
マークラインズ	6,700	2,291.00	15,349,700
メディカル・データ・ビジョン	10,200	1,061.00	10,822,200
ショーケース	3,500	727.00	2,544,500
モバイルファクトリー	3,100	1,482.00	4,594,200
テラスカイ	4,800	2,552.00	12,249,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,789.00	10,555,100
PCIホールディングス	2,800	2,220.00	6,216,000
パイブドHD	1,800	1,929.00	3,472,200
アイビーシー	2,600	1,252.00	3,255,200

ネオジャパン	2,700	985.00	2,659,500
P R T I M E S	1,200	2,428.00	2,913,600
ランドコンピュータ	2,200	1,144.00	2,516,800
ダブルスタンダード	1,700	5,480.00	9,316,000
オープンドア	6,600	1,771.00	11,688,600
マイネット	4,200	577.00	2,423,400
アカツキ	4,700	6,160.00	28,952,000
ベネフィットジャパン	1,100	1,510.00	1,661,000
U b i c o mホールディングス	3,100	1,215.00	3,766,500
L I N E	30,000	5,170.00	155,100,000
カナミックネットワーク	8,400	701.00	5,888,400
ノムラシステムコーポレーション	3,300	542.00	1,788,600
チェンジ	2,700	2,114.00	5,707,800
シンクロ・フード	6,100	525.00	3,202,500
オークネット	8,200	1,356.00	11,119,200
セグエグループ	1,300	1,604.00	2,085,200
エイトレッド	1,800	1,496.00	2,692,800
A O I T Y O H o l d i n g s	13,600	665.00	9,044,000
マクロミル	23,600	998.00	23,552,800
ビーグリー	2,800	1,240.00	3,472,000
オロ	3,500	3,965.00	13,877,500
テモナ	2,200	456.00	1,003,200
ニーズウェル	2,000	684.00	1,368,000
サインポスト	2,200	1,791.00	3,940,200
ソルクシーズ	5,800	927.00	5,376,600
フェイス	4,900	789.00	3,866,100
プロトコーポレーション	11,900	1,059.00	12,602,100
ハイマックス	1,700	1,901.00	3,231,700
野村総合研究所	219,000	2,371.00	519,249,000
サイバネットシステム	9,700	728.00	7,061,600
C Eホールディングス	8,100	456.00	3,693,600
日本システム技術	2,300	1,218.00	2,801,400
インテージホールディングス	16,600	956.00	15,869,600
東邦システムサイエンス	3,700	930.00	3,441,000
ソースネクスト	62,600	492.00	30,799,200
インフォコム	14,400	2,400.00	34,560,000
ラクスル	7,000	3,330.00	23,310,000
F I G	15,000	318.00	4,770,000
システムサポート	1,300	1,693.00	2,200,900
アルテリア・ネットワークス	14,700	1,514.00	22,255,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,593.00	4,938,300
フォーカスシステムズ	8,400	900.00	7,560,000

クレスコ	4,100	3,385.00	13,878,500
フジ・メディア・ホールディングス	126,300	1,525.00	192,607,500
オービック	45,400	14,420.00	654,668,000
ジャストシステム	21,300	5,650.00	120,345,000
TDCソフト	11,700	929.00	10,869,300
Zホールディングス	1,799,300	388.00	698,128,400
トレンドマイクロ	58,300	5,800.00	338,140,000
IDホールディングス	5,200	1,458.00	7,581,600
日本オラクル	26,600	9,980.00	265,468,000
アルファシステムズ	4,200	2,845.00	11,949,000
フューチャー	15,900	1,900.00	30,210,000
CAC Holdings	8,700	1,540.00	13,398,000
SBテクノロジー	4,800	2,102.00	10,089,600
トーセ	3,800	883.00	3,355,400
オービックビジネスコンサルタント	13,400	4,700.00	62,980,000
伊藤忠テクノソリューションズ	59,800	2,976.00	177,964,800
アイティフォー	16,200	892.00	14,450,400
東計電算	2,000	3,385.00	6,770,000
エクスネット	2,300	963.00	2,214,900
大塚商会	70,900	4,410.00	312,669,000
サイボウズ	15,500	1,101.00	17,065,500
ソフトブレーン	8,200	564.00	4,624,800
電通国際情報サービス	8,200	3,890.00	31,898,000
デジタルガレージ	23,600	3,895.00	91,922,000
EMシステムズ	9,300	2,175.00	20,227,500
ウェザーニューズ	4,500	3,475.00	15,637,500
CIJ	10,000	922.00	9,220,000
ビジネスエンジニアリング	1,600	3,190.00	5,104,000
日本エンタープライズ	14,500	232.00	3,364,000
WOWOW	6,400	2,726.00	17,446,400
スカラ	9,600	800.00	7,680,000
インテリジェント ウェイブ	5,300	783.00	4,149,900
IMAGICA GROUP	11,500	662.00	7,613,000
ネットワンシステムズ	50,000	2,982.00	149,100,000
システムソフト	33,400	111.00	3,707,400
アルゴグラフィックス	11,200	3,145.00	35,224,000
マーベラス	20,300	774.00	15,712,200
エイベックス	22,700	1,301.00	29,532,700
日本ユニシス	41,000	3,465.00	142,065,000
兼松エレクトロニクス	7,200	3,410.00	24,552,000
東京放送ホールディングス	79,800	1,755.00	140,049,000
日本テレビホールディングス	109,500	1,455.00	159,322,500

朝日放送グループホールディングス	13,300	756.00	10,054,800
テレビ朝日ホールディングス	36,100	1,778.00	64,185,800
スカパーJ S A Tホールディングス	86,700	462.00	40,055,400
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,314.00	24,991,200
日本BS放送	4,700	1,083.00	5,090,100
ビジョン	12,300	1,650.00	20,295,000
スマートバリュー	4,200	789.00	3,313,800
ワイヤレスゲート	6,500	768.00	4,992,000
コネクシオ	7,600	1,496.00	11,369,600
クロップス	2,700	752.00	2,030,400
日本電信電話	875,400	5,468.00	4,786,687,200
K D D I	976,200	3,167.00	3,091,625,400
ソフトバンク	1,190,500	1,494.00	1,778,607,000
光通信	13,500	25,010.00	337,635,000
N T T ドコモ	967,600	3,002.00	2,904,735,200
エムティーアイ	13,000	700.00	9,100,000
G M O インターネット	51,800	2,181.00	112,975,800
ファイバーゲート	2,600	1,340.00	3,484,000
アйдママーケティングコミュニケーション	4,300	797.00	3,427,100
K A D O K A W A	35,400	1,636.00	57,914,400
学研ホールディングス	4,400	6,910.00	30,404,000
ゼンリン	26,300	1,900.00	49,970,000
昭文社	6,600	430.00	2,838,000
インプレスホールディングス	10,800	162.00	1,749,600
アイネット	6,900	1,409.00	9,722,100
松竹	8,700	15,870.00	138,069,000
東宝	78,400	4,465.00	350,056,000
東映	4,900	17,650.00	86,485,000
エヌ・ティ・ティ・データ	348,900	1,499.00	523,001,100
ピー・シー・エー	1,700	3,860.00	6,562,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,416.00	5,556,800
D T S	29,400	2,274.00	66,855,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,900	5,080.00	283,972,000
シーイーシー	14,200	2,173.00	30,856,600
カブコン	61,800	2,517.00	155,550,600
アイ・エス・ビー	2,700	1,852.00	5,000,400
ジャステック	8,600	1,163.00	10,001,800
S C S K	30,300	5,770.00	174,831,000
日本システムウエア	4,400	2,458.00	10,815,200
アイネス	13,100	1,266.00	16,584,600
T K C	11,100	5,050.00	56,055,000
富士ソフト	16,800	4,175.00	70,140,000

N S D	21,600	3,585.00	77,436,000
コナミホールディングス	47,600	4,820.00	229,432,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	3,750.00	19,500,000
J B C Cホールディングス	9,000	1,806.00	16,254,000
ミロク情報サービス	11,600	3,045.00	35,322,000
ソフトバンクグループ	1,039,300	4,272.00	4,439,889,600
ハウスイ	1,100	858.00	943,800
高千穂交易	5,100	1,105.00	5,635,500
伊藤忠食品	3,200	5,300.00	16,960,000
エレマテック	12,300	1,061.00	13,050,300
J A L U X	3,700	2,590.00	9,583,000
あらた	10,500	4,275.00	44,887,500
トーメンデバイス	2,000	2,774.00	5,548,000
東京エレクトロン デバイス	4,800	2,225.00	10,680,000
フィールズ	10,100	497.00	5,019,700
双日	726,100	341.00	247,600,100
アルフレッサ ホールディングス	146,100	2,436.00	355,899,600
横浜冷凍	36,900	1,103.00	40,700,700
ラサ商事	7,000	882.00	6,174,000
ラクーンホールディングス	6,400	700.00	4,480,000
アルコニックス	14,000	1,529.00	21,406,000
神戸物産	45,400	3,385.00	153,679,000
あい ホールディングス	18,800	2,071.00	38,934,800
ディーブイエックス	4,700	937.00	4,403,900
ダイワボウホールディングス	11,200	5,120.00	57,344,000
マクニカ・富士エレホールディングス	31,400	1,813.00	56,928,200
ラクト・ジャパン	4,900	3,440.00	16,856,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,800	1,105.00	27,404,000
八洲電機	10,200	889.00	9,067,800
メディアスホールディングス	7,500	819.00	6,142,500
レスターホールディングス	13,700	1,955.00	26,783,500
ジュテックホールディングス	3,000	1,075.00	3,225,000
大光	5,600	722.00	4,043,200
O C H Iホールディングス	3,800	1,364.00	5,183,200
T O K A Iホールディングス	69,500	1,088.00	75,616,000
黒谷	3,000	451.00	1,353,000
C o m i n i x	2,300	818.00	1,881,400
三洋貿易	6,600	2,362.00	15,589,200
ビューティガレージ	2,100	1,861.00	3,908,100
ウイン・パートナーズ	9,500	1,492.00	14,174,000
ミタチ産業	4,000	774.00	3,096,000
シップヘルスケアホールディングス	21,100	4,535.00	95,688,500

明治電機工業	4,100	1,534.00	6,289,400
デリカフーズホールディングス	4,700	680.00	3,196,000
スターティアホールディングス	3,000	654.00	1,962,000
コメダホールディングス	28,600	2,101.00	60,088,600
アセンテック	1,100	1,900.00	2,090,000
富士興産	4,000	724.00	2,896,000
協栄産業	1,500	1,538.00	2,307,000
小野建	11,800	1,337.00	15,776,600
南陽	2,900	1,775.00	5,147,500
佐島電機	9,700	928.00	9,001,600
エコートレーディング	3,100	529.00	1,639,900
伯東	8,000	1,278.00	10,224,000
コンドーテック	10,200	1,084.00	11,056,800
中山福	7,600	559.00	4,248,400
ナガイレーベン	19,000	2,590.00	49,210,000
三菱食品	14,500	2,929.00	42,470,500
松田産業	9,600	1,563.00	15,004,800
第一興商	19,600	5,460.00	107,016,000
メディパルホールディングス	141,900	2,505.00	355,459,500
S P K	2,800	2,842.00	7,957,600
萩原電気ホールディングス	4,900	2,835.00	13,891,500
アズワン	8,600	8,910.00	76,626,000
スズデン	4,600	1,408.00	6,476,800
尾家産業	3,900	1,393.00	5,432,700
シモジマ	8,100	1,282.00	10,384,200
ドウシシャ	12,400	1,774.00	21,997,600
小津産業	2,900	1,841.00	5,338,900
高速	7,800	1,239.00	9,664,200
たけびし	4,600	1,447.00	6,656,200
リックス	3,000	1,647.00	4,941,000
丸文	11,700	580.00	6,786,000
ハピネット	11,000	1,456.00	16,016,000
橋本総業ホールディングス	2,700	1,817.00	4,905,900
日本ライフライン	39,000	1,541.00	60,099,000
タカショー	6,500	485.00	3,152,500
エクセル	3,800	1,264.00	4,803,200
マルカ	4,700	2,436.00	11,449,200
I D O M	35,500	463.00	16,436,500
進和	7,800	2,446.00	19,078,800
エスケイジャパン	2,900	447.00	1,296,300
ダイトロン	5,600	1,580.00	8,848,000
シークス	16,700	1,557.00	26,001,900

田中商事	4,100	714.00	2,927,400
オーハシテクニカ	7,400	1,465.00	10,841,000
白銅	4,700	1,423.00	6,688,100
伊藤忠商事	919,500	2,420.50	2,225,649,750
丸紅	1,368,400	805.00	1,101,562,000
高島	2,100	1,746.00	3,666,600
長瀬産業	73,900	1,598.00	118,092,200
蝶理	8,400	1,927.00	16,186,800
豊田通商	146,700	3,925.00	575,797,500
三共生興	20,000	600.00	12,000,000
兼松	49,000	1,431.00	70,119,000
ツカモトコーポレーション	2,400	1,100.00	2,640,000
三井物産	1,155,500	1,925.00	2,224,337,500
日本紙パルプ商事	7,500	4,055.00	30,412,500
日立ハイテクノロジーズ	45,700	6,780.00	309,846,000
カメイ	17,200	1,235.00	21,242,000
東都水産	1,700	2,582.00	4,389,400
OUGホールディングス	2,100	2,725.00	5,722,500
スターゼン	4,900	4,585.00	22,466,500
山善	51,400	1,037.00	53,301,800
椿本興業	2,400	4,020.00	9,648,000
住友商事	829,500	1,671.50	1,386,509,250
内田洋行	5,600	4,260.00	23,856,000
三菱商事	922,500	2,850.00	2,629,125,000
第一実業	6,400	3,645.00	23,328,000
キャノンマーケティングジャパン	37,600	2,432.00	91,443,200
西華産業	7,500	1,435.00	10,762,500
佐藤商事	10,900	906.00	9,875,400
菱洋エレクトロ	13,300	1,926.00	25,615,800
東京産業	11,900	558.00	6,640,200
ユアサ商事	12,500	3,555.00	44,437,500
神鋼商事	3,300	2,656.00	8,764,800
小林産業	7,900	309.00	2,441,100
阪和興業	24,600	2,783.00	68,461,800
正栄食品工業	8,500	3,225.00	27,412,500
カナデン	10,700	1,352.00	14,466,400
菱電商事	9,500	1,679.00	15,950,500
フルサト工業	7,300	1,654.00	12,074,200
岩谷産業	29,200	3,675.00	107,310,000
すてきナイスグループ	5,600	1,199.00	6,714,400
昭光通商	4,200	659.00	2,767,800
二チモウ	2,100	2,009.00	4,218,900

極東貿易	3,800	2,107.00	8,006,600
イワキ	17,300	478.00	8,269,400
三愛石油	32,400	1,077.00	34,894,800
稲畑産業	29,000	1,520.00	44,080,000
G S I クレオス	3,200	1,099.00	3,516,800
明和産業	12,200	601.00	7,332,200
クワザワ	4,700	601.00	2,824,700
ワキタ	28,100	1,105.00	31,050,500
東邦ホールディングス	42,200	2,637.00	111,281,400
サンゲツ	36,100	2,109.00	76,134,900
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,399.00	24,622,400
シナネンホールディングス	5,400	1,976.00	10,670,400
伊藤忠エネクス	29,100	888.00	25,840,800
サンリオ	36,900	2,165.00	79,888,500
サンワテクノス	9,300	1,175.00	10,927,500
リョーサン	14,500	2,895.00	41,977,500
新光商事	20,600	891.00	18,354,600
トーホー	6,000	1,790.00	10,740,000
三信電気	7,100	1,628.00	11,558,800
東陽テクニカ	15,200	1,135.00	17,252,000
モスフードサービス	17,300	3,055.00	52,851,500
加賀電子	13,100	2,507.00	32,841,700
ソーダニッカ	13,600	610.00	8,296,000
立花エレテック	9,700	1,732.00	16,800,400
フォーバル	5,800	1,043.00	6,049,400
P A L T A C	21,100	5,450.00	114,995,000
三谷産業	17,400	342.00	5,950,800
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,795.00	9,108,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,441.00	1,585,100
国際紙パルプ商事	31,200	303.00	9,453,600
ヤマタネ	6,600	1,508.00	9,952,800
丸紅建材リース	1,300	1,750.00	2,275,000
日鉄物産	9,400	5,020.00	47,188,000
泉州電業	4,000	2,922.00	11,688,000
トラスコ中山	27,400	2,759.00	75,596,600
オートバックスセブン	48,800	1,799.00	87,791,200
モリト	9,600	816.00	7,833,600
加藤産業	20,600	3,775.00	77,765,000
北恵	2,500	1,001.00	2,502,500
イノテック	7,800	1,039.00	8,104,200
イエローハット	24,800	1,885.00	46,748,000
J Kホールディングス	11,900	641.00	7,627,900

日伝	11,900	2,122.00	25,251,800
北沢産業	10,000	283.00	2,830,000
杉本商事	7,100	2,026.00	14,384,600
因幡電機産業	18,700	5,120.00	95,744,000
東テク	4,400	2,459.00	10,819,600
ミスミグループ本社	164,700	2,729.00	449,466,300
アルテック	10,600	235.00	2,491,000
タキヒヨー	4,000	1,936.00	7,744,000
蔵王産業	2,600	1,466.00	3,811,600
スズケン	55,700	5,130.00	285,741,000
ジェコス	9,100	935.00	8,508,500
グローセル	13,200	456.00	6,019,200
ローソン	33,300	5,930.00	197,469,000
サンエー	11,000	5,130.00	56,430,000
カワチ薬品	10,300	2,306.00	23,751,800
エービーシー・マート	20,500	7,350.00	150,675,000
ハードオフコーポレーション	5,400	812.00	4,384,800
アスクル	13,800	2,890.00	39,882,000
ゲオホールディングス	23,800	1,386.00	32,986,800
アダストリア	18,300	2,687.00	49,172,100
ジーフット	8,200	622.00	5,100,400
くら寿司	6,900	4,770.00	32,913,000
キャンドゥ	6,400	1,626.00	10,406,400
パルグループホールディングス	6,800	3,530.00	24,004,000
エディオン	60,500	1,190.00	71,995,000
サーラコーポレーション	27,000	650.00	17,550,000
ワッツ	6,100	606.00	3,696,600
ハローズ	5,000	2,553.00	12,765,000
フジオフードシステム	5,600	3,660.00	20,496,000
あみやき亭	2,900	3,545.00	10,280,500
ひらまつ	24,700	307.00	7,582,900
大黒天物産	3,200	3,270.00	10,464,000
ハニーズホールディングス	11,700	1,439.00	16,836,300
ファーマライズホールディングス	3,300	645.00	2,128,500
アルペン	10,200	1,803.00	18,390,600
ハブ	3,900	1,014.00	3,954,600
クオールホールディングス	19,500	1,595.00	31,102,500
ジズホールディングス	7,000	6,700.00	46,900,000
ビックカメラ	78,100	1,223.00	95,516,300
DCMホールディングス	71,100	1,074.00	76,361,400
ペッパーフードサービス	10,600	1,397.00	14,808,200
Monotaro	93,500	3,000.00	280,500,000

東京一番フーズ	3,600	625.00	2,250,000
D Dホールディングス	5,200	1,430.00	7,436,000
きちりホールディングス	3,700	900.00	3,330,000
アークランドサービスホールディングス	9,700	1,897.00	18,400,900
J . フロント リテイリング	157,100	1,464.00	229,994,400
ドトール・日レスホールディングス	21,100	2,222.00	46,884,200
マツモトキヨシホールディングス	54,400	4,255.00	231,472,000
ブロンコビリー	6,900	2,690.00	18,561,000
Z O Z O	130,100	2,302.00	299,490,200
トレジャー・ファクトリー	4,000	1,173.00	4,692,000
物語コーポレーション	3,300	8,520.00	28,116,000
ココカラファイン	13,700	6,580.00	90,146,000
三越伊勢丹ホールディングス	229,800	1,008.00	231,638,400
H a m e e	4,100	1,255.00	5,145,500
ウエルシアホールディングス	39,100	6,870.00	268,617,000
クリエイトSDホールディングス	19,400	2,706.00	52,496,400
丸善CHIホールディングス	15,300	373.00	5,706,900
ティーライフ	2,000	854.00	1,708,000
エー・ピーカンパニー	2,800	515.00	1,442,000
チムニー	4,100	2,340.00	9,594,000
シュッピン	9,100	1,044.00	9,500,400
ネクステージ	18,900	1,139.00	21,527,100
ジョイフル本田	38,600	1,454.00	56,124,400
鳥貴族	4,400	1,999.00	8,795,600
麒麟堂ホールディングス	5,200	2,139.00	11,122,800
ホットランド	8,900	1,247.00	11,098,300
すかいらーくホールディングス	147,400	2,175.00	320,595,000
S F Pホールディングス	5,700	2,290.00	13,053,000
綿半ホールディングス	5,000	2,057.00	10,285,000
ヨシックス	2,200	2,839.00	6,245,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,400	981.00	37,670,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,300	653.00	4,113,900
B E E N O S	4,700	1,695.00	7,966,500
あさひ	9,900	1,256.00	12,434,400
日本調剤	4,000	3,920.00	15,680,000
コスモス薬品	5,800	22,540.00	130,732,000
トーエル	6,600	803.00	5,299,800
オンリー	2,400	806.00	1,934,400
セブン&アイ・ホールディングス	514,300	4,092.00	2,104,515,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,400	1,898.00	67,189,200
ツルハホールディングス	28,600	12,740.00	364,364,000

サンマルクホールディングス	10,500	2,400.00	25,200,000
フェリシモ	3,100	1,049.00	3,251,900
トリドールホールディングス	16,300	3,080.00	50,204,000
T O K Y O B A S E	12,100	664.00	8,034,400
ウイルプラスホールディングス	2,200	845.00	1,859,000
ジャパンミート	6,700	2,199.00	14,733,300
サツドラホールディングス	2,100	1,796.00	3,771,600
デファクトスタンダード	1,600	363.00	580,800
アレンザホールディングス	6,800	842.00	5,725,600
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,594.00	5,447,400
パロックジャパンリミテッド	9,300	938.00	8,723,400
クスリのアオキホールディングス	13,100	8,630.00	113,053,000
力の源ホールディングス	6,100	915.00	5,581,500
スシローグローバルホールディングス	14,400	8,800.00	126,720,000
L I X I L ビバ	13,100	1,906.00	24,968,600
メディカルシステムネットワーク	13,000	568.00	7,384,000
はるやまホールディングス	6,400	841.00	5,382,400
ノジマ	23,500	2,295.00	53,932,500
カップ・クリエイト	18,400	1,475.00	27,140,000
ライトオン	9,800	586.00	5,742,800
良品計画	174,600	2,438.00	425,674,800
三城ホールディングス	14,500	286.00	4,147,000
アドヴァン	20,200	1,286.00	25,977,200
アルビス	5,100	2,305.00	11,755,500
コナカ	15,900	404.00	6,423,600
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,659.00	2,820,300
G - 7ホールディングス	3,900	3,875.00	15,112,500
イオン北海道	13,400	796.00	10,666,400
コジマ	23,000	459.00	10,557,000
ヒマラヤ	4,800	842.00	4,041,600
コーナン商事	18,800	2,573.00	48,372,400
エコス	4,900	1,702.00	8,339,800
ワタミ	15,700	1,297.00	20,362,900
マルシェ	3,700	777.00	2,874,900
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	315,100	1,731.00	545,438,100
西松屋チェーン	29,000	939.00	27,231,000
ゼンショーホールディングス	63,100	2,531.00	159,706,100
幸楽苑ホールディングス	8,400	2,062.00	17,320,800
ハークスレイ	2,900	1,059.00	3,071,100
サイゼリヤ	21,700	2,515.00	54,575,500
V Tホールディングス	54,800	480.00	26,304,000
魚力	3,700	1,520.00	5,624,000

フジ・コーポレーション	3,600	2,220.00	7,992,000
ユナイテッドアローズ	13,800	3,425.00	47,265,000
ハイデイ日高	19,000	2,193.00	41,667,000
京都きもの友禅	8,800	358.00	3,150,400
コロワイド	43,800	2,215.00	97,017,000
ピーシーデポコーポレーション	17,800	466.00	8,294,800
壱番屋	9,300	5,030.00	46,779,000
P L A N T	3,600	664.00	2,390,400
スギホールディングス	26,300	6,340.00	166,742,000
薬王堂ホールディングス	5,800	2,585.00	14,993,000
スクロール	20,700	349.00	7,224,300
ヨンドシーホールディングス	13,400	2,619.00	35,094,600
ファミリーマート	105,100	2,742.00	288,184,200
木曽路	17,200	2,836.00	48,779,200
S R Sホールディングス	15,600	1,047.00	16,333,200
タカキュー	11,000	194.00	2,134,000
ケーヨー	27,300	542.00	14,796,600
上新電機	15,600	2,465.00	38,454,000
日本瓦斯	20,800	3,125.00	65,000,000
ロイヤルホールディングス	23,000	2,505.00	57,615,000
いなげや	16,400	1,493.00	24,485,200
島忠	27,800	3,130.00	87,014,000
チヨダ	13,900	1,643.00	22,837,700
ライフコーポレーション	10,000	2,480.00	24,800,000
リンガーハット	16,300	2,456.00	40,032,800
M r M a x H D	18,400	504.00	9,273,600
テンアライド	12,100	443.00	5,360,300
A O K Iホールディングス	26,400	1,146.00	30,254,400
オークワ	20,800	1,382.00	28,745,600
コメリ	20,400	2,358.00	48,103,200
青山商事	27,200	1,696.00	46,131,200
しまむら	15,300	9,490.00	145,197,000
はせがわ	7,400	407.00	3,011,800
高島屋	95,900	1,316.00	126,204,400
松屋	26,700	878.00	23,442,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	62,400	1,231.00	76,814,400
近鉄百貨店	5,100	3,575.00	18,232,500
パルコ	12,700	1,330.00	16,891,000
丸井グループ	120,600	2,644.00	318,866,400
アクシアル リテイリング	10,900	3,985.00	43,436,500
イオン	505,900	2,262.50	1,144,598,750
イズミ	26,800	4,290.00	114,972,000

平和堂	26,800	2,110.00	56,548,000
フジ	16,000	1,991.00	31,856,000
ヤオコー	15,000	5,150.00	77,250,000
ゼビオホールディングス	16,000	1,261.00	20,176,000
ケーズホールディングス	127,000	1,332.00	169,164,000
Olympicグループ	7,100	630.00	4,473,000
日産東京販売ホールディングス	19,900	289.00	5,751,100
Genky DrugStores	6,500	2,547.00	16,555,500
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	1,361.00	3,130,300
総合メディカルホールディングス	11,500	1,978.00	22,747,000
ブックオフグループホールディングス	7,700	1,105.00	8,508,500
アインホールディングス	17,600	6,660.00	117,216,000
元気寿司	3,400	3,130.00	10,642,000
ヤマダ電機	400,800	562.00	225,249,600
アークランドサカモト	20,700	1,305.00	27,013,500
ニトリホールディングス	56,900	16,820.00	957,058,000
グルメ杵屋	9,500	1,188.00	11,286,000
愛眼	10,500	252.00	2,646,000
ケーユーホールディングス	7,000	945.00	6,615,000
吉野家ホールディングス	43,200	2,736.00	118,195,200
松屋フーズホールディングス	6,400	4,190.00	26,816,000
サガミホールディングス	17,700	1,382.00	24,461,400
関西スーパーマーケット	11,100	1,060.00	11,766,000
王将フードサービス	9,700	6,580.00	63,826,000
プレナス	14,800	1,904.00	28,179,200
ミニストップ	9,900	1,495.00	14,800,500
アークス	26,900	2,341.00	62,972,900
パローホールディングス	29,200	2,012.00	58,750,400
ベルク	6,500	5,140.00	33,410,000
大庄	7,100	1,608.00	11,416,800
ファーストリテイリング	17,600	66,920.00	1,177,792,000
サンドラッグ	49,500	3,830.00	189,585,000
サックスパーホールディングス	11,300	903.00	10,203,900
ヤマザワ	3,200	1,725.00	5,520,000
やまや	2,800	2,247.00	6,291,600
ベルーナ	28,400	731.00	20,760,400
島根銀行	2,600	724.00	1,882,400
じもとホールディングス	88,900	113.00	10,045,700
めぶきフィナンシャルグループ	684,000	286.00	195,624,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,800	1,514.00	26,949,200
九州フィナンシャルグループ	216,000	486.00	104,976,000
ゆうちょ銀行	373,000	1,061.00	395,753,000

富山第一銀行	31,400	356.00	11,178,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	774,300	450.00	348,435,000
西日本フィナンシャルホールディングス	89,700	864.00	77,500,800
関西みらいフィナンシャルグループ	77,300	720.00	55,656,000
三十三フィナンシャルグループ	12,200	1,723.00	21,020,600
第四北越フィナンシャルグループ	22,800	2,933.00	66,872,400
新生銀行	96,600	1,714.00	165,572,400
あおぞら銀行	78,400	2,870.00	225,008,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,062,300	580.10	5,257,040,230
りそなホールディングス	1,444,700	477.80	690,277,660
三井住友トラスト・ホールディングス	248,800	4,291.00	1,067,600,800
三井住友フィナンシャルグループ	910,500	4,015.00	3,655,657,500
千葉銀行	452,800	626.00	283,452,800
群馬銀行	258,700	394.00	101,927,800
武蔵野銀行	19,600	2,017.00	39,533,200
千葉興業銀行	36,100	352.00	12,707,200
筑波銀行	54,700	258.00	14,112,600
七十七銀行	44,500	1,751.00	77,919,500
青森銀行	10,200	2,814.00	28,702,800
秋田銀行	8,400	2,254.00	18,933,600
山形銀行	14,800	1,621.00	23,990,800
岩手銀行	8,600	2,946.00	25,335,600
東邦銀行	117,700	282.00	33,191,400
東北銀行	6,300	1,045.00	6,583,500
みちのく銀行	8,500	1,608.00	13,668,000
ふくおかフィナンシャルグループ	110,900	2,059.00	228,343,100
静岡銀行	326,000	829.00	270,254,000
十六銀行	16,500	2,623.00	43,279,500
スルガ銀行	134,700	585.00	78,799,500
八十二銀行	317,700	464.00	147,412,800
山梨中央銀行	15,300	1,146.00	17,533,800
大垣共立銀行	26,000	2,562.00	66,612,000
福井銀行	11,300	1,608.00	18,170,400
北國銀行	13,600	3,355.00	45,628,000
清水銀行	5,400	2,096.00	11,318,400
富山銀行	2,500	2,576.00	6,440,000
滋賀銀行	26,400	2,665.00	70,356,000
南都銀行	21,900	2,810.00	61,539,000
百五銀行	118,500	364.00	43,134,000
京都銀行	47,100	4,475.00	210,772,500
紀陽銀行	46,600	1,687.00	78,614,200
ほくほくフィナンシャルグループ	87,600	1,126.00	98,637,600

広島銀行	194,300	549.00	106,670,700
山陰合同銀行	78,100	678.00	52,951,800
中国銀行	113,300	1,079.00	122,250,700
鳥取銀行	4,500	1,387.00	6,241,500
伊予銀行	187,800	600.00	112,680,000
百十四銀行	14,000	2,284.00	31,976,000
四国銀行	20,000	1,011.00	20,220,000
阿波銀行	21,500	2,709.00	58,243,500
大分銀行	7,600	2,842.00	21,599,200
宮崎銀行	8,800	2,637.00	23,205,600
佐賀銀行	8,000	1,664.00	13,312,000
沖縄銀行	12,100	3,655.00	44,225,500
琉球銀行	30,400	1,209.00	36,753,600
セブン銀行	439,800	331.00	145,573,800
みずほフィナンシャルグループ	17,888,600	170.10	3,042,850,860
高知銀行	4,800	938.00	4,502,400
山口フィナンシャルグループ	164,300	753.00	123,717,900
長野銀行	4,300	1,700.00	7,310,000
名古屋銀行	10,600	3,335.00	35,351,000
北洋銀行	198,400	245.00	48,608,000
愛知銀行	4,800	3,865.00	18,552,000
中京銀行	5,400	2,257.00	12,187,800
大光銀行	4,500	1,764.00	7,938,000
愛媛銀行	18,400	1,229.00	22,613,600
トマト銀行	5,100	1,085.00	5,533,500
京葉銀行	56,100	665.00	37,306,500
栃木銀行	63,600	237.00	15,073,200
北日本銀行	4,100	2,111.00	8,655,100
東和銀行	23,100	930.00	21,483,000
福島銀行	12,400	344.00	4,265,600
大東銀行	6,800	638.00	4,338,400
トモニホールディングス	101,800	398.00	40,516,400
フィデアホールディングス	127,800	136.00	17,380,800
池田泉州ホールディングス	151,400	209.00	31,642,600
F P G	41,500	1,168.00	48,472,000
マーキュリアインベストメント	6,100	755.00	4,605,500
S B Iホールディングス	147,100	2,257.00	332,004,700
ジャフコ	20,300	4,215.00	85,564,500
大和証券グループ本社	1,056,700	525.00	554,767,500
野村ホールディングス	2,316,800	540.20	1,251,535,360
岡三証券グループ	112,700	400.00	45,080,000
丸三証券	39,500	533.00	21,053,500

東洋証券	48,300	169.00	8,162,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,800	336.00	51,004,800
光世証券	3,400	701.00	2,383,400
水戸証券	38,800	270.00	10,476,000
いちよし証券	24,900	697.00	17,355,300
松井証券	75,400	898.00	67,709,200
だいこう証券ビジネス	5,700	605.00	3,448,500
マネックスグループ	100,100	275.00	27,527,500
極東証券	17,900	808.00	14,463,200
岩井コスモホールディングス	12,600	1,215.00	15,309,000
藍澤証券	23,900	724.00	17,303,600
マネーパートナーズグループ	14,800	249.00	3,685,200
スパークス・グループ	46,400	251.00	11,646,400
かんぽ生命保険	46,600	1,878.00	87,514,800
S O M P Oホールディングス	247,500	4,342.00	1,074,645,000
アニコム ホールディングス	10,900	3,750.00	40,875,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	344,200	3,535.00	1,216,747,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	108,200	2,413.00	261,086,600
第一生命ホールディングス	745,000	1,804.50	1,344,352,500
東京海上ホールディングス	470,800	5,875.00	2,765,950,000
T & Dホールディングス	407,100	1,319.00	536,964,900
アドバンスクリエイト	3,100	1,889.00	5,855,900
全国保証	37,100	4,300.00	159,530,000
ジェイリース	3,600	325.00	1,170,000
イントラスト	4,600	728.00	3,348,800
日本モーゲージサービス	2,700	1,553.00	4,193,100
C a s a	4,500	1,228.00	5,526,000
アルヒ	20,900	2,491.00	52,061,900
プレミアグループ	7,100	2,420.00	17,182,000
クレディセゾン	92,200	1,805.00	166,421,000
芙蓉総合リース	13,800	7,140.00	98,532,000
みずほリース	20,300	3,160.00	64,148,000
東京センチュリー	26,500	5,910.00	156,615,000
日本証券金融	58,000	525.00	30,450,000
アイフル	200,800	238.00	47,790,400
リコーリース	10,400	3,735.00	38,844,000
イオンフィナンシャルサービス	80,600	1,629.00	131,297,400
アコム	264,600	442.00	116,953,200
ジャックス	14,500	2,712.00	39,324,000
オリエントコーポレーション	356,100	165.00	58,756,500
日立キャピタル	31,000	2,571.00	79,701,000
アプラスフィナンシャル	63,200	88.00	5,561,600

オリックス	823,400	1,742.50	1,434,774,500
三菱UFJリース	334,100	692.00	231,197,200
九州リースサービス	6,500	607.00	3,945,500
日本取引所グループ	377,900	1,863.00	704,027,700
イー・ギャランティ	14,100	1,406.00	19,824,600
アサックス	5,500	647.00	3,558,500
NECキャピタルソリューション	5,400	2,476.00	13,370,400
いちご	170,400	421.00	71,738,400
日本駐車場開発	151,900	171.00	25,974,900
スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,779.00	13,342,500
ヒューリック	282,200	1,197.00	337,793,400
三栄建築設計	6,100	1,570.00	9,577,000
野村不動産ホールディングス	80,300	2,596.00	208,458,800
三重交通グループホールディングス	28,700	614.00	17,621,800
サムティ	19,200	2,130.00	40,896,000
ディア・ライフ	19,100	565.00	10,791,500
コーセーアールイー	5,400	788.00	4,255,200
エー・ディー・ワークス	244,200	31.00	7,570,200
日本商業開発	9,100	1,558.00	14,177,800
プレサンスコーポレーション	21,600	1,757.00	37,951,200
ユニゾホールディングス	20,100	4,990.00	100,299,000
ハウスコム	2,500	1,578.00	3,945,000
日本管理センター	9,600	1,384.00	13,286,400
サンセイランディック	5,200	870.00	4,524,000
エストラスト	1,800	790.00	1,422,000
フージャースホールディングス	26,200	716.00	18,759,200
オープンハウス	38,600	3,510.00	135,486,000
東急不動産ホールディングス	359,700	701.00	252,149,700
飯田グループホールディングス	110,500	1,862.00	205,751,000
イーグランド	3,700	773.00	2,860,100
ムゲンエステート	10,800	721.00	7,786,800
ハウスドゥ	7,300	1,673.00	12,212,900
シーアールイー	4,400	1,078.00	4,743,200
ケイアイスター不動産	4,700	2,028.00	9,531,600
グッドコムアセット	3,800	1,758.00	6,680,400
ジェイ・エス・ビー	1,700	4,560.00	7,752,000
テンポイノベーション	2,200	1,640.00	3,608,000
パーク24	71,100	2,502.00	177,892,200
パラカ	4,000	2,045.00	8,180,000
三井不動産	657,800	2,784.50	1,831,644,100
三菱地所	923,000	2,025.50	1,869,536,500
平和不動産	24,600	2,550.00	62,730,000

東京建物	144,700	1,562.00	226,021,400
ダイビル	35,000	1,158.00	40,530,000
京阪神ビルディング	22,300	1,394.00	31,086,200
住友不動産	296,200	3,837.00	1,136,519,400
テオオーシー	27,300	845.00	23,068,500
東京楽天地	2,400	6,190.00	14,856,000
スターツコーポレーション	18,300	2,727.00	49,904,100
フジ住宅	17,000	675.00	11,475,000
空港施設	15,400	573.00	8,824,200
明和地所	9,300	587.00	5,459,100
ゴールドクレスト	10,900	2,229.00	24,296,100
エスリード	5,700	2,076.00	11,833,200
日神不動産	22,000	503.00	11,066,000
日本エスコン	25,200	973.00	24,519,600
タカラレーベン	62,800	491.00	30,834,800
サンヨーハウジング名古屋	8,700	966.00	8,404,200
イオンモール	66,700	1,739.00	115,991,300
毎日コムネット	4,300	817.00	3,513,100
ファースト住建	6,500	1,310.00	8,515,000
カチタス	16,600	5,350.00	88,810,000
トーセイ	19,000	1,464.00	27,816,000
穴吹興産	1,900	2,873.00	5,458,700
サンフロンティア不動産	19,200	1,309.00	25,132,800
エフ・ジェー・ネクスト	12,600	1,066.00	13,431,600
インテリックス	5,400	743.00	4,012,200
ランドビジネス	5,500	795.00	4,372,500
日本社宅サービス	4,500	1,075.00	4,837,500
グランディハウス	12,800	471.00	6,028,800
日本空港ビルデング	42,200	5,620.00	237,164,000
日本工営	8,600	3,390.00	29,154,000
LIFULL	44,700	547.00	24,450,900
ジェイエイシーリクルートメント	8,600	2,032.00	17,475,200
日本M&Aセンター	96,400	3,595.00	346,558,000
メンバーズ	3,800	2,554.00	9,705,200
中広	1,600	536.00	857,600
アイティメディア	4,000	823.00	3,292,000
タケエイ	12,300	1,224.00	15,055,200
E・Jホールディングス	1,700	1,460.00	2,482,000
トラスト・テック	14,200	1,426.00	20,249,200
コシダカホールディングス	30,800	1,617.00	49,803,600
アルトナー	3,300	736.00	2,428,800
パソナグループ	15,700	1,628.00	25,559,600

C D S	3,300	1,573.00	5,190,900
リンクアンドモチベーション	28,400	705.00	20,022,000
G C A	15,500	961.00	14,895,500
エス・エム・エス	39,700	2,894.00	114,891,800
サニーサイドアップ	3,000	1,100.00	3,300,000
パーソルホールディングス	127,600	2,009.00	256,348,400
リニカル	6,300	1,003.00	6,318,900
クックパッド	45,000	384.00	17,280,000
エスクリ	4,200	807.00	3,389,400
アイ・ケイ・ケイ	6,400	710.00	4,544,000
学情	4,600	1,516.00	6,973,600
スタジオアリス	6,500	1,921.00	12,486,500
シミックホールディングス	7,200	1,737.00	12,506,400
エプロ	2,100	1,516.00	3,183,600
N J S	2,900	1,758.00	5,098,200
総合警備保障	50,800	5,600.00	284,480,000
カカクコム	95,600	2,500.00	239,000,000
アイロムグループ	4,500	1,437.00	6,466,500
セントケア・ホールディング	8,600	510.00	4,386,000
サイネックス	2,400	676.00	1,622,400
ルネサンス	7,200	1,726.00	12,427,200
ディップ	18,000	3,020.00	54,360,000
オプトホールディング	7,000	1,790.00	12,530,000
ツクイ	30,300	569.00	17,240,700
キャリアデザインセンター	3,300	1,335.00	4,405,500
ベネフィット・ワン	35,000	2,282.00	79,870,000
エムスリー	281,200	2,858.00	803,669,600
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	630.00	5,292,000
プラス	1,700	687.00	1,167,900
アウトソーシング	73,100	1,207.00	88,231,700
ウェルネット	12,300	818.00	10,061,400
ワールドホールディングス	4,300	1,867.00	8,028,100
ディー・エヌ・エー	62,600	1,754.00	109,800,400
博報堂D Yホールディングス	177,500	1,826.00	324,115,000
ぐるなび	22,400	1,009.00	22,601,600
タカミヤ	13,700	749.00	10,261,300
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,130.00	9,718,000
ファンコミュニケーションズ	35,400	520.00	18,408,000
ライク	5,100	1,728.00	8,812,800
ビジネス・ブレークスルー	5,800	341.00	1,977,800
エスプール	24,800	671.00	16,640,800
W D Bホールディングス	5,900	2,719.00	16,042,100

ティア	7,700	592.00	4,558,400
C D G	1,500	1,400.00	2,100,000
バリューコマース	7,200	1,855.00	13,356,000
インフォマート	70,000	1,930.00	135,100,000
J Pホールディングス	40,600	309.00	12,545,400
エコナックホールディングス	24,200	135.00	3,267,000
E P Sホールディングス	19,300	1,413.00	27,270,900
レグス	3,300	1,415.00	4,669,500
プレステージ・インターナショナル	47,900	932.00	44,642,800
アミューズ	7,000	3,005.00	21,035,000
ドリームインキュベータ	4,000	1,583.00	6,332,000
クイック	8,000	1,580.00	12,640,000
T A C	8,400	229.00	1,923,600
ケネディクス	121,600	586.00	71,257,600
電通	131,500	4,135.00	543,752,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,214.00	6,070,000
ぴあ	3,700	4,825.00	17,852,500
イオンファンタジー	5,000	3,250.00	16,250,000
シーティーエス	14,600	741.00	10,818,600
ネクシィーズグループ	4,500	2,064.00	9,288,000
みらかホールディングス	35,700	2,729.00	97,425,300
アルプス技研	11,400	1,741.00	19,847,400
ダイオーズ	2,600	1,325.00	3,445,000
日本空調サービス	13,600	732.00	9,955,200
オリエンタルランド	135,700	15,300.00	2,076,210,000
ダスキン	32,800	2,841.00	93,184,800
明光ネットワークジャパン	15,100	1,001.00	15,115,100
ファルコホールディングス	7,100	1,708.00	12,126,800
ラウンドワン	35,700	1,147.00	40,947,900
リゾートトラスト	58,600	1,840.00	107,824,000
ビー・エム・エル	16,500	3,185.00	52,552,500
ワタベウェディング	2,300	608.00	1,398,400
りらいあコミュニケーションズ	23,200	1,464.00	33,964,800
リソー教育	58,700	408.00	23,949,600
早稲田アカデミー	4,300	932.00	4,007,600
ユー・エス・エス	142,900	2,107.00	301,090,300
東京個別指導学院	4,700	752.00	3,534,400
サイバーエージェント	73,400	3,405.00	249,927,000
楽天	594,700	956.00	568,533,200
クリーク・アンド・リバー社	6,700	1,126.00	7,544,200
テー・オー・ダブリュー	11,400	836.00	9,530,400
山田コンサルティンググループ	6,300	1,817.00	11,447,100

セントラルスポーツ	4,800	3,305.00	15,864,000
フルキャストホールディングス	12,800	2,352.00	30,105,600
エン・ジャパン	22,700	5,260.00	119,402,000
リソルホールディングス	1,400	4,025.00	5,635,000
テクノプロ・ホールディングス	25,600	6,910.00	176,896,000
アトラ	3,300	404.00	1,333,200
インターワークス	2,700	517.00	1,395,900
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	4,250.00	22,100,000
K e e P e r 技研	4,800	1,359.00	6,523,200
ファーストロジック	3,200	650.00	2,080,000
三機サービス	2,800	1,000.00	2,800,000
G u n o s y	9,000	1,725.00	15,525,000
デザインワン・ジャパン	3,000	321.00	963,000
イー・ガーディアン	6,600	2,153.00	14,209,800
リブセンス	8,600	307.00	2,640,200
ジャパンマテリアル	39,300	1,676.00	65,866,800
ベクトル	16,100	928.00	14,940,800
ウチヤマホールディングス	6,600	555.00	3,663,000
チャーム・ケア・コーポレーション	4,200	1,962.00	8,240,400
ライクキッズ	3,200	870.00	2,784,000
キャリアリンク	4,400	546.00	2,402,400
I B J	8,800	978.00	8,606,400
アサンテ	5,200	2,095.00	10,894,000
N・フィールド	9,000	705.00	6,345,000
バリューHR	2,600	3,650.00	9,490,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	8,470.00	38,115,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,000	1,683.00	8,415,000
E R Iホールディングス	3,800	805.00	3,059,000
アビスト	2,000	2,692.00	5,384,000
シグマクシス	8,800	2,100.00	18,480,000
ウィルグループ	8,500	1,048.00	8,908,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	18,300	234.00	4,282,200
リクルートホールディングス	913,700	3,879.00	3,544,242,300
エラン	7,600	1,670.00	12,692,000
土木管理総合試験所	5,900	445.00	2,625,500
ネットマーケティング	4,700	1,129.00	5,306,300
日本郵政	1,045,500	1,029.50	1,076,342,250
ベルシステム24ホールディングス	21,500	1,835.00	39,452,500
鎌倉新書	9,600	1,666.00	15,993,600
S M N	2,200	928.00	2,041,600
一蔵	1,600	714.00	1,142,400
L I T A L I C O	4,400	2,432.00	10,700,800

グローバルキッズCOMPANY	2,100	777.00	1,631,700
エポラブルアジア	5,800	2,081.00	12,069,800
アトラエ	3,400	3,885.00	13,209,000
ストライク	4,900	4,515.00	22,123,500
ソラスト	35,200	1,252.00	44,070,400
セラク	4,200	822.00	3,452,400
インソース	6,200	3,345.00	20,739,000
ベikalレント・コンサルティング	7,800	5,860.00	45,708,000
Orchestra Holdings	2,700	1,187.00	3,204,900
アイモバイル	4,300	671.00	2,885,300
キャリアインデックス	5,600	410.00	2,296,000
MS - Japan	4,200	1,343.00	5,640,600
船場	2,200	1,100.00	2,420,000
グレイステクノロジー	5,800	2,930.00	16,994,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,500	2,795.00	37,732,500
フルテック	1,900	1,407.00	2,673,300
グリーンズ	4,900	1,209.00	5,924,100
ツナググループ・ホールディングス	1,800	618.00	1,112,400
GameWith	3,000	830.00	2,490,000
ソウルドアウト	2,100	1,537.00	3,227,700
MS&Consulting	1,900	988.00	1,877,200
日総工産	8,600	1,171.00	10,070,600
キュービーネットホールディングス	7,900	2,592.00	20,476,800
RPAホールディングス	7,300	1,245.00	9,088,500
スプリックス	4,400	1,243.00	5,469,200
アドバンテッジリスクマネジメント	6,600	949.00	6,263,400
リログループ	69,800	2,905.00	202,769,000
東祥	8,000	2,412.00	19,296,000
エイチ・アイ・エス	19,900	2,942.00	58,545,800
ラックランド	2,600	2,507.00	6,518,200
共立メンテナンス	21,200	5,190.00	110,028,000
イチネンホールディングス	14,400	1,424.00	20,505,600
建設技術研究所	8,900	2,059.00	18,325,100
スペース	8,400	1,274.00	10,701,600
長大	4,800	1,161.00	5,572,800
燦ホールディングス	5,700	1,317.00	7,506,900
スバル興業	800	7,240.00	5,792,000
東京テアトル	5,100	1,403.00	7,155,300
タナベ経営	2,600	1,245.00	3,237,000
ナガワ	4,100	7,540.00	30,914,000
よみうりランド	2,800	4,515.00	12,642,000
東京都競馬	8,400	3,325.00	27,930,000

カナモト	20,900	3,140.00	65,626,000	
東京ドーム	51,800	1,005.00	52,059,000	
西尾レントオール	13,000	3,175.00	41,275,000	
トランス・コスモス	12,200	2,990.00	36,478,000	
乃村工藝社	54,800	1,426.00	78,144,800	
藤田観光	5,600	2,919.00	16,346,400	
KNT-CTホールディングス	7,900	1,497.00	11,826,300	
日本管財	13,700	1,939.00	26,564,300	
トーカイ	12,400	2,566.00	31,818,400	
白洋舎	1,500	2,916.00	4,374,000	
セコム	135,400	9,569.00	1,295,642,600	
セントラル警備保障	6,200	6,370.00	39,494,000	
丹青社	24,200	1,199.00	29,015,800	
メイテック	15,800	5,810.00	91,798,000	
応用地質	13,800	1,404.00	19,375,200	
船井総研ホールディングス	26,400	2,591.00	68,402,400	
進学会ホールディングス	5,300	570.00	3,021,000	
オオバ	10,200	776.00	7,915,200	
いであ	2,400	2,280.00	5,472,000	
学究社	3,800	1,343.00	5,103,400	
ベネッセホールディングス	42,500	2,970.00	126,225,000	
イオンディライト	15,800	3,855.00	60,909,000	
ナック	7,200	1,077.00	7,754,400	
ニチイ学館	18,200	1,750.00	31,850,000	
ダイセキ	21,400	3,200.00	68,480,000	
ステップ	4,800	1,495.00	7,176,000	
合 計	155,614,600		319,850,480,690	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

（2019年12月30日現在）

資産総額	2,916,422,524円
負債総額	1,159,915円
純資産総額（ - ）	2,915,262,609円
発行済口数	3,124,318,029口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9331円
（1万口当たり純資産額）	（9,331円）

（参考）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年12月30日現在）

資産総額	393,598,670,333円
負債総額	138,529,404円
純資産総額（ - ）	393,460,140,929円
発行済口数	137,722,225,957口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8569円
（1万口当たり純資産額）	（28,569円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2019年12月30日現在）

資産総額	323,711,310,253円
負債総額	224,610,825円
純資産総額（ - ）	323,486,699,428円
発行済口数	201,625,803,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6044円
（1万口当たり純資産額）	（16,044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。

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。

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。

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。

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。

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として）に支払います。

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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年12月30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年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

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、各取締役に対して会日の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、招集の手続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。

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

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。

[D0（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 - D0 - 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2020年 2月19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。

2019年12月30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	539	12,804,006
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	326,953
単位型公社債投資信託	17	140,733
合計	643	13,271,692

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 （2018年3月31日現在）	当事業年度 （2019年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：千円)

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

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

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価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. 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、原則として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。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

6. 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。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。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なっております。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9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。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なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。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なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

(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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

4. 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(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 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

2019年6月27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(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

(リ - 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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券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有価証券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。

有価証券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6.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。

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。

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。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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。

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

(*) 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。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

（*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）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。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらは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。

（4）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

これらは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。

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5 年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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:千円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
香港ドル	560	-	4	4	
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計		1,346,753	-	7,916	7,916

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建 ユーロ		6,313	-	86
			合計		8,643,951

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、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. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	
有価証券評価差額	-		173,602	"
繰延ヘッジ損益	-		58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社(当社の親会社の連結子会社)を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

(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。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	4,679,437千円

〔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。

(持分法損益等)

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 2017年4月1日 至 2018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（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	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	投信販売 代行手数料 等	9,571,581	未払 手数料	1,568,277
							投資助言費 用	4,809,206	その他 未払金	424,421

(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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	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	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	無対価		

(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

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。

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

(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(2018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(2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826

固定資産

有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358

固定資産合計		18,780
--------	--	--------

資産合計		62,606
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216

固定負債

退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく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。）

時価のないもの

移動平均法による原価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）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

7．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。

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

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

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額:投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)は、市場

価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（５）投資有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

時価のある子会社株式はありません。なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（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	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

（注） 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
	合計			5,046	-

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

(関連情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

略しております。

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己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)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）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

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 2月19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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するた

め、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 6月17日	臨時報告書
2019年 8月20日	有価証券届出書
2019年 8月20日	有価証券報告書
2019年 9月17日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月5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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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2019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すべ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。

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年1月17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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

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」に掲げられているグローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2019年5月21日から2019年11月19日までの特定期間の財務諸表、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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2019年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべ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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内 知 明	印

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。