

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年8月19日提出
【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
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜 2.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

### （６）【申込単位】

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

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

**( 7 ) 【申込期間】**

2020年 8月20日から2021年 2月19日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、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。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、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－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  TOPIX  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。

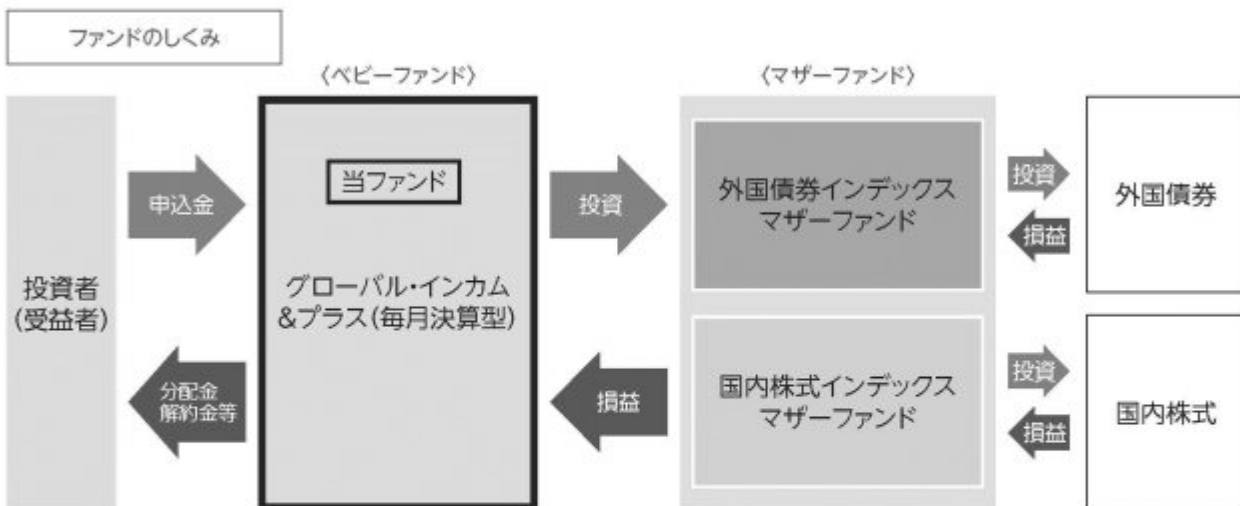
(3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

## 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。

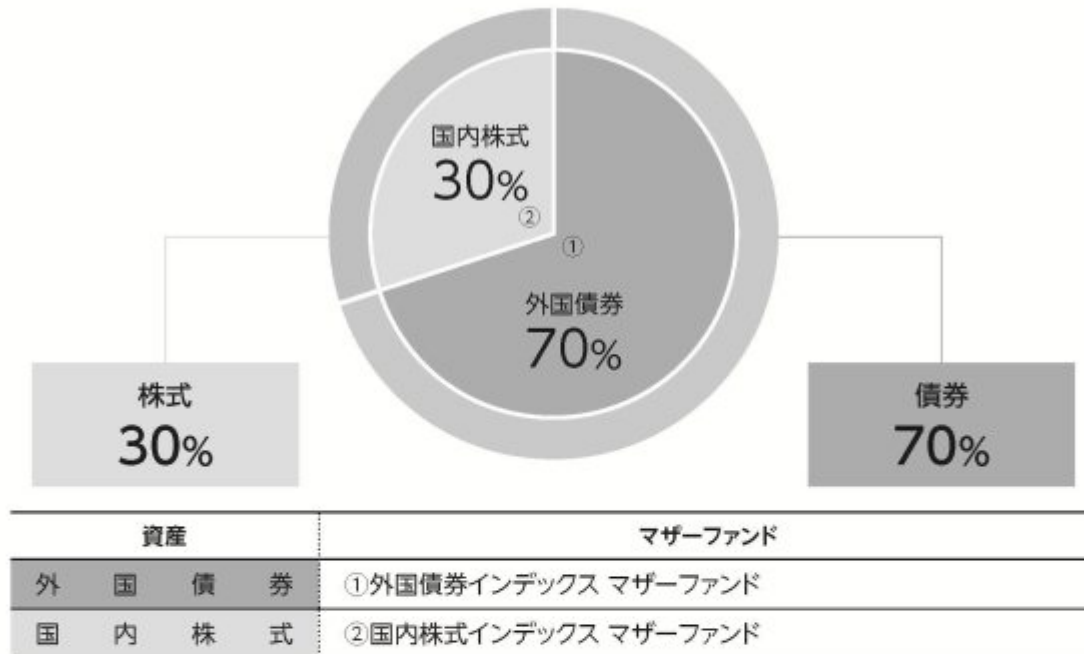
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※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。

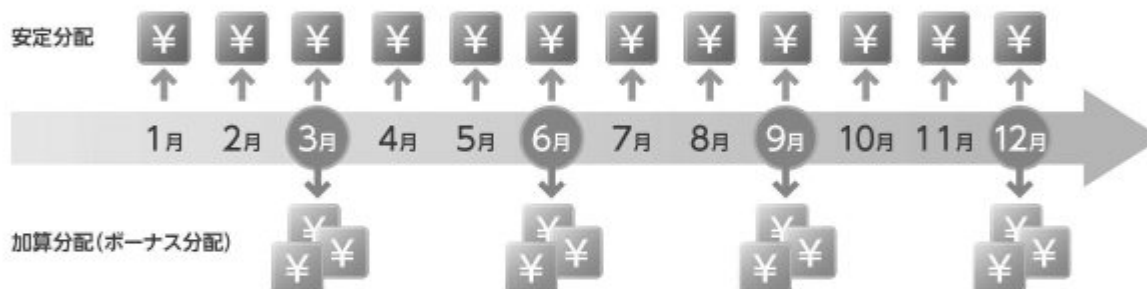
4.

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】

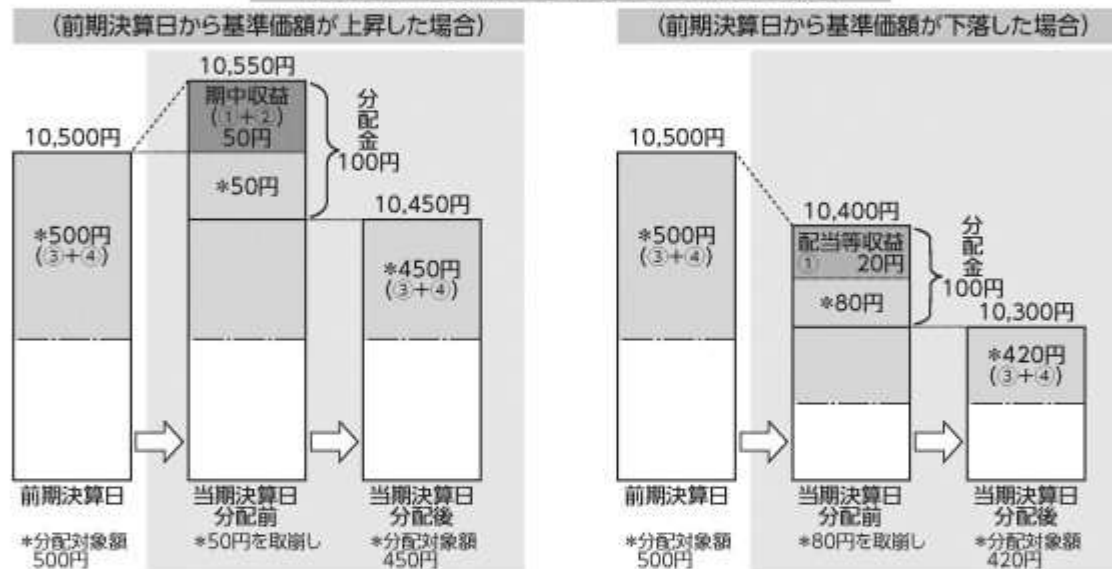
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

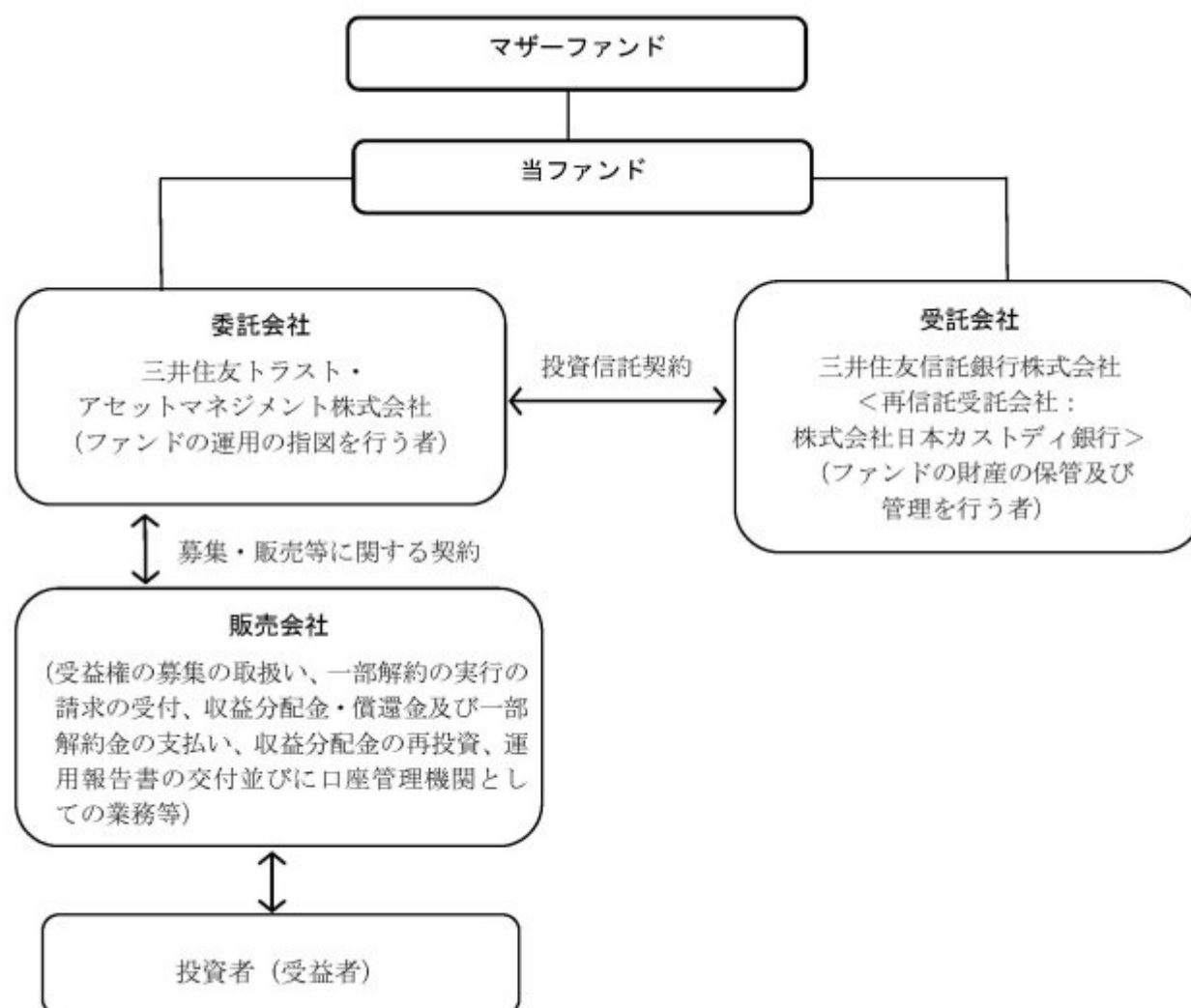
2012年4月1日

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（2020年 6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ます。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。

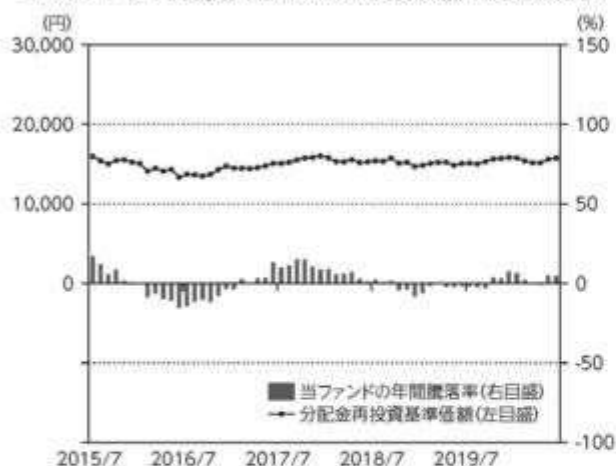
#### (2)リスクの管理体制

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】

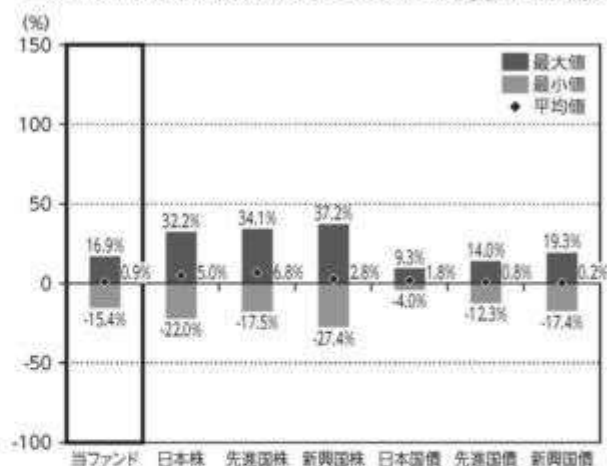
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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7月～2020年6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国内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。「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、ファンドの認定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募認定利付国債の市場主体の動きを表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社が、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により開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのサポーターではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。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 JPMorgan Global Bond Index - Emerging Market (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していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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す。

## （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、2020年6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、2020年6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	2,673,311,862	97.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		57,093,285	2.09
合計（純資産総額）		2,730,405,147	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	636,319,372	2.9096	1,851,434,924	2.9466	1,874,978,661	68.67
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	541,683,540	1.4944	809,491,883	1.4738	798,333,201	29.24

(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	97.91
合計	97.91

(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
第31特定期間末	(2020年 5月19日)	2,657,035,815	2,660,011,967	8,928	8,938
	2019年 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	
	2020年 1月末日	2,856,339,365		9,295	
	2月末日	2,747,939,201		9,068	
	3月末日	2,672,291,622		8,908	
	4月末日	2,650,871,317		8,897	
	5月末日	2,720,517,535		9,145	
	6月末日	2,730,405,147		9,223	

## 【分配の推移】

	期 間	1万円当たりの分配金（円）
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
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	60

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	2.5

(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
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	7,421,919	192,075,711	2,976,152,375

(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	124,927,985,639	43.96

フランス	27,793,097,291	9.78
イタリア	25,063,081,254	8.82
ドイツ	20,738,592,855	7.30
イギリス	18,014,335,200	6.34
スペイン	16,288,102,504	5.73
ベルギー	7,052,422,586	2.48
オーストラリア	5,943,258,743	2.09
オランダ	5,388,043,807	1.90
カナダ	5,332,442,377	1.88
オーストリア	4,261,748,715	1.50
アイルランド	2,147,791,100	0.76
メキシコ	2,141,339,927	0.75
ポーランド	1,670,446,128	0.59
フィンランド	1,647,632,273	0.58
デンマーク	1,436,327,855	0.51
マレーシア	1,391,303,838	0.49
シンガポール	1,270,618,006	0.45
イスラエル	1,048,582,809	0.37
スウェーデン	803,743,040	0.28
ノルウェー	580,311,340	0.20
小計	274,941,207,287	96.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	9,229,569,271	3.25
合計(純資産総額)	284,170,776,558	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	2,966,187,465	1.04
	買建	ドイツ	3,520,844,152	1.24

(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		6,763,327,600	2.38

(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 2.375% 05/15/29	15,010,000	12,401.04	1,861,396,463	12,455.75	1,869,608,684	2.375	2029/5/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/15/29	14,650,000	11,715.04	1,716,253,588	11,775.64	1,725,132,037	1.625	2029/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	12,500,000	11,713.35	1,464,169,766	11,724.72	1,465,590,169	2.375	2024/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/46	10,790,000	12,665.34	1,366,590,411	12,839.57	1,385,390,446	2.250	2046/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	12,150,000	11,152.35	1,355,010,840	11,146.46	1,354,294,952	1.625	2022/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 09/15/21	12,000,000	11,132.15	1,335,858,163	11,110.68	1,333,282,500	2.750	2021/9/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	10,200,000	12,822.74	1,307,919,831	13,017.18	1,327,752,413	2.250	2049/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	12,143.47	1,305,423,719	12,172.93	1,308,590,680	2.375	2027/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,598.84	1,258,624,740	12,647.66	1,263,501,826	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/21	11,000,000	11,109.21	1,222,013,592	11,087.11	1,219,583,131	2.750	2021/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,808.05	1,206,782,859	11,842.98	1,210,352,843	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,698.62	1,187,410,743	11,714.19	1,188,991,289	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/48	7,300,000	15,686.27	1,145,097,756	15,903.43	1,160,950,686	3.375	2048/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	8,500,000	13,231.81	1,124,704,594	13,411.10	1,139,943,916	2.500	2046/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,741.93	1,136,580,908	12,778.97	1,139,884,486	2.875	2028/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.125% 09/30/21	10,300,000	11,053.87	1,138,548,759	11,038.29	1,136,944,867	2.125	2021/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	11,244.52	1,124,452,083	11,235.26	1,123,526,187	2.000	2022/10/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	11,087.54	1,108,754,020	11,080.38	1,108,038,562	1.500	2022/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,795.33	1,095,726,251	10,799.67	1,096,166,748	0.250	2023/4/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	12,928.49	1,097,629,532	12,910.63	1,096,113,278	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,006.23	1,092,524,002	13,045.79	1,095,847,112	3.125	2028/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.25% 10/31/21	10,000,000	10,937.50	1,093,750,385	10,930.77	1,093,077,010	1.250	2021/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,017.21	1,075,541,068	12,048.36	1,078,328,415	2.250	2027/2/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000	21,831.20	1,054,447,362	22,283.92	1,076,313,647	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	11,112.37	1,061,231,424	11,101.00	1,060,146,235	1.750	2022/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	11,084.38	1,058,558,648	11,072.59	1,057,433,270	1.750	2022/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/49	7,000,000	14,729.23	1,031,046,552	14,942.19	1,045,953,387	3.000	2049/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,085.39	1,033,301,512	12,115.69	1,035,892,322	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/31/26	8,600,000	11,842.56	1,018,460,330	11,874.54	1,021,211,067	2.125	2026/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,555.11	1,014,539,097	11,591.72	1,017,753,875	1.625	2026/11/30	0.36

(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	96.75
合計	96.75

(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	83	アメリカドル	10,402,866.37	1,120,804,822	10,439,195.52	1,124,718,925	0.40
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	52	アメリカドル	7,200,533.15	775,785,442	7,245,062.76	780,583,062	0.27
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	55	アメリカドル	9,708,931.75	1,046,040,307	9,846,718.75	1,060,885,478	0.37
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	40	ユーロ	4,481,175	542,580,669	4,486,000	543,164,880	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	50	ユーロ	6,711,700	812,652,636	6,750,000	817,290,000	0.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	101	ユーロ	17,601,244	2,131,158,623	17,842,660	2,160,389,272	0.76

(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	29,030,000.00	3,105,494,798	3,127,111,600	1.10
	カナダドル	買建	3,890,000.00	309,330,468	306,493,100	0.11
	ユーロ	買建	23,550,000.00	2,863,188,416	2,851,434,000	1.00
	イギリスポンド	買建	3,610,000.00	489,912,934	478,288,900	0.17

(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	317,813,283,870	98.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,035,403,784	1.25
合計(純資産総額)		321,848,687,654	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	4,005,345,000	1.24

(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	1,621,500	6,768.89	10,975,768,126	6,762.00	10,964,583,000	3.41
日本	株式	ソニー	電気機器	910,400	6,901.78	6,283,388,728	7,384.00	6,722,393,600	2.09
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,131,500	4,857.37	5,496,116,909	5,450.00	6,166,675,000	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	131,700	44,369.40	5,843,450,296	45,030.00	5,930,451,000	1.84
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,906,300	2,448.03	4,666,682,260	2,515.50	4,795,297,650	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,209,100	4,183.19	5,057,895,892	3,848.00	4,652,616,800	1.45
日本	株式	任天堂	その他製品	89,100	43,679.51	3,891,844,444	48,010.00	4,277,691,000	1.33
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,804,900	445.12	4,364,357,190	421.60	4,133,745,840	1.28
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	994,900	3,720.01	3,701,046,566	3,682.00	3,663,221,800	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	415,900	10,034.12	4,173,194,234	8,806.00	3,662,415,400	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,039,700	3,139.64	3,264,283,708	3,234.00	3,362,389,800	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	185,200	15,895.06	2,943,766,832	17,335.00	3,210,442,000	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,144,200	2,792.29	3,194,943,736	2,755.50	3,152,843,100	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	244,400	12,617.73	3,083,773,840	12,595.00	3,078,218,000	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	991,300	3,127.84	3,100,628,390	3,032.00	3,005,621,600	0.93
日本	株式	花王	化学	348,000	8,656.42	3,012,437,008	8,540.00	2,971,920,000	0.92

日本	株式	HOYA	精密機器	288,300	10,109.96	2,914,704,277	10,260.00	2,957,958,000	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,019,800	2,949.27	3,007,668,084	2,882.00	2,939,063,600	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	427,000	6,035.90	2,577,330,918	6,316.00	2,696,932,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	136,700	19,269.50	2,634,140,650	19,260.00	2,632,842,000	0.82
日本	株式	中外製薬	医薬品	454,500	5,300.28	2,408,978,518	5,765.00	2,620,192,500	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,476,700	134.80	2,625,468,508	132.20	2,574,819,740	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	349,800	6,640.08	2,322,702,434	7,196.00	2,517,160,800	0.78
日本	株式	S M C	機械	45,600	54,473.00	2,483,969,011	55,180.00	2,516,208,000	0.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	92,200	21,632.04	1,994,474,912	26,440.00	2,437,768,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	506,800	4,682.07	2,372,875,868	4,698.00	2,380,946,400	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	698,300	3,464.77	2,419,451,599	3,403.00	2,376,314,900	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,001,100	2,312.68	2,315,233,134	2,321.50	2,324,053,650	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,260,000	1,909.96	2,406,551,006	1,799.50	2,267,370,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	938,500	2,513.81	2,359,210,685	2,270.00	2,130,395,000	0.66

(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	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.56
		食料品	3.89
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.22
		医薬品	6.81
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.54
		機械	5.21
		電気機器	14.93
		輸送用機器	7.19
		精密機器	2.61
		その他製品	2.46
		電気・ガス業	1.54
陸運業	3.97		
海運業	0.13		

	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.83
	卸売業	4.41
	小売業	4.92
	銀行業	4.89
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	1.98
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.99
	サービス業	5.22
	小計	98.75
合計		98.75

(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	257	円	4,075,394,300	4,005,345,000	1.24

(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：2020年6月30日

**基準価額・純資産の推移**

※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年間の推移を表示しております。

基準価額 9,223円  
純資産総額 27,30億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

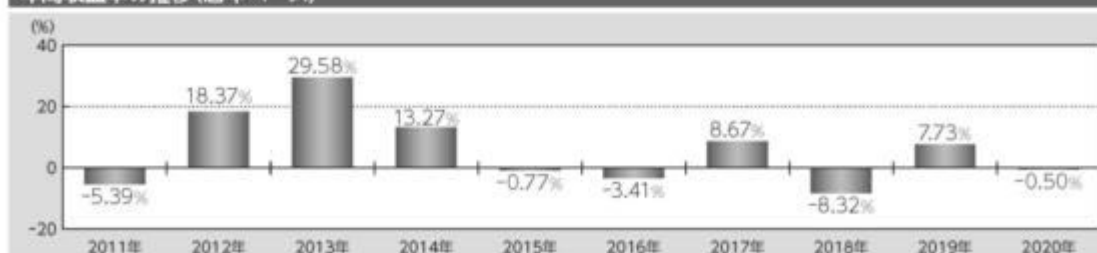
決算期	分配金
2020年2月	10円
2020年3月	10円
2020年4月	10円
2020年5月	10円
2020年6月	10円
直近1年間 分配金合計額	120円
設定来 分配金合計額	4,966円

※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。

**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	68.7%	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	国債	-	2.375%	2029/05/15	0.5%
		T 1.625% 08/15/29	アメリカ	国債	-	1.625%	2029/08/15	0.4%
		T 2.375% 08/15/24	アメリカ	国債	-	2.375%	2024/08/15	0.4%
		T 2.25% 08/15/46	アメリカ	国債	-	2.250%	2046/08/15	0.3%
		T 1.625% 11/15/22	アメリカ	国債	-	1.625%	2022/11/15	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	29.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.4%

※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。

※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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）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）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31特定期間(2019年11月20日から2020年5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&amp;プラス（毎月決算型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第30特定期間 （2019年11月19日現在）	第31特定期間 （2020年 5月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	32,972,984	55,062,113
親投資信託受益証券	2,881,193,361	2,602,930,713
未収入金	12,200,000	4,800,000
流動資産合計	2,926,366,345	2,662,792,826
資産合計	2,926,366,345	2,662,792,826
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,160,806	2,976,152
未払解約金	6,285,611	-
未払受託者報酬	178,478	161,538
未払委託者報酬	2,881,178	2,607,678
未払利息	65	114
その他未払費用	12,741	11,529
流動負債合計	12,518,879	5,757,011
負債合計	12,518,879	5,757,011
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,160,806,167	2,976,152,375
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	246,958,701	319,116,560
（分配準備積立金）	98,144,688	97,956,002
元本等合計	2,913,847,466	2,657,035,815
純資産合計	2,913,847,466	2,657,035,815
負債純資産合計	2,926,366,345	2,662,792,826

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日	第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日
営業収益		
受取利息	13	110
有価証券売買等損益	138,842,359	50,692,648
営業収益合計	138,842,372	50,692,538
営業費用		
支払利息	10,515	10,560
受託者報酬	1,104,235	1,066,445
委託者報酬	17,825,526	17,215,368
その他費用	78,834	76,115
営業費用合計	19,019,110	18,368,488
営業利益又は営業損失（ ）	119,823,262	69,061,026
経常利益又は経常損失（ ）	119,823,262	69,061,026
当期純利益又は当期純損失（ ）	119,823,262	69,061,026
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（ ）	353,965	405,453
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	362,887,731	246,958,701
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,610,103	15,452,312
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,610,103	15,452,312
剰余金減少額又は欠損金増加額	835,708	692,693
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	835,708	692,693
分配金	19,314,662	18,261,905
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	246,958,701	319,116,560

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第30特定期間 (2019年11月19日現在)	第31特定期間 (2020年5月19日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	3,160,806,167口	2,976,152,375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 246,958,701円	元本の欠損 319,116,560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 0.9219円 (1万口当たり純資産額) (9,219円)	1口当たり純資産額 0.8928円 (1万口当たり純資産額) (8,928円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日	第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5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	分配金の計算過程 第179期 自 2019年11月20日 至 2019年12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>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> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>109,529,106円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,288,335,460口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>333円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10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	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	3,288,335,460口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	333円	1万口当たり分配金額	H	10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>3,414,512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>9,225,504円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>97,185,114円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>109,825,130円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,130,683,052口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>350円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,414,512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	9,225,504円	分配準備積立金額	D	97,185,114円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,825,130円	当ファンドの期末残存口数	F	3,130,683,052口	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
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																																																					
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	3,288,335,460口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	333円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	3,414,512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	9,225,504円																																																					
分配準備積立金額	D	97,185,114円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,825,130円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	3,130,683,052口																																																					
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																																																					

第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日			第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日		
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,288,335円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,130,683円
第174期 自 2019年 6月20日 至 2019年 7月19日			第180期 自 2019年12月20日 至 2020年 1月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,074,253円	費用控除後の配当等収益額	A	4,279,823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	9,449,521円	収益調整金額	C	9,201,154円
分配準備積立金額	D	95,865,218円	分配準備積立金額	D	96,804,356円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	108,388,992円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	110,285,333円
当ファンドの期末残存口数	F	3,259,662,285口	当ファンドの期末残存口数	F	3,110,453,157口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	332円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	354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	$I=F \times H / 10,000$	3,259,662円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,110,453円
第175期 自 2019年 7月20日 至 2019年 8月19日			第181期 自 2020年 1月21日 至 2020年 2月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	694,832円	費用控除後の配当等収益額	A	413,175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	9,375,158円	収益調整金額	C	9,050,469円
分配準備積立金額	D	94,667,934円	分配準備積立金額	D	96,103,494円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	104,737,924円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,567,138円
当ファンドの期末残存口数	F	3,225,973,244口	当ファンドの期末残存口数	F	3,051,792,385口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	324円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	345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	$I=F \times H / 10,000$	3,225,973円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,051,792円
第176期 自 2019年 8月20日 至 2019年 9月19日			第182期 自 2020年 2月20日 至 2020年 3月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,778,257円	費用控除後の配当等収益額	A	640,286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	9,355,037円	収益調整金額	C	8,970,054円
分配準備積立金額	D	91,346,362円	分配準備積立金額	D	91,940,313円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	104,479,656円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,550,653円
当ファンドの期末残存口数	F	3,200,209,850口	当ファンドの期末残存口数	F	3,003,990,588口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	326円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	338円

第30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日			第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日		
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
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	3,200,209円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	3,003,990円
第177期 自 2019年 9月20日 至 2019年10月21日			第183期 自 2020年 3月20日 至 2020年 4月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,747,028円	費用控除後の配当等収益額	A	12,931,965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	9,319,225円	収益調整金額	C	8,953,036円
分配準備積立金額	D	91,312,168円	分配準備積立金額	D	89,098,888円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	111,378,421円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	110,983,889円
当ファンドの期末残存口数	F	3,179,677,016口	当ファンドの期末残存口数	F	2,988,835,925口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	350円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	371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
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	3,179,677円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,988,835円
第178期 自 2019年10月22日 至 2019年11月19日			第184期 自 2020年 4月21日 至 2020年 5月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,038,216円	費用控除後の配当等収益額	A	2,373,643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	9,289,604円	収益調整金額	C	8,978,576円
分配準備積立金額	D	98,267,278円	分配準備積立金額	D	98,558,511円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	110,595,098円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	109,910,730円
当ファンドの期末残存口数	F	3,160,806,167口	当ファンドの期末残存口数	F	2,976,152,375口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	349円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	369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
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	3,160,806円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,976,152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31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5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31特定期間 (2020年 5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30特定期間 自 2019年 5月21日 至 2019年11月19日	第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,313,848,126円	3,160,806,167円
期中追加設定元本額	8,156,132円	7,421,919円
期中一部解約元本額	161,198,091円	192,075,711円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第30特定期間 (2019年11月19日現在)	第31特定期間 (2020年 5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	20,469,662	19,991,810
合計	20,469,662	19,991,810

## （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	584,422,655	819,944,984	
	外国債券インデックス マザーファンド	622,333,588	1,782,985,729	
合計		1,206,756,243	2,602,930,713	

(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

	2020年 5月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	461,352,981
コール・ローン	4,253,643,864
国債証券	265,406,916,186
派生商品評価勘定	26,649,671
未収入金	948,350
未収利息	1,551,595,689
前払費用	131,116,010
差入委託証拠金	473,719,594
流動資産合計	272,305,942,345
資産合計	272,305,942,345
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,736,608
前受金	930,787
未払金	1,140,632
未払解約金	441,075,825
未払利息	8,861
流動負債合計	453,892,713
負債合計	453,892,713
純資産の部	
元本等	
元本	94,886,392,267
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	176,965,657,365



	2020年 5月19日現在
項目	金額（円）
元本等合計	271,852,049,632
純資産合計	271,852,049,632
負債純資産合計	272,305,942,345

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 5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）

		2020年 5月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		94,886,392,267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)	2.8650円 (28,650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

		2020年 5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

		2020年 5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。	

	2020年 5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>(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	2020年 5月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月20日
期首元本額	138,928,212,558円
期中追加設定元本額	9,800,227,174円
期中一部解約元本額	53,842,047,465円
期末元本額	94,886,392,267円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,630,275,849円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	622,333,588円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	427,119,141円

区分	2020年 5月19日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,022,503,863円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,906,861円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,517,389,265円
世界経済インデックスファンド	6,508,007,538円
D C マイセレクション 2 5	1,746,900,933円
D C マイセレクション 5 0	1,309,435,330円
D C マイセレクション 7 5	846,349,339円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,973,750,326円
D C マイセレクション S 2 5	733,191,623円
D C マイセレクション S 5 0	548,200,492円
D C マイセレクション S 7 5	237,735,270円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	43,644,647円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	64,283,637円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	29,976,456円
D C 世界経済インデックスファンド	8,450,031,397円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	605,125,050円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	30,990,618円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,454,903円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,876,546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）	50,188,117円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	80,741,779円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	123,269,428円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	128,500,127円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	234,135,680円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,845,836,352円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	517,608,634円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,906,640,648円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	758,810,254円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	68,561,341円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	528,933,284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）	30,886,754円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	215,826,773円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	269,622,961円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	880,880,976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）	2,035,616,272円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	793,370,537円
外国債券ファンド・シリーズ 1	595,766,137円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,079,149,805円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,644,409,609円
分散投資コア戦略ファンド A	1,656,350,336円
分散投資コア戦略ファンド S	5,810,356,988円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	306,307,671円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,782,821,339円

区分	2020年 5月19日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	563,477,235円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	196,156,818円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,814,219円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,070,577,143円
SMT インデックスバランス・オープン	177,339,697円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	19,865,986,781円
SMT 世界経済インデックス・オープン	91,567,628円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	101,980,211円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	172,022,865円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,639,077円
グローバル経済コア	829,255,541円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	8,711,139円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	160,416円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	218,715,325円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	19,162,672円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	85,255円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	175,176円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	81,075円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	72,551円
FOFs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）	635,276,424円
FOFs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）	10,357,270,527円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	343,937,925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）	371,151,057円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	64,701,036円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5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		13,727,902,939
合計		13,727,902,939

(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

（2020年 5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	3,725,411,393	-	3,726,342,180	930,787
合計		3,725,411,393	-	3,726,342,180	930,787

## (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

(2020年 5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	3,605,870,924	-	3,620,853,200	14,982,276
	アメリカドル	1,696,603,363	-	1,699,632,000	3,028,637
	カナダドル	163,023,989	-	164,822,800	1,798,811
	ユーロ	1,472,996,514	-	1,483,752,000	10,755,486
	イギリスポンド	273,247,058	-	272,646,400	600,658
合計		3,605,870,924	-	3,620,853,200	14,982,276

## (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% 06/30/21	9,800,000.00	9,905,273.46	
		T 1.125% 07/31/21	5,000,000.00	5,057,519.55	

T 1.125% 09/30/21	2,800,000.00	2,836,039.05	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,694,853.52	
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,153,906.30	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,175,976.55	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,591,503.90	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,149,531.24	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,140,429.70	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,599,492.21	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,076,960.91	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,146,406.24	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,292,187.50	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,910,890.60	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,927,324.24	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,630,929.72	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,643,691.41	
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,825,640.62	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,041,875.00	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,579,882.82	
T 1.625% 08/15/29	14,650,000.00	15,878,082.10	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,162,109.40	
T 1.625% 10/31/23	5,000,000.00	5,233,398.45	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,809,003.88	
T 1.625% 11/15/22	12,150,000.00	12,576,673.85	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,395,971.87	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,861,437.50	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,569,384.77	
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,827,733.38	
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,667,578.12	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,917,488.28	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,856,338.29	
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,851,048.85	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,230,234.41	
T 1.75% 06/30/24	7,600,000.00	8,044,421.85	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,597,550.04	
T 1.75% 07/31/21	6,700,000.00	6,826,933.57	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,338,095.71	
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,194,750.96	
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,199,746.12	
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,575,000.00	
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,672,304.71	
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,595,494.12	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,331,523.46	

T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,623,648.84
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,153,125.00
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,393,750.00
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,753,529.31
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,540,167.96
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,450,824.20
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,918,289.04
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,935,159.95
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,605,500.00
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,434,468.75
T 2.125% 06/30/21	7,500,000.00	7,664,794.95
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,245,859.36
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,160,000.00
T 2.125% 08/15/21	5,370,000.00	5,500,264.43
T 2.125% 09/30/21	10,300,000.00	10,572,990.27
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,618,750.00
T 2.125% 11/30/23	5,680,000.00	6,049,643.77
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,608,964.83
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,585,168.75
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,289,531.24
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,961,070.31
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,156,406.24
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,533,750.00
T 2.25% 07/31/21	3,000,000.00	3,074,824.23
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,572,660.19
T 2.25% 08/15/46	10,790,000.00	12,765,075.83
T 2.25% 08/15/49	10,200,000.00	12,200,156.25
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,828,855.45
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	11,007,199.26
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,830,546.86
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,584,734.37
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,818,691.39
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,127,781.29
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,290,429.70
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,210,675.01
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,443,421.85
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	12,093,750.00
T 2.375% 05/15/29	15,010,000.00	17,229,838.35
T 2.375% 08/15/24	12,500,000.00	13,575,195.37
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,747,685.55
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,812,859.37
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,498,242.20
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,112,914.08



T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,423,955.49	
T 2.5% 02/15/46	8,500,000.00	10,506,132.85	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,313,091.80	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,586,003.92	
T 2.5% 05/15/46	10,050,000.00	12,432,164.06	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,880,052.72	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,261,044.12	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,653,178.95	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,493,187.50	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	8,036,171.87	
T 2.625% 06/15/21	10,000,000.00	10,265,429.70	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,262,906.25	
T 2.625% 07/15/21	3,350,000.00	3,445,396.47	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,795,312.50	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,521,128.12	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,274,453.14	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,650,937.52	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,866,062.50	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,174,334.39	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,153,769.54	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,079,765.63	
T 2.75% 08/15/21	11,000,000.00	11,352,558.58	
T 2.75% 08/15/42	3,000,000.00	3,818,671.89	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,444,281.25	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,741,207.01	
T 2.75% 09/15/21	12,000,000.00	12,408,046.92	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,646,654.70	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	5,345,484.39	
T 2.75% 11/15/47	4,550,000.00	5,929,929.68	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,488,593.76	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,539,007.84	
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,695,000.00	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,494,696.12	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,292,725.00	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,152,524.23	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,526,296.91	
T 2.875% 08/15/45	9,300,000.00	12,228,046.87	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,165,996.11	
T 2.875% 10/15/21	7,250,000.00	7,524,423.81	
T 2.875% 10/31/23	5,500,000.00	5,992,421.87	
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,684,489.22	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,387,453.12	

T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,578,613.27
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,243,164.05
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,108,379.72
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,696,484.40
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,643,710.93
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,872,585.92
T 2% 05/31/24	8,000,000.00	8,541,562.48
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,877,480.45
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,118,945.32
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,455,195.31
T 2% 08/31/21	3,740,000.00	3,827,656.25
T 2% 10/31/21	5,650,000.00	5,798,643.53
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,437,500.00
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,465,390.61
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,178,524.19
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,090,312.50
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,264,109.38
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,168,828.12
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,721,992.20
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,557,968.75
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,384,454.68
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	10,119,375.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,354,296.87
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,360,157.05
T 3.375% 11/15/48	7,300,000.00	10,673,398.47
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,084,917.97
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,502,125.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,909,687.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,927,968.76
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	8,158,906.25
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,147,472.66
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	6,066,601.56
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,613,515.66
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,144,854.69
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,687,812.50
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,760,692.99
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,456,707.05
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,773,726.55
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,691,406.25
T 3% 11/15/44	6,050,000.00	8,076,750.00
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,384,945.31
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,648,925.79
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,544,765.63

	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,987,007.82
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,083,437.50
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,972,687.50
	T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,420,402.35
	T 4.5% 05/15/38	1,600,000.00	2,509,250.00
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,695,429.69
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,840,539.07
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,235,566.41
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,793,687.50
	T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,740,332.03
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,797,960.94
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,891,179.68
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,672,125.00
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,236,031.25
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	2,043,593.75
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,614,703.12
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,971,041.01
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,898,388.67
	<b>アメリカドル 小計</b>	1,029,250,000.00	1,151,630,675.21 (123,627,552,983)
<b>カナダドル</b>	CAN 0.5% 03/01/22	4,030,000.00	4,048,034.25
	CAN 0.5% 09/01/25	700,000.00	703,811.50
	CAN 0.75% 09/01/21	2,700,000.00	2,717,793.00
	CAN 1.25% 06/01/30	1,730,000.00	1,849,793.85
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,907,260.00
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,235,518.90
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,110,274.80
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,449,624.00
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	629,061.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,769,506.00
	CAN 1.75% 05/01/21	2,700,000.00	2,738,853.00
	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	519,142.50
	CAN 1% 09/01/22	1,500,000.00	1,525,177.50
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,465,956.50
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,970,181.00
	CAN 2.25% 06/01/29	2,190,000.00	2,530,577.85
	CAN 2.5% 06/01/24	4,560,000.00	4,959,524.40
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,856,692.90
	CAN 2.75% 12/01/48	1,980,000.00	2,793,067.20
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	894,353.60
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,467,665.05
	CAN 2% 09/01/23	2,110,000.00	2,226,018.35

	CAN 2% 12/01/51	1,970,000.00	2,455,516.35
	CAN 3.25% 06/01/21	1,840,000.00	1,897,288.40
	CAN 3.5% 12/01/45	2,140,000.00	3,300,864.40
	CAN 4.0% 06/01/41	1,850,000.00	2,901,003.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,710,744.75
	CAN 5.75% 06/01/33	1,600,000.00	2,605,336.00
	CAN 5% 06/01/37	1,580,000.00	2,607,355.50
	CAN 8.0% 06/01/27	1,850,000.00	2,813,609.50
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>58,080,000.00</b>	<b>67,659,605.55</b> <b>(5,213,172,607)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,397,534.75
	MBONO 10% 12/05/24	25,860,000.00	30,805,595.70
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	25,931,921.40
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	26,974,538.55
	MBONO 6.5% 06/10/21	39,660,000.00	40,268,384.40
	MBONO 6.75% 03/09/23	10,400,000.00	10,871,380.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,172,620.20
	MBONO 7.5% 06/03/27	41,630,000.00	45,704,952.55
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	18,731,597.90
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,075,973.35
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,580,000.00	17,409,637.30
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	43,968,612.35
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	25,952,466.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,159,151.75
	MBONO 8% 11/07/47	18,770,000.00	20,823,062.60
MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,454,340.30	
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>408,420,000.00</b>	<b>447,701,769.10</b> <b>(2,032,566,031)</b>
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,060,000.00	1,062,877.90
	BGB 0.2% 10/22/23	1,510,000.00	1,542,804.75
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	659,909.10
	BGB 0.5% 10/22/24	970,000.00	1,005,817.25
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,300,652.10
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,800,602.05
	BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,669,870.80
	BGB 0.9% 06/22/29	1,550,000.00	1,676,286.25
	BGB 0% 10/22/27	2,310,000.00	2,323,917.75
	BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	958,940.25
	BGB 1.45% 06/22/37	530,000.00	613,064.25
	BGB 1.6% 06/22/47	1,480,000.00	1,798,658.80
	BGB 1.7% 06/22/50	630,000.00	786,825.90
	BGB 1.9% 06/22/38	1,280,000.00	1,582,188.80
	BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,553,716.20

BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,631,244.55
BGB 2.15% 06/22/66	940,000.00	1,395,777.80
BGB 2.25% 06/22/23	1,450,000.00	1,572,546.75
BGB 2.25% 06/22/57	680,000.00	988,767.60
BGB 2.6% 06/22/24	2,440,000.00	2,738,473.00
BGB 3.75% 06/22/45	1,300,000.00	2,220,133.50
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,409,848.55
BGB 4.25% 03/28/41	2,140,000.00	3,653,472.20
BGB 4.25% 09/28/21	2,350,000.00	2,501,351.75
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,338,066.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,457,433.00
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,322,839.90
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,561,685.40
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,008,259.60
BGB 5% 03/28/35	2,920,000.00	4,873,071.20
BKO 0% 03/11/22	3,100,000.00	3,140,470.50
BKO 0% 06/11/21	2,640,000.00	2,656,962.00
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	1,996,667.40
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	559,227.30
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,579,238.90
BTPS 0.45% 06/01/21	1,400,000.00	1,404,025.00
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,159,074.05
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,202,180.50
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,012,520.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,595,621.90
BTPS 0.95% 08/01/30	650,000.00	604,750.25
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,034,180.30
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,934,185.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	971,750.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,942,920.00
BTPS 1.45% 03/01/36	550,000.00	506,170.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,327,301.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,050,000.00	1,070,333.25
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,437,908.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,444,607.60
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,228,622.20
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,960,967.10
BTPS 1.75% 07/01/24	1,600,000.00	1,643,984.00
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,065,380.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,778,489.00
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,180,358.00
BTPS 2.05% 08/01/27	1,740,000.00	1,806,163.50
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,334,816.00

BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,568,437.50	
BTPS 2.2% 06/01/27	3,680,000.00	3,855,168.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,417,605.40	
BTPS 2.3% 10/15/21	2,700,000.00	2,772,414.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,500,000.00	2,641,175.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	870,000.00	852,082.35	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,960,000.00	3,116,820.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,140,039.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,128,607.75	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	2,612,282.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,360,246.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,071,723.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,750,000.00	3,025,797.50	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,706,933.25	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,173,119.30	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,587,560.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,217,091.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,210,000.00	1,404,604.30	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,492,653.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,592,550.60	
BTPS 3.75% 08/01/21	3,220,000.00	3,352,631.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,388,134.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,590,000.00	3,258,284.75	
BTPS 3% 08/01/29	4,960,000.00	5,532,855.20	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,107,637.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,446,912.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,969,092.30	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,790,000.00	6,509,175.90	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,950,000.00	4,174,241.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,518,533.25	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,076,777.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,210,000.00	5,241,050.05	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	3,949,862.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,669,011.20	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,387,631.25	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,853,650.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,383,825.60	
BTPS 5% 03/01/22	3,250,000.00	3,509,447.50	
BTPS 5% 03/01/25	4,400,000.00	5,182,826.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	4,648,703.40	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	4,512,398.55	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,520,000.00	4,737,251.20	

BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,565,328.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,902,740.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,020,928.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,393,140.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,163,972.70
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,328,894.00
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,173,145.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,206,040.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,596,974.00
DBR 0.5% 08/15/27	3,160,000.00	3,421,363.60
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,737,236.65
DBR 0% 08/15/26	4,470,000.00	4,655,929.65
DBR 0% 08/15/29	2,510,000.00	2,629,036.75
DBR 0% 08/15/50	860,000.00	865,955.50
DBR 1.25% 08/15/48	3,050,000.00	4,171,637.50
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,142,321.20
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,325,907.40
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,494,840.50
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,943,066.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,804,530.75
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,199,432.40
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,147,030.00
DBR 1% 08/15/25	4,120,000.00	4,490,491.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,022,744.75
DBR 2.5% 07/04/44	3,320,000.00	5,446,028.40
DBR 2.5% 08/15/46	4,020,000.00	6,762,343.50
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,446,272.50
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,115,069.10
DBR 3.25% 07/04/21	4,100,000.00	4,278,473.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,940,000.00	5,188,409.10
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,056,462.15
DBR 4.25% 07/04/39	3,010,000.00	5,627,450.85
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,670,916.25
DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,463,834.80
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,705,379.05
DBR 5.5% 01/04/31	2,140,000.00	3,524,569.30
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,467,297.00
DBR 6.25% 01/04/24	5,440,000.00	6,826,955.20
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,080,268.75
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,486,400.30
FRTR 0.25% 11/25/26	4,530,000.00	4,671,313.35
FRTR 0.5% 05/25/25	5,980,000.00	6,242,432.30
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,330,757.00

FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,201,940.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	5,640,000.00	6,038,212.20	
FRTR 0.75% 05/25/52	1,550,000.00	1,544,947.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	4,570,000.00	4,901,416.40	
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,017,960.00	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,364,800.60	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,053,232.50	
FRTR 0% 03/25/25	5,090,000.00	5,180,602.00	
FRTR 0% 05/25/21	4,100,000.00	4,119,885.00	
FRTR 0% 05/25/22	4,050,000.00	4,092,302.25	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,265,733.40	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,787,969.25	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,027,584.85	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,264,463.10	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,330,000.00	4,014,881.10	
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,906,090.35	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,413,279.50	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,264,501.90	
FRTR 1.75% 11/25/24	5,810,000.00	6,378,363.25	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,040,553.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,881,163.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,547,351.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,130,635.70	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,160,000.00	6,442,182.60	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,730,686.50	
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	4,593,945.80	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,190,000.00	5,113,904.95	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,650,000.00	5,954,422.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,783,258.50	
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	9,068,253.90	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,846,317.10	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,830,000.00	8,628,456.90	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,075,680.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,050,000.00	4,076,291.75	
FRTR 4% 04/25/60	1,850,000.00	3,864,104.25	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,489,510.95	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,757,791.80	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,331,540.30	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,558,502.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,264,840.00	
IRISH 0.2% 05/15/27	1,270,000.00	1,286,624.30	
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	473,265.60	



IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	838,327.00
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,141,481.35
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,613.65
IRISH 1.1% 05/15/29	920,000.00	999,506.40
IRISH 1.3% 05/15/33	630,000.00	703,193.40
IRISH 1.35% 03/18/31	390,000.00	435,433.05
IRISH 1.5% 05/15/50	630,000.00	736,060.50
IRISH 1.7% 05/15/37	750,000.00	886,241.25
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,510,816.10
IRISH 2.4% 05/15/30	1,400,000.00	1,704,185.00
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,409,386.35
IRISH 3.4% 03/18/24	1,160,000.00	1,322,835.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,131,528.25
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,918,258.70
NETHER 0.25% 07/15/25	2,400,000.00	2,496,576.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,600,000.00	1,677,824.00
NETHER 0.5% 01/15/40	760,000.00	831,345.00
NETHER 0.5% 07/15/26	1,860,000.00	1,970,372.40
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,285,921.25
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,765,176.30
NETHER 0% 01/15/22	980,000.00	989,804.90
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,889,090.50
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,648,398.50
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,288,780.90
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	701,230.20
NETHER 2.5% 01/15/33	1,650,000.00	2,206,281.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,130,000.00	3,633,172.95
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,204,661.30
NETHER 3.25% 07/15/21	2,740,000.00	2,859,751.70
NETHER 3.75% 01/15/23	2,940,000.00	3,284,229.90
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,717,352.40
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,537,256.75
NETHER 5.5% 01/15/28	1,380,000.00	2,007,182.40
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	243,588.00
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,979,387.50
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,684,436.75
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,876,881.25
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,266,797.60
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,229,472.00
OBL 0% 10/08/21	2,600,000.00	2,623,140.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,547,372.50
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,422,462.25
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,233,384.75

RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	936,845.15
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,736,721.00
RAGB 0.75% 03/20/51	560,000.00	611,920.40
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,285,841.00
RAGB 0% 02/20/30	470,000.00	472,956.30
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,524,802.50
RAGB 0% 07/15/24	920,000.00	938,266.60
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,489.60
RAGB 1.2% 10/20/25	1,660,000.00	1,803,083.70
RAGB 1.5% 02/20/47	830,000.00	1,069,326.35
RAGB 1.5% 11/02/86	450,000.00	644,116.50
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,083,233.25
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,433,793.20
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,418,407.00
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,354,547.85
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,382,360.85
RAGB 3.4% 11/22/22	2,990,000.00	3,291,765.75
RAGB 3.5% 09/15/21	1,730,000.00	1,823,411.35
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,255,195.40
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,053,690.65
RAGB 4.15% 03/15/37	1,770,000.00	2,932,509.45
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,711,272.65
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,729,679.40
RFGB 0.125% 04/15/36	510,000.00	506,299.95
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	650,792.30
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,379,063.20
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	706,066.10
RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	685,204.00
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	542,900.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	736,054.05
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	394,295.85
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	549,255.60
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,204.70
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	729,430.40
RFGB 1.375% 04/15/47	450,000.00	575,217.00
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	689,230.75
RFGB 1.625% 09/15/22	1,250,000.00	1,314,093.75
RFGB 2.625% 07/04/42	570,000.00	863,413.20
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	520,111.20
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	801,642.20
RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	786,278.40
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,940,325.50

SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,312,087.05
SPGB 0.35% 07/30/23	1,440,000.00	1,460,275.20
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,421,368.75
SPGB 0.45% 10/31/22	2,210,000.00	2,247,426.35
SPGB 0.5% 04/30/30	2,150,000.00	2,102,549.50
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,759,302.90
SPGB 0.75% 07/30/21	2,200,000.00	2,229,491.00
SPGB 0% 01/31/25	870,000.00	865,049.70
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,387,294.70
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,187,295.75
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,660,243.00
SPGB 1.4% 04/30/28	4,430,000.00	4,725,126.60
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,521,595.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,059,284.80
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,782,507.00
SPGB 1.5% 04/30/27	3,050,000.00	3,277,636.75
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,268,364.75
SPGB 1.85% 07/30/35	1,820,000.00	2,013,702.60
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,084,789.90
SPGB 1.95% 07/30/30	2,510,000.00	2,805,301.50
SPGB 1% 10/31/50	1,180,000.00	1,021,449.30
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,606,549.20
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,857,654.80
SPGB 2.7% 10/31/48	1,780,000.00	2,259,994.80
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,029,282.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,170,000.00	2,834,302.10
SPGB 3.45% 07/30/66	1,500,000.00	2,307,075.00
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,898,491.40
SPGB 4.2% 01/31/37	2,720,000.00	3,989,206.40
SPGB 4.4% 10/31/23	3,490,000.00	4,031,246.65
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,498,610.20
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,273,645.20
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,830,488.00
SPGB 4.9% 07/30/40	2,590,000.00	4,246,512.20
SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,366,111.10
SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,254,806.75
SPGB 5.4% 01/31/23	2,900,000.00	3,336,885.00
SPGB 5.5% 04/30/21	3,390,000.00	3,577,365.30
SPGB 5.75% 07/30/32	2,730,000.00	4,272,422.70
SPGB 5.85% 01/31/22	4,280,000.00	4,727,773.60
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,664,226.60
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,526,810.25

ユーロ 小計		749,330,000.00	883,876,499.95 (103,581,487,029)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/23	1,090,000.00	1,091,422.45
	UKT 0.5% 07/22/22	3,540,000.00	3,579,594.90
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,494,843.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,977,279.20
	UKT 0.875% 10/22/29	2,760,000.00	2,931,741.00
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,235,972.35
	UKT 1.25% 10/22/41	650,000.00	728,448.50
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,176,830.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,980,000.00	3,618,912.00
	UKT 1.625% 10/22/28	4,040,000.00	4,542,495.20
	UKT 1.625% 10/22/54	1,100,000.00	1,451,758.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,530,000.00	2,349,024.30
	UKT 1.75% 01/22/49	2,120,000.00	2,735,966.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,030,000.00	2,840,690.65
	UKT 1.75% 09/07/22	2,470,000.00	2,569,503.95
	UKT 1.75% 09/07/37	3,530,000.00	4,212,613.75
	UKT 1% 04/22/24	3,100,000.00	3,217,691.50
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,684,362.50
	UKT 2.5% 07/22/65	2,350,000.00	4,208,544.50
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,808,519.40
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,967,282.70
	UKT 3.25% 01/22/44	2,820,000.00	4,413,060.30
	UKT 3.5% 01/22/45	3,030,000.00	4,981,532.10
	UKT 3.5% 07/22/68	2,140,000.00	4,838,764.70
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	4,014,043.55
	UKT 3.75% 09/07/21	2,820,000.00	2,955,726.60
	UKT 4.25% 03/07/36	2,790,000.00	4,372,083.45
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,841,666.75
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,129,767.60
	UKT 4.25% 12/07/27	670,000.00	876,313.10
	UKT 4.25% 12/07/40	2,270,000.00	3,862,632.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	4,088,666.30
	UKT 4.25% 12/07/49	1,890,000.00	3,726,569.70
	UKT 4.25% 12/07/55	2,310,000.00	5,027,229.90
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,760,191.10
UKT 4.5% 12/07/42	2,460,000.00	4,453,313.40	
UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	4,259,984.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	3,295,996.50	
UKT 4% 01/22/60	1,920,000.00	4,292,620.80	
UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,090,809.50	
UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,447,448.30	

	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,869,118.75
	UKT 8% 06/07/21	740,000.00	801,690.10
イギリスポンド 小計		96,200,000.00	133,822,724.35 (17,548,173,844)
スウェーデンクローナ	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,596,766.75
	SGB 0.75% 11/12/29	6,700,000.00	7,218,513.00
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,306,000.00
	SGB 1% 11/12/26	8,640,000.00	9,335,390.40
	SGB 2.5% 05/12/25	8,370,000.00	9,542,846.25
	SGB 3.5% 03/30/39	5,900,000.00	9,260,758.00
	SGB 3.5% 06/01/22	12,850,000.00	13,864,507.50
スウェーデンクローナ 小計		61,110,000.00	69,124,781.90 (764,520,087)
ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	3,610,000.00	3,944,231.85
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,282,497.15
	NGB 1.75% 02/17/27	4,120,000.00	4,536,696.80
	NGB 1.75% 03/13/25	5,190,000.00	5,597,778.30
	NGB 1.75% 09/06/29	5,420,000.00	6,092,269.70
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,547,559.50
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,928,618.80
	NGB 3.75% 05/25/21	11,380,000.00	11,811,472.70
	NGB 3% 03/14/24	6,830,000.00	7,596,086.95
ノルウェークローネ 小計		57,620,000.00	62,337,211.75 (668,254,909)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	3,140,000.00	3,201,748.10
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,455,723.55
	DGB 0.5% 11/15/29	12,460,000.00	13,399,857.80
	DGB 1.5% 11/15/23	7,380,000.00	7,908,002.10
	DGB 1.75% 11/15/25	8,930,000.00	10,044,508.65
	DGB 3% 11/15/21	8,330,000.00	8,767,408.30
	DGB 4.5% 11/15/39	16,530,000.00	31,020,528.60
デンマーククローネ 小計		67,500,000.00	85,797,777.10 (1,348,741,056)
ポーランドズロチ	POLGB 1.75% 07/25/21	4,550,000.00	4,620,388.50
	POLGB 2.25% 04/25/22	4,710,000.00	4,868,515.05
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,181,402.10
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,165,452.50
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,760,000.00	4,022,316.40
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,750,000.00	5,169,781.25
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,497,072.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,721,490.25
	POLGB 2.75% 10/25/29	4,060,000.00	4,606,049.70

	POLGB 3.25% 07/25/25	3,480,000.00	3,898,522.20
	POLGB 4% 10/25/23	4,900,000.00	5,460,241.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	829,326.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,532,725.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,400,000.00	3,658,825.00
ポージランドズロチ 小計		56,380,000.00	61,232,107.45 (1,573,052,840)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,800,000.00	1,791,252.00
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,980,216.20
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,060,000.00	2,162,279.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	3,570,000.00	3,972,089.10
	ACGB 2.25% 11/21/22	4,050,000.00	4,253,289.75
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,347,357.40
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,600,827.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	959,172.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	730,000.00	877,127.85
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,821,191.65
	ACGB 2.75% 11/21/28	2,960,000.00	3,421,552.80
	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,422,551.00
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,983,152.20
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,964,729.20
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,931,254.50
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,320,000.00	1,691,956.20
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,188,976.40
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,138,799.60
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,506,415.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,691,304.60
ACGB 4.75% 04/21/27	4,150,000.00	5,302,849.25	
ACGB 5.5% 04/21/23	2,820,000.00	3,250,769.10	
ACGB 5.75% 05/15/21	3,450,000.00	3,636,610.50	
ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,744,948.25	
オーストラリアドル 小計		67,390,000.00	77,640,670.55 (5,452,704,292)
シンガポールドル	SIGB 1.25% 10/01/21	1,440,000.00	1,461,067.20
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	831,712.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	298,251.95
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	812,212.90
	SIGB 2.25% 06/01/21	1,080,000.00	1,103,284.80
	SIGB 2.25% 08/01/36	510,000.00	599,505.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	320,000.00	351,280.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	260,000.00	317,184.40
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,214,624.25
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,686,567.40

	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	806,782.95
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,151,068.55
	SIGB 2.875% 07/01/29	840,000.00	1,001,187.60
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	421,933.75
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	435,028.45
	SIGB 3.125% 09/01/22	640,000.00	682,048.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	840,000.00	1,096,376.40
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,051,613.20
	SIGB 3% 09/01/24	840,000.00	933,689.40
	シンガポールドル 小計	14,210,000.00	16,255,418.20 (1,231,185,374)
マレーシアリングgit	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,538,257.50
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	727,699.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,840,000.00	2,933,918.80
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,587,327.10
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,267,900.00
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,049,119.60
	MGS 3.757% 04/20/23	350,000.00	364,078.75
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,553,407.50
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,734,658.50
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,488,039.00
	MGS 3.882% 03/10/22	750,000.00	772,575.00
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,093,334.70
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	790,133.75
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,208,721.45
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,116,627.10
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,545,436.80
	MGS 3.955% 09/15/25	1,630,000.00	1,748,941.10
	MGS 4.048% 09/30/21	2,050,000.00	2,103,976.50
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,023,196.00
	MGS 4.127% 04/15/32	430,000.00	469,437.45
	MGS 4.16% 07/15/21	2,030,000.00	2,078,263.25
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,366,457.60
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,207,900.00
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	890,473.50
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,674,179.00
	MGS 4.498% 04/15/30	1,410,000.00	1,587,892.65
	MGS 4.642% 11/07/33	1,500,000.00	1,717,200.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,699,380.40
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,660,611.80
	MGS 4.893% 06/08/38	800,000.00	947,060.00
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,242,333.75
	MGS 4.935% 09/30/43	2,550,000.00	2,993,598.00

	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,731,940.40
マレーシアリングgit 小計		49,750,000.00	53,914,075.95 (1,332,755,957)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,836,936.62
	ILGOV 1% 03/31/30	830,000.00	847,934.22
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,160,000.00	2,433,535.92
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,619,848.46
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,100,000.00	3,027,498.18
	ILGOV 5.5% 01/31/22	3,160,000.00	3,450,957.94
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,512,743.27
	ILGOV 6.25% 10/30/26	6,020,000.00	8,209,065.84
イスラエルシェケル 小計		27,680,000.00	33,938,520.45 (1,032,749,177)
合計			265,406,916,186 (265,406,916,186)

## 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 190銘柄	100.0%	46.6%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 312銘柄	100.0%	39.0%
イギリスポンド	国債証券 43銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.3%
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 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%

(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

	2020年 5月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,347,468,120
株式	291,363,845,380
派生商品評価勘定	278,125,900
未収入金	414,650
未収配当金	3,501,621,320
差入委託証拠金	335,804,800
流動資産合計	297,827,280,170
資産合計	297,827,280,170
負債の部	
流動負債	
前受金	278,153,950
未払解約金	244,530,886
未払利息	4,890
流動負債合計	522,689,726
負債合計	522,689,726
純資産の部	
元本等	
元本	211,904,917,970
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	85,399,672,474
元本等合計	297,304,590,444
純資産合計	297,304,590,444
負債純資産合計	297,827,280,170

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p>

2020年 5月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 5月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	211,904,917,970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 1.4030円 (1万口当たり純資産額) (14,030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

2020年 5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。

	2020年 5月19日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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

	2020年 5月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
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	2020年 5月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年11月20日
期首元本額	206,137,046,461円
期中追加設定元本額	26,434,167,998円
期中一部解約元本額	20,666,296,489円
期末元本額	211,904,917,970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）	584,422,655円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,032,474,306円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,199,044円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,619,633,944円
世界経済インデックスファンド	2,221,967,509円
日本株式インデックス・オープン	4,283,479,035円
D C マイセレクション 2 5	7,557,720,578円
D C マイセレクション 5 0	20,071,793,496円
D C マイセレクション 7 5	18,021,964,917円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,860,127,049円
D C マイセレクション S 2 5	3,173,485,254円
D C マイセレクション S 5 0	8,409,223,724円
D C マイセレクション S 7 5	5,224,166,242円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,959,610,459円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	339,404,341円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	771,180,340円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	504,896,823円
D C 世界経済インデックスファンド	2,868,576,545円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,062,736,349円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,508,623円

区分	2020年 5月19日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,718,016円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470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)	262,721,287円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,765,336円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	75,093,855円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	262,532,624円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	55,956,109円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	305,953,663円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,753,430,856円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	687,687,698円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,116,915,596円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	632,871,378円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,938,901円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	783,800,305円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	36,710,849円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	450,741,204円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	577,821,124円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,920,347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)	856,856,883円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,543,113円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,356,624円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	5,521,747,548円
分散投資コア戦略ファンドS	15,342,693,791円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	318,306,910円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	345,712,983円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,121,141円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,025,279円
SMT インデックスバランス・オープン	68,229,533円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,556,829,429円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	21,688,100円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	74,587,033円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	12,935,493円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,688,370円
グローバル経済コア	269,783,105円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	17,859,446円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	48,794,571円
DCターゲット・イヤーフンド2055	3,211,669円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,642,992円

区分	2020年 5月19日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	105,494円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	164,939円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,311円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	59,624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）	51,468,080,803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）	558,161,799円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	28,753,994円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	11,671,697円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 5月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		8,652,576,433
合計		8,652,576,433

(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

（2020年 5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	株価指数先物取引 買建	5,341,031,050	-	5,619,185,000	278,153,950
	合計	5,341,031,050	-	5,619,185,000	278,153,950

## (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

	評価額

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	6,600	2,698.00	17,806,800	
日本水産	189,600	463.00	87,784,800	
マルハニチロ	27,400	2,246.00	61,540,400	
カネコ種苗	5,700	1,494.00	8,515,800	
サカタのタネ	22,600	3,720.00	84,072,000	
ホクト	14,500	1,996.00	28,942,000	
ホクリヨウ	2,900	656.00	1,902,400	
住石ホールディングス	38,300	110.00	4,213,000	
日鉄鉱業	4,300	4,590.00	19,737,000	
三井松島ホールディングス	7,400	790.00	5,846,000	
国際石油開発帝石	760,500	732.90	557,370,450	
石油資源開発	24,800	2,079.00	51,559,200	
K & O エナジーグループ	9,200	1,567.00	14,416,400	
ヒノキヤグループ	4,700	1,559.00	7,327,300	
ショーボンドホールディングス	29,500	4,755.00	140,272,500	
ミライト・ホールディングス	56,300	1,490.00	83,887,000	
タマホーム	10,200	1,372.00	13,994,400	
サンヨーホームズ	1,600	610.00	976,000	
日本アクア	7,500	577.00	4,327,500	
ファーストコーポレーション	5,800	499.00	2,894,200	
ベステラ	3,300	992.00	3,273,600	
T A T E R U	39,100	153.00	5,982,300	
キャンディル	3,100	476.00	1,475,600	
スペースバリューホールディングス	23,100	365.00	8,431,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,037.00	3,733,200	
第一カッター興業	2,300	1,800.00	4,140,000	
明豊ファシリティワークス	6,100	532.00	3,245,200	
安藤・間	112,900	661.00	74,626,900	
東急建設	55,500	570.00	31,635,000	
コムシスホールディングス	67,200	3,060.00	205,632,000	
ピーアールホールディングス	20,600	531.00	10,938,600	
高松コンストラクショングループ	11,800	2,332.00	27,517,600	
東建コーポレーション	5,800	7,300.00	42,340,000	
ソネック	2,000	796.00	1,592,000	
ヤマウラ	8,200	773.00	6,338,600	
大成建設	146,000	3,675.00	536,550,000	
大林組	437,800	953.00	417,223,400	
清水建設	444,300	869.00	386,096,700	
飛鳥建設	12,600	1,073.00	13,519,800	
長谷工コーポレーション	169,500	1,214.00	205,773,000	
松井建設	17,200	626.00	10,767,200	

銭高組	1,900	3,680.00	6,992,000
鹿島建設	343,700	1,207.00	414,845,900
不動テトラ	11,400	1,363.00	15,538,200
大末建設	5,100	763.00	3,891,300
鉄建建設	9,500	2,150.00	20,425,000
西松建設	33,700	2,084.00	70,230,800
三井住友建設	105,800	444.00	46,975,200
大豊建設	9,800	2,465.00	24,157,000
前田建設工業	109,600	859.00	94,146,400
佐田建設	9,400	401.00	3,769,400
ナカノフドー建設	12,000	391.00	4,692,000
奥村組	23,700	2,493.00	59,084,100
東鉄工業	18,800	2,732.00	51,361,600
イチケン	3,200	1,374.00	4,396,800
富士ピー・エス	6,400	525.00	3,360,000
浅沼組	4,900	3,810.00	18,669,000
戸田建設	181,800	647.00	117,624,600
熊谷組	20,300	2,469.00	50,120,700
北野建設	2,700	2,615.00	7,060,500
植木組	1,900	2,438.00	4,632,200
矢作建設工業	19,300	757.00	14,610,100
ピーエス三菱	14,400	550.00	7,920,000
日本ハウスホールディングス	29,900	287.00	8,581,300
大東建託	47,800	10,730.00	512,894,000
新日本建設	18,600	752.00	13,987,200
N I P P O	36,200	2,614.00	94,626,800
東亜道路工業	2,700	3,260.00	8,802,000
前田道路	38,600	1,936.00	74,729,600
日本道路	4,200	6,910.00	29,022,000
東亜建設工業	13,600	1,536.00	20,889,600
日本国土開発	42,600	560.00	23,856,000
若築建設	7,900	1,130.00	8,927,000
東洋建設	49,100	422.00	20,720,200
五洋建設	173,500	564.00	97,854,000
世紀東急工業	21,000	742.00	15,582,000
福田組	5,100	4,475.00	22,822,500
住友林業	110,900	1,287.00	142,728,300
日本基礎技術	14,700	425.00	6,247,500
巴コーポレーション	19,400	364.00	7,061,600
大和ハウス工業	433,100	2,515.00	1,089,246,500
ライト工業	25,100	1,424.00	35,742,400
積水ハウス	478,900	1,892.50	906,318,250



日特建設	11,400	697.00	7,945,800
北陸電気工事	7,600	904.00	6,870,400
ユアテック	25,000	593.00	14,825,000
日本リーテック	9,200	2,031.00	18,685,200
四電工	2,400	2,312.00	5,548,800
中電工	17,600	2,227.00	39,195,200
関電工	62,300	942.00	58,686,600
きんでん	104,000	1,771.00	184,184,000
東京エネシス	14,500	745.00	10,802,500
トーエネック	4,400	3,570.00	15,708,000
住友電設	12,400	2,602.00	32,264,800
日本電設工業	24,000	2,229.00	53,496,000
協和エクシオ	66,400	2,449.00	162,613,600
新日本空調	11,600	2,300.00	26,680,000
九電工	30,700	2,977.00	91,393,900
三機工業	31,500	1,296.00	40,824,000
日揮ホールディングス	134,800	1,051.00	141,674,800
中外炉工業	4,700	1,577.00	7,411,900
ヤマト	14,000	635.00	8,890,000
太平電業	10,600	2,371.00	25,132,600
高砂熱学工業	38,000	1,702.00	64,676,000
三晃金属工業	1,900	2,055.00	3,904,500
朝日工業社	2,900	3,075.00	8,917,500
明星工業	28,300	753.00	21,309,900
大気社	21,300	3,070.00	65,391,000
ダイダン	10,500	2,756.00	28,938,000
日比谷総合設備	14,100	1,862.00	26,254,200
フィル・カンパニー	2,500	2,841.00	7,102,500
OSJBホールディングス	69,000	256.00	17,664,000
東洋エンジニアリング	18,400	367.00	6,752,800
レイズネクスト	23,500	1,219.00	28,646,500
日本製粉	41,000	1,589.00	65,149,000
日清製粉グループ本社	158,300	1,635.00	258,820,500
日東富士製粉	1,000	5,970.00	5,970,000
昭和産業	12,900	3,220.00	41,538,000
鳥越製粉	12,400	876.00	10,862,400
中部飼料	17,100	1,586.00	27,120,600
フィード・ワン	94,100	184.00	17,314,400
東洋精糖	2,400	1,216.00	2,918,400
日本甜菜製糖	7,300	1,680.00	12,264,000
三井製糖	12,300	2,105.00	25,891,500
塩水港精糖	15,200	207.00	3,146,400

日新製糖	6,600	1,995.00	13,167,000
森永製菓	32,900	4,280.00	140,812,000
中村屋	3,600	3,935.00	14,166,000
江崎グリコ	41,500	5,070.00	210,405,000
名糖産業	6,700	1,262.00	8,455,400
井村屋グループ	7,900	1,949.00	15,397,100
不二家	7,800	2,061.00	16,075,800
山崎製パン	105,000	1,878.00	197,190,000
第一屋製パン	2,400	938.00	2,251,200
モロゾフ	2,400	5,790.00	13,896,000
亀田製菓	8,000	5,340.00	42,720,000
寿スピリッツ	13,500	4,855.00	65,542,500
カルビー	63,800	2,983.00	190,315,400
森永乳業	25,900	4,515.00	116,938,500
六甲バター	9,300	1,460.00	13,578,000
ヤクルト本社	96,400	6,370.00	614,068,000
明治ホールディングス	92,600	7,600.00	703,760,000
雪印メグミルク	33,700	2,656.00	89,507,200
プリマハム	21,900	2,420.00	52,998,000
日本ハム	53,500	3,850.00	205,975,000
林兼産業	4,600	614.00	2,824,400
丸大食品	14,900	2,046.00	30,485,400
S Foods	11,200	2,442.00	27,350,400
柿安本店	4,900	2,460.00	12,054,000
伊藤ハム米久ホールディングス	90,200	644.00	58,088,800
サッポロホールディングス	47,800	2,063.00	98,611,400
アサヒグループホールディングス	293,400	3,753.00	1,101,130,200
キリンホールディングス	594,200	2,070.00	1,229,994,000
宝ホールディングス	103,900	801.00	83,223,900
オエノンホールディングス	37,000	391.00	14,467,000
養命酒製造	4,300	1,875.00	8,062,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	98,300	1,971.00	193,749,300
サントリー食品インターナショナル	93,700	4,115.00	385,575,500
ダイトーグループホールディングス	7,200	4,825.00	34,740,000
伊藤園	42,500	6,100.00	259,250,000
キーコーヒー	13,800	2,355.00	32,499,000
ユニカフェ	3,600	950.00	3,420,000
ジャパンフーズ	2,000	1,161.00	2,322,000
日清オイリオグループ	18,000	3,260.00	58,680,000
不二製油グループ本社	34,200	2,784.00	95,212,800
かどや製油	1,500	3,540.00	5,310,000
J - オイルミルズ	7,300	4,095.00	29,893,500

キッコーマン	100,800	5,130.00	517,104,000
味の素	309,400	1,947.00	602,401,800
キューピー	78,000	2,085.00	162,630,000
ハウス食品グループ本社	52,400	3,530.00	184,972,000
カゴメ	53,200	2,839.00	151,034,800
焼津水産化学工業	6,800	916.00	6,228,800
アリアケジャパン	12,800	7,390.00	94,592,000
ピエトロ	1,800	1,618.00	2,912,400
エバラ食品工業	3,400	2,143.00	7,286,200
やまみ	1,200	2,280.00	2,736,000
ニチレイ	66,700	2,934.00	195,697,800
東洋水産	72,100	5,540.00	399,434,000
イトアンド	4,800	1,757.00	8,433,600
大冷	1,800	1,844.00	3,319,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	1,206.00	9,406,800
日清食品ホールディングス	59,600	9,120.00	543,552,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,211.00	15,034,800
一正蒲鉾	5,400	983.00	5,308,200
フジッコ	15,200	1,949.00	29,624,800
ロック・フィールド	15,100	1,343.00	20,279,300
日本たばこ産業	809,000	2,034.50	1,645,910,500
ケンコーマヨネーズ	7,900	2,119.00	16,740,100
わらべや日洋ホールディングス	9,200	1,632.00	15,014,400
なとり	7,800	1,721.00	13,423,800
イフジ産業	2,400	779.00	1,869,600
ピククルスコーポレーション	3,100	2,204.00	6,832,400
北の達人コーポレーション	48,900	544.00	26,601,600
ユーグレナ	60,400	683.00	41,253,200
ミヨシ油脂	5,400	1,119.00	6,042,600
理研ビタミン	13,200	2,150.00	28,380,000
片倉工業	20,300	1,071.00	21,741,300
ゲンゼ	10,200	3,750.00	38,250,000
東洋紡	54,400	1,475.00	80,240,000
ユニチカ	41,500	330.00	13,695,000
富士紡ホールディングス	6,800	3,175.00	21,590,000
倉敷紡績	13,700	2,362.00	32,359,400
シキボウ	7,200	990.00	7,128,000
日本毛織	45,500	948.00	43,134,000
トーア紡コーポレーション	5,400	486.00	2,624,400
帝国繊維	15,500	2,458.00	38,099,000
帝人	111,800	1,676.00	187,376,800
東レ	990,900	491.80	487,324,620

サカイオーベックス	3,900	2,060.00	8,034,000
住江織物	3,000	1,882.00	5,646,000
日本フェルト	8,700	460.00	4,002,000
イチカワ	2,300	1,407.00	3,236,100
日東製網	1,600	1,393.00	2,228,800
アツギ	11,700	614.00	7,183,800
ダイニック	5,200	782.00	4,066,400
セーレン	34,000	1,288.00	43,792,000
ソトー	5,700	952.00	5,426,400
東海染工	2,100	1,125.00	2,362,500
小松マテーレ	22,800	746.00	17,008,800
ワコールホールディングス	35,800	2,156.00	77,184,800
ホギメディカル	15,700	3,360.00	52,752,000
クラウドシアホールディングス	4,000	424.00	1,696,000
T S Iホールディングス	46,400	444.00	20,601,600
マツオカコーポレーション	4,000	2,033.00	8,132,000
ワールド	19,600	1,349.00	26,440,400
三陽商会	7,400	952.00	7,044,800
ナイガイ	5,600	385.00	2,156,000
オンワードホールディングス	82,900	344.00	28,517,600
ルックホールディングス	5,000	797.00	3,985,000
ゴールドウイン	24,800	5,800.00	143,840,000
デサント	26,900	1,470.00	39,543,000
キング	6,900	481.00	3,318,900
ヤマトインターナショナル	12,700	327.00	4,152,900
特種東海製紙	8,700	4,175.00	36,322,500
王子ホールディングス	571,500	559.00	319,468,500
日本製紙	60,500	1,552.00	93,896,000
三菱製紙	15,500	373.00	5,781,500
北越コーポレーション	81,500	395.00	32,192,500
中越パルプ工業	5,800	1,350.00	7,830,000
巴川製紙所	4,100	860.00	3,526,000
大王製紙	60,300	1,458.00	87,917,400
阿波製紙	3,500	496.00	1,736,000
レンゴー	129,200	906.00	117,055,200
トモク	8,400	1,767.00	14,842,800
ザ・パック	10,300	3,160.00	32,548,000
クラレ	215,300	1,090.00	234,677,000
旭化成	906,200	776.20	703,392,440
共和レザー	7,400	671.00	4,965,400
昭和電工	97,300	2,286.00	222,427,800
住友化学	1,004,500	324.00	325,458,000

住友精化	6,100	3,000.00	18,300,000	
日産化学	75,900	4,465.00	338,893,500	
ラサ工業	4,800	1,490.00	7,152,000	
クレハ	11,700	4,515.00	52,825,500	
多木化学	5,300	5,940.00	31,482,000	
テイカ	10,000	1,583.00	15,830,000	
石原産業	24,500	721.00	17,664,500	
片倉コープアグリ	3,500	1,168.00	4,088,000	
日本曹達	20,200	2,846.00	57,489,200	
東ソー	211,300	1,438.00	303,849,400	
トクヤマ	39,400	2,400.00	94,560,000	
セントラル硝子	27,900	1,950.00	54,405,000	
東亜合成	85,800	1,001.00	85,885,800	
大阪ソーダ	13,900	2,518.00	35,000,200	
関東電化工業	32,400	926.00	30,002,400	
デンカ	49,900	2,717.00	135,578,300	
信越化学工業	234,800	12,150.00	2,852,820,000	
日本カーバイド工業	4,600	1,155.00	5,313,000	
堺化学工業	8,800	1,853.00	16,306,400	
第一稀元素化学工業	14,800	764.00	11,307,200	
エア・ウォーター	127,200	1,521.00	193,471,200	
大陽日酸	131,400	1,823.00	239,542,200	
日本化学工業	4,300	2,244.00	9,649,200	
東邦アセチレン	2,000	1,273.00	2,546,000	
日本パーカライズン	69,000	1,134.00	78,246,000	
高压ガス工業	21,700	760.00	16,492,000	
チタン工業	1,700	1,723.00	2,929,100	
四国化成工業	21,100	1,078.00	22,745,800	
戸田工業	3,200	1,594.00	5,100,800	
ステラ ケミファ	7,400	2,669.00	19,750,600	
保土谷化学工業	5,100	3,630.00	18,513,000	
日本触媒	21,200	5,510.00	116,812,000	
大日精化工業	12,100	2,391.00	28,931,100	
カネカ	35,400	2,799.00	99,084,600	
三菱瓦斯化学	127,200	1,493.00	189,909,600	
三井化学	124,100	1,996.00	247,703,600	
J S R	127,400	1,968.00	250,723,200	
東京応化工業	23,500	4,860.00	114,210,000	
大阪有機化学工業	12,600	1,740.00	21,924,000	
三菱ケミカルホールディングス	914,000	600.20	548,582,800	
K Hネオケム	24,100	2,000.00	48,200,000	
ダイセル	178,000	893.00	158,954,000	

住友ベークライト	21,500	2,956.00	63,554,000
積水化学工業	294,000	1,392.00	409,248,000
日本ゼオン	123,300	955.00	117,751,500
アイカ工業	41,000	3,050.00	125,050,000
宇部興産	69,000	1,752.00	120,888,000
積水樹脂	24,600	2,184.00	53,726,400
タキロンシーアイ	29,600	646.00	19,121,600
旭有機材	7,700	1,344.00	10,348,800
ニチバン	7,200	1,502.00	10,814,400
リケンテクノス	34,400	412.00	14,172,800
大倉工業	6,500	1,584.00	10,296,000
積水化成成品工業	18,300	597.00	10,925,100
群栄化学工業	3,100	2,810.00	8,711,000
タイガースポリマー	7,200	437.00	3,146,400
ミライアル	4,800	1,130.00	5,424,000
ダイキアクシス	4,800	728.00	3,494,400
ダイキョーニシカワ	28,800	580.00	16,704,000
竹本容器	4,900	738.00	3,616,200
森六ホールディングス	7,400	1,492.00	11,040,800
日本化薬	84,600	1,046.00	88,491,600
カーリットホールディングス	14,600	515.00	7,519,000
日本精化	11,000	1,313.00	14,443,000
扶桑化学工業	13,900	3,695.00	51,360,500
トリケミカル研究所	3,000	9,220.00	27,660,000
A D E K A	62,900	1,436.00	90,324,400
日油	51,500	3,770.00	194,155,000
新日本理化	22,600	176.00	3,977,600
ハリマ化成グループ	11,300	908.00	10,260,400
花王	334,200	8,826.00	2,949,649,200
第一工業製薬	5,100	4,365.00	22,261,500
石原ケミカル	3,700	1,917.00	7,092,900
日華化学	4,600	942.00	4,333,200
ニイタカ	2,800	2,919.00	8,173,200
三洋化成工業	8,200	4,600.00	37,720,000
有機合成薬品工業	10,500	365.00	3,832,500
大日本塗料	15,500	947.00	14,678,500
日本ペイントホールディングス	112,800	6,910.00	779,448,000
関西ペイント	153,600	2,072.00	318,259,200
神東塗料	10,700	179.00	1,915,300
中国塗料	38,900	771.00	29,991,900
日本特殊塗料	10,200	866.00	8,833,200
藤倉化成	18,400	492.00	9,052,800

太陽ホールディングス	10,000	5,050.00	50,500,000
D I C	57,700	2,639.00	152,270,300
サカタインクス	29,800	963.00	28,697,400
東洋インキＳＣホールディングス	28,900	1,950.00	56,355,000
T & K T O K A	10,600	734.00	7,780,400
富士フイルムホールディングス	267,600	5,066.00	1,355,661,600
資生堂	277,400	6,503.00	1,803,932,200
ライオン	181,500	2,463.00	447,034,500
高砂香料工業	8,700	2,379.00	20,697,300
マンダム	31,400	2,151.00	67,541,400
ミルボン	18,700	5,110.00	95,557,000
ファンケル	56,500	3,045.00	172,042,500
コーセー	26,300	13,470.00	354,261,000
コタ	8,000	1,198.00	9,584,000
シーボン	1,800	2,040.00	3,672,000
ポーラ・オルビスホールディングス	59,600	2,008.00	119,676,800
ノエビアホールディングス	11,800	4,825.00	56,935,000
アジュバンコスメジャパン	3,100	938.00	2,907,800
エステー	9,000	1,585.00	14,265,000
アグロ カネショウ	5,800	1,383.00	8,021,400
コニシ	22,900	1,480.00	33,892,000
長谷川香料	24,100	2,305.00	55,550,500
星光P M C	8,000	666.00	5,328,000
小林製薬	39,100	9,690.00	378,879,000
荒川化学工業	12,500	1,335.00	16,687,500
メック	9,600	2,010.00	19,296,000
日本高純度化学	3,800	2,634.00	10,009,200
タカラバイオ	36,500	2,661.00	97,126,500
J C U	16,900	2,993.00	50,581,700
新田ゼラチン	8,800	729.00	6,415,200
O A T アグリオ	2,400	1,091.00	2,618,400
デクセリアルズ	36,000	790.00	28,440,000
アース製薬	10,500	6,500.00	68,250,000
北興化学工業	14,300	597.00	8,537,100
大成ラミック	4,600	2,628.00	12,088,800
クミアイ化学工業	57,700	851.00	49,102,700
日本農薬	24,900	443.00	11,030,700
アキレス	9,600	1,593.00	15,292,800
有沢製作所	22,100	787.00	17,392,700
日東電工	96,300	5,410.00	520,983,000
レック	14,900	1,513.00	22,543,700
三光合成	16,000	310.00	4,960,000

きもと	23,700	157.00	3,720,900
藤森工業	12,500	3,190.00	39,875,000
前澤化成工業	8,900	1,076.00	9,576,400
未来工業	7,500	1,940.00	14,550,000
ウェブロックホールディングス	4,800	722.00	3,465,600
J S P	8,200	1,403.00	11,504,600
エフピコ	15,400	7,680.00	118,272,000
天馬	9,300	1,495.00	13,903,500
信越ポリマー	25,100	850.00	21,335,000
東リ	34,800	247.00	8,595,600
ニフコ	51,300	2,210.00	113,373,000
バルカー	11,300	1,849.00	20,893,700
ユニ・チャーム	269,100	4,045.00	1,088,509,500
ショーエイコーポレーション	2,100	781.00	1,640,100
協和キリン	140,400	2,621.00	367,988,400
武田薬品工業	1,161,400	4,085.00	4,744,319,000
アステラス製薬	1,210,300	1,703.50	2,061,746,050
大日本住友製薬	103,500	1,401.00	145,003,500
塩野義製薬	178,500	5,743.00	1,025,125,500
わかもと製薬	16,600	249.00	4,133,400
あすか製薬	15,900	1,130.00	17,967,000
日本新薬	36,500	8,210.00	299,665,000
ピオフェルミン製薬	2,400	2,280.00	5,472,000
中外製薬	145,500	13,305.00	1,935,877,500
科研製薬	23,900	5,640.00	134,796,000
エーザイ	167,100	7,489.00	1,251,411,900
ロート製薬	71,700	3,410.00	244,497,000
小野薬品工業	320,600	2,789.00	894,153,400
久光製薬	36,900	5,020.00	185,238,000
持田製薬	19,400	4,005.00	77,697,000
参天製薬	260,100	1,909.00	496,530,900
扶桑薬品工業	4,900	2,561.00	12,548,900
日本ケミファ	1,800	2,767.00	4,980,600
ツムラ	43,200	2,860.00	123,552,000
日医工	39,500	1,338.00	52,851,000
キッセイ薬品工業	24,700	2,487.00	61,428,900
生化学工業	27,100	1,160.00	31,436,000
栄研化学	24,500	1,727.00	42,311,500
日水製薬	5,900	1,248.00	7,363,200
鳥居薬品	8,700	2,844.00	24,742,800
J C R ファーマ	9,800	11,740.00	115,052,000
東和薬品	17,900	2,187.00	39,147,300



富士製薬工業	9,500	1,150.00	10,925,000
沢井製薬	28,700	5,520.00	158,424,000
ゼリア新薬工業	25,300	2,174.00	55,002,200
第一三共	399,500	8,519.00	3,403,340,500
キョーリン製薬ホールディングス	30,800	2,151.00	66,250,800
大幸薬品	17,000	1,867.00	31,739,000
ダイト	8,400	3,975.00	33,390,000
大塚ホールディングス	265,900	4,329.00	1,151,081,100
大正製薬ホールディングス	29,500	6,430.00	189,685,000
ペプチドリーム	70,900	4,460.00	316,214,000
日本コークス工業	117,900	58.00	6,838,200
ニチレキ	16,500	1,483.00	24,469,500
ユシロ化学工業	7,800	1,191.00	9,289,800
ビーピー・カストロール	5,000	1,191.00	5,955,000
富士石油	37,300	175.00	6,527,500
MORESCO	5,000	958.00	4,790,000
出光興産	154,900	2,515.00	389,573,500
JXTGホールディングス	2,100,000	388.90	816,690,000
コスモエネルギーホールディングス	40,400	1,648.00	66,579,200
横浜ゴム	80,800	1,481.00	119,664,800
TOYO TIRE	80,200	1,478.00	118,535,600
ブリヂストン	402,100	3,346.00	1,345,426,600
住友ゴム工業	125,400	1,057.00	132,547,800
藤倉コンポジット	12,200	368.00	4,489,600
オカモト	8,500	4,015.00	34,127,500
フコク	6,100	645.00	3,934,500
ニッタ	15,700	2,133.00	33,488,100
住友理工	27,100	593.00	16,070,300
三ツ星ベルト	18,400	1,530.00	28,152,000
バンドー化学	24,600	601.00	14,784,600
日東紡績	20,800	5,180.00	107,744,000
AGC	138,000	2,849.00	393,162,000
日本板硝子	66,800	382.00	25,517,600
石塚硝子	2,600	2,092.00	5,439,200
日本山村硝子	5,800	825.00	4,785,000
日本電気硝子	56,100	1,607.00	90,152,700
オハラ	5,500	895.00	4,922,500
住友大阪セメント	26,400	3,705.00	97,812,000
太平洋セメント	88,200	2,233.00	196,950,600
日本ヒューム	14,000	699.00	9,786,000
日本コンクリート工業	30,200	257.00	7,761,400
三谷セキサン	6,500	4,910.00	31,915,000

アジアパイルホールディングス	19,900	421.00	8,377,900
東海カーボン	146,300	888.00	129,914,400
日本カーボン	7,200	3,230.00	23,256,000
東洋炭素	8,200	1,636.00	13,415,200
ノリタケカンパニーリミテド	7,700	3,220.00	24,794,000
TOTO	99,700	3,920.00	390,824,000
日本碍子	167,600	1,428.00	239,332,800
日本特殊陶業	106,200	1,674.00	177,778,800
MARUWA	5,400	8,050.00	43,470,000
品川リフラクトリーズ	3,700	2,249.00	8,321,300
黒崎播磨	2,800	3,795.00	10,626,000
ヨータイ	11,100	625.00	6,937,500
イソライト工業	7,200	468.00	3,369,600
東京窯業	17,800	307.00	5,464,600
ニッカトー	6,400	640.00	4,096,000
フジインコーポレーテッド	12,400	3,055.00	37,882,000
クニミネ工業	5,700	1,056.00	6,019,200
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,144.00	2,745,600
ニチアス	38,200	2,323.00	88,738,600
ニチハ	19,400	2,292.00	44,464,800
日本製鉄	617,900	924.10	571,001,390
神戸製鋼所	252,900	383.00	96,860,700
中山製鋼所	19,300	338.00	6,523,400
合同製鐵	7,500	2,000.00	15,000,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	372,900	729.00	271,844,100
東京製鐵	67,300	718.00	48,321,400
共英製鋼	15,600	1,380.00	21,528,000
大和工業	29,400	2,203.00	64,768,200
東京鐵鋼	5,700	1,226.00	6,988,200
大阪製鐵	7,400	1,192.00	8,820,800
淀川製鋼所	18,700	1,720.00	32,164,000
丸一鋼管	44,800	2,790.00	124,992,000
モリ工業	4,200	2,270.00	9,534,000
大同特殊鋼	22,600	3,315.00	74,919,000
日本高周波鋼業	5,300	388.00	2,056,400
日本冶金工業	11,500	1,670.00	19,205,000
山陽特殊製鋼	9,500	959.00	9,110,500
愛知製鋼	7,800	2,762.00	21,543,600
日立金属	148,800	1,040.00	154,752,000
日本金属	3,200	629.00	2,012,800
大平洋金属	9,400	1,588.00	14,927,200
新日本電工	89,400	154.00	13,767,600

栗本鐵工所	6,800	1,806.00	12,280,800
虹技	2,100	1,186.00	2,490,600
三菱製鋼	10,300	666.00	6,859,800
日亜鋼業	20,400	272.00	5,548,800
日本精線	2,300	2,994.00	6,886,200
エンビプロ・ホールディングス	6,000	596.00	3,576,000
シンニッタン	21,700	258.00	5,598,600
新家工業	3,200	1,053.00	3,369,600
大紀アルミニウム工業所	22,900	561.00	12,846,900
日本軽金属ホールディングス	349,900	171.00	59,832,900
三井金属鉱業	37,300	2,098.00	78,255,400
東邦亜鉛	7,100	1,358.00	9,641,800
三菱マテリアル	91,200	2,349.00	214,228,800
住友金属鉱山	176,500	2,855.00	503,907,500
D O W Aホールディングス	35,000	3,185.00	111,475,000
古河機械金属	24,600	1,072.00	26,371,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,500	952.00	13,804,000
東邦チタニウム	24,900	646.00	16,085,400
U A C J	21,000	1,740.00	36,540,000
C Kサンエツ	2,900	3,180.00	9,222,000
古河電気工業	42,900	2,064.00	88,545,600
住友電気工業	516,200	1,139.00	587,951,800
フジクラ	167,000	313.00	52,271,000
昭和電線ホールディングス	16,000	1,032.00	16,512,000
東京特殊電線	2,100	2,354.00	4,943,400
タツタ電線	27,600	600.00	16,560,000
カナレ電気	2,300	1,684.00	3,873,200
平河ヒューテック	7,000	1,030.00	7,210,000
リョービ	17,100	1,227.00	20,981,700
アーレスティ	18,400	348.00	6,403,200
アサヒホールディングス	24,200	2,682.00	64,904,400
稲葉製作所	7,800	1,394.00	10,873,200
宮地エンジニアリンググループ	4,200	1,616.00	6,787,200
トーカロ	38,300	1,057.00	40,483,100
アルファC o	4,900	907.00	4,444,300
S U M C O	165,200	1,620.00	267,624,000
川田テクノロジーズ	2,800	4,905.00	13,734,000
R S Technologies	3,900	3,215.00	12,538,500
信和	7,900	664.00	5,245,600
東洋製罐グループホールディングス	87,900	1,071.00	94,140,900
ホッカンホールディングス	7,600	1,561.00	11,863,600
コロナ	7,600	974.00	7,402,400

横河ブリッジホールディングス	25,700	1,978.00	50,834,600
駒井ハルテック	2,600	1,510.00	3,926,000
高田機工	1,300	2,263.00	2,941,900
三和ホールディングス	130,200	886.00	115,357,200
文化シャッター	40,700	785.00	31,949,500
三協立山	17,800	903.00	16,073,400
アルインコ	10,000	924.00	9,240,000
東洋シャッター	3,300	676.00	2,230,800
L I X I Lグループ	203,700	1,407.00	286,605,900
日本ファイルコン	10,600	520.00	5,512,000
ノーリツ	28,600	1,151.00	32,918,600
長府製作所	14,000	2,300.00	32,200,000
リンナイ	26,800	8,610.00	230,748,000
ダイニチ工業	7,400	691.00	5,113,400
日東精工	19,100	448.00	8,556,800
三洋工業	1,800	1,765.00	3,177,000
岡部	28,000	787.00	22,036,000
ジーテクト	17,100	1,119.00	19,134,900
東プレ	25,800	1,352.00	34,881,600
高周波熱錬	26,600	539.00	14,337,400
東京製綱	9,900	518.00	5,128,200
サンコール	10,300	396.00	4,078,800
モリテック スチール	10,800	287.00	3,099,600
パイオラックス	20,400	1,635.00	33,354,000
エイチワン	13,500	530.00	7,155,000
日本発條	148,100	727.00	107,668,700
中央発條	1,700	2,728.00	4,637,600
アドバネクス	2,000	1,370.00	2,740,000
立川ブラインド工業	6,100	1,132.00	6,905,200
三益半導体工業	10,800	2,135.00	23,058,000
日本ドライケミカル	3,500	1,362.00	4,767,000
日本製鋼所	42,000	1,379.00	57,918,000
三浦工業	59,800	4,500.00	269,100,000
タクマ	46,900	1,244.00	58,343,600
ツガミ	28,700	1,010.00	28,987,000
オークマ	16,100	4,395.00	70,759,500
芝浦機械	15,600	2,183.00	34,054,800
アマダ	171,300	980.00	167,874,000
アイダエンジニアリング	36,300	736.00	26,716,800
滝澤鉄工所	4,300	1,023.00	4,398,900
F U J I	59,400	1,793.00	106,504,200
牧野フライス製作所	16,200	3,235.00	52,407,000

オーエスジー	63,900	1,473.00	94,124,700
ダイジェット工業	1,700	1,263.00	2,147,100
旭ダイヤモンド工業	36,500	478.00	17,447,000
D M G 森精機	87,400	1,208.00	105,579,200
ソディック	32,500	801.00	26,032,500
ディスコ	18,700	24,270.00	453,849,000
日東工器	7,600	1,919.00	14,584,400
日進工具	5,400	2,934.00	15,843,600
パンチ工業	12,700	372.00	4,724,400
富士ダイス	6,200	622.00	3,856,400
豊和工業	7,800	802.00	6,255,600
O K K	5,900	464.00	2,737,600
東洋機械金属	10,100	415.00	4,191,500
津田駒工業	2,800	821.00	2,298,800
エンシュウ	3,400	994.00	3,379,600
島精機製作所	21,800	1,572.00	34,269,600
オプトラン	15,400	2,969.00	45,722,600
N C ホールディングス	4,300	500.00	2,150,000
イワキポンプ	8,800	968.00	8,518,400
フリー	13,600	815.00	11,084,000
ヤマシンフィルタ	30,100	899.00	27,059,900
日阪製作所	17,100	741.00	12,671,100
やまびこ	26,900	909.00	24,452,100
平田機工	6,500	5,930.00	38,545,000
ペガサスミシン製造	14,200	327.00	4,643,400
マルマエ	5,200	871.00	4,529,200
タツモ	6,500	1,509.00	9,808,500
ナプテスコ	81,400	3,305.00	269,027,000
三井海洋開発	14,700	1,455.00	21,388,500
レオン自動機	13,600	1,279.00	17,394,400
S M C	43,800	53,000.00	2,321,400,000
ホソカワミクロン	4,900	5,850.00	28,665,000
ユニオンツール	5,200	2,811.00	14,617,200
オイレス工業	17,900	1,344.00	24,057,600
日精エー・エス・ビー機械	4,000	3,365.00	13,460,000
サトーホールディングス	19,700	2,282.00	44,955,400
技研製作所	12,200	4,315.00	52,643,000
日本エアータック	4,800	1,207.00	5,793,600
カワタ	4,200	747.00	3,137,400
日精樹脂工業	11,700	958.00	11,208,600
オカダアイヨン	4,400	906.00	3,986,400
ワイエイシイホールディングス	5,900	430.00	2,537,000

小松製作所	632,300	2,111.50	1,335,101,450
住友重機械工業	80,000	2,364.00	189,120,000
日立建機	56,000	2,681.00	150,136,000
日工	19,300	605.00	11,676,500
巴工業	6,000	1,866.00	11,196,000
井関農機	14,000	1,155.00	16,170,000
TOWA	14,200	965.00	13,703,000
丸山製作所	2,900	1,253.00	3,633,700
北川鉄工所	6,400	1,660.00	10,624,000
ローツェ	6,100	4,915.00	29,981,500
タカキタ	5,000	536.00	2,680,000
クボタ	740,700	1,448.50	1,072,903,950
荏原実業	3,500	2,271.00	7,948,500
三菱化工機	4,900	1,765.00	8,648,500
月島機械	25,800	1,200.00	30,960,000
帝国電機製作所	11,600	1,340.00	15,544,000
新東工業	33,300	728.00	24,242,400
澁谷工業	12,200	2,923.00	35,660,600
アイチ コーポレーション	24,300	713.00	17,325,900
小森コーポレーション	35,500	761.00	27,015,500
鶴見製作所	10,800	1,848.00	19,958,400
住友精密工業	2,100	2,180.00	4,578,000
日本ギア工業	5,800	264.00	1,531,200
酒井重工業	2,700	2,118.00	5,718,600
荏原製作所	57,800	2,358.00	136,292,400
石井鐵工所	1,900	2,560.00	4,864,000
西島製作所	14,200	705.00	10,011,000
北越工業	14,500	1,002.00	14,529,000
ダイキン工業	177,900	14,725.00	2,619,577,500
オルガノ	5,000	6,420.00	32,100,000
トーヨーカネツ	6,100	1,941.00	11,840,100
栗田工業	75,600	2,980.00	225,288,000
椿本チエイン	20,000	2,581.00	51,620,000
大同工業	6,800	640.00	4,352,000
木村化工機	11,900	460.00	5,474,000
アネスト岩田	21,800	831.00	18,115,800
ダイフク	71,400	8,110.00	579,054,000
サムコ	3,500	1,874.00	6,559,000
加藤製作所	7,700	1,146.00	8,824,200
油研工業	2,400	1,401.00	3,362,400
タダノ	67,500	843.00	56,902,500
フジテック	50,800	1,554.00	78,943,200

C K D	38,300	1,770.00	67,791,000
キトー	10,600	1,175.00	12,455,000
平和	39,000	1,844.00	71,916,000
理想科学工業	12,400	1,303.00	16,157,200
S A N K Y O	31,100	2,754.00	85,649,400
日本金銭機械	15,600	552.00	8,611,200
マースグループホールディングス	8,900	1,621.00	14,426,900
フクシマガリレイ	8,600	3,165.00	27,219,000
オーイズミ	6,000	405.00	2,430,000
ダイコク電機	6,500	1,243.00	8,079,500
竹内製作所	23,400	1,751.00	40,973,400
アマノ	36,600	2,222.00	81,325,200
J U K I	19,400	625.00	12,125,000
蛇の目ミシン工業	12,900	423.00	5,456,700
マックス	21,300	1,535.00	32,695,500
グローリー	35,900	2,440.00	87,596,000
新晃工業	13,000	1,470.00	19,110,000
大和冷機工業	20,300	958.00	19,447,400
セガサミーホールディングス	138,500	1,384.00	191,684,000
日本ピストンリング	5,100	1,120.00	5,712,000
リケン	6,500	2,660.00	17,290,000
T P R	18,800	1,289.00	24,233,200
ツバキ・ナカシマ	28,600	820.00	23,452,000
ホシザキ	40,800	8,430.00	343,944,000
大豊工業	11,500	500.00	5,750,000
日本精工	262,900	767.00	201,644,300
N T N	323,400	210.00	67,914,000
ジェイテクト	134,000	797.00	106,798,000
不二越	13,000	3,360.00	43,680,000
日本トムソン	41,600	365.00	15,184,000
T H K	81,200	2,648.00	215,017,600
ユーシン精機	10,900	668.00	7,281,200
前澤給装工業	5,100	2,023.00	10,317,300
イーグル工業	17,400	722.00	12,562,800
前澤工業	9,500	348.00	3,306,000
日本ピラー工業	14,200	1,382.00	19,624,400
キッツ	56,700	719.00	40,767,300
マキタ	182,100	3,510.00	639,171,000
日立造船	111,000	367.00	40,737,000
三菱重工業	234,000	2,584.50	604,773,000
I H I	100,600	1,302.00	130,981,200
スター精密	21,600	1,240.00	26,784,000

日清紡ホールディングス	93,200	746.00	69,527,200
イビデン	85,600	2,929.00	250,722,400
コニカミノルタ	306,100	382.00	116,930,200
ブラザー工業	170,700	1,905.00	325,183,500
ミネベアミツミ	259,400	1,842.00	477,814,800
日立製作所	670,800	3,253.00	2,182,112,400
三菱電機	1,396,000	1,341.50	1,872,734,000
富士電機	84,200	2,764.00	232,728,800
東洋電機製造	5,100	1,285.00	6,553,500
安川電機	150,300	3,600.00	541,080,000
シンフォニアテクノロジー	18,200	1,046.00	19,037,200
明電舎	25,700	1,739.00	44,692,300
オリジン	3,800	1,465.00	5,567,000
山洋電気	6,800	4,915.00	33,422,000
デンヨー	11,900	1,927.00	22,931,300
東芝テック	17,500	3,515.00	61,512,500
芝浦メカトロニクス	2,600	2,638.00	6,858,800
マブチモーター	38,800	3,210.00	124,548,000
日本電産	336,000	6,426.00	2,159,136,000
トレックス・セミコンダクター	8,400	1,052.00	8,836,800
東光高岳	8,200	967.00	7,929,400
ダイヘン	15,300	3,645.00	55,768,500
ヤーマン	23,400	716.00	16,754,400
JVCケンウッド	116,300	163.00	18,956,900
ミマキエンジニアリング	13,600	388.00	5,276,800
第一精工	5,900	2,371.00	13,988,900
日新電機	32,800	1,081.00	35,456,800
大崎電気工業	28,000	495.00	13,860,000
オムロン	125,200	6,820.00	853,864,000
日東工業	20,600	1,869.00	38,501,400
I D E C	20,200	1,710.00	34,542,000
正興電機製作所	3,800	889.00	3,378,200
不二電機工業	2,700	1,245.00	3,361,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,900	1,682.00	78,885,800
サクサホールディングス	3,300	1,738.00	5,735,400
メルコホールディングス	5,000	2,509.00	12,545,000
テクノメディカ	3,400	1,847.00	6,279,800
日本電気	169,400	4,850.00	821,590,000
富士通	134,600	10,370.00	1,395,802,000
沖電気工業	56,800	1,049.00	59,583,200
岩崎通信機	6,100	844.00	5,148,400
電気興業	6,800	2,492.00	16,945,600



サンケン電気	15,300	2,648.00	40,514,400
ナカヨ	2,800	1,300.00	3,640,000
アイホン	8,000	1,617.00	12,936,000
ルネサスエレクトロニクス	668,200	553.00	369,514,600
セイコーエプソン	173,300	1,156.00	200,334,800
ワコム	95,000	470.00	44,650,000
アルバック	25,700	3,090.00	79,413,000
アクセル	6,400	716.00	4,582,400
E I Z O	10,900	3,655.00	39,839,500
日本信号	35,600	1,045.00	37,202,000
京三製作所	32,900	510.00	16,779,000
能美防災	18,700	1,909.00	35,698,300
ホーチキ	10,400	1,279.00	13,301,600
星和電機	7,600	576.00	4,377,600
エレコム	15,500	4,250.00	65,875,000
パナソニック	1,595,000	866.10	1,381,429,500
シャープ	161,600	1,195.00	193,112,000
アンリツ	89,900	2,110.00	189,689,000
富士通ゼネラル	37,900	2,070.00	78,453,000
ソニー	874,500	6,902.00	6,035,799,000
T D K	67,400	9,190.00	619,406,000
帝国通信工業	6,500	1,201.00	7,806,500
タムラ製作所	46,900	435.00	20,401,500
アルプスアルパイン	123,900	1,175.00	145,582,500
池上通信機	4,400	848.00	3,731,200
鈴木	7,500	780.00	5,850,000
日本トリム	2,000	3,095.00	6,190,000
ローランド ディー . ジー .	8,000	1,165.00	9,320,000
フォスター電機	14,700	1,118.00	16,434,600
S M K	3,600	2,373.00	8,542,800
ヨコオ	9,200	2,765.00	25,438,000
ホシデン	38,600	875.00	33,775,000
ヒロセ電機	21,600	12,250.00	264,600,000
日本航空電子工業	32,100	1,382.00	44,362,200
T O A	15,100	700.00	10,570,000
マクセルホールディングス	30,500	1,028.00	31,354,000
古野電気	18,500	801.00	14,818,500
ユニデンホールディングス	3,900	1,950.00	7,605,000
スミダコーポレーション	11,400	670.00	7,638,000
アイコム	7,800	2,726.00	21,262,800
リオン	6,000	2,279.00	13,674,000
本多通信工業	13,000	419.00	5,447,000

横河電機	128,100	1,443.00	184,848,300
新電元工業	5,000	2,547.00	12,735,000
アズビル	88,100	2,718.00	239,455,800
東亜ディーケーケー	7,400	916.00	6,778,400
日本光電工業	57,800	3,460.00	199,988,000
チノー	4,900	1,280.00	6,272,000
共和電業	14,900	387.00	5,766,300
日本電子材料	5,600	965.00	5,404,000
堀場製作所	27,700	5,790.00	160,383,000
アドバンテスト	103,800	5,110.00	530,418,000
小野測器	6,700	501.00	3,356,700
エスペック	12,600	1,721.00	21,684,600
キーエンス	126,500	39,650.00	5,015,725,000
日置電機	7,400	3,185.00	23,569,000
シスメックス	99,800	7,973.00	795,705,400
日本マイクロニクス	24,800	869.00	21,551,200
メガチップス	13,300	1,885.00	25,070,500
O B A R A G R O U P	8,300	2,952.00	24,501,600
澤藤電機	1,900	1,540.00	2,926,000
原田工業	7,100	844.00	5,992,400
コーセル	19,100	868.00	16,578,800
イリソ電子工業	11,900	3,335.00	39,686,500
オブテックスグループ	23,200	1,260.00	29,232,000
千代田インテグレ	6,700	1,703.00	11,410,100
アイ・オー・データ機器	5,000	929.00	4,645,000
レーザーテック	61,400	7,700.00	472,780,000
スタンレー電気	98,300	2,545.00	250,173,500
岩崎電気	5,700	1,643.00	9,365,100
ウシオ電機	77,400	1,079.00	83,514,600
岡谷電機産業	12,300	323.00	3,972,900
ヘリオス テクノ ホールディング	14,200	336.00	4,771,200
エノモト	4,600	993.00	4,567,800
日本セラミック	14,400	2,036.00	29,318,400
遠藤照明	7,800	568.00	4,430,400
古河電池	10,700	641.00	6,858,700
双信電機	8,100	430.00	3,483,000
山一電機	10,400	1,467.00	15,256,800
図研	9,200	2,495.00	22,954,000
日本電子	27,700	3,165.00	87,670,500
カシオ計算機	123,500	1,667.00	205,874,500
ファナック	132,600	18,240.00	2,418,624,000
日本シイエムケイ	33,800	397.00	13,418,600

エンプラス	7,300	2,170.00	15,841,000
大真空	5,300	1,982.00	10,504,600
ローム	62,000	7,120.00	441,440,000
浜松ホトニクス	100,200	4,750.00	475,950,000
三井ハイテック	15,700	1,309.00	20,551,300
新光電気工業	47,200	1,315.00	62,068,000
京セラ	196,500	5,778.00	1,135,377,000
太陽誘電	62,200	2,896.00	180,131,200
村田製作所	410,100	6,003.00	2,461,830,300
双葉電子工業	22,500	1,012.00	22,770,000
北陸電気工業	6,100	938.00	5,721,800
ニチコン	48,000	773.00	37,104,000
日本ケミコン	10,600	1,248.00	13,228,800
K O A	21,500	903.00	19,414,500
市光工業	21,800	503.00	10,965,400
小糸製作所	83,700	4,370.00	365,769,000
ミツバ	26,600	443.00	11,783,800
S C R E E Nホールディングス	24,200	4,925.00	119,185,000
キャノン電子	14,900	1,558.00	23,214,200
キャノン	751,500	2,190.50	1,646,160,750
リコー	355,300	758.00	269,317,400
象印マホービン	41,200	1,595.00	65,714,000
M U T O Hホールディングス	2,100	1,378.00	2,893,800
東京エレクトロン	88,600	21,810.00	1,932,366,000
トヨタ紡織	40,700	1,360.00	55,352,000
芦森工業	3,000	822.00	2,466,000
ユニプレス	27,100	1,028.00	27,858,800
豊田自動織機	113,000	5,370.00	606,810,000
モリタホールディングス	24,400	1,740.00	42,456,000
三櫻工業	17,800	689.00	12,264,200
デンソー	307,400	3,866.00	1,188,408,400
東海理化電機製作所	36,800	1,456.00	53,580,800
三井E & Sホールディングス	50,400	534.00	26,913,600
川崎重工業	108,600	1,587.00	172,348,200
名村造船所	44,900	168.00	7,543,200
日本車輛製造	5,100	2,754.00	14,045,400
三菱ロジスネクスト	18,500	999.00	18,481,500
近畿車輛	2,100	1,210.00	2,541,000
日産自動車	1,646,300	384.90	633,660,870
いすゞ自動車	404,500	903.00	365,263,500
トヨタ自動車	1,557,600	6,431.00	10,016,925,600
日野自動車	174,300	639.00	111,377,700

三菱自動車工業	516,700	297.00	153,459,900
エフテック	9,900	449.00	4,445,100
レシップホールディングス	5,500	515.00	2,832,500
G M B	2,600	660.00	1,716,000
ファルテック	2,500	661.00	1,652,500
武蔵精密工業	31,200	887.00	27,674,400
日産車体	27,300	940.00	25,662,000
新明和工業	37,600	1,051.00	39,517,600
極東開発工業	25,900	1,205.00	31,209,500
日信工業	28,400	2,220.00	63,048,000
トピー工業	11,500	1,253.00	14,409,500
ティラド	5,100	1,328.00	6,772,800
曙ブレーキ工業	76,600	189.00	14,477,400
タチエス	23,000	891.00	20,493,000
N O K	75,100	1,311.00	98,456,100
フタバ産業	39,000	481.00	18,759,000
K Y B	15,600	2,255.00	35,178,000
大同メタル工業	26,900	557.00	14,983,300
プレス工業	69,400	238.00	16,517,200
ミクニ	18,000	260.00	4,680,000
太平洋工業	29,300	987.00	28,919,100
ケーヒン	32,100	2,558.00	82,111,800
河西工業	19,000	491.00	9,329,000
アイシン精機	115,000	3,320.00	381,800,000
マツダ	410,700	630.00	258,741,000
今仙電機製作所	13,000	742.00	9,646,000
本田技研工業	1,099,100	2,579.00	2,834,578,900
スズキ	276,700	3,522.00	974,537,400
S U B A R U	433,400	2,204.00	955,213,600
安永	6,800	1,032.00	7,017,600
ヤマハ発動機	182,000	1,397.00	254,254,000
ショーワ	33,000	2,267.00	74,811,000
T B K	16,700	450.00	7,515,000
エクセディ	19,000	1,668.00	31,692,000
豊田合成	45,100	2,227.00	100,437,700
愛三工業	22,000	538.00	11,836,000
盟和産業	2,200	936.00	2,059,200
日本プラスト	11,100	439.00	4,872,900
ヨロズ	13,100	1,147.00	15,025,700
エフ・シー・シー	22,900	1,657.00	37,945,300
シマノ	52,200	20,460.00	1,068,012,000
テイ・エス テック	32,400	2,923.00	94,705,200

ジャムコ	7,100	612.00	4,345,200
テルモ	395,000	3,867.00	1,527,465,000
クリエートメディック	4,600	965.00	4,439,000
日機装	41,900	847.00	35,489,300
日本エム・ディ・エム	8,100	1,579.00	12,789,900
島津製作所	166,800	2,750.00	458,700,000
JMS	11,800	824.00	9,723,200
長野計器	10,200	929.00	9,475,800
ブイ・テクノロジー	6,500	4,000.00	26,000,000
東京計器	8,900	766.00	6,817,400
愛知時計電機	1,800	4,360.00	7,848,000
インターアクション	7,500	2,370.00	17,775,000
オーバル	12,600	225.00	2,835,000
東京精密	25,300	3,500.00	88,550,000
マニー	55,600	2,570.00	142,892,000
ニコン	213,200	953.00	203,179,600
トプコン	70,300	893.00	62,777,900
オリンパス	772,400	1,700.00	1,313,080,000
理研計器	12,300	2,135.00	26,260,500
タムロン	11,300	1,773.00	20,034,900
H O Y A	278,800	9,606.00	2,678,152,800
シード	6,000	843.00	5,058,000
ノーリツ鋼機	9,400	1,419.00	13,338,600
エー・アンド・デイ	12,800	713.00	9,126,400
朝日インテック	158,100	3,090.00	488,529,000
シチズン時計	163,600	363.00	59,386,800
リズム時計工業	4,400	599.00	2,635,600
大研医器	9,700	628.00	6,091,600
メニコン	19,800	4,765.00	94,347,000
シンシア	1,600	406.00	649,600
松風	6,300	1,542.00	9,714,600
セイコーホールディングス	19,800	1,665.00	32,967,000
ニプロ	96,600	1,242.00	119,977,200
中本パックス	3,500	1,511.00	5,288,500
スノーピーク	7,400	875.00	6,475,000
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,325.00	63,577,500
トランザクション	7,600	1,010.00	7,676,000
粧美堂	4,100	358.00	1,467,800
ニホンフラッシュ	13,000	1,356.00	17,628,000
前田工織	15,400	2,108.00	32,463,200
永大産業	18,200	295.00	5,369,000
アートネイチャー	14,900	635.00	9,461,500

バンダイナムコホールディングス	144,300	5,593.00	807,069,900
アイフィスジャパン	3,600	681.00	2,451,600
共立印刷	23,300	138.00	3,215,400
S H O E I	12,200	2,256.00	27,523,200
フランスベッドホールディングス	19,700	885.00	17,434,500
パイロットコーポレーション	22,800	3,635.00	82,878,000
萩原工業	7,700	1,369.00	10,541,300
トッパン・フォームズ	29,900	977.00	29,212,300
フジシールインターナショナル	31,300	2,103.00	65,823,900
タカラトミー	62,600	931.00	58,280,600
廣済堂	9,700	788.00	7,643,600
エステールホールディングス	3,700	597.00	2,208,900
アーク	53,300	101.00	5,383,300
タカノ	5,500	694.00	3,817,000
プロネクサス	12,000	1,033.00	12,396,000
ホクシン	8,600	115.00	989,000
ウッドワン	4,700	1,171.00	5,503,700
大建工業	9,400	1,642.00	15,434,800
凸版印刷	197,000	1,554.00	306,138,000
大日本印刷	182,700	2,180.00	398,286,000
共同印刷	4,300	2,706.00	11,635,800
N I S S H A	28,700	979.00	28,097,300
光村印刷	1,200	1,508.00	1,809,600
T A K A R A & C O M P A N Y	6,700	1,870.00	12,529,000
アシックス	115,200	1,048.00	120,729,600
ツツミ	4,400	1,705.00	7,502,000
小松ウオール工業	4,300	1,833.00	7,881,900
ヤマハ	83,000	4,855.00	402,965,000
河合楽器製作所	4,300	2,725.00	11,717,500
クリナップ	13,000	530.00	6,890,000
ビジョン	84,400	4,185.00	353,214,000
オリバー	3,000	2,575.00	7,725,000
兼松サステック	900	1,448.00	1,303,200
キングジム	11,600	889.00	10,312,400
リンテック	33,200	2,436.00	80,875,200
イトーキ	29,700	326.00	9,682,200
任天堂	85,600	43,980.00	3,764,688,000
三菱鉛筆	23,000	1,427.00	32,821,000
タカラスタンダード	28,800	1,529.00	44,035,200
コクヨ	67,000	1,302.00	87,234,000
ナカバヤシ	13,700	568.00	7,781,600
グローブライド	6,200	2,136.00	13,243,200

オカムラ	48,700	829.00	40,372,300
美津濃	12,700	1,833.00	23,279,100
東京電力ホールディングス	1,114,400	354.00	394,497,600
中部電力	427,100	1,458.50	622,925,350
関西電力	528,900	1,023.50	541,329,150
中国電力	201,400	1,495.00	301,093,000
北陸電力	127,600	694.00	88,554,400
東北電力	348,700	1,049.00	365,786,300
四国電力	125,700	805.00	101,188,500
九州電力	287,700	858.00	246,846,600
北海道電力	130,600	422.00	55,113,200
沖縄電力	25,800	2,101.00	54,205,800
電源開発	111,100	1,898.00	210,867,800
エフオン	7,500	594.00	4,455,000
イーレックス	19,900	1,323.00	26,327,700
レノバ	23,300	883.00	20,573,900
東京瓦斯	268,500	2,475.50	664,671,750
大阪瓦斯	270,900	2,061.00	558,324,900
東邦瓦斯	68,700	5,580.00	383,346,000
北海道瓦斯	7,500	1,576.00	11,820,000
広島ガス	28,700	357.00	10,245,900
西部瓦斯	15,700	2,595.00	40,741,500
静岡ガス	39,600	972.00	38,491,200
メタウォーター	6,700	4,705.00	31,523,500
SBSホールディングス	12,000	1,914.00	22,968,000
東武鉄道	145,500	3,720.00	541,260,000
相鉄ホールディングス	44,700	2,922.00	130,613,400
東急	352,100	1,631.00	574,275,100
京浜急行電鉄	179,300	1,737.00	311,444,100
小田急電鉄	207,600	2,522.00	523,567,200
京王電鉄	72,400	6,140.00	444,536,000
京成電鉄	97,100	3,370.00	327,227,000
富士急行	19,000	3,150.00	59,850,000
新京成電鉄	3,600	2,101.00	7,563,600
東日本旅客鉄道	245,700	7,962.00	1,956,263,400
西日本旅客鉄道	124,400	6,330.00	787,452,000
東海旅客鉄道	116,100	17,805.00	2,067,160,500
西武ホールディングス	187,300	1,336.00	250,232,800
鴻池運輸	22,200	1,162.00	25,796,400
西日本鉄道	38,700	2,756.00	106,657,200
ハマキョウレックス	10,700	3,045.00	32,581,500
サカイ引越センター	7,300	5,940.00	43,362,000

近鉄グループホールディングス	132,200	5,150.00	680,830,000
阪急阪神ホールディングス	176,300	3,765.00	663,769,500
南海電気鉄道	62,700	2,512.00	157,502,400
京阪ホールディングス	58,900	4,955.00	291,849,500
神戸電鉄	3,100	3,860.00	11,966,000
名古屋鉄道	108,700	3,205.00	348,383,500
山陽電気鉄道	9,400	2,257.00	21,215,800
日本通運	45,800	5,060.00	231,748,000
ヤマトホールディングス	231,800	2,082.00	482,607,600
山九	36,700	4,030.00	147,901,000
丸運	7,500	228.00	1,710,000
丸全昭和運輸	10,700	2,698.00	28,868,600
センコーグループホールディングス	72,900	848.00	61,819,200
トナミホールディングス	3,200	5,650.00	18,080,000
ニッコンホールディングス	47,300	2,071.00	97,958,300
日本石油輸送	1,400	3,230.00	4,522,000
福山通運	16,900	3,330.00	56,277,000
セイノーホールディングス	99,000	1,329.00	131,571,000
エスライン	4,000	1,002.00	4,008,000
神奈川中央交通	3,300	4,145.00	13,678,500
日立物流	24,200	2,758.00	66,743,600
丸和運輸機関	13,900	2,810.00	39,059,000
C & F ロジホールディングス	13,400	1,395.00	18,693,000
九州旅客鉄道	115,900	2,987.00	346,193,300
S Gホールディングス	138,800	3,260.00	452,488,000
日本郵船	111,200	1,455.00	161,796,000
商船三井	84,200	1,814.00	152,738,800
川崎汽船	40,700	1,111.00	45,217,700
N S ユナイテッド海運	7,900	1,364.00	10,775,600
飯野海運	65,500	329.00	21,549,500
共栄タンカー	3,400	887.00	3,015,800
乾汽船	7,600	1,244.00	9,454,400
日本航空	233,800	1,862.00	435,335,600
A N A ホールディングス	241,700	2,306.00	557,360,200
パスコ	2,600	1,429.00	3,715,400
トランコム	3,700	6,660.00	24,642,000
日新	11,400	1,575.00	17,955,000
三菱倉庫	41,900	2,523.00	105,713,700
三井倉庫ホールディングス	15,100	1,382.00	20,868,200
住友倉庫	47,500	1,285.00	61,037,500
澁澤倉庫	7,300	2,199.00	16,052,700
東陽倉庫	23,900	322.00	7,695,800



日本トランスシティ	29,100	500.00	14,550,000
ケイヒン	2,500	1,282.00	3,205,000
中央倉庫	8,100	1,010.00	8,181,000
川西倉庫	2,400	1,010.00	2,424,000
安田倉庫	10,900	846.00	9,221,400
ファイブホールディングス	2,800	1,002.00	2,805,600
東洋埠頭	4,000	1,352.00	5,408,000
宇徳	11,300	445.00	5,028,500
上組	73,800	1,936.00	142,876,800
サンリツ	3,100	602.00	1,866,200
キムラユニティー	3,500	1,021.00	3,573,500
キューソー流通システム	3,300	1,743.00	5,751,900
近鉄エクスプレス	28,100	1,589.00	44,650,900
東海運	7,500	261.00	1,957,500
エーアイティー	9,300	731.00	6,798,300
内外トランスライン	4,600	1,020.00	4,692,000
日本コンセプト	4,200	1,383.00	5,808,600
NEC ネットエスアイ	13,000	5,240.00	68,120,000
クロスキャット	3,900	1,003.00	3,911,700
システナ	49,000	1,544.00	75,656,000
デジタルアーツ	6,800	7,930.00	53,924,000
日鉄ソリューションズ	20,600	2,737.00	56,382,200
キューブシステム	7,700	777.00	5,982,900
エイジア	2,700	1,289.00	3,480,300
コア	6,000	1,157.00	6,942,000
ラクーンホールディングス	6,500	762.00	4,953,000
ソリトンシステムズ	6,200	1,333.00	8,264,600
ソフトクリエイティブホールディングス	6,100	1,859.00	11,339,900
T I S	137,100	2,286.00	313,410,600
ネオス	5,500	651.00	3,580,500
電算システム	5,300	3,160.00	16,748,000
グリー	84,600	447.00	37,816,200
コーエーテクモホールディングス	28,100	3,070.00	86,267,000
三菱総合研究所	5,900	3,855.00	22,744,500
電算	1,700	2,082.00	3,539,400
A G S	8,100	788.00	6,382,800
ファインデックス	11,800	1,070.00	12,626,000
ブレインパッド	3,600	4,655.00	16,758,000
K L a b	26,500	721.00	19,106,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,800	946.00	15,892,800
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	2,152.00	4,519,200
ネクソン	382,200	2,126.00	812,557,200

アイスタイル	39,200	295.00	11,564,000
エムアップホールディングス	4,100	2,307.00	9,458,700
エイチーム	9,800	728.00	7,134,400
エニグモ	13,200	961.00	12,685,200
テクノスジャパン	11,200	504.00	5,644,800
コロプラ	45,200	1,080.00	48,816,000
ブロードリーフ	68,400	566.00	38,714,400
クロス・マーケティンググループ	7,000	309.00	2,163,000
デジタルハーツホールディングス	7,600	810.00	6,156,000
システム情報	10,600	995.00	10,547,000
メディアドゥホールディングス	4,400	4,155.00	18,282,000
じげん	34,700	352.00	12,214,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,300	917.00	3,026,100
サイバーリンクス	2,300	1,433.00	3,295,900
フィックスターズ	14,800	1,248.00	18,470,400
CARTA HOLDINGS	6,900	952.00	6,568,800
オブティム	7,300	2,743.00	20,023,900
セレス	4,800	1,223.00	5,870,400
SHIFT	5,500	9,030.00	49,665,000
ティーガイア	12,300	2,174.00	26,740,200
セック	2,100	3,475.00	7,297,500
日本アジアグループ	14,400	239.00	3,441,600
テクマトリックス	9,700	3,100.00	30,070,000
プロシップ	4,200	1,270.00	5,334,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,200	1,667.00	55,344,400
GMOペイメントゲートウェイ	29,000	11,540.00	334,660,000
ザッパラス	6,700	353.00	2,365,100
システムリサーチ	3,800	1,850.00	7,030,000
インターネットイニシアティブ	20,300	3,875.00	78,662,500
さくらインターネット	15,100	567.00	8,561,700
ヴィンクス	4,100	1,088.00	4,460,800
GMOクラウド	2,600	4,010.00	10,426,000
SRAホールディングス	7,400	2,216.00	16,398,400
システムインテグレータ	4,700	824.00	3,872,800
朝日ネット	10,000	1,010.00	10,100,000
eBASE	16,600	1,171.00	19,438,600
アバント	13,300	1,031.00	13,712,300
アドソル日進	4,900	2,571.00	12,597,900
フリービット	7,400	822.00	6,082,800
コムチュア	15,500	2,502.00	38,781,000
サイバーコム	2,600	1,891.00	4,916,600
アステリア	8,900	480.00	4,272,000

アイル	7,700	1,724.00	13,274,800
マークライنز	7,000	1,891.00	13,237,000
メディカル・データ・ビジョン	10,700	1,022.00	10,935,400
ショーケース	3,700	529.00	1,957,300
モバイルファクトリー	3,300	1,151.00	3,798,300
テラスカイ	5,000	2,739.00	13,695,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,600	1,560.00	8,736,000
P C Iホールディングス	5,500	836.00	4,598,000
パイプドHD	1,900	1,515.00	2,878,500
アイビーシー	2,500	1,129.00	2,822,500
ネオジャパン	2,800	1,241.00	3,474,800
P R T I M E S	1,300	2,410.00	3,133,000
ランドコンピュータ	2,300	1,066.00	2,451,800
ダブルスタンダード	1,800	4,805.00	8,649,000
オープンドア	7,000	1,065.00	7,455,000
マイネット	4,400	1,107.00	4,870,800
アカツキ	4,900	4,295.00	21,045,500
ベネフィットジャパン	1,200	1,520.00	1,824,000
U b i c o mホールディングス	3,200	1,372.00	4,390,400
L I N E	31,400	5,330.00	167,362,000
カナミックネットワーク	12,900	835.00	10,771,500
ノムラシステムコーポレーション	3,700	542.00	2,005,400
チェンジ	4,800	4,330.00	20,784,000
シンクロ・フード	6,800	326.00	2,216,800
オークネット	8,700	1,025.00	8,917,500
セグエグループ	3,300	781.00	2,577,300
エイトレッド	2,400	1,851.00	4,442,400
A O I T Y O H o l d i n g s	14,400	471.00	6,782,400
マクロミル	28,300	692.00	19,583,600
ビーグリー	2,800	1,408.00	3,942,400
オロ	3,700	3,025.00	11,192,500
ユーザーローカル	1,400	3,150.00	4,410,000
テモナ	3,300	744.00	2,455,200
ニーズウェル	3,000	665.00	1,995,000
サインポスト	3,000	1,434.00	4,302,000
ソルクシーズ	6,200	654.00	4,054,800
フェイス	5,200	618.00	3,213,600
プロトコーポレーション	12,500	1,098.00	13,725,000
ハイマックス	1,800	1,923.00	3,461,400
野村総合研究所	194,300	2,633.00	511,591,900
サイバネットシステム	10,100	674.00	6,807,400
C Eホールディングス	7,800	478.00	3,728,400

日本システム技術	2,400	1,311.00	3,146,400
インテージホールディングス	17,400	818.00	14,233,200
東邦システムサイエンス	3,900	936.00	3,650,400
ソースネクスト	65,800	326.00	21,450,800
インフォコム	15,100	2,543.00	38,399,300
HEROZ	2,000	3,745.00	7,490,000
ラクスル	11,100	2,725.00	30,247,500
FIG	15,900	264.00	4,197,600
システムサポート	1,600	3,295.00	5,272,000
イーソル	6,700	1,314.00	8,803,800
アルテリア・ネットワークス	15,300	2,018.00	30,875,400
東海ソフト	1,200	1,399.00	1,678,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	944.00	2,454,400
フォーカスシステムズ	8,800	802.00	7,057,600
クレスコ	8,500	1,450.00	12,325,000
フジ・メディア・ホールディングス	132,200	1,028.00	135,901,600
オービック	47,500	17,650.00	838,375,000
ジャストシステム	22,300	6,850.00	152,755,000
TDCソフト	12,300	873.00	10,737,900
Zホールディングス	1,881,700	437.00	822,302,900
トレンドマイクロ	61,000	5,710.00	348,310,000
IDホールディングス	5,400	1,481.00	7,997,400
日本オラクル	27,800	12,770.00	355,006,000
アルファシステムズ	4,300	3,775.00	16,232,500
フューチャー	16,700	1,680.00	28,056,000
CAC Holdings	9,100	1,139.00	10,364,900
SBテクノロジー	5,000	2,635.00	13,175,000
トーセ	4,000	849.00	3,396,000
オービックビジネスコンサルタント	14,000	5,270.00	73,780,000
伊藤忠テクノソリューションズ	62,500	3,520.00	220,000,000
アイティフォー	17,000	702.00	11,934,000
東計電算	2,100	3,830.00	8,043,000
エクスネット	2,400	966.00	2,318,400
大塚商会	74,200	4,705.00	349,111,000
サイボウズ	16,100	2,248.00	36,192,800
ソフトブレーン	8,600	501.00	4,308,600
電通国際情報サービス	8,500	4,765.00	40,502,500
ACCESS	13,100	880.00	11,528,000
デジタルガレージ	24,700	3,790.00	93,613,000
EMシステムズ	19,600	829.00	16,248,400
ウェザーニューズ	4,700	3,935.00	18,494,500
CIJ	9,700	809.00	7,847,300

ビジネスエンジニアリング	1,700	2,480.00	4,216,000
日本エンタープライズ	15,100	234.00	3,533,400
WOWOW	6,700	2,488.00	16,669,600
スカラ	9,600	602.00	5,779,200
インテリジェント ウェイブ	8,400	652.00	5,476,800
I M A G I C A G R O U P	12,400	375.00	4,650,000
ネットワンシステムズ	52,300	3,180.00	166,314,000
システムソフト	33,100	76.00	2,515,600
アルゴグラフィックス	11,700	3,710.00	43,407,000
マーベラス	21,400	573.00	12,262,200
エイベックス	23,800	879.00	20,920,200
日本ユニシス	42,900	3,295.00	141,355,500
兼松エレクトロニクス	7,500	3,825.00	28,687,500
東京放送ホールディングス	83,500	1,667.00	139,194,500
日本テレビホールディングス	114,600	1,204.00	137,978,400
朝日放送グループホールディングス	14,000	722.00	10,108,000
テレビ朝日ホールディングス	37,800	1,633.00	61,727,400
スカパーJ S A Tホールディングス	90,800	423.00	38,408,400
テレビ東京ホールディングス	11,300	2,346.00	26,509,800
日本BS放送	4,900	1,061.00	5,198,900
ビジョン	13,100	848.00	11,108,800
スマートバリュー	3,900	976.00	3,806,400
ワイヤレスゲート	6,900	571.00	3,939,900
コネクシオ	7,900	1,525.00	12,047,500
クロップス	2,900	704.00	2,041,600
日本電信電話	1,831,200	2,421.00	4,433,335,200
K D D I	1,020,900	3,227.00	3,294,444,300
ソフトバンク	1,245,000	1,403.00	1,746,735,000
光通信	14,100	21,780.00	307,098,000
N T T ドコモ	1,011,900	3,066.00	3,102,485,400
エムティーアイ	13,700	610.00	8,357,000
G M O インターネット	54,100	2,573.00	139,199,300
ファイバーゲート	4,600	1,368.00	6,292,800
アйдママーケティングコミュニケーション	4,700	444.00	2,086,800
K A D O K A W A	37,000	1,553.00	57,461,000
学研ホールディングス	18,500	1,594.00	29,489,000
ゼンリン	27,500	1,316.00	36,190,000
昭文社ホールディングス	7,000	400.00	2,800,000
インプレスホールディングス	11,300	148.00	1,672,400
アイネット	7,200	1,501.00	10,807,200
松竹	9,100	13,410.00	122,031,000
東宝	80,900	3,860.00	312,274,000

東映	5,100	14,460.00	73,746,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	364,900	1,161.00	423,648,900	
ピー・シー・エー	2,400	3,860.00	9,264,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,710.00	6,504,000	
D T S	30,700	2,224.00	68,276,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,500	4,740.00	277,290,000	
シーイーシー	14,800	1,739.00	25,737,200	
カプコン	64,700	3,455.00	223,538,500	
アイ・エス・ピー	2,800	1,987.00	5,563,600	
ジャステック	8,900	1,183.00	10,528,700	
S C S K	31,700	4,870.00	154,379,000	
日本システムウエア	4,600	2,202.00	10,129,200	
アイネス	13,600	1,298.00	17,652,800	
T K C	11,600	5,020.00	58,232,000	
富士ソフト	17,600	4,335.00	76,296,000	
N S D	44,200	1,637.00	72,355,400	
コナミホールディングス	49,800	3,530.00	175,794,000	
福井コンピュータホールディングス	5,500	2,817.00	15,493,500	
J B C Cホールディングス	9,400	1,554.00	14,607,600	
ミロク情報サービス	12,200	2,423.00	29,560,600	
ソフトバンクグループ	1,086,900	4,494.00	4,884,528,600	
ハウスイ	1,100	917.00	1,008,700	
高千穂交易	5,300	947.00	5,019,100	
カワニシホールディングス	1,600	1,257.00	2,011,200	
伊藤忠食品	3,400	4,710.00	16,014,000	
エレマテック	12,900	817.00	10,539,300	
J A L U X	3,900	1,609.00	6,275,100	
あらた	10,900	4,355.00	47,469,500	
トーメンデバイス	2,100	3,705.00	7,780,500	
東京エレクトロン デバイス	5,000	2,835.00	14,175,000	
フィールズ	10,500	375.00	3,937,500	
双日	759,400	238.00	180,737,200	
アルフレッサ ホールディングス	152,800	2,096.00	320,268,800	
横浜冷凍	36,000	884.00	31,824,000	
ラサ商事	7,300	859.00	6,270,700	
アルコニックス	14,600	1,200.00	17,520,000	
神戸物産	47,400	4,915.00	232,971,000	
ハイパー	2,100	534.00	1,121,400	
あい ホールディングス	19,600	1,356.00	26,577,600	
ディーブイエックス	4,900	931.00	4,561,900	
ダイワボウホールディングス	11,700	6,910.00	80,847,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	32,800	1,610.00	52,808,000	

ラクト・ジャパン	5,100	3,720.00	18,972,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,900	1,070.00	27,713,000	
八洲電機	10,700	858.00	9,180,600	
メディアスホールディングス	7,800	928.00	7,238,400	
レスターホールディングス	14,300	1,920.00	27,456,000	
ジューテックホールディングス	3,200	1,022.00	3,270,400	
大光	5,900	701.00	4,135,900	
OCHIホールディングス	4,000	1,404.00	5,616,000	
TOKAIホールディングス	72,700	983.00	71,464,100	
黒谷	3,800	438.00	1,664,400	
Cominix	2,400	716.00	1,718,400	
三洋貿易	13,900	892.00	12,398,800	
ビューティガレージ	2,200	1,669.00	3,671,800	
ウイン・パートナーズ	9,900	937.00	9,276,300	
ミタチ産業	4,200	624.00	2,620,800	
シップヘルスケアホールディングス	22,000	4,700.00	103,400,000	
明治電機工業	4,300	1,349.00	5,800,700	
デリカフーズホールディングス	4,900	622.00	3,047,800	
スターティアホールディングス	3,200	627.00	2,006,400	
コメダホールディングス	30,000	1,810.00	54,300,000	
ピーバンドットコム	1,400	958.00	1,341,200	
アセンテック	1,500	2,863.00	4,294,500	
富士興産	4,200	468.00	1,965,600	
協栄産業	1,500	1,171.00	1,756,500	
小野建	12,300	1,233.00	15,165,900	
南陽	3,000	1,388.00	4,164,000	
佐島電機	9,400	852.00	8,008,800	
エコートレーディング	3,200	509.00	1,628,800	
伯東	8,400	966.00	8,114,400	
コンドーテック	10,700	1,022.00	10,935,400	
中山福	7,900	476.00	3,760,400	
ナガイレーベン	18,200	2,635.00	47,957,000	
三菱食品	15,100	2,538.00	38,323,800	
松田産業	10,000	1,388.00	13,880,000	
第一興商	20,500	3,695.00	75,747,500	
メディバルホールディングス	148,400	2,047.00	303,774,800	
S P K	5,900	1,370.00	8,083,000	
萩原電気ホールディングス	5,100	2,065.00	10,531,500	
アズワン	9,000	11,300.00	101,700,000	
スズデン	4,800	1,200.00	5,760,000	
尾家産業	4,000	1,499.00	5,996,000	
シモジマ	8,400	1,270.00	10,668,000	

ドウシシャ	13,000	1,442.00	18,746,000
小津産業	3,000	1,931.00	5,793,000
高速	8,200	1,459.00	11,963,800
たけびし	4,800	1,399.00	6,715,200
リックス	3,100	1,400.00	4,340,000
丸文	12,200	450.00	5,490,000
ハピネット	11,500	1,024.00	11,776,000
橋本総業ホールディングス	2,800	1,900.00	5,320,000
日本ライフライン	40,700	1,356.00	55,189,200
タカショー	9,000	478.00	4,302,000
マルカ	4,900	1,827.00	8,952,300
I D O M	37,100	473.00	17,548,300
進和	8,100	1,754.00	14,207,400
エスケイジャパン	3,000	314.00	942,000
ダイトロン	5,800	1,622.00	9,407,600
シークス	17,500	1,019.00	17,832,500
田中商事	4,200	685.00	2,877,000
オーハシテクニカ	7,800	1,535.00	11,973,000
白銅	4,900	1,315.00	6,443,500
伊藤忠商事	961,600	2,242.50	2,156,388,000
丸紅	1,431,100	480.00	686,928,000
高島	2,200	1,680.00	3,696,000
長瀬産業	77,300	1,325.00	102,422,500
蝶理	8,800	1,790.00	15,752,000
豊田通商	153,500	2,488.00	381,908,000
三共生興	20,900	443.00	9,258,700
兼松	51,300	1,263.00	64,791,900
ツカモトコーポレーション	2,500	1,116.00	2,790,000
三井物産	1,208,400	1,604.50	1,938,877,800
日本紙パルプ商事	7,800	3,700.00	28,860,000
カメイ	17,900	1,043.00	18,669,700
東都水産	1,800	3,010.00	5,418,000
O U G ホールディングス	2,200	2,531.00	5,568,200
スターゼン	5,100	4,460.00	22,746,000
山善	53,700	896.00	48,115,200
椿本興業	2,500	3,255.00	8,137,500
住友商事	867,500	1,257.00	1,090,447,500
内田洋行	5,400	5,320.00	28,728,000
三菱商事	964,800	2,395.00	2,310,696,000
第一実業	6,700	3,695.00	24,756,500
キャノンマーケティングジャパン	34,100	2,079.00	70,893,900
西華産業	7,800	1,148.00	8,954,400



佐藤商事	11,400	893.00	10,180,200
菱洋エレクトロ	13,900	2,536.00	35,250,400
東京産業	12,500	560.00	7,000,000
ユアサ商事	13,100	2,907.00	38,081,700
神鋼商事	3,500	1,840.00	6,440,000
トルク	8,300	281.00	2,332,300
阪和興業	25,700	1,730.00	44,461,000
正栄食品工業	8,900	4,230.00	37,647,000
カナデン	11,200	1,265.00	14,168,000
菱電商事	9,900	1,356.00	13,424,400
フルサト工業	7,600	1,412.00	10,731,200
岩谷産業	30,500	3,750.00	114,375,000
ナイス	5,900	744.00	4,389,600
昭光通商	4,400	567.00	2,494,800
ニチモウ	2,100	1,729.00	3,630,900
極東貿易	4,000	1,408.00	5,632,000
イワキ	18,100	448.00	8,108,800
三愛石油	33,900	1,036.00	35,120,400
稲畑産業	30,300	1,243.00	37,662,900
G S Iクレオス	3,400	1,038.00	3,529,200
明和産業	12,700	493.00	6,261,100
クワザワ	4,900	527.00	2,582,300
ヤマエ久野	10,000	1,240.00	12,400,000
ワキタ	29,300	967.00	28,333,100
東邦ホールディングス	44,100	2,100.00	92,610,000
サンゲツ	37,500	1,566.00	58,725,000
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,209.00	24,542,700
シナネンホールディングス	5,700	2,735.00	15,589,500
伊藤忠エネクス	30,400	823.00	25,019,200
サンリオ	38,600	1,702.00	65,697,200
サンワテクノス	9,800	828.00	8,114,400
リョーサン	15,200	2,306.00	35,051,200
新光商事	21,600	885.00	19,116,000
トーホー	6,200	1,850.00	11,470,000
三信電気	7,400	1,573.00	11,640,200
東陽テクニカ	14,700	1,044.00	15,346,800
モスフードサービス	18,000	2,914.00	52,452,000
加賀電子	13,700	2,070.00	28,359,000
ソーダニッカ	14,200	560.00	7,952,000
立花エレテック	10,200	1,598.00	16,299,600
フォーバル	6,000	1,168.00	7,008,000
P A L T A C	22,000	5,080.00	111,760,000

三谷産業	18,100	392.00	7,095,200
西本Wismettacホールディングス	2,500	1,750.00	4,375,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,945.00	2,334,000
国際紙パルプ商事	32,600	313.00	10,203,800
ヤマタネ	6,900	1,245.00	8,590,500
丸紅建材リース	1,400	1,487.00	2,081,800
日鉄物産	9,800	3,285.00	32,193,000
泉州電業	4,200	2,395.00	10,059,000
トラスコ中山	28,600	2,449.00	70,041,400
オートバックスセブン	51,000	1,281.00	65,331,000
モリト	10,000	684.00	6,840,000
加藤産業	19,800	3,600.00	71,280,000
北恵	3,500	833.00	2,915,500
イノテック	7,200	903.00	6,501,600
イエローハット	26,000	1,434.00	37,284,000
J Kホールディングス	12,500	776.00	9,700,000
日伝	12,500	2,248.00	28,100,000
北沢産業	10,400	275.00	2,860,000
杉本商事	7,400	1,789.00	13,238,600
因幡電機産業	39,100	2,345.00	91,689,500
東テク	4,600	2,211.00	10,170,600
ミスミグループ本社	172,300	2,731.00	470,551,300
アルテック	11,000	208.00	2,288,000
タキヒヨー	4,200	1,690.00	7,098,000
蔵王産業	2,700	1,432.00	3,866,400
スズケン	58,200	3,725.00	216,795,000
ジェコス	9,500	956.00	9,082,000
グローセル	13,800	420.00	5,796,000
ローソン	34,800	5,560.00	193,488,000
サンエー	11,500	4,070.00	46,805,000
カワチ薬品	10,700	2,465.00	26,375,500
エービーシー・マート	21,500	6,030.00	129,645,000
ハードオフコーポレーション	5,700	650.00	3,705,000
アスクル	14,400	3,405.00	49,032,000
ゲオホールディングス	24,900	1,365.00	33,988,500
アダストリア	19,200	1,616.00	31,027,200
ジーフット	8,300	456.00	3,784,800
くら寿司	7,200	4,665.00	33,588,000
キャンドウ	6,600	1,930.00	12,738,000
パルグループホールディングス	14,200	1,322.00	18,772,400
エディオン	63,300	950.00	60,135,000
サーラコーポレーション	28,200	563.00	15,876,600

ワッツ	6,300	685.00	4,315,500
ハローズ	5,200	2,993.00	15,563,600
フジオフードシステム	11,700	1,384.00	16,192,800
あみやき亭	3,000	3,000.00	9,000,000
ひらまつ	25,300	162.00	4,098,600
大黒天物産	3,300	4,140.00	13,662,000
ハニーズホールディングス	12,300	1,161.00	14,280,300
ファーマライズホールディングス	3,600	673.00	2,422,800
アルペン	10,600	1,660.00	17,596,000
ハブ	4,200	692.00	2,906,400
クオールホールディングス	20,400	1,158.00	23,623,200
ジーンズホールディングス	7,300	6,740.00	49,202,000
ビックカメラ	81,700	1,046.00	85,458,200
D C Mホールディングス	76,300	1,082.00	82,556,600
MonotaRO	97,800	3,920.00	383,376,000
東京一番フーズ	3,900	498.00	1,942,200
D Dホールディングス	5,400	928.00	5,011,200
きちりホールディングス	4,000	614.00	2,456,000
アーランドサービスホールディングス	10,100	1,830.00	18,483,000
J . フロント リテイリング	164,400	879.00	144,507,600
ドトール・日レスホールディングス	22,000	1,743.00	38,346,000
マツモトキヨシホールディングス	56,900	3,910.00	222,479,000
ブロンコビリー	7,300	2,208.00	16,118,400
Z O Z O	94,600	2,017.00	190,808,200
トレジャー・ファクトリー	4,300	675.00	2,902,500
物語コーポレーション	3,700	7,810.00	28,897,000
ココカラファイン	14,400	5,300.00	76,320,000
三越伊勢丹ホールディングス	240,600	690.00	166,014,000
H a m e e	5,000	1,318.00	6,590,000
ウエルシアホールディングス	40,900	7,760.00	317,384,000
クリエイティブSDホールディングス	23,200	3,120.00	72,384,000
丸善C H Iホールディングス	16,000	380.00	6,080,000
ティーライフ	2,200	957.00	2,105,400
チムニー	4,300	1,702.00	7,318,600
シュッピン	9,600	775.00	7,440,000
ネクステージ	19,900	841.00	16,735,900
ジョイフル本田	40,400	1,249.00	50,459,600
鳥貴族	4,100	1,756.00	7,199,600
麒麟堂ホールディングス	5,500	2,040.00	11,220,000
ホットランド	9,300	1,179.00	10,964,700
すかいらーくホールディングス	154,200	1,713.00	264,144,600
S F Pホールディングス	7,900	1,536.00	12,134,400

綿半ホールディングス	5,200	1,751.00	9,105,200	
ヨシックス	2,300	2,056.00	4,728,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,100	1,064.00	42,666,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	511.00	3,423,700	
B E E N O S	6,500	1,043.00	6,779,500	
あさひ	10,400	1,370.00	14,248,000	
日本調剤	8,400	1,654.00	13,893,600	
コスモス薬品	6,100	28,830.00	175,863,000	
トーエル	6,900	705.00	4,864,500	
オンリー	2,700	580.00	1,566,000	
セブン&アイ・ホールディングス	537,900	3,616.00	1,945,046,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	74,200	760.00	56,392,000	
ツルハホールディングス	29,900	14,180.00	423,982,000	
サンマルクホールディングス	11,000	1,836.00	20,196,000	
フェリシモ	3,200	1,010.00	3,232,000	
トリドールホールディングス	34,100	1,328.00	45,284,800	
T O K Y O B A S E	13,000	336.00	4,368,000	
ウイルプラスホールディングス	2,000	729.00	1,458,000	
J Mホールディングス	10,500	2,535.00	26,617,500	
サツドラホールディングス	2,100	2,035.00	4,273,500	
アレンザホールディングス	7,100	853.00	6,056,300	
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,625.00	4,712,500	
パロックジャパンリミテッド	9,900	600.00	5,940,000	
クスリのアオキホールディングス	12,300	8,020.00	98,646,000	
力の源ホールディングス	6,500	706.00	4,589,000	
スシローグローバルホールディングス	75,500	2,080.00	157,040,000	
L I X I L ビバ	13,700	2,063.00	28,263,100	
メディカルシステムネットワーク	13,700	459.00	6,288,300	
はるやまホールディングス	6,700	746.00	4,998,200	
ノジマ	24,600	2,127.00	52,324,200	
カップ・クリエイト	19,300	1,442.00	27,830,600	
ライトオン	10,300	516.00	5,314,800	
良品計画	182,700	1,485.00	271,309,500	
三城ホールディングス	15,300	272.00	4,161,600	
アドヴァン	21,200	1,106.00	23,447,200	
アルビス	5,300	2,013.00	10,668,900	
コナカ	16,800	318.00	5,342,400	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,570.00	2,826,000	
G - 7ホールディングス	8,200	2,210.00	18,122,000	
イオン北海道	18,300	793.00	14,511,900	
コジマ	24,100	427.00	10,290,700	

ヒマラヤ	5,100	779.00	3,972,900
コーナン商事	19,600	2,685.00	52,626,000
エコス	5,200	1,848.00	9,609,600
ワタミ	16,400	1,133.00	18,581,200
マルシェ	3,900	631.00	2,460,900
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	302,200	2,047.00	618,603,400
西松屋チェーン	30,400	869.00	26,417,600
ゼンショーホールディングス	66,000	2,229.00	147,114,000
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,698.00	14,942,400
ハークスレイ	3,000	966.00	2,898,000
サイゼリヤ	20,500	2,346.00	48,093,000
V Tホールディングス	57,500	289.00	16,617,500
魚力	3,900	1,540.00	6,006,000
フジ・コーポレーション	3,700	1,827.00	6,759,900
ユナイテッドアローズ	14,500	1,754.00	25,433,000
ハイデイ日高	19,900	1,804.00	35,899,600
京都きもの友禅	9,600	227.00	2,179,200
コロワイド	45,700	1,579.00	72,160,300
ピーシーデポコーポレーション	18,600	580.00	10,788,000
壱番屋	9,700	4,945.00	47,966,500
P L A N T	3,800	561.00	2,131,800
スギホールディングス	27,500	6,780.00	186,450,000
薬王堂ホールディングス	6,100	2,606.00	15,896,600
スクロール	21,700	354.00	7,681,800
ヨンドシーホールディングス	14,100	1,821.00	25,676,100
ファミリーマート	109,900	1,862.00	204,633,800
木曽路	18,000	2,440.00	43,920,000
S R Sホールディングス	16,400	890.00	14,596,000
タカキュー	12,000	136.00	1,632,000
ケーヨー	28,500	578.00	16,473,000
上新電機	16,200	2,064.00	33,436,800
日本瓦斯	21,800	4,110.00	89,598,000
ロイヤルホールディングス	24,100	1,812.00	43,669,200
いなげや	17,100	1,671.00	28,574,100
島忠	25,900	2,713.00	70,266,700
チヨダ	14,600	1,023.00	14,935,800
ライフコーポレーション	10,500	3,255.00	34,177,500
リンガーハット	17,000	2,379.00	40,443,000
M r M a x H D	19,300	421.00	8,125,300
テンアライド	12,700	380.00	4,826,000
A O K Iホールディングス	27,800	620.00	17,236,000
オークワ	21,700	1,388.00	30,119,600

コメリ	21,300	2,371.00	50,502,300
青山商事	28,600	798.00	22,822,800
しまむら	16,000	6,870.00	109,920,000
はせがわ	7,700	400.00	3,080,000
高島屋	100,300	991.00	99,397,300
松屋	28,000	621.00	17,388,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,300	840.00	54,852,000
近鉄百貨店	5,300	2,902.00	15,380,600
丸井グループ	126,100	1,767.00	222,818,700
アクシアル リテイリング	11,500	3,915.00	45,022,500
イオン	529,100	2,307.50	1,220,898,250
イズミ	28,000	3,290.00	92,120,000
平和堂	28,000	1,822.00	51,016,000
フジ	16,700	1,806.00	30,160,200
ヤオコー	15,600	6,730.00	104,988,000
ゼビオホールディングス	16,800	879.00	14,767,200
ケーズホールディングス	132,800	1,269.00	168,523,200
Olympicグループ	7,400	675.00	4,995,000
日産東京販売ホールディングス	21,100	218.00	4,599,800
シルバーライフ	1,900	2,099.00	3,988,100
一家ダイニングプロジェクト	1,400	608.00	851,200
Genky DrugStores	6,100	2,505.00	15,280,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	597.00	2,029,800
ブックオフグループホールディングス	8,000	797.00	6,376,000
アインホールディングス	16,900	6,690.00	113,061,000
元気寿司	3,500	2,378.00	8,323,000
ヤマダ電機	419,200	480.00	201,216,000
アークランドサカモト	21,700	1,068.00	23,175,600
ニトリホールディングス	59,500	17,330.00	1,031,135,000
グルメ杵屋	10,000	955.00	9,550,000
愛眼	11,000	218.00	2,398,000
ケーユーホールディングス	7,400	820.00	6,068,000
吉野家ホールディングス	45,200	2,354.00	106,400,800
松屋フーズホールディングス	6,700	3,975.00	26,632,500
サガミホールディングス	18,500	1,291.00	23,883,500
関西スーパーマーケット	11,600	1,098.00	12,736,800
王将フードサービス	10,100	6,120.00	61,812,000
プレナス	15,500	1,864.00	28,892,000
ミニストップ	10,300	1,479.00	15,233,700
アークス	28,200	2,055.00	57,951,000
バローホールディングス	30,500	1,952.00	59,536,000
ベルク	6,800	6,360.00	43,248,000

大庄	7,500	1,315.00	9,862,500
ファーストリテイリング	18,400	51,760.00	952,384,000
サンドラッグ	51,800	3,400.00	176,120,000
サクスパー ホールディングス	12,000	526.00	6,312,000
ヤマザワ	3,300	1,700.00	5,610,000
やまや	2,900	2,218.00	6,432,200
ペルーナ	29,900	485.00	14,501,500
島根銀行	3,600	498.00	1,792,800
じもとホールディングス	93,000	92.00	8,556,000
めぶきフィナンシャルグループ	715,400	228.00	163,111,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,600	1,018.00	18,934,800
九州フィナンシャルグループ	301,200	445.00	134,034,000
ゆうちょ銀行	390,100	920.00	358,892,000
富山第一銀行	32,800	256.00	8,396,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	786,400	321.00	252,434,400
西日本フィナンシャルホールディングス	91,600	644.00	58,990,400
関西みらいフィナンシャルグループ	80,800	356.00	28,764,800
三十三フィナンシャルグループ	12,800	1,426.00	18,252,800
第四北越フィナンシャルグループ	23,900	2,146.00	51,289,400
新生銀行	101,000	1,332.00	134,532,000
あおぞら銀行	82,000	1,866.00	153,012,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,418,300	423.90	3,992,417,370
りそなホールディングス	1,510,900	351.40	530,930,260
三井住友トラスト・ホールディングス	260,200	3,008.00	782,681,600
三井住友フィナンシャルグループ	952,200	2,919.50	2,779,947,900
千葉銀行	459,500	465.00	213,667,500
群馬銀行	264,500	311.00	82,259,500
武蔵野銀行	20,500	1,341.00	27,490,500
千葉興業銀行	37,800	228.00	8,618,400
筑波銀行	57,200	173.00	9,895,600
七十七銀行	46,500	1,461.00	67,936,500
青森銀行	10,700	1,983.00	21,218,100
秋田銀行	8,800	1,444.00	12,707,200
山形銀行	15,500	1,252.00	19,406,000
岩手銀行	9,000	2,380.00	21,420,000
東邦銀行	123,100	227.00	27,943,700
東北銀行	6,600	901.00	5,946,600
みちのく銀行	8,800	1,147.00	10,093,600
ふくおかフィナンシャルグループ	116,000	1,615.00	187,340,000
静岡銀行	340,900	631.00	215,107,900
十六銀行	17,300	1,927.00	33,337,100
スルガ銀行	140,900	353.00	49,737,700

八十二銀行	332,300	363.00	120,624,900	
山梨中央銀行	16,000	841.00	13,456,000	
大垣共立銀行	27,200	2,119.00	57,636,800	
福井銀行	11,800	1,592.00	18,785,600	
北國銀行	14,200	2,700.00	38,340,000	
清水銀行	5,700	1,753.00	9,992,100	
富山銀行	2,700	2,221.00	5,996,700	
滋賀銀行	27,600	2,331.00	64,335,600	
南都銀行	22,900	2,218.00	50,792,200	
百五銀行	123,900	302.00	37,417,800	
京都銀行	49,300	3,675.00	181,177,500	
紀陽銀行	48,700	1,603.00	78,066,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	91,600	822.00	75,295,200	
広島銀行	203,200	457.00	92,862,400	
山陰合同銀行	81,600	511.00	41,697,600	
中国銀行	118,500	926.00	109,731,000	
鳥取銀行	4,700	1,195.00	5,616,500	
伊予銀行	196,500	578.00	113,577,000	
百十四銀行	14,600	1,952.00	28,499,200	
四国銀行	20,900	857.00	17,911,300	
阿波銀行	22,500	2,140.00	48,150,000	
大分銀行	7,900	2,326.00	18,375,400	
宮崎銀行	9,200	2,301.00	21,169,200	
佐賀銀行	8,400	1,093.00	9,181,200	
沖縄銀行	12,600	3,050.00	38,430,000	
琉球銀行	31,800	909.00	28,906,200	
セブン銀行	459,900	306.00	140,729,400	
みずほフィナンシャルグループ	18,708,700	123.00	2,301,170,100	
高知銀行	5,000	711.00	3,555,000	
山口フィナンシャルグループ	171,900	599.00	102,968,100	
長野銀行	4,500	1,049.00	4,720,500	
名古屋銀行	10,300	2,168.00	22,330,400	
北洋銀行	207,500	190.00	39,425,000	
愛知銀行	5,000	2,990.00	14,950,000	
中京銀行	5,700	2,013.00	11,474,100	
大光銀行	4,700	1,498.00	7,040,600	
愛媛銀行	19,200	1,108.00	21,273,600	
トマト銀行	5,300	1,021.00	5,411,300	
京葉銀行	58,700	500.00	29,350,000	
栃木銀行	66,500	160.00	10,640,000	
北日本銀行	4,300	1,760.00	7,568,000	
東和銀行	24,200	662.00	16,020,400	



福島銀行	13,000	165.00	2,145,000	
大東銀行	7,200	564.00	4,060,800	
トモニホールディングス	106,400	335.00	35,644,000	
フィデアホールディングス	133,700	104.00	13,904,800	
池田泉州ホールディングス	158,300	162.00	25,644,600	
F P G	42,800	556.00	23,796,800	
マーキュリアインベストメント	6,400	532.00	3,404,800	
S B Iホールディングス	153,900	2,285.00	351,661,500	
ジャフコ	21,200	3,365.00	71,338,000	
大和証券グループ本社	1,105,100	416.30	460,053,130	
野村ホールディングス	2,423,000	423.50	1,026,140,500	
岡三証券グループ	117,800	322.00	37,931,600	
丸三証券	41,300	424.00	17,511,200	
東洋証券	50,600	126.00	6,375,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158,800	226.00	35,888,800	
光世証券	3,600	514.00	1,850,400	
水戸証券	40,700	194.00	7,895,800	
いちよし証券	26,100	427.00	11,144,700	
松井証券	78,900	769.00	60,674,100	
だいこう証券ビジネス	6,900	919.00	6,341,100	
マネックスグループ	101,800	225.00	22,905,000	
極東証券	18,800	488.00	9,174,400	
岩井コスモホールディングス	13,200	917.00	12,104,400	
藍澤證券	25,000	698.00	17,450,000	
マネーパートナーズグループ	15,500	196.00	3,038,000	
スパークス・グループ	64,400	189.00	12,171,600	
かんぽ生命保険	48,800	1,322.00	64,513,600	
S O M P Oホールディングス	258,900	3,155.00	816,829,500	
アニコム ホールディングス	11,400	4,545.00	51,813,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	360,000	2,980.00	1,072,800,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	113,100	2,412.00	272,797,200	
第一生命ホールディングス	779,100	1,268.00	987,898,800	
東京海上ホールディングス	486,800	4,610.00	2,244,148,000	
T & Dホールディングス	411,500	872.00	358,828,000	
アドバンスクリエイト	2,900	2,352.00	6,820,800	
全国保証	38,800	3,645.00	141,426,000	
ジェイリース	3,800	231.00	877,800	
イントラスト	4,800	770.00	3,696,000	
日本モーゲージサービス	2,800	1,784.00	4,995,200	
C a s a	4,800	1,147.00	5,505,600	
アルヒ	21,900	1,455.00	31,864,500	
プレミアグループ	7,500	1,798.00	13,485,000	

クレディセゾン	96,400	1,163.00	112,113,200
芙蓉総合リース	14,400	5,790.00	83,376,000
みずほリース	21,200	2,237.00	47,424,400
東京センチュリー	27,700	4,030.00	111,631,000
日本証券金融	60,700	506.00	30,714,200
アイフル	210,000	264.00	55,440,000
リコーリース	10,800	2,962.00	31,989,600
イオンフィナンシャルサービス	84,300	1,096.00	92,392,800
アコム	276,700	415.00	114,830,500
ジャックス	15,200	1,756.00	26,691,200
オリエントコーポレーション	372,400	120.00	44,688,000
日立キャピタル	32,500	2,091.00	67,957,500
アプラスフィナンシャル	66,100	66.00	4,362,600
オリックス	861,100	1,296.50	1,116,416,150
三菱UFJリース	349,400	510.00	178,194,000
九州リースサービス	6,700	451.00	3,021,700
日本取引所グループ	395,200	2,165.00	855,608,000
イー・ギャランティ	14,700	2,301.00	33,824,700
アサックス	7,100	641.00	4,551,100
NECキャピタルソリューション	5,600	1,961.00	10,981,600
いちご	181,900	294.00	53,478,600
日本駐車場開発	150,200	137.00	20,577,400
スター・マイカ・ホールディングス	8,300	1,590.00	13,197,000
ADワークスグループ	25,500	174.00	4,437,000
ヒューリック	295,800	1,034.00	305,857,200
三栄建築設計	7,100	1,189.00	8,441,900
野村不動産ホールディングス	84,600	1,878.00	158,878,800
三重交通グループホールディングス	31,700	463.00	14,677,100
サムティ	20,800	1,431.00	29,764,800
ディア・ライフ	23,800	446.00	10,614,800
日本商業開発	10,000	1,530.00	15,300,000
ハウスコム	3,800	1,251.00	4,753,800
日本管理センター	10,800	1,030.00	11,124,000
サンセイランディック	6,500	800.00	5,200,000
フージャースホールディングス	27,400	604.00	16,549,600
オープンハウス	40,800	2,678.00	109,262,400
東急不動産ホールディングス	377,800	524.00	197,967,200
飯田グループホールディングス	116,100	1,422.00	165,094,200
イーランド	5,100	636.00	3,243,600
ムゲンエステート	13,500	478.00	6,453,000
ハウズドゥ	6,800	911.00	6,194,800
シーアールイー	4,900	1,179.00	5,777,100

グッドコムアセット	4,500	1,543.00	6,943,500
ジェイ・エス・ビー	3,700	2,399.00	8,876,300
テンポイノベーション	5,600	695.00	3,892,000
パーク24	75,000	2,020.00	151,500,000
パラカ	4,700	1,698.00	7,980,600
三井不動産	680,000	1,947.50	1,324,300,000
三菱地所	965,700	1,611.00	1,555,742,700
平和不動産	25,900	2,915.00	75,498,500
東京建物	146,600	1,291.00	189,260,600
ダイビル	37,300	1,028.00	38,344,400
京阪神ビルディング	23,600	1,435.00	33,866,000
住友不動産	310,100	2,871.50	890,452,150
テオオーシー	29,700	684.00	20,314,800
東京楽天地	2,700	4,250.00	11,475,000
スターツコーポレーション	19,600	2,109.00	41,336,400
フジ住宅	19,500	484.00	9,438,000
空港施設	18,100	414.00	7,493,400
明和地所	11,900	406.00	4,831,400
ゴールドクレスト	12,000	1,546.00	18,552,000
エスリード	6,700	1,362.00	9,125,400
日神グループホールディングス	25,000	398.00	9,950,000
日本エスコン	24,900	770.00	19,173,000
タカラレーベン	62,900	359.00	22,581,100
A V A N T I A	10,400	753.00	7,831,200
イオンモール	70,300	1,520.00	106,856,000
毎日コムネット	5,800	823.00	4,773,400
ファースト住建	7,900	895.00	7,070,500
カチタス	35,000	2,440.00	85,400,000
トーセイ	20,800	981.00	20,404,800
穴吹興産	4,200	1,596.00	6,703,200
サンフロンティア不動産	21,200	895.00	18,974,000
エフ・ジェー・ネクスト	14,300	809.00	11,568,700
インテリックス	3,900	530.00	2,067,000
ランドビジネス	4,600	293.00	1,347,800
日本社宅サービス	6,000	1,013.00	6,078,000
グランディハウス	16,100	340.00	5,474,000
日本空港ビルデング	44,400	4,300.00	190,920,000
日本工営	9,000	3,110.00	27,990,000
L I F U L L	46,900	419.00	19,651,100
ジェイエイシーリクルートメント	9,100	1,312.00	11,939,200
日本M&Aセンター	100,800	3,975.00	400,680,000
メンバーズ	4,000	1,684.00	6,736,000

中広	2,100	501.00	1,052,100
UTグループ	21,100	1,859.00	39,224,900
アイティメディア	5,500	965.00	5,307,500
タケエイ	12,900	914.00	11,790,600
E・Jホールディングス	2,400	1,512.00	3,628,800
ビーネックスグループ	16,900	804.00	13,587,600
コシダカホールディングス	32,400	492.00	15,940,800
アルトナー	3,400	676.00	2,298,400
パソナグループ	14,600	1,188.00	17,344,800
CDS	3,400	1,286.00	4,372,400
リンクアンドモチベーション	29,800	408.00	12,158,400
GCA	16,400	625.00	10,250,000
エス・エム・エス	41,600	2,550.00	106,080,000
サニーサイドアップグループ	4,800	736.00	3,532,800
パーソルホールディングス	133,500	1,309.00	174,751,500
リニカル	6,600	970.00	6,402,000
クックパッド	47,000	287.00	13,489,000
エスクリ	4,500	412.00	1,854,000
アイ・ケイ・ケイ	6,700	624.00	4,180,800
学情	4,800	1,257.00	6,033,600
スタジオアリス	6,800	1,580.00	10,744,000
シミックホールディングス	6,700	1,424.00	9,540,800
エプロ	3,000	1,085.00	3,255,000
NJS	3,000	1,765.00	5,295,000
総合警備保障	53,100	5,500.00	292,050,000
カカクコム	98,600	2,592.00	255,571,200
アイロムグループ	4,700	1,842.00	8,657,400
セントケア・ホールディング	8,900	425.00	3,782,500
サイネックス	2,500	635.00	1,587,500
ルネサンス	7,500	1,054.00	7,905,000
ディップ	18,900	2,500.00	47,250,000
オプトホールディング	7,300	1,447.00	10,563,100
ツクイ	31,700	496.00	15,723,200
キャリアデザインセンター	3,200	908.00	2,905,600
ベネフィット・ワン	48,600	2,191.00	106,482,600
エムスリー	294,200	4,040.00	1,188,568,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,900	366.00	3,257,400
プラス	2,000	440.00	880,000
アウトソーシング	76,600	625.00	47,875,000
ウェルネット	13,700	657.00	9,000,900
ワールドホールディングス	4,600	1,769.00	8,137,400
ディー・エヌ・エー	65,500	1,406.00	92,093,000

博報堂D Yホールディングス	185,600	1,155.00	214,368,000
ぐるなび	23,400	610.00	14,274,000
タカミヤ	14,400	480.00	6,912,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,500	673.00	7,066,500
ファンコミュニケーションズ	37,000	450.00	16,650,000
ライク	4,500	1,717.00	7,726,500
ビジネス・ブレークスルー	5,900	369.00	2,177,100
エスプール	34,400	700.00	24,080,000
WDBホールディングス	6,100	2,503.00	15,268,300
手間いらず	900	4,670.00	4,203,000
ティア	8,000	513.00	4,104,000
C D G	1,500	1,460.00	2,190,000
バリューコマース	7,500	2,377.00	17,827,500
インフォマート	146,300	858.00	125,525,400
J Pホールディングス	42,400	277.00	11,744,800
エコナックホールディングス	25,600	91.00	2,329,600
E P Sホールディングス	18,200	1,105.00	20,111,000
レッグス	3,400	952.00	3,236,800
プレステージ・インターナショナル	50,100	906.00	45,390,600
アミューズ	7,300	2,323.00	16,957,900
ドリームインキュベータ	4,200	1,449.00	6,085,800
クイック	8,400	1,141.00	9,584,400
T A C	8,700	200.00	1,740,000
ケネディクス	124,600	537.00	66,910,200
電通グループ	137,600	2,320.00	319,232,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	674.00	3,572,200
ぴあ	3,900	3,260.00	12,714,000
イオンファンタジー	5,200	1,868.00	9,713,600
シーティーエス	15,300	681.00	10,419,300
ネクシィーズグループ	4,200	938.00	3,939,600
みらかホールディングス	37,400	2,511.00	93,911,400
アルプス技研	11,900	1,803.00	21,455,700
ダイオーズ	2,700	1,055.00	2,848,500
日本空調サービス	14,200	702.00	9,968,400
オリエンタルランド	141,900	15,195.00	2,156,170,500
ダスキン	33,200	2,825.00	93,790,000
明光ネットワークジャパン	17,000	809.00	13,753,000
ファルコホールディングス	7,400	1,596.00	11,810,400
ラウンドワン	37,400	959.00	35,866,600
リゾートトラスト	61,300	1,200.00	73,560,000
ビー・エム・エル	17,200	2,801.00	48,177,200
ワタベウェディング	2,500	385.00	962,500

りらいあコミュニケーションズ	24,200	1,238.00	29,959,600
リソー教育	61,400	275.00	16,885,000
早稲田アカデミー	5,900	960.00	5,664,000
ユー・エス・エス	149,400	1,747.00	261,001,800
東京個別指導学院	4,900	600.00	2,940,000
サイバーエージェント	82,200	5,070.00	416,754,000
楽天	621,900	999.00	621,278,100
クリーク・アンド・リバー社	7,000	997.00	6,979,000
テー・オー・ダブリュー	21,700	299.00	6,488,300
山田コンサルティンググループ	8,700	1,224.00	10,648,800
セントラルスポーツ	5,000	2,437.00	12,185,000
フルキャストホールディングス	13,400	1,532.00	20,528,800
エン・ジャパン	23,800	2,768.00	65,878,400
リソルホールディングス	1,500	3,340.00	5,010,000
テクノプロ・ホールディングス	26,700	6,380.00	170,346,000
アトラ	3,600	255.00	918,000
インターワークス	2,900	380.00	1,102,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	8,430.00	45,522,000
Keeper 技研	5,000	1,546.00	7,730,000
ファーストロジック	2,800	590.00	1,652,000
三機サービス	2,700	1,180.00	3,186,000
Gunosy	8,400	913.00	7,669,200
デザインワン・ジャパン	4,600	223.00	1,025,800
イー・ガーディアン	5,900	2,067.00	12,195,300
リブセンス	9,000	274.00	2,466,000
ジャパンマテリアル	41,100	1,671.00	68,678,100
ベクトル	16,800	754.00	12,667,200
ウチヤマホールディングス	7,000	338.00	2,366,000
チャーム・ケア・コーポレーション	11,500	965.00	11,097,500
ライクキッズ	2,500	669.00	1,672,500
キャリアリンク	4,600	505.00	2,323,000
I B J	9,300	821.00	7,635,300
アサンテ	5,400	1,485.00	8,019,000
N・フィールド	9,500	510.00	4,845,000
バリューHR	5,400	1,350.00	7,290,000
M&Aキャピタルパートナーズ	10,900	3,485.00	37,986,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,462.00	7,602,400
E R Iホールディングス	3,900	676.00	2,636,400
アビスト	2,100	2,182.00	4,582,200
シグマクシス	9,200	1,650.00	15,180,000
ウィルグループ	8,900	672.00	5,980,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,100	203.00	3,877,300

リクルートホールディングス	955,600	3,394.00	3,243,306,400
エラン	8,000	1,786.00	14,288,000
土木管理総合試験所	6,200	342.00	2,120,400
ネットマーケティング	5,300	612.00	3,243,600
日本郵政	1,093,500	764.60	836,090,100
ベルシステム24ホールディングス	22,400	1,298.00	29,075,200
鎌倉新書	10,100	1,191.00	12,029,100
S MN	3,000	880.00	2,640,000
一蔵	1,800	382.00	687,600
L I T A L I C O	4,600	2,890.00	13,294,000
グローバルキッズCOMPANY	2,600	612.00	1,591,200
エアトリ	7,000	1,050.00	7,350,000
アトラエ	4,100	3,185.00	13,058,500
ストライク	5,100	4,410.00	22,491,000
ソラスト	36,900	1,200.00	44,280,000
セラク	4,300	936.00	4,024,800
インソース	5,600	2,799.00	15,674,400
ベйкаレント・コンサルティング	8,100	6,670.00	54,027,000
Orchestra Holdings	2,900	1,112.00	3,224,800
アイモバイル	4,900	682.00	3,341,800
キャリアインデックス	5,900	316.00	1,864,400
MS - J a p a n	4,500	847.00	3,811,500
船場	2,300	932.00	2,143,600
グレイステクノロジー	6,200	4,070.00	25,234,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,100	2,977.00	41,975,700
フルテック	2,000	1,276.00	2,552,000
グリーンズ	3,700	471.00	1,742,700
ツナググループ・ホールディングス	2,500	457.00	1,142,500
GameWith	4,200	681.00	2,860,200
ソウルドアウト	2,800	2,247.00	6,291,600
MS&Consulting	2,700	590.00	1,593,000
ミダック	1,900	1,452.00	2,758,800
日総工産	9,200	674.00	6,200,800
キュービーネットホールディングス	5,600	2,076.00	11,625,600
R P Aホールディングス	10,300	802.00	8,260,600
スプリックス	3,900	933.00	3,638,700
マネジメントソリューションズ	5,900	1,013.00	5,976,700
a n d f a c t o r y	1,400	1,233.00	1,726,200
カーブスホールディングス	36,900	591.00	21,807,900
フォーラムエンジニアリング	7,100	802.00	5,694,200
アドバンテッジリスクマネジメント	6,900	796.00	5,492,400
リログループ	73,000	2,486.00	181,478,000

東祥	8,400	1,418.00	11,911,200
エイチ・アイ・エス	20,800	1,705.00	35,464,000
ラックランド	3,200	2,040.00	6,528,000
共立メンテナンス	22,100	3,040.00	67,184,000
イチネンホールディングス	15,100	1,163.00	17,561,300
建設技術研究所	9,300	1,660.00	15,438,000
スペース	8,800	1,026.00	9,028,800
長大	5,500	1,047.00	5,758,500
燦ホールディングス	5,900	1,136.00	6,702,400
スバル興業	800	7,800.00	6,240,000
東京テアトル	5,300	1,196.00	6,338,800
タナベ経営	2,700	1,249.00	3,372,300
ナガワ	4,300	7,420.00	31,906,000
よみうりランド	2,900	3,695.00	10,715,500
東京都競馬	8,800	3,730.00	32,824,000
カナモト	21,900	2,233.00	48,902,700
東京ドーム	54,200	866.00	46,937,200
西尾レントオール	12,400	2,263.00	28,061,200
トランス・コスモス	12,800	2,309.00	29,555,200
乃村工藝社	57,300	909.00	52,085,700
藤田観光	5,900	1,770.00	10,443,000
KNT-CTホールディングス	8,300	1,025.00	8,507,500
日本管財	14,400	1,809.00	26,049,600
トーカイ	12,900	2,608.00	33,643,200
白洋舎	1,600	2,774.00	4,438,400
セコム	141,600	9,121.00	1,291,533,600
セントラル警備保障	6,500	4,680.00	30,420,000
丹青社	25,400	720.00	18,288,000
メイテック	16,400	5,110.00	83,804,000
応用地質	14,500	1,283.00	18,603,500
船井総研ホールディングス	27,600	2,608.00	71,980,800
進学会ホールディングス	5,500	510.00	2,805,000
オオバ	9,800	649.00	6,360,200
いであ	3,300	1,554.00	5,128,200
学究社	4,000	1,116.00	4,464,000
ベネッセホールディングス	44,500	3,110.00	138,395,000
イオンディライト	16,500	2,885.00	47,602,500
ナック	7,500	897.00	6,727,500
ニチイ学館	19,100	1,590.00	30,369,000
ダイセキ	22,400	2,577.00	57,724,800
ステップ	5,000	1,412.00	7,060,000
合計	163,579,400		291,363,845,380



## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	38,100	-	
合計		38,100	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券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

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&amp;プラス（毎月決算型）】

## 【純資産額計算書】

（2020年 6月30日現在）

資産総額	2,731,494,977円
負債総額	1,089,830円
純資産総額（ - ）	2,730,405,147円
発行済口数	2,960,509,684口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9223円
（1万口当たり純資産額）	（9,223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

（2020年 6月30日現在）

資産総額	284,509,448,267円
負債総額	338,671,709円
純資産総額（ - ）	284,170,776,558円
発行済口数	96,440,831,562口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9466円
（1万口当たり純資産額）	（29,466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

（2020年 6月30日現在）

資産総額	324,397,326,919円
負債総額	2,548,639,265円
純資産総額（ - ）	321,848,687,654円
発行済口数	218,384,436,086口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4738円
（1万口当たり純資産額）	（14,738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。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2020年6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年間ににお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。

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2020年 8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。

2020年6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	533	12,437,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	292,295
単位型公社債投資信託	32	234,734
合計	643	12,964,574

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者の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、当事業年度より百万円単位で記載することに变更いたしました。
- (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、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

## （２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589



	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
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
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	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	0	-	0	25,592
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
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
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	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	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

## 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. 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、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。

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、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。

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。

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。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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(百万円)	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	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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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(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

## 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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29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、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.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（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(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	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(\*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。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(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	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(\*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

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) 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。

(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) 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：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

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、「(5)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(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度(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:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度(2020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:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. 其他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973



小計	4,405	3,432	973
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	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（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。

## 3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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 (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	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
ユーロ	2	-	0	0	
合計	1,346	-	7	7	

(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	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(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 (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					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(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。

当事業年度（2020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 (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	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(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	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(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 (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				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(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. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

## 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の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

## 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。

## (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 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	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

## (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 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（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	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	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 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。

## 当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(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。

## (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（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）

当事業年度（2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の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

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 8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 (2020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) (2020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	11,945	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 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27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（株式会社日本カストディ銀行）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【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. 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7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  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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11月20日から2020年5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。

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2020年5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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。