

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月19日提出
【計算期間】	第32特定期間(自 2020年5月20日至 2020年11月19日)
【ファンド名】	グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる

る特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

[決算頻度による属性区分]

(1) 年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

- (5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

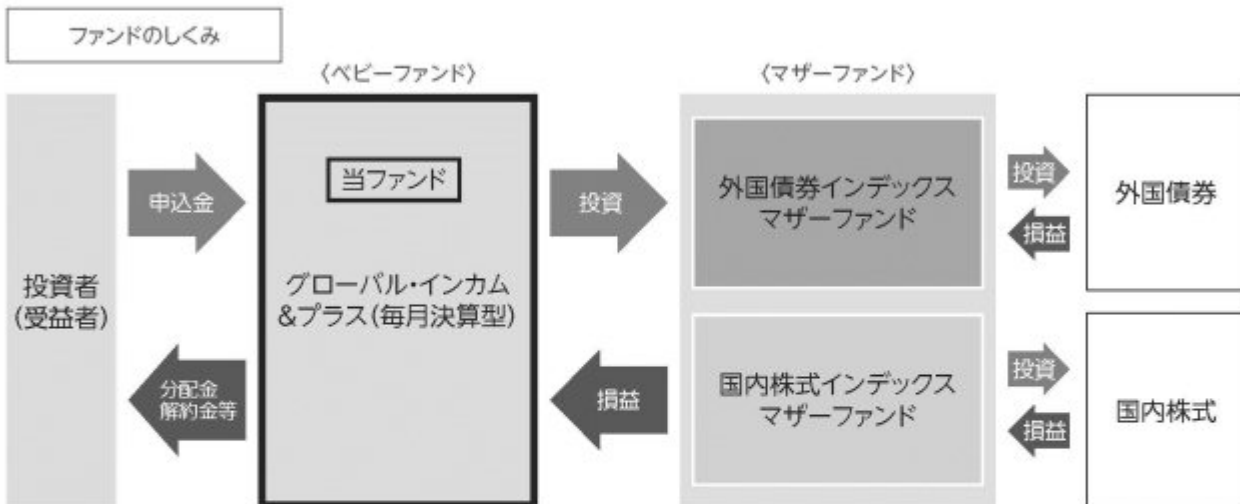
[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

1. 日本を除く世界の主要国の公社債および日本の株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

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

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

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

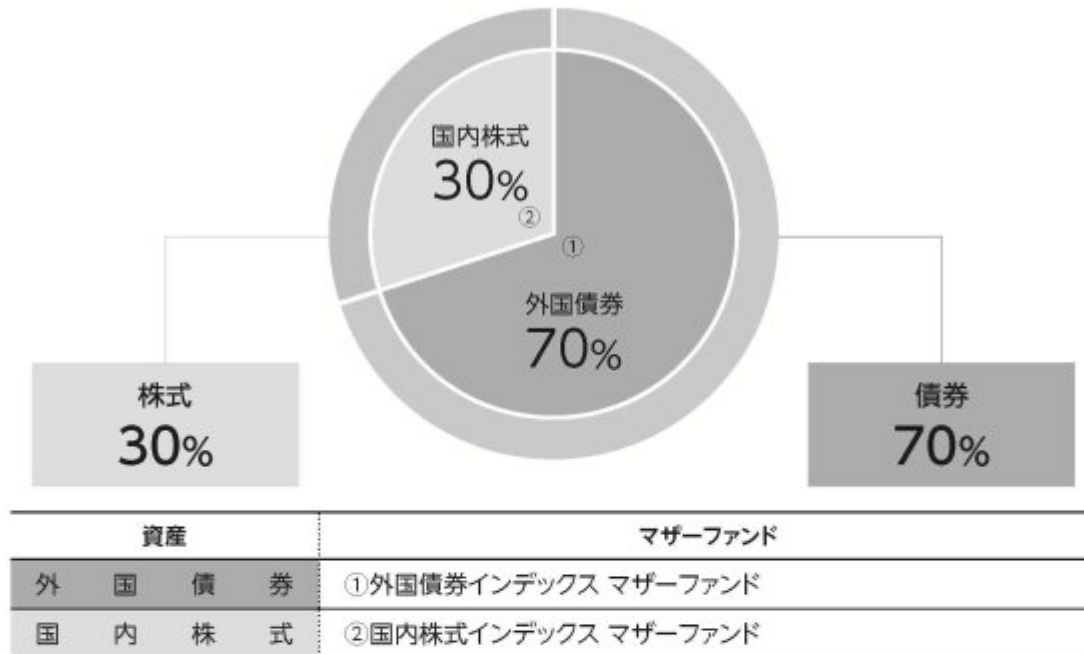
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

3. 債券70%、株式30%を基本資産配分比率として運用します。

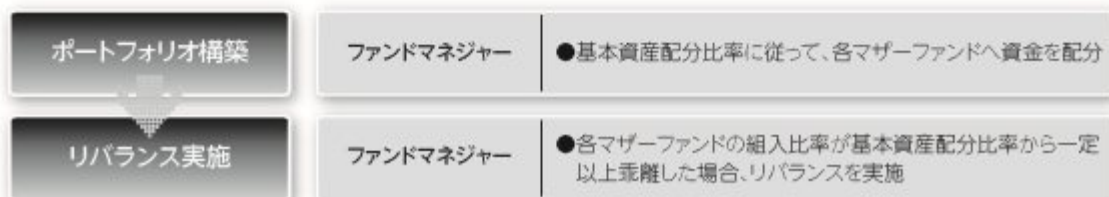
基本資産配分比率



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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

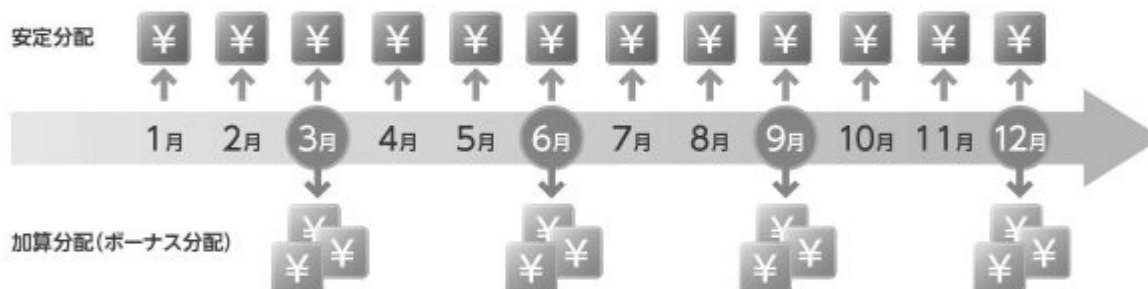
4.

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

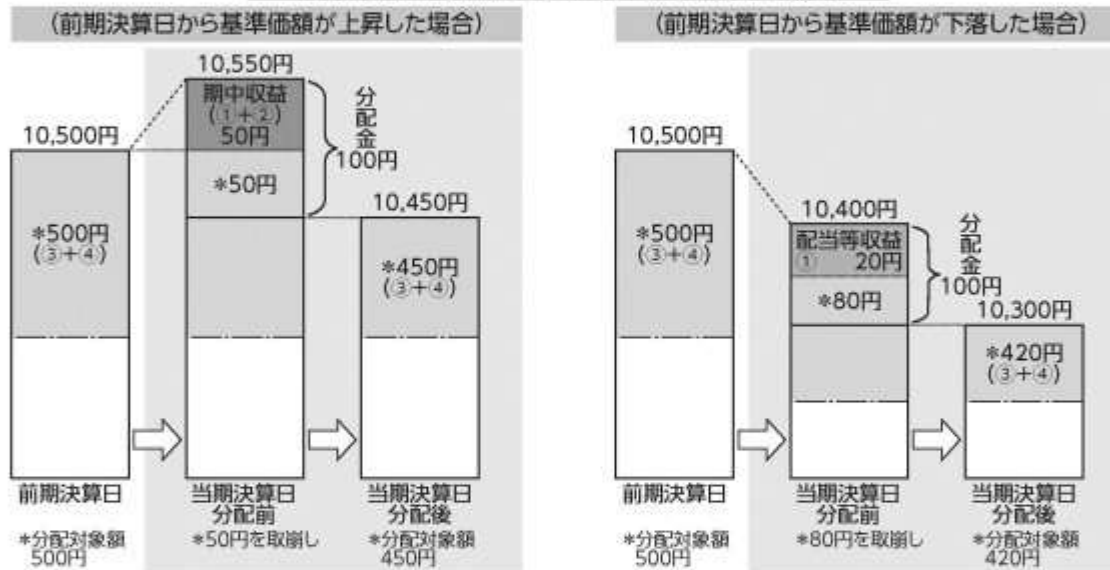
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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）



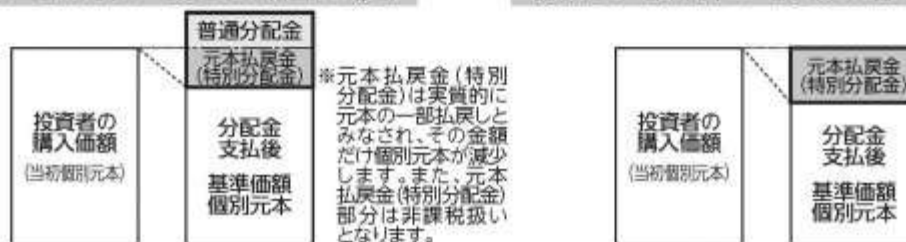
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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

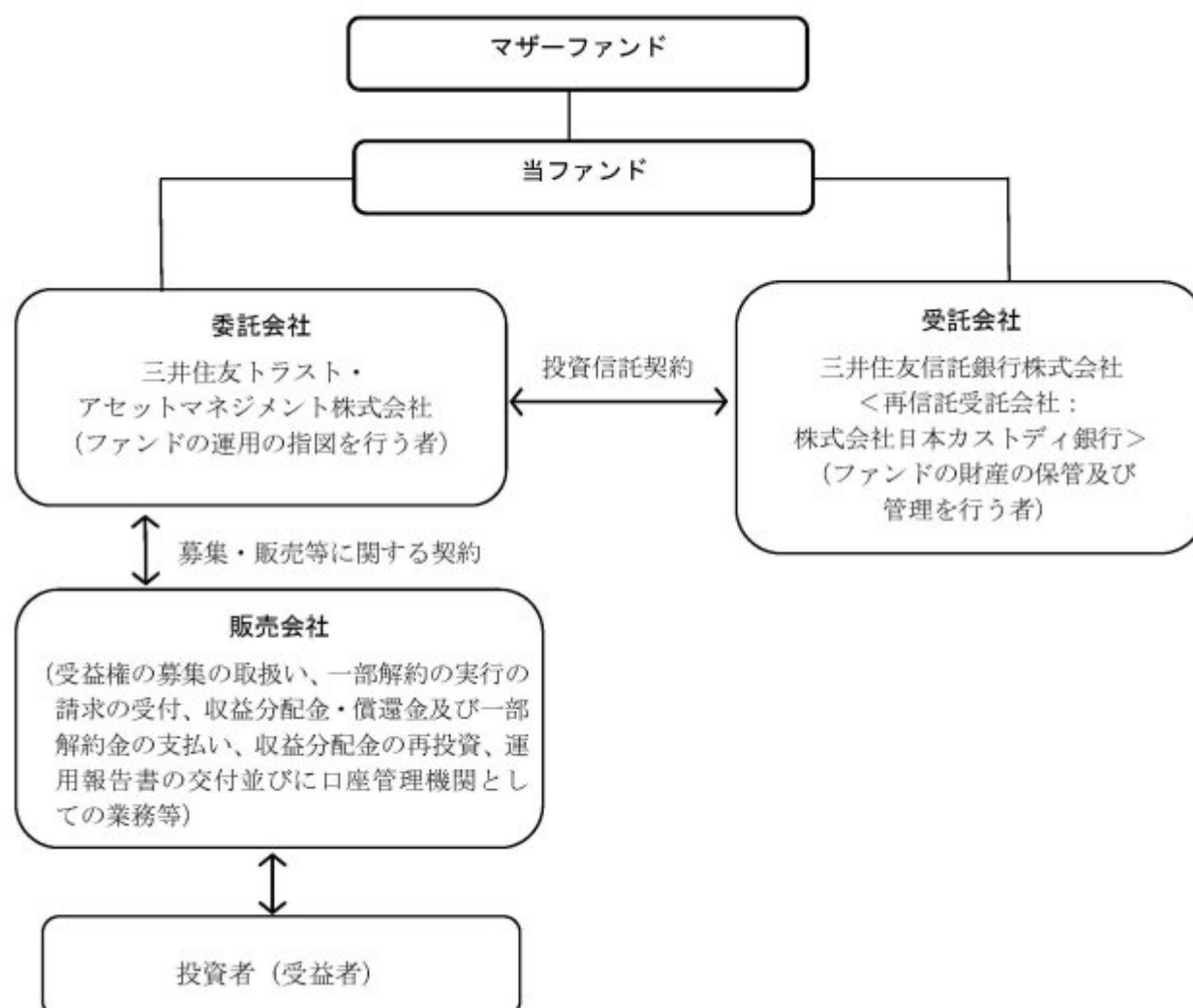
2012年4月1日

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12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可

- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

八．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

（イ）基本方針

本ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、日本の株式にも投資し分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

（ロ）運用方法

投資対象

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

投資態度

- 1)主として、外国債券インデックス マザーファンドの受益証券および国内株式インデックス マザーファンドの受益証券への投資を通して、外国債券と国内株式への分散投資を行います。
- 2)基本資産配分比率は、外国債券70%（円短期金融資産3%程度を含みます。）、国内株式30%とし、各資産ごとの許容乖離幅は±5%とします。
- 3)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 4)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- 5)ただし、資金動向、市況動向、投資信託財産の規模等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第26条、第27条および第28条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託者は、信託金を、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の

受益証券に限ります。）

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

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（二）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（八）第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取

引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

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

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

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3)【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

・分配対象額の範囲

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

・分配対象額についての分配方針

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

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

・留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。

（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第22条）

委託者は、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、当該売付に係る建玉の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該売付に係る建玉の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額の合計額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第25条）

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8

項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。(投資信託約款第26条)

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。(投資信託約款第27条)

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産(以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。)の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。(投資信託約款第28条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。(投資信託約款第29条)

- 1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第33条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第40条）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限
（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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。

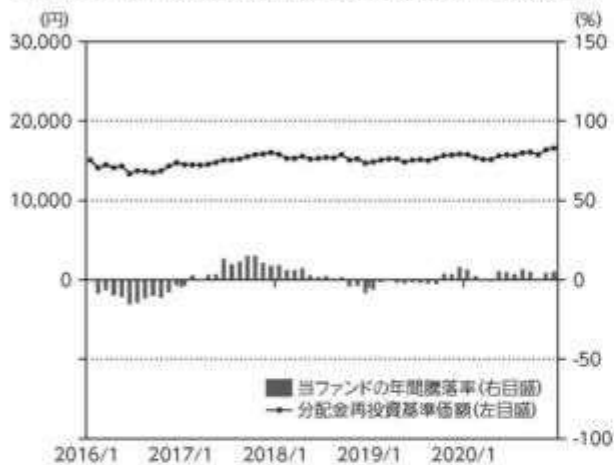
(2)リスクの管理体制

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。

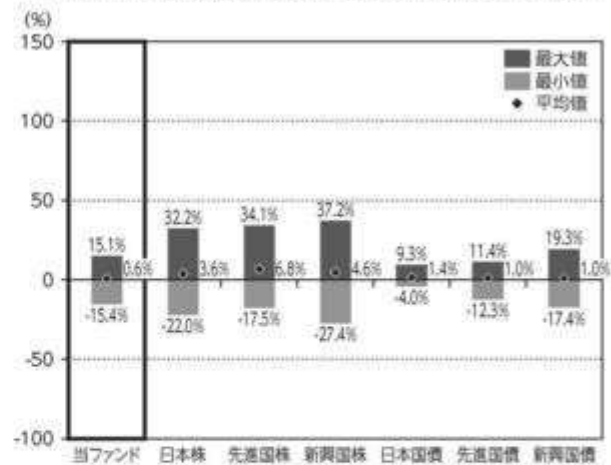
【参考情報】

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



- *2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数, 配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式を主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、他者への公表、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、責任を負いません。
先進国株 MSCIロジックサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロジックサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、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、誤差または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index - Emerging Markets (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からの複製による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.2% (税抜 2.0%) (1)の率を上限として、販売

会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

（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12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年12月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,651,964,785	97.98
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		54,624,634	2.02
合計（純資産総額）		2,706,589,419	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	612,497,689	2.9826	1,826,835,608	2.9967	1,835,471,824	67.81
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	473,658,755	1.7067	808,393,398	1.7238	816,492,961	30.17

(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	97.98
合計	97.98

(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
第32特定期間末	(2020年11月19日)	2,687,460,239	2,690,308,087	9,437	9,447
	2019年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	
	7月末日	2,685,806,003		9,157	
	8月末日	2,722,455,472		9,340	
	9月末日	2,704,861,001		9,384	
	10月末日	2,637,380,579		9,192	
	11月末日	2,706,153,813		9,540	
	12月末日	2,706,589,419		9,657	

【分配の推移】

	期 間	1万円当たりの分配金（円）
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
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	60

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	6.4

(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
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	10,530,677	138,834,428	2,847,848,624

(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	118,479,959,058	42.11

フランス	29,637,491,349	10.53
イタリア	26,550,303,689	9.44
ドイツ	21,676,980,389	7.70
イギリス	18,629,587,493	6.62
スペイン	16,927,314,538	6.02
オーストラリア	7,617,285,281	2.71
ベルギー	7,063,592,222	2.51
オランダ	5,498,120,356	1.95
カナダ	5,458,035,613	1.94
オーストリア	4,263,454,016	1.52
アイルランド	2,380,127,169	0.85
メキシコ	2,373,902,270	0.84
フィンランド	1,779,218,901	0.63
ポーランド	1,736,928,877	0.62
デンマーク	1,443,550,682	0.51
マレーシア	1,368,082,001	0.49
イスラエル	1,231,825,069	0.44
シンガポール	1,218,906,070	0.43
スウェーデン	932,579,350	0.33
ノルウェー	610,894,953	0.22
小計	276,878,139,346	98.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4,493,965,454	1.60
合計(純資産総額)	281,372,104,800	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	1,186,622,668	0.42
	買建	ドイツ	1,637,982,531	0.58

(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		2,628,937,300	0.93

(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 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,219.93	1,630,080,146	10,072.65	1,606,588,057	0.625	2030/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,302.91	1,452,711,696	10,101.76	1,424,348,409	0.625	2030/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	10,750,000	11,665.58	1,254,050,074	11,539.44	1,240,489,957	2.375	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	9,990,000	12,103.03	1,209,092,822	11,867.73	1,185,586,279	2.625	2029/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	11,343.35	1,159,291,126	11,259.66	1,150,738,071	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	11,238.24	1,140,681,380	11,151.31	1,131,858,620	2.250	2024/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	8,490,000	13,555.27	1,150,842,990	13,322.25	1,131,059,870	3.000	2022/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	4,490,000	22,935.27	1,029,794,025	24,067.05	1,080,610,726	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,920,000	12,240.49	1,091,851,903	12,014.89	1,071,728,596	2.875	2028/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2% 10/31/22	10,000,000	10,802.00	1,080,200,396	10,705.78	1,070,578,125	2.000	2022/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	10,000,000	10,651.20	1,065,120,114	10,583.27	1,058,327,927	1.500	2022/8/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 0% 03/25/25	8,090,000	13,008.69	1,052,403,738	13,065.69	1,057,014,645	0.000	2025/3/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	10,370.49	1,052,605,039	10,376.27	1,053,192,345	0.250	2023/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	10,343.58	1,034,358,300	10,312.80	1,031,280,469	0.250	2025/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,494.39	1,049,528,812	12,243.72	1,028,473,031	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	11,544.29	1,033,214,224	11,435.13	1,023,444,386	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/22	9,550,000	10,675.05	1,019,467,722	10,589.54	1,011,301,632	1.750	2022/5/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/22	9,550,000	10,648.16	1,016,900,131	10,562.25	1,008,695,432	1.750	2022/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/15/22	9,500,000	10,626.91	1,009,557,011	10,593.38	1,006,371,743	1.500	2022/9/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000	15,943.85	988,519,229	16,227.76	1,006,121,405	2.500	2030/5/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000	19,100.38	987,490,122	19,181.51	991,684,080	5.500	2029/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000	15,602.98	990,789,241	15,550.61	987,463,944	3.500	2026/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	11,609.78	992,636,964	11,470.71	980,745,784	2.250	2027/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/31/25	9,000,000	10,859.32	977,339,115	10,813.72	973,235,569	1.375	2025/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	10,300.63	978,559,898	10,205.26	969,499,868	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/30/26	8,780,000	11,100.37	974,612,925	11,033.66	968,755,878	1.625	2026/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.875% 07/31/22	9,000,000	10,728.82	965,594,353	10,638.06	957,425,536	1.875	2022/7/31	0.34
フランス	国債証券	FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000	13,677.14	939,619,790	13,916.63	956,073,158	0.750	2028/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 08/15/50	9,900,000	10,028.81	992,852,260	9,628.73	953,244,703	1.375	2050/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000	21,561.94	935,788,617	21,921.21	951,380,870	5.750	2032/10/25	0.34

(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	98.40
合計	98.40

(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	34	アメリカドル	4,282,657.77	443,255,079	4,286,921.96	443,696,423	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	22	アメリカドル	3,034,717.92	314,093,304	3,034,281.36	314,048,120	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	24	アメリカドル	4,166,129.7	431,194,424	4,143,750	428,878,125	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	16	ユーロ	1,797,323.6	228,170,231	1,796,480	228,063,136	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	23	ユーロ	3,110,078.3	394,824,440	3,109,600	394,763,720	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	45	ユーロ	7,984,074.5	1,013,578,258	7,996,500	1,015,155,675	0.36

(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	10,690,000.00	1,108,690,413	1,105,987,400	0.39
	カナダドル	買建	1,920,000.00	156,118,250	155,155,200	0.06
	ユーロ	買建	9,110,000.00	1,152,179,056	1,156,696,700	0.41
	イギリスポンド	買建	1,510,000.00	209,351,194	211,098,000	0.08

(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	371,577,359,020	99.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,027,438,937	0.81
合計（純資産総額）		374,604,797,957	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	2,941,335,000	0.79

(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	1,658,500	6,793.64	11,267,251,940	7,957.00	13,196,684,500	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	931,100	7,055.06	6,568,966,366	10,285.00	9,576,363,500	2.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,157,300	5,018.32	5,807,701,736	8,058.00	9,325,523,400	2.49
日本	株式	キーエンス	電気機器	134,700	44,543.76	6,000,044,472	58,000.00	7,812,600,000	2.09
日本	株式	任天堂	その他製品	91,100	45,116.59	4,110,121,349	65,830.00	5,997,113,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,949,800	2,439.18	4,755,913,164	2,645.50	5,158,195,900	1.38
日本	株式	日本電産	電気機器	357,800	6,944.71	2,484,817,238	12,980.00	4,644,244,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,236,700	4,150.04	5,132,354,468	3,755.00	4,643,808,500	1.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,028,700	444.54	4,458,158,298	456.10	4,574,090,070	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	1,276,100	3,332.93	4,253,151,973	3,535.00	4,511,013,500	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	250,000	12,756.66	3,189,165,000	18,040.00	4,510,000,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,017,500	3,760.03	3,825,830,525	4,321.00	4,396,617,500	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	189,400	16,328.75	3,092,665,250	22,920.00	4,341,048,000	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	294,900	10,228.01	3,016,240,149	14,270.00	4,208,223,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	436,700	6,123.43	2,674,101,881	9,320.00	4,070,044,000	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	94,300	22,290.23	2,101,968,689	38,400.00	3,621,120,000	0.97

日本	株式	ファナック	電気機器	139,800	19,393.15	2,711,162,370	25,360.00	3,545,328,000	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,170,300	2,782.40	3,256,242,720	2,877.50	3,367,538,250	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,063,400	3,118.58	3,316,297,972	3,066.00	3,260,384,400	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,013,900	3,124.53	3,167,960,967	3,188.00	3,232,313,200	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	313,200	4,577.79	1,433,763,828	9,743.00	3,051,507,600	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,024,000	2,354.68	2,411,192,320	2,964.00	3,035,136,000	0.81
日本	株式	S M C	機械	46,600	54,897.13	2,558,206,258	62,950.00	2,933,470,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	714,200	3,481.43	2,486,437,306	4,065.00	2,903,223,000	0.78
日本	株式	花王	化学	355,900	8,590.41	3,057,326,919	7,970.00	2,836,523,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	518,300	4,704.73	2,438,461,559	5,308.00	2,751,136,400	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,992,100	1,352.47	2,694,255,487	1,307.50	2,604,670,750	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	151,100	15,524.80	2,345,797,280	17,040.00	2,574,744,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	464,900	5,244.82	2,438,316,818	5,503.00	2,558,344,700	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	959,900	2,516.44	2,415,530,756	2,541.00	2,439,105,900	0.65

(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	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.50
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.52
		医薬品	5.88
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.50
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.60
		機械	5.72
		電気機器	17.17
		輸送用機器	7.34
		精密機器	2.78
		その他製品	2.75
電気・ガス業	1.29		

	陸運業	3.46
	海運業	0.19
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	9.08
	卸売業	4.53
	小売業	4.76
	銀行業	4.41
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.89
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.93
	サービス業	5.74
	小計	99.19
合計		99.19

(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	163	円	2,895,756,650	2,941,335,000	0.79

(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12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年間を表示しております。

基準価額	9,657円
純資産総額	27.07億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年8月	10円
2020年9月	10円
2020年10月	10円
2020年11月	10円
2020年12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	5,026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	67.8%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.4%
		T 0.625% 05/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/05/15	0.3%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.3%
		T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.3%
		T 2% 11/15/26	アメリカ	国債	-	2.000%	2026/11/15	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	30.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.8%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		任天堂	日本	株式	その他製品	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

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

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

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

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎年5月及び11月の決算時並びに償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32特定期間(2020年5月20日から2020年11月19日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第31特定期間 （2020年 5月19日現在）	第32特定期間 （2020年11月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,062,113	50,900,785
親投資信託受益証券	2,602,930,713	2,636,448,846
未収入金	4,800,000	6,260,000
流動資産合計	2,662,792,826	2,693,609,631
資産合計	2,662,792,826	2,693,609,631
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,976,152	2,847,848
未払解約金	-	289,148
未払受託者報酬	161,538	174,988
未払委託者報酬	2,607,678	2,824,831
未払利息	114	88
その他未払費用	11,529	12,489
流動負債合計	5,757,011	6,149,392
負債合計	5,757,011	6,149,392
純資産の部		
元本等		
元本	2,976,152,375	2,847,848,624
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	319,116,560	160,388,385
（分配準備積立金）	97,956,002	96,353,049
元本等合計	2,657,035,815	2,687,460,239
純資産合計	2,657,035,815	2,687,460,239
負債純資産合計	2,662,792,826	2,693,609,631

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日	第32特定期間 自 2020年 5月20日 至 2020年11月19日
営業収益		
受取利息	110	116
有価証券売買等損益	50,692,648	185,748,133
営業収益合計	50,692,538	185,748,249
営業費用		
支払利息	10,560	13,746
受託者報酬	1,066,445	1,053,789
委託者報酬	17,215,368	17,011,053
その他費用	76,115	75,298
営業費用合計	18,368,488	18,153,886
営業利益又は営業損失（ ）	69,061,026	167,594,363
経常利益又は経常損失（ ）	69,061,026	167,594,363
当期純利益又は当期純損失（ ）	69,061,026	167,594,363
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（ ）	405,453	880,216
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	246,958,701	319,116,560
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,452,312	10,179,815
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,452,312	10,179,815
剰余金減少額又は欠損金増加額	692,693	729,174
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	692,693	729,174
分配金	18,261,905	17,436,613
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	319,116,560	160,388,385

(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31特定期間 (2020年 5月19日現在)	第32特定期間 (2020年11月19日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,976,152,375口	2,847,848,624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 319,116,560円	元本の欠損 160,388,385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 0.8928円 (1万口当たり純資産額) (8,928円)	1口当たり純資産額 0.9437円 (1万口当たり純資産額) (9,437円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日	第32特定期間 自 2020年 5月20日 至 2020年11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	分配金の計算過程 第185期 自 2020年 5月20日 至 2020年 6月19日																																																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>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	<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>3,070,891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>8,998,628円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>97,397,464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>109,466,983円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,961,155,750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>369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	3,070,891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	8,998,628円	分配準備積立金額	D	97,397,464円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,466,983円	当ファンドの期末残存口数	F	2,961,155,750口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	369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																																																					
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	3,070,891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	8,998,628円																																																					
分配準備積立金額	D	97,397,464円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,466,983円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,961,155,750口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	369円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					

第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日			第32特定期間 自 2020年 5月20日 至 2020年11月19日		
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,130,683円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,961,155円
第180期 自 2019年12月20日 至 2020年 1月20日			第186期 自 2020年 6月20日 至 2020年 7月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,279,823円	費用控除後の配当等収益額	A	3,942,767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	9,201,154円	収益調整金額	C	8,944,324円
分配準備積立金額	D	96,804,356円	分配準備積立金額	D	96,648,902円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	110,285,333円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	109,535,993円
当ファンドの期末残存口数	F	3,110,453,157口	当ファンドの期末残存口数	F	2,935,777,576口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	354円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	373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	$I=F \times H / 10,000$	3,110,453円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,935,777円
第181期 自 2020年 1月21日 至 2020年 2月19日			第187期 自 2020年 7月21日 至 2020年 8月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	413,175円	費用控除後の配当等収益額	A	2,592,102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	9,050,469円	収益調整金額	C	8,931,636円
分配準備積立金額	D	96,103,494円	分配準備積立金額	D	97,153,682円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,567,138円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	108,677,420円
当ファンドの期末残存口数	F	3,051,792,385口	当ファンドの期末残存口数	F	2,921,589,701口
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
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	3,051,792円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,921,589円
第182期 自 2020年 2月20日 至 2020年 3月19日			第188期 自 2020年 8月20日 至 2020年 9月23日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	640,286円	費用控除後の配当等収益額	A	208,249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	8,970,054円	収益調整金額	C	9,033,848円
分配準備積立金額	D	91,940,313円	分配準備積立金額	D	95,818,608円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,550,653円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,060,705円
当ファンドの期末残存口数	F	3,003,990,588口	当ファンドの期末残存口数	F	2,896,592,890口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	338円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	362円

第31特定期間 自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日			第32特定期間 自 2020年 5月20日 至 2020年11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	$I=F \times H / 10,000$	3,003,990円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,896,592円
第183期 自 2020年 3月20日 至 2020年 4月20日			第189期 自 2020年 9月24日 至 2020年10月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	12,931,965円	費用控除後の配当等収益額	A	7,932,194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	8,953,036円	収益調整金額	C	8,985,970円
分配準備積立金額	D	89,098,888円	分配準備積立金額	D	92,369,217円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	110,983,889円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	109,287,381円
当ファンドの期末残存口数	F	2,988,835,925口	当ファンドの期末残存口数	F	2,873,652,678口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	371円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	380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	$I=F \times H / 10,000$	2,988,835円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,873,652円
第184期 自 2020年 4月21日 至 2020年 5月19日			第190期 自 2020年10月20日 至 2020年11月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,373,643円	費用控除後の配当等収益額	A	2,676,597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	8,978,576円	収益調整金額	C	8,934,015円
分配準備積立金額	D	98,558,511円	分配準備積立金額	D	96,524,300円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	109,910,730円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	108,134,912円
当ファンドの期末残存口数	F	2,976,152,375口	当ファンドの期末残存口数	F	2,847,848,624口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	369円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	379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	$I=F \times H / 10,000$	2,976,152円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,847,848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32特定期間 自 2020年 5月20日 至 2020年11月19日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第32特定期間 (2020年11月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第31特定期間	第32特定期間
	自 2019年11月20日 至 2020年 5月19日	自 2020年 5月20日 至 2020年11月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,160,806,167円	2,976,152,375円
期中追加設定元本額	7,421,919円	10,530,677円
期中一部解約元本額	192,075,711円	138,834,428円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第31特定期間 (2020年 5月19日現在)	第32特定期間 (2020年11月19日現在)
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	19,991,810	22,476,033
合計	19,991,810	22,476,033

（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	513,311,042	845,217,961	
	外国債券インデックス マザーファンド	608,186,502	1,791,230,885	
合計		1,121,497,544	2,636,448,846	

(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11月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	441,758,870
コール・ローン	2,811,475,631
国債証券	271,193,648,901
派生商品評価勘定	4,439,802
未収利息	1,474,619,407
前払金	279,571
前払費用	61,008,326
差入委託証拠金	501,869,013
流動資産合計	276,489,099,521
資産合計	276,489,099,521
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,312,391
未払金	5,641,698
未払解約金	367,506,104
未払利息	4,893
流動負債合計	405,465,086
負債合計	405,465,086
純資産の部	
元本等	
元本	93,738,983,915
剰余金	
剰余金又は欠損金()	182,344,650,520
元本等合計	276,083,634,435

	2020年11月19日現在
項目	金額（円）
純資産合計	276,083,634,435
負債純資産合計	276,489,099,521

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年11月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		93,738,983,915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)	2.9452円 (29,452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11月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年11月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2020年11月19日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月20日
期首元本額	94,886,392,267円
期中追加設定元本額	7,446,399,679円
期中一部解約元本額	8,593,808,031円
期末元本額	93,738,983,915円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,532,427,634円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	608,186,502円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	420,469,762円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,049,040,114円

区分	2020年11月19日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,005,429円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	6,723,090,051円
世界経済インデックスファンド	7,389,494,424円
D C マイセレクション 2 5	1,792,418,589円
D C マイセレクション 5 0	1,442,634,272円
D C マイセレクション 7 5	888,075,363円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,085,316,275円
D C マイセレクション S 2 5	766,379,883円
D C マイセレクション S 5 0	641,484,499円
D C マイセレクション S 7 5	282,226,671円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	39,930,040円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	71,481,181円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	35,039,201円
D C 世界経済インデックスファンド	9,389,865,907円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	680,208,378円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	8,511,079円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,415,114円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,584,618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）	36,717,300円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	74,999,016円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	110,727,967円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	116,531,300円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	161,876,367円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,698,549,508円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	501,420,198円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,886,505,072円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	751,744,727円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	61,770,357円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	523,602,173円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	196,536,339円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	245,461,612円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	834,574,467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）	932,539,055円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	763,704,356円
外国債券ファンド・シリーズ 1	591,447,680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	1,090,641,754円
分散投資コア戦略ファンド S	2,150,936,306円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	337,332,294円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,155,067,296円
コア投資戦略ファンド（切替型）	824,670,942円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	197,974,381円

区分	2020年11月19日現在
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	96,608,958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)	1,130,146,949円
SMT インデックスバランス・オープン	185,657,997円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	20,910,583,680円
SMT 世界経済インデックス・オープン	132,159,710円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	122,399,622円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	217,517,692円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,344,646円
グローバル経済コア	768,532,048円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,420,390円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	322,641円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	232,161,402円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	21,200,031円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	349,403円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	429,692円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	269,984円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	419,748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)	601,490,967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)	10,339,713,733円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	340,455,781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)	367,596,767円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	137,147,138円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	294,880,069円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年11月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	835,292,483
合計	835,292,483

(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11月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	債券先物取引		うち1年超	

	買建	2,578,655,785	-	2,578,376,214	279,571
	合計	2,578,655,785	-	2,578,376,214	279,571

(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。

2.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。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2020年11月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,252,399,018	-	2,224,806,000	27,593,018
	アメリカドル	962,722,658	-	949,006,200	13,716,458
	カナダドル	127,374,748	-	125,309,800	2,064,948
	ユーロ	981,173,330	-	971,779,000	9,394,330
	イギリスポンド	181,128,282	-	178,711,000	2,417,282
	合計	2,252,399,018	-	2,224,806,000	27,593,018

(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 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,486,523.47	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,164,273.43	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,009,375.04	

T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	994,765.63
T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,943,750.00
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	8,009,375.04
T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,355,273.48
T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,825,846.87
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,269,073.47
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,925,070.32
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,479,765.62
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	7,053,960.97
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,825,711.00
T 0.625% 08/15/30	10,950,000.00	10,713,035.21
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,716,190.62
T 1.125% 08/15/40	4,800,000.00	4,581,375.01
T 1.25% 05/15/50	6,850,000.00	6,273,101.56
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,677,435.53
T 1.25% 10/31/21	10,000,000.00	10,107,421.90
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,393,046.92
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,152,929.70
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	9,353,179.73
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,580,761.72
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,132,968.76
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,113,574.20
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,573,388.65
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,865,782.06
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	8,032,476.58
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,123,437.52
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,230,859.40
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,878,734.39
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,728,593.75
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,893,457.01
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,602,136.73
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,622,226.58
T 1.625% 05/15/26	8,270,000.00	8,793,335.93
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,035,976.56
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,563,232.42
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	7,236,738.31
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,128,906.25
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,603,515.62
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,773,929.72
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,311,668.79
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,352,757.85
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,809,236.34

T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,551,220.70
T 1.75% 03/31/22	9,550,000.00	9,757,973.59
T 1.75% 04/30/22	5,500,000.00	5,626,542.95
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,889,953.14
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,832,266.80
T 1.75% 05/31/22	9,550,000.00	9,781,848.59
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,178,007.83
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,527,312.51
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,536,937.51
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,300,677.72
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,251,484.39
T 1.75% 11/30/21	6,050,000.00	6,151,384.75
T 1.875% 01/31/22	7,000,000.00	7,145,332.04
T 1.875% 02/28/22	2,500,000.00	2,555,322.27
T 1.875% 03/31/22	5,500,000.00	5,629,013.66
T 1.875% 04/30/22	4,450,000.00	4,560,293.96
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,259,453.17
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,595,671.47
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,120,625.00
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,357,890.64
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,743,956.25
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,695,762.68
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,497,558.61
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,413,171.87
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,863,367.20
T 2.125% 05/15/22	3,790,000.00	3,900,591.02
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,589,281.25
T 2.125% 05/31/26	8,600,000.00	9,381,726.58
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,188,671.86
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,125,687.48
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,562,187.52
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,833,995.31
T 2.125% 12/31/21	3,500,000.00	3,577,724.60
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,537,579.70
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,256,562.52
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,885,904.27
T 2.25% 04/15/22	4,000,000.00	4,117,578.12
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,477,695.33
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,481,148.43
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	8,397,168.75
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	6,355,937.50
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,781,359.37
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,931,470.72

T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,802,015.63	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,498,671.87	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,781,953.12	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	9,065,109.39	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,240,039.05	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,160,275.01	
T 2.375% 04/30/26	7,600,000.00	8,388,203.14	
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,984,570.31	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	9,074,453.94	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,389,453.15	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,900,976.60	
T 2.5% 01/15/22	6,500,000.00	6,677,607.43	
T 2.5% 01/31/24	6,300,000.00	6,754,042.95	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,454,296.90	
T 2.5% 02/15/22	7,800,000.00	8,027,906.25	
T 2.5% 02/15/45	4,410,000.00	5,302,680.49	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,820,937.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,270,535.17	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,513,484.37	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	6,089,195.31	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,835,085.93	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,221,838.68	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,494,743.75	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,477,492.18	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,967,636.75	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,209,503.89	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,759,628.91	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,471,339.82	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,243,281.25	
T 2.75% 02/15/28	4,000,000.00	4,593,125.00	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,824,437.50	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,129,623.44	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	6,100,703.12	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,068,398.44	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,624,289.06	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	6,265,617.18	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	8,027,636.70	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,674,902.36	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,580,673.45	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,521,254.70	
T 2.75% 11/15/47	6,050,000.00	7,666,484.37	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,446,406.24	

T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,425,570.34
T 2.875% 05/15/43	5,150,000.00	6,565,847.68
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	7,258,406.25
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,252,734.37
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	6,097,071.10
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	10,382,043.75
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,517,437.50
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,110,332.05
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,694,824.22
T 2.875% 11/15/21	8,350,000.00	8,577,178.70
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,341,442.97
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,557,910.15
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,202,343.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	9,054,843.75
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,486,328.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,602,339.87
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,511,444.54
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,842,031.25
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,092,812.50
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,415,900.81
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,354,101.60
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,444,671.87
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	11,112,653.12
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,073,671.88
T 2% 12/31/21	2,200,000.00	2,245,718.75
T 3.125% 02/15/42	2,350,000.00	3,106,039.06
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,631,210.95
T 3.125% 05/15/48	4,700,000.00	6,368,500.00
T 3.125% 08/15/44	2,490,000.00	3,311,700.00
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,968,437.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,307,128.91
T 3.375% 05/15/44	4,510,000.00	6,220,981.25
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,516,890.62
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	1,055,441.41
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,428,062.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,848,906.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,865,156.26
T 3.75% 11/15/43	5,500,000.00	7,984,023.46
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	2,094,910.16
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,695,781.26
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,895,207.05
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	9,320,390.66
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	2,100,557.82

T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,579,531.25	
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,546,121.87	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	7,236,578.12	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,728,937.50	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,637,890.65	
T 3% 11/15/44	4,050,000.00	5,288,097.67	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,348,875.00	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,562,085.93	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,500,781.25	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,912,046.87	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	3,014,425.79	
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,922,878.12	
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,351,212.50	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	838,664.06	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,625,703.12	
T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,744,037.50	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,207,968.75	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,739,289.06	
T 5.25% 02/15/29	1,250,000.00	1,704,492.18	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,760,992.19	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,821,253.91	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,636,968.75	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,190,410.15	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,998,847.66	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,575,492.18	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,923,087.88	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	1,832,746.09	
アメリカドル 小計		1,033,570,000.00	1,132,072,387.67 (117,588,358,907)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	1,210,000.00	1,208,669.00
	CAN 0.25% 03/01/26	1,200,000.00	1,184,496.00
	CAN 0.25% 04/01/24	700,000.00	697,592.00
	CAN 0.5% 03/01/22	3,600,000.00	3,612,888.00
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	4,001,211.90
	CAN 0.5% 12/01/30	1,360,000.00	1,325,918.40
	CAN 1.25% 06/01/30	5,190,000.00	5,450,589.90
	CAN 1.25% 11/01/21	1,880,000.00	1,898,612.00
	CAN 1.5% 02/01/22	1,210,000.00	1,228,561.40
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,103,234.20
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,438,213.60
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	625,944.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,741,487.20

	CAN 1% 06/01/27	500,000.00	515,965.00
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,534,175.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,444,601.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,950,804.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,430,226.00
	CAN 2.5% 06/01/24	3,300,000.00	3,552,153.00
	CAN 2.75% 06/01/22	3,670,000.00	3,811,698.70
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,560,560.00
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	849,380.00
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,449,069.60
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,512,613.10
	CAN 2% 12/01/51	2,770,000.00	3,304,637.70
	CAN 3.5% 12/01/45	1,700,000.00	2,559,350.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,420,000.00	2,185,223.80
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,665,787.50
	CAN 5.75% 06/01/33	1,350,000.00	2,138,508.00
	CAN 5% 06/01/37	1,130,000.00	1,832,453.20
	CAN 8.0% 06/01/27	1,130,000.00	1,672,727.70
	カナダドル 小計	61,050,000.00	68,487,350.90 (5,433,101,546)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	11,448,877.50
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	35,120,109.40
	MBONO 5.75% 03/05/26	25,630,000.00	26,194,116.30
	MBONO 6.5% 06/09/22	26,230,000.00	27,027,916.60
	MBONO 6.75% 03/09/23	31,500,000.00	33,005,070.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	30,180,000.00	31,071,215.40
	MBONO 7.5% 06/03/27	34,220,000.00	37,957,508.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	16,780,000.00	19,052,683.20
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	26,411,125.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,897,045.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,670,000.00	44,652,134.50
	MBONO 8.5% 11/18/38	22,200,000.00	26,093,214.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	38,180,006.10
	MBONO 8% 11/07/47	21,480,000.00	23,959,221.60
	MBONO 8% 12/07/23	30,620,000.00	33,457,249.20
	メキシコペソ 小計	387,480,000.00	429,527,493.00 (2,194,885,489)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,433,348.80
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,005,930.80
	BGB 0.4% 06/22/40	690,000.00	728,426.10
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,696,285.80
	BGB 0.8% 06/22/25	2,180,000.00	2,328,458.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,843,840.70

BGB 0.8% 06/22/28	1,560,000.00	1,717,653.60
BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,637,583.20
BGB 0% 10/22/27	1,520,000.00	1,576,422.40
BGB 1.25% 04/22/33	850,000.00	1,010,157.00
BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	895,888.80
BGB 1.6% 06/22/47	1,320,000.00	1,765,183.20
BGB 1.7% 06/22/50	1,000,000.00	1,388,400.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,397,991.00
BGB 1% 06/22/26	2,380,000.00	2,597,603.40
BGB 1% 06/22/31	1,490,000.00	1,699,315.20
BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,485,603.30
BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,993,393.50
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,259,658.40
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,396,243.60
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,211,864.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,479,636.20
BGB 4.25% 03/28/41	2,190,000.00	4,003,232.40
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,295,426.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,457,946.00
BGB 4% 03/28/22	1,220,000.00	1,298,080.00
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,615,593.60
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	4,036,893.60
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,705,240.40
BKO 0% 03/11/22	6,580,000.00	6,641,457.20
BKO 0% 06/10/22	600,000.00	606,774.00
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,049,183.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	591,292.60
BTPS 0.35% 11/01/21	2,580,000.00	2,601,594.60
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,230,694.90
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,339,707.50
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,252,822.00
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,060,600.00
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,659,283.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,308,986.60
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,485,624.40
BTPS 1.2% 04/01/22	2,010,000.00	2,056,029.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,079,051.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,000,000.00	1,073,980.00
BTPS 1.35% 04/15/22	2,900,000.00	2,973,776.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,250,000.00	1,332,300.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,457,642.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,058,774.40
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,553,216.00

BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,580,772.60	
BTPS 1.6% 06/01/26	3,180,000.00	3,445,212.00	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,313,588.60	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,794,812.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	620,000.00	647,156.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,423,904.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,340,000.00	1,461,323.60	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,144,200.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,934,306.00	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,211,926.40	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,065,786.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,557,056.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,572,075.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,569,628.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,390,000.00	1,639,352.10	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,790,000.00	2,134,360.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,470,000.00	1,807,056.30	
BTPS 2.45% 10/01/23	910,000.00	982,235.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,316,626.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,263,378.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,210,691.60	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,741,634.40	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,246,680.80	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,645,853.00	
BTPS 2% 02/01/28	1,650,000.00	1,846,399.50	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,300,128.60	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,874,371.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,723,818.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,930,622.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	3,077,137.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	5,024,170.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,468,823.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,366,705.60	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,083,038.40	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,178,505.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,565,721.60	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	4,008,597.60	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,634,585.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,840,387.20	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,200,000.00	3,707,836.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	5,083,316.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,418,204.00	

BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	5,041,066.80
BTPS 5.5% 09/01/22	1,250,000.00	1,382,362.50
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,848,785.50
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,848,813.20
BTPS 5% 03/01/22	650,000.00	696,020.00
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,462,418.40
BTPS 5% 08/01/34	3,420,000.00	5,217,210.00
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,287,488.80
BTPS 6.5% 11/01/27	5,240,000.00	7,463,594.00
BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	6,060,783.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,988,490.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,020,592.00
DBR 0.25% 02/15/27	4,140,000.00	4,398,998.40
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,186,612.50
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,339,619.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,164,370.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,200,670.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,601,993.00
DBR 0.5% 08/15/27	4,690,000.00	5,083,350.30
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,770,955.30
DBR 0% 05/15/35	2,010,000.00	2,120,288.70
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,538,877.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,696,490.00
DBR 0% 08/15/30	3,620,000.00	3,822,394.20
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	709,081.10
DBR 0% 08/15/50	2,180,000.00	2,282,111.20
DBR 1.25% 08/15/48	3,270,000.00	4,600,693.80
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,111,848.00
DBR 1.5% 05/15/23	2,180,000.00	2,304,369.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,474,665.60
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,913,680.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,787,082.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,175,083.90
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,134,780.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,951,036.80
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,931,270.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,800,000.00	6,536,988.00
DBR 2% 01/04/22	3,300,000.00	3,402,564.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,080,220.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,637,937.00
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	5,083,227.70
DBR 4.25% 07/04/39	2,550,000.00	4,819,270.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,640,125.00

DBR 4.75% 07/04/34	3,720,000.00	6,464,095.20
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,766,577.80
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,646,978.40
DBR 5.625% 01/04/28	4,360,000.00	6,385,743.20
DBR 6.25% 01/04/24	4,450,000.00	5,441,994.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,061,900.00
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,461,944.40
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,919,194.80
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,887,779.30
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,408,277.70
FRTR 0.5% 05/25/29	4,000,000.00	4,328,000.00
FRTR 0.5% 05/25/40	1,310,000.00	1,416,031.40
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,531,581.00
FRTR 0.75% 05/25/52	2,280,000.00	2,556,518.40
FRTR 0.75% 11/25/28	4,500,000.00	4,951,800.00
FRTR 0% 02/25/22	2,000,000.00	2,017,380.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,082,472.00
FRTR 0% 02/25/26	3,110,000.00	3,210,546.30
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,378,131.40
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,091,134.00
FRTR 0% 03/25/25	8,090,000.00	8,325,499.90
FRTR 0% 05/25/22	2,800,000.00	2,829,596.00
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,455,356.40
FRTR 0% 11/25/30	2,560,000.00	2,644,812.80
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	6,093,470.60
FRTR 1.25% 05/25/36	4,430,000.00	5,343,687.50
FRTR 1.5% 05/25/31	5,420,000.00	6,471,751.00
FRTR 1.5% 05/25/50	3,690,000.00	4,943,271.60
FRTR 1.75% 05/25/23	4,590,000.00	4,876,875.00
FRTR 1.75% 05/25/66	1,530,000.00	2,363,528.70
FRTR 1.75% 06/25/39	3,460,000.00	4,582,216.40
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,572,048.00
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,132,437.50
FRTR 1% 11/25/25	5,480,000.00	5,938,840.40
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,530,377.00
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	6,071,485.00
FRTR 2.5% 05/25/30	6,200,000.00	7,935,256.00
FRTR 2.75% 10/25/27	4,700,000.00	5,798,766.00
FRTR 2% 05/25/48	3,460,000.00	5,073,882.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,810,072.50
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,801,292.50
FRTR 3% 04/25/22	8,490,000.00	8,940,139.80

FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,760,199.00
FRTR 4.5% 04/25/41	4,490,000.00	8,539,710.60
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	6,324,337.60
FRTR 4% 04/25/55	2,170,000.00	4,733,898.40
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	5,050,471.40
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,817,732.10
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,828,620.80
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,520,872.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,535,227.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,226,070.00
IRISH 0.2% 05/15/27	760,000.00	793,607.20
IRISH 0.2% 10/18/30	830,000.00	867,623.90
IRISH 0.4% 05/15/35	480,000.00	510,436.80
IRISH 0.8% 03/15/22	820,000.00	835,694.80
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,177,000.00
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	536,540.20
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,350,120.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	791,082.40
IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	1,003,224.40
IRISH 1.5% 05/15/50	650,000.00	861,594.50
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,044,557.00
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,542,233.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,270,000.00	1,600,123.80
IRISH 2% 02/18/45	1,090,000.00	1,550,634.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,100,959.70
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,117,928.60
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,906,465.60
NETHER 0.25% 07/15/25	1,870,000.00	1,954,000.40
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,829,700.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,100,000.00	1,254,198.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,475,927.20
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,306,841.90
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,789,759.80
NETHER 0% 01/15/22	1,490,000.00	1,502,232.90
NETHER 0% 01/15/24	1,850,000.00	1,892,661.00
NETHER 0% 01/15/27	1,160,000.00	1,205,564.80
NETHER 0% 01/15/52	710,000.00	727,373.70
NETHER 0% 07/15/30	1,610,000.00	1,685,525.10
NETHER 1.75% 07/15/23	3,060,000.00	3,263,979.60
NETHER 2.25% 07/15/22	660,000.00	692,742.60
NETHER 2.5% 01/15/33	1,640,000.00	2,232,532.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,100,000.00	3,741,087.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,190,492.50

NETHER 3.75% 01/15/23	2,430,000.00	2,666,876.40	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,840,519.80	
NETHER 4% 01/15/37	2,110,000.00	3,613,712.60	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,502,860.20	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	235,912.00	
OBL 0% 04/05/24	2,900,000.00	2,976,328.00	
OBL 0% 04/08/22	2,650,000.00	2,676,526.50	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,875,475.00	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,261,181.00	
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,218,572.80	
OBL 0% 10/10/25	2,240,000.00	2,322,812.80	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,544,503.50	
OBL 0% 10/18/24	2,350,000.00	2,420,664.50	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,170,000.00	1,268,689.50	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	954,507.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,776,443.40	
RAGB 0.75% 03/20/51	460,000.00	549,966.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,140,000.00	2,317,277.60	
RAGB 0% 02/20/30	1,130,000.00	1,174,409.00	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,528,575.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,240,000.00	1,271,644.80	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	324,256.00	
RAGB 0% 10/20/40	290,000.00	291,861.80	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,564,377.10	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,286,841.00	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	556,475.70	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,082,654.10	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,426,970.30	
RAGB 2.1% 09/20/17	760,000.00	1,698,136.40	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,030,000.00	1,404,961.20	
RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	1,685,241.60	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,556,942.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,160,000.00	1,231,804.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,147,913.90	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,124,739.80	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,702,842.80	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,730,316.60	
RFGB 0.125% 04/15/36	520,000.00	544,195.60	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	425,932.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	659,190.20	
RFGB 0.5% 09/15/27	1,310,000.00	1,407,765.30	
RFGB 0.5% 09/15/28	670,000.00	724,584.90	

RFGB 0.5% 09/15/29	650,000.00	706,504.50
RFGB 0.75% 04/15/31	500,000.00	560,080.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	742,453.80
RFGB 0% 04/15/22	390,000.00	393,954.60
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	551,070.00
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	431,289.60
RFGB 0% 09/15/30	250,000.00	259,967.50
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	760,153.60
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	672,039.90
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	685,249.50
RFGB 1.625% 09/15/22	1,130,000.00	1,179,222.80
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	941,333.20
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	527,763.60
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	798,401.00
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	1,013,031.60
SPGB 0.05% 10/31/21	1,930,000.00	1,941,116.80
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,356,730.60
SPGB 0.35% 07/30/23	3,390,000.00	3,472,580.40
SPGB 0.4% 04/30/22	2,390,000.00	2,423,938.00
SPGB 0.45% 10/31/22	2,360,000.00	2,408,639.60
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	3,031,544.00
SPGB 0.6% 10/31/29	2,780,000.00	2,935,902.40
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,136,880.00
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,395,261.00
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,412,725.00
SPGB 1.2% 10/31/40	1,700,000.00	1,879,078.00
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,403,861.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,786,789.00
SPGB 1.4% 04/30/28	2,120,000.00	2,367,128.40
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,691,512.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,860,000.00	3,225,908.40
SPGB 1.45% 10/31/27	2,600,000.00	2,900,456.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,330,000.00	2,598,882.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,332,094.50
SPGB 1.85% 07/30/35	2,110,000.00	2,551,517.50
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,168,303.10
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,483,900.00
SPGB 1% 10/31/50	1,600,000.00	1,649,952.00
SPGB 2.15% 10/31/25	2,360,000.00	2,662,693.60
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,075,839.60
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,710,953.00
SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	4,066,416.00
SPGB 2.9% 10/31/46	2,070,000.00	3,095,560.80

	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,531,886.40
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,899,839.60
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	4,028,999.70
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	3,086,290.80
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,525,547.60
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,728,609.60
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,813,712.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,350,000.00	4,246,826.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,630,000.00	6,575,711.20
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,850,000.00	3,649,902.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,378,250.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,305,722.80
	SPGB 5.85% 01/31/22	3,760,000.00	4,049,820.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,730,538.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,576,438.50
	ユーロ 小計	747,560,000.00	914,340,910.90 (112,445,645,222)
イギリスbond	UKT 0.125% 01/30/26	1,700,000.00	1,704,165.00
	UKT 0.125% 01/31/23	2,790,000.00	2,797,226.10
	UKT 0.125% 01/31/28	1,250,000.00	1,243,775.00
	UKT 0.375% 10/22/30	3,960,000.00	3,966,177.60
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,177,688.50
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,172,433.00
	UKT 0.625% 06/07/25	3,400,000.00	3,494,690.00
	UKT 0.625% 07/31/35	1,000,000.00	990,390.00
	UKT 0.625% 10/22/50	2,000,000.00	1,841,060.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,971,750.20
	UKT 0.875% 10/22/29	2,550,000.00	2,682,676.50
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,211,828.10
	UKT 1.25% 10/22/41	1,650,000.00	1,766,721.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,164,880.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,894,938.50
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,446,202.00
	UKT 1.625% 10/22/54	1,600,000.00	1,930,544.00
	UKT 1.625% 10/22/71	800,000.00	1,084,384.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,567,280.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,180,000.00	2,767,052.20
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,219,964.80
	UKT 1.75% 09/07/37	3,100,000.00	3,584,034.00
	UKT 1% 04/22/24	2,620,000.00	2,712,250.20
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,660,350.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,083,193.60

	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,790,488.80
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,949,598.40
	UKT 3.25% 01/22/44	2,910,000.00	4,340,497.80
	UKT 3.5% 01/22/45	2,800,000.00	4,373,404.00
	UKT 3.5% 07/22/68	2,000,000.00	4,080,580.00
	UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	3,293,407.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,490,000.00	3,783,654.60
	UKT 4.25% 06/07/32	1,950,000.00	2,781,226.50
	UKT 4.25% 09/07/39	1,880,000.00	3,017,249.60
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,766,313.60
	UKT 4.25% 12/07/40	2,070,000.00	3,377,536.20
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,865,554.20
	UKT 4.25% 12/07/49	1,490,000.00	2,757,662.20
	UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,424,685.20
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,687,249.40
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	4,045,836.60
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,730,948.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,765,977.50
	UKT 4% 01/22/60	1,700,000.00	3,462,186.00
	UKT 4% 03/07/22	1,950,000.00	2,051,907.00
	UKT 5% 03/07/25	1,980,000.00	2,406,848.40
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,824,212.50
	イギリスポンド 小計	100,420,000.00	129,712,677.80 (17,835,493,197)
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	3,570,000.00	3,617,302.50
	SGB 0.75% 05/12/28	6,150,000.00	6,576,072.00
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,997,429.10
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,204,000.00
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,691,426.30
	SGB 2.5% 05/12/25	9,170,000.00	10,354,122.10
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	9,133,161.60
	SGB 3.5% 06/01/22	12,650,000.00	13,415,072.00
	スウェーデンクローナ 小計	66,340,000.00	73,988,585.60 (893,042,228)
ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	4,340,000.00	4,578,960.40
	NGB 1.5% 02/19/26	4,910,000.00	5,160,802.80
	NGB 1.75% 02/17/27	3,250,000.00	3,481,400.00
	NGB 1.75% 03/13/25	4,300,000.00	4,542,950.00
	NGB 1.75% 09/06/29	7,500,000.00	8,142,750.00
	NGB 2% 04/26/28	4,900,000.00	5,373,340.00
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,750,260.40
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	8,007,091.20
		47,820,000.00	51,037,554.80

ノルウェークローネ 小計			(586,421,504)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	4,120,000.00	4,191,894.00
	DGB 0.25% 11/15/52	2,830,000.00	3,068,172.80
	DGB 0.5% 11/15/27	10,730,000.00	11,512,002.40
	DGB 0.5% 11/15/29	13,020,000.00	14,114,070.60
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,900,593.40
	DGB 1.75% 11/15/25	8,030,000.00	8,984,767.00
	DGB 3% 11/15/21	10,860,000.00	11,248,788.00
	DGB 4.5% 11/15/39	16,430,000.00	31,436,997.70
デンマーククローネ 小計		73,440,000.00	92,457,285.90 (1,525,545,217)
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	960,000.00	976,425.60
	POLGB 1.25% 10/25/30	210,000.00	211,625.40
	POLGB 2.25% 04/25/22	5,470,000.00	5,644,219.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,246,207.80
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,174,564.80
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,230,000.00	6,742,666.70
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,714,358.80
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,200,000.00	3,564,128.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,848,451.90
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,466,443.20
	POLGB 3.25% 07/25/25	5,210,000.00	5,901,471.20
	POLGB 4% 10/25/23	3,430,000.00	3,828,291.60
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	839,988.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,150,000.00	3,483,207.00
ポーランドズロチ 小計		56,860,000.00	62,642,049.50 (1,724,535,622)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	4,370,000.00	4,380,619.10
	ACGB 0.25% 11/21/25	3,590,000.00	3,580,091.60
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,410,000.00	3,428,516.30
	ACGB 1.25% 05/21/32	1,940,000.00	1,988,829.80
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	3,009,172.50
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	2,026,673.00
	ACGB 1% 11/21/31	2,830,000.00	2,835,009.10
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,357,584.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	4,160,000.00	4,657,411.20
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,295,848.40
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,361,304.60
	ACGB 2.75% 04/21/24	4,200,000.00	4,578,756.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	800,000.00	949,816.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,475,901.60
	ACGB 2.75% 11/21/27	3,330,000.00	3,833,396.10
	ACGB 2.75% 11/21/28	3,960,000.00	4,597,282.80

	ACGB 2.75% 11/21/29	4,650,000.00	5,437,477.50
	ACGB 2% 12/21/21	1,930,000.00	1,970,626.50
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,941,308.80
	ACGB 3.25% 04/21/29	4,100,000.00	4,942,468.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	830,000.00	1,056,805.80
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,179,321.20
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,103,208.80
	ACGB 4.25% 04/21/26	3,700,000.00	4,476,482.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,677,036.90
	ACGB 4.75% 04/21/27	4,120,000.00	5,234,171.60
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,200,000.00	4,746,252.00
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,663,895.00
	オーストラリアドル 小計	85,600,000.00	95,785,266.20 (7,260,523,177)
シンガポールドル	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	825,696.00
	SIGB 1.75% 04/01/22	290,000.00	295,974.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	80,000.00	95,043.20
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	802,115.60
	SIGB 2.25% 08/01/36	730,000.00	841,054.90
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	532,002.80
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	511,626.90
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,187,833.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,636,837.20
	SIGB 2.75% 04/01/42	610,000.00	778,463.70
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,138,094.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	310,000.00	360,452.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	896,800.00
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	431,643.90
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,210,000.00	1,271,649.50
	SIGB 3.375% 09/01/33	1,100,000.00	1,398,804.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,030,981.60
	SIGB 3% 09/01/24	1,220,000.00	1,339,389.20
	シンガポールドル 小計	13,420,000.00	15,374,463.30 (1,189,060,991)
マレーシアリングット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,544,070.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	735,014.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,419,075.90
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,610,218.70
	MGS 3.62% 11/30/21	1,240,000.00	1,265,754.80
	MGS 3.733% 06/15/28	1,930,000.00	2,094,204.40
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,139,813.00
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	574,469.50

	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,557,435.00
	MGS 3.8% 08/17/23	1,660,000.00	1,745,390.40
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,523,994.00
	MGS 3.882% 03/10/22	960,000.00	986,985.60
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,105,941.90
	MGS 3.885% 08/15/29	730,000.00	797,517.70
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,227,112.20
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,152,087.10
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,564,876.80
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	650,766.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,220,000.00	2,408,322.60
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,040,353.00
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	766,878.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,374,963.20
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,257,500.00
	MGS 4.254% 05/31/35	810,000.00	900,639.00
	MGS 4.392% 04/15/26	2,440,000.00	2,699,054.80
	MGS 4.498% 04/15/30	2,380,000.00	2,722,839.00
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,281,385.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,658,961.60
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,681,097.60
	MGS 4.893% 06/08/38	1,610,000.00	1,901,619.30
	MGS 4.921% 07/06/48	1,050,000.00	1,205,463.00
	MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,798,477.20
	マレーシアリングット 小計	48,820,000.00	53,392,280.30 (1,353,494,305)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.5% 04/30/25	1,910,000.00	1,925,125.66
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,750,000.00	6,829,104.60
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,100,000.00	1,112,134.65
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,155,939.55
	ILGOV 1% 03/31/30	1,770,000.00	1,804,013.02
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,110,000.00	2,375,053.55
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,558,835.32
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,520,000.00	3,534,329.22
	ILGOV 5.5% 01/31/22	2,110,000.00	2,247,887.02
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,432,954.19
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,546,116.18
	イスラエルシェケル 小計	31,630,000.00	37,521,492.96 (1,163,541,496)
	合計		271,193,648,901 (271,193,648,901)

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 200銘柄	100.0%	43.4%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 319銘柄	100.0%	41.5%
イギリスポンド	国債証券 47銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
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 28銘柄	100.0%	2.7%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 11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

項目	2020年11月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,126,427,631
株式	354,864,638,360
派生商品評価勘定	218,850,300
未収入金	6,216,187,401
未収配当金	3,064,699,893
差入委託証拠金	232,864,000

	2020年11月19日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	366,723,667,585
資産合計	366,723,667,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	571,000
前受金	218,296,900
未払金	41,577,200
未払解約金	1,373,116,695
未払利息	3,701
流動負債合計	1,633,565,496
負債合計	1,633,565,496
純資産の部	
元本等	
元本	221,721,131,136
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	143,368,970,953
元本等合計	365,090,102,089
純資産合計	365,090,102,089
負債純資産合計	366,723,667,585

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年11月19日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、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>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</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、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</p> <p>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</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11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		221,721,131,136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)	1.6466円 (16,466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11月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
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11月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2020年11月19日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月20日
期首元本額	211,904,917,970円
期中追加設定元本額	37,292,449,233円
期中一部解約元本額	27,476,236,067円
期末元本額	221,721,131,136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）	513,311,042円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,050,792,126円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,072,996円

区分	2020年11月19日現在
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,954,107,528円
世界経済インデックスファンド	2,398,370,061円
日本株式インデックス・オープン	3,902,382,687円
DCマイセレクション25	6,891,774,196円
DCマイセレクション50	19,525,524,902円
DCマイセレクション75	18,017,089,523円
DC日本株式インデックス・オープン	5,832,395,398円
DCマイセレクションS25	2,978,975,867円
DCマイセレクションS50	8,030,929,646円
DCマイセレクションS75	5,434,937,452円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,144,654,235円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	311,820,970円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	702,923,363円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	482,243,076円
DC世界経済インデックスファンド	3,033,832,948円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,625,738,879円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	14,492,197円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,243,911円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,422,250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）	246,402,809円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,505,321円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	63,042,654円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	215,888,207円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	46,610,654円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	194,244,087円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,416,796,773円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	606,180,509円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,622,044,017円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	577,257,569円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	33,897,979円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	670,368,960円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	380,902,479円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	475,210,621円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	47,285,222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）	775,845,480円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,431,058,451円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,948,886,357円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,418,242,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,651,639,015円
分散投資コア戦略ファンドA	2,249,878,534円
分散投資コア戦略ファンドS	7,711,269,663円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	350,237,061円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	361,624,101円

区分	2020年11月19日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,350,540,852円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,061,834円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,559,052円
SMT インデックスバランス・オープン	64,962,034円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,768,439,879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	28,146,797円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	88,507,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	15,673,978円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,639,450円
グローバル経済コア	250,148,440円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,181,405円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	45,225,256円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,699,919円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,152,864,256円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	117,678,642円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	374,695円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	398,137円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	221,934円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	316,167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）	47,344,653,592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）	1,652,365,969円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	86,652,574円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,406,958円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	562,991,333円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年11月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	31,471,287,506
合計	31,471,287,506

(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11月19日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,805,563,100	-	5,023,860,000	218,296,900
	合計	4,805,563,100	-	5,023,860,000	218,296,900

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,100	2,838.00	20,149,800	
日本水産	201,700	418.00	84,310,600	
マルハニチロ	29,100	2,280.00	66,348,000	
雪国まいたけ	12,400	1,749.00	21,687,600	
カネコ種苗	6,100	1,545.00	9,424,500	
サカタのタネ	24,000	3,510.00	84,240,000	
ホクト	15,400	2,117.00	32,601,800	
ホクリヨウ	3,100	684.00	2,120,400	
住石ホールディングス	40,700	122.00	4,965,400	
日鉄鉱業	4,600	4,920.00	22,632,000	
三井松島ホールディングス	7,800	743.00	5,795,400	
国際石油開発帝石	741,700	575.00	426,477,500	
石油資源開発	26,400	1,841.00	48,602,400	
K&Oエナジーグループ	9,800	1,456.00	14,268,800	
ヒノキヤグループ	5,000	2,181.00	10,905,000	
ショーボンドホールディングス	31,400	5,340.00	167,676,000	
ミライト・ホールディングス	59,900	1,658.00	99,314,200	
タマホーム	10,900	1,411.00	15,379,900	
サンヨーホームズ	1,700	707.00	1,201,900	
日本アクア	8,000	612.00	4,896,000	
ファーストコーポレーション	6,200	742.00	4,600,400	
ベステラ	3,500	1,494.00	5,229,000	
TATERU	37,800	183.00	6,917,400	
キャンディル	3,500	533.00	1,865,500	
スペースバリューホールディングス	24,600	598.00	14,710,800	

ダイセキ環境ソリューション	3,900	702.00	2,737,800	
第一カッター興業	2,500	2,258.00	5,645,000	
安藤・間	120,100	721.00	86,592,100	
東急建設	59,100	496.00	29,313,600	
コムシスホールディングス	71,500	3,195.00	228,442,500	
ピーアールホールディングス	22,000	601.00	13,222,000	
高松コンストラクショングループ	12,500	2,115.00	26,437,500	
東建コーポレーション	6,200	7,910.00	49,042,000	
ソネック	2,100	860.00	1,806,000	
ヤマウラ	8,800	901.00	7,928,800	
大成建設	155,300	3,600.00	559,080,000	
大林組	465,700	974.00	453,591,800	
清水建設	472,600	811.00	383,278,600	
飛鳥建設	13,400	1,059.00	14,190,600	
長谷工コーポレーション	180,300	1,189.00	214,376,700	
松井建設	18,300	760.00	13,908,000	
銭高組	2,000	4,730.00	9,460,000	
鹿島建設	365,600	1,368.00	500,140,800	
不動テトラ	12,200	1,584.00	19,324,800	
大末建設	5,400	903.00	4,876,200	
鉄建建設	10,100	1,897.00	19,159,700	
西松建設	35,900	1,974.00	70,866,600	
三井住友建設	112,500	428.00	48,150,000	
大豊建設	10,500	3,415.00	35,857,500	
前田建設工業	116,600	849.00	98,993,400	
佐田建設	10,000	457.00	4,570,000	
ナカノフドー建設	12,700	419.00	5,321,300	
奥村組	21,900	2,500.00	54,750,000	
東鉄工業	20,000	2,850.00	57,000,000	
イチケン	3,400	1,740.00	5,916,000	
富士ピー・エス	6,900	599.00	4,133,100	
浅沼組	5,200	4,000.00	20,800,000	
戸田建設	193,400	633.00	122,422,200	
熊谷組	21,600	2,482.00	53,611,200	
北野建設	2,800	2,654.00	7,431,200	
植木組	2,100	2,827.00	5,936,700	
矢作建設工業	20,600	893.00	18,395,800	
ピーエス三菱	15,300	568.00	8,690,400	
日本ハウスホールディングス	31,800	236.00	7,504,800	
大東建託	50,800	10,110.00	513,588,000	
新日本建設	19,800	875.00	17,325,000	
N I P P O	38,500	2,753.00	105,990,500	

東亜道路工業	2,900	3,575.00	10,367,500
前田道路	41,100	1,779.00	73,116,900
日本道路	4,500	8,010.00	36,045,000
東亜建設工業	14,500	1,992.00	28,884,000
日本国土開発	45,300	570.00	25,821,000
若築建設	8,400	1,180.00	9,912,000
東洋建設	52,200	393.00	20,514,600
五洋建設	184,600	789.00	145,649,400
世紀東急工業	22,400	807.00	18,076,800
福田組	5,400	5,220.00	28,188,000
住友林業	118,000	1,865.00	220,070,000
日本基礎技術	15,600	492.00	7,675,200
巴コーポレーション	20,700	373.00	7,721,100
大和ハウス工業	460,800	3,320.00	1,529,856,000
ライト工業	26,700	1,669.00	44,562,300
積水ハウス	505,100	1,912.50	966,003,750
日特建設	12,200	809.00	9,869,800
北陸電気工事	8,100	1,121.00	9,080,100
ユアテック	26,600	670.00	17,822,000
日本リーテック	9,700	2,416.00	23,435,200
四電工	2,500	2,373.00	5,932,500
中電工	18,800	2,152.00	40,457,600
関電工	66,300	805.00	53,371,500
きんでん	110,600	1,731.00	191,448,600
東京エネシス	15,500	817.00	12,663,500
トーエネック	4,700	3,575.00	16,802,500
住友電設	13,100	2,753.00	36,064,300
日本電設工業	25,500	2,205.00	56,227,500
協和エクシオ	70,600	2,762.00	194,997,200
新日本空調	12,300	2,186.00	26,887,800
九電工	32,700	3,050.00	99,735,000
三機工業	33,000	1,143.00	37,719,000
日揮ホールディングス	143,400	955.00	136,947,000
中外炉工業	5,000	1,605.00	8,025,000
ヤマト	14,900	734.00	10,936,600
太平電業	11,300	2,489.00	28,125,700
高砂熱学工業	35,600	1,477.00	52,581,200
三晃金属工業	2,000	2,670.00	5,340,000
朝日工業社	3,100	2,994.00	9,281,400
明星工業	30,100	835.00	25,133,500
大気社	22,600	2,848.00	64,364,800
ダイダシ	11,100	2,732.00	30,325,200

日比谷総合設備	15,000	1,825.00	27,375,000
フィル・カンパニー	2,700	2,043.00	5,516,100
OSJBホールディングス	73,400	239.00	17,542,600
東洋エンジニアリング	19,600	330.00	6,468,000
レイズネクスト	25,000	1,141.00	28,525,000
日本製粉	43,600	1,686.00	73,509,600
日清製粉グループ本社	168,400	1,750.00	294,700,000
日東富士製粉	1,100	6,520.00	7,172,000
昭和産業	13,700	3,280.00	44,936,000
鳥越製粉	13,200	1,090.00	14,388,000
中部飼料	18,200	1,444.00	26,280,800
フィード・ワン	20,000	900.00	18,000,000
東洋精糖	2,500	1,217.00	3,042,500
日本甜菜製糖	7,800	1,659.00	12,940,200
三井製糖	13,100	1,801.00	23,593,100
塩水港精糖	16,100	225.00	3,622,500
日新製糖	7,100	1,852.00	13,149,200
森永製菓	35,000	3,975.00	139,125,000
中村屋	3,900	4,195.00	16,360,500
江崎グリコ	41,000	4,415.00	181,015,000
名糖産業	7,200	1,483.00	10,677,600
井村屋グループ	8,400	2,584.00	21,705,600
不二家	9,500	2,434.00	23,123,000
山崎製パン	111,700	1,820.00	203,294,000
第一屋製パン	2,900	1,003.00	2,908,700
モロゾフ	2,500	6,110.00	15,275,000
亀田製菓	8,500	4,985.00	42,372,500
寿スピリッツ	14,300	5,580.00	79,794,000
カルビー	67,900	2,985.00	202,681,500
森永乳業	27,600	5,200.00	143,520,000
六甲バター	9,900	1,884.00	18,651,600
ヤクルト本社	102,500	5,120.00	524,800,000
明治ホールディングス	98,600	7,650.00	754,290,000
雪印メグミルク	35,900	2,440.00	87,596,000
プリマハム	23,300	2,855.00	66,521,500
日本ハム	57,000	4,355.00	248,235,000
林兼産業	4,900	609.00	2,984,100
丸大食品	15,900	1,719.00	27,332,100
S Foods	11,900	3,230.00	38,437,000
柿安本店	5,200	2,517.00	13,088,400
伊藤ハム米久ホールディングス	96,000	683.00	65,568,000
サッポロホールディングス	50,900	2,047.00	104,192,300

アサヒグループホールディングス	325,600	4,057.00	1,320,959,200
麒麟ホールディングス	632,100	2,220.50	1,403,578,050
宝ホールディングス	110,500	1,204.00	133,042,000
オエノンホールディングス	42,300	440.00	18,612,000
養命酒製造	4,600	1,869.00	8,597,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	114,100	1,712.00	195,339,200
サントリー食品インターナショナル	99,700	3,900.00	388,830,000
ダイトーグループホールディングス	7,600	5,830.00	44,308,000
伊藤園	45,200	8,120.00	367,024,000
キーコーヒー	14,600	2,225.00	32,485,000
ユニカフェ	4,500	1,128.00	5,076,000
ジャパンフーズ	2,100	1,240.00	2,604,000
日清オイリオグループ	19,200	2,995.00	57,504,000
不二製油グループ本社	36,300	3,025.00	109,807,500
かどや製油	1,600	3,895.00	6,232,000
J - オイルミルズ	7,700	3,675.00	28,297,500
キッコーマン	107,300	6,650.00	713,545,000
味の素	329,200	2,258.00	743,333,600
キューピー	83,000	2,220.00	184,260,000
ハウス食品グループ本社	55,700	3,810.00	212,217,000
カゴメ	60,900	4,060.00	247,254,000
焼津水産化学工業	7,200	996.00	7,171,200
アリアケジャパン	13,600	7,170.00	97,512,000
ピエトロ	1,900	1,720.00	3,268,000
エバラ食品工業	3,600	2,323.00	8,362,800
やまみ	1,300	2,195.00	2,853,500
ニチレイ	71,000	3,030.00	215,130,000
東洋水産	76,700	5,280.00	404,976,000
イトアンドホールディングス	5,200	1,874.00	9,744,800
大冷	1,900	2,095.00	3,980,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,300	848.00	7,038,400
日清食品ホールディングス	63,400	8,680.00	550,312,000
永谷園ホールディングス	7,300	2,383.00	17,395,900
一正蒲鉾	5,800	1,147.00	6,652,600
フジッコ	16,100	2,053.00	33,053,300
ロック・フィールド	16,100	1,561.00	25,132,100
日本たばこ産業	799,200	2,154.50	1,721,876,400
ケンコーマヨネーズ	8,400	1,700.00	14,280,000
わらべや日洋ホールディングス	9,800	1,452.00	14,229,600
なとり	8,300	2,066.00	17,147,800
イフジ産業	2,600	820.00	2,132,000
ピククルスコーポレーション	3,200	3,020.00	9,664,000

北の達人コーポレーション	52,000	526.00	27,352,000
ユーグレナ	64,400	821.00	52,872,400
ミヨシ油脂	5,200	1,221.00	6,349,200
理研ビタミン	14,100	1,395.00	19,669,500
片倉工業	19,900	1,288.00	25,631,200
グンゼ	10,800	3,645.00	39,366,000
東洋紡	57,800	1,369.00	79,128,200
ユニチカ	43,900	382.00	16,769,800
富士紡ホールディングス	7,200	3,420.00	24,624,000
倉敷紡績	14,700	1,854.00	27,253,800
シキボウ	7,600	1,008.00	7,660,800
日本毛織	48,300	1,040.00	50,232,000
トーア紡コーポレーション	5,800	487.00	2,824,600
帝国繊維	16,600	2,672.00	44,355,200
帝人	118,900	1,849.00	219,846,100
東レ	1,054,000	566.50	597,091,000
サカイオーベックス	4,100	2,022.00	8,290,200
住江織物	3,200	2,191.00	7,011,200
日本フェルト	9,300	464.00	4,315,200
イチカワ	2,400	1,320.00	3,168,000
日東製網	1,700	1,448.00	2,461,600
アツギ	12,300	540.00	6,642,000
ダイニック	5,500	840.00	4,620,000
セーレン	36,100	1,570.00	56,677,000
ソトー	6,000	920.00	5,520,000
東海染工	2,200	1,116.00	2,455,200
小松マテーレ	24,100	925.00	22,292,500
ワコールホールディングス	36,400	2,049.00	74,583,600
ホギメディカル	16,600	3,140.00	52,124,000
T S Iホールディングス	45,100	218.00	9,831,800
マツオカコーポレーション	4,200	2,724.00	11,440,800
ワールド	20,800	1,299.00	27,019,200
三陽商会	7,600	533.00	4,050,800
ナイガイ	5,900	365.00	2,153,500
オンワードホールディングス	88,400	200.00	17,680,000
ルックホールディングス	5,200	1,035.00	5,382,000
ゴールドウイン	26,300	6,720.00	176,736,000
デサント	28,500	1,807.00	51,499,500
キング	7,200	569.00	4,096,800
ヤマトインターナショナル	13,400	340.00	4,556,000
特種東海製紙	8,900	5,360.00	47,704,000
王子ホールディングス	608,000	499.00	303,392,000

日本製紙	64,300	1,218.00	78,317,400
三菱製紙	16,500	344.00	5,676,000
北越コーポレーション	86,700	367.00	31,818,900
中越パルプ工業	6,200	1,264.00	7,836,800
巴川製紙所	4,300	928.00	3,990,400
大王製紙	70,100	1,823.00	127,792,300
阿波製紙	3,800	452.00	1,717,600
レンゴー	137,500	862.00	118,525,000
トーモク	8,900	1,700.00	15,130,000
ザ・パック	11,000	3,005.00	33,055,000
クラレ	229,100	1,102.00	252,468,200
旭化成	964,100	988.80	953,302,080
共和レザー	7,900	619.00	4,890,100
昭和電工	110,400	1,940.00	214,176,000
住友化学	1,068,600	381.00	407,136,600
住友精化	6,400	3,565.00	22,816,000
日産化学	80,200	6,350.00	509,270,000
ラサ工業	5,100	1,911.00	9,746,100
クレハ	12,500	4,810.00	60,125,000
多木化学	5,700	6,780.00	38,646,000
テイカ	10,700	1,493.00	15,975,100
石原産業	26,100	606.00	15,816,600
片倉コープアグリ	3,700	1,277.00	4,724,900
日本曹達	21,500	2,745.00	59,017,500
東ソー	224,800	1,708.00	383,958,400
トクヤマ	41,900	2,208.00	92,515,200
セントラル硝子	29,700	2,254.00	66,943,800
東亜合成	91,300	1,175.00	107,277,500
大阪ソーダ	14,800	2,543.00	37,636,400
関東電化工業	34,500	699.00	24,115,500
デンカ	53,100	3,220.00	170,982,000
信越化学工業	249,800	15,065.00	3,763,237,000
日本カーバイド工業	5,100	1,241.00	6,329,100
堺化学工業	9,400	2,069.00	19,448,600
第一稀元素化学工業	15,800	721.00	11,391,800
エア・ウォーター	135,300	1,782.00	241,104,600
日本酸素ホールディングス	139,800	1,783.00	249,263,400
日本化学工業	4,500	2,301.00	10,354,500
東邦アセチレン	2,200	1,219.00	2,681,800
日本パーカラライジング	73,400	1,099.00	80,666,600
高圧ガス工業	23,100	798.00	18,433,800
チタン工業	1,800	1,893.00	3,407,400

四国化成工業	21,300	1,213.00	25,836,900
戸田工業	3,400	1,935.00	6,579,000
ステラ ケミファ	7,900	3,115.00	24,608,500
保土谷化学工業	5,400	4,390.00	23,706,000
日本触媒	22,600	5,380.00	121,588,000
大日精化工業	12,900	2,239.00	28,883,100
カネカ	37,600	3,220.00	121,072,000
三菱瓦斯化学	135,300	1,951.00	263,970,300
三井化学	135,000	2,988.00	403,380,000
J S R	135,500	2,797.00	378,993,500
東京応化工業	25,000	6,130.00	153,250,000
大阪有機化学工業	13,400	2,559.00	34,290,600
三菱ケミカルホールディングス	972,300	591.70	575,309,910
K Hネオケム	24,000	2,879.00	69,096,000
ダイセル	181,600	792.00	143,827,200
住友ベークライト	22,900	3,030.00	69,387,000
積水化学工業	307,600	1,732.00	532,763,200
日本ゼオン	131,200	1,233.00	161,769,600
アイカ工業	43,600	3,835.00	167,206,000
宇部興産	73,500	1,822.00	133,917,000
積水樹脂	26,200	2,199.00	57,613,800
タキロンシーアイ	31,500	658.00	20,727,000
旭有機材	8,200	1,422.00	11,660,400
ニチバン	7,600	1,718.00	13,056,800
リケンテクノス	35,500	426.00	15,123,000
大倉工業	6,900	1,870.00	12,903,000
積水化成成品工業	19,500	550.00	10,725,000
群栄化学工業	3,300	2,551.00	8,418,300
タイガースポリマー	7,700	433.00	3,334,100
ミライアル	5,100	1,184.00	6,038,400
ダイキアクシス	5,100	880.00	4,488,000
ダイキョーニシカワ	30,700	679.00	20,845,300
竹本容器	5,200	901.00	4,685,200
森六ホールディングス	7,800	1,999.00	15,592,200
日本化薬	90,000	923.00	83,070,000
カーリットホールディングス	15,500	546.00	8,463,000
日本精化	11,700	1,422.00	16,637,400
扶桑化学工業	14,700	3,280.00	48,216,000
トリケミカル研究所	3,200	13,190.00	42,208,000
A D E K A	66,900	1,643.00	109,916,700
日油	54,800	4,605.00	252,354,000
新日本理化	24,100	160.00	3,856,000

ハリマ化成グループ	12,000	989.00	11,868,000	
花王	355,600	7,860.00	2,795,016,000	
第一工業製薬	5,400	4,380.00	23,652,000	
石原ケミカル	3,900	2,146.00	8,369,400	
日華化学	4,900	983.00	4,816,700	
ニイタカ	3,000	3,210.00	9,630,000	
三洋化成工業	8,700	4,520.00	39,324,000	
有機合成薬品工業	11,100	311.00	3,452,100	
大日本塗料	16,400	993.00	16,285,200	
日本ペイントホールディングス	120,000	11,930.00	1,431,600,000	
関西ペイント	163,400	2,980.00	486,932,000	
神東塗料	11,400	175.00	1,995,000	
中国塗料	41,400	961.00	39,785,400	
日本特殊塗料	10,900	1,129.00	12,306,100	
藤倉化成	19,600	529.00	10,368,400	
太陽ホールディングス	10,700	5,610.00	60,027,000	
D I C	61,400	2,572.00	157,920,800	
サカタインクス	31,800	1,168.00	37,142,400	
東洋インキＳＣホールディングス	30,700	2,002.00	61,461,400	
T & K T O K A	11,300	876.00	9,898,800	
富士フイルムホールディングス	284,700	5,738.00	1,633,608,600	
資生堂	295,100	7,201.00	2,125,015,100	
ライオン	193,100	2,530.00	488,543,000	
高砂香料工業	9,300	2,418.00	22,487,400	
マンダム	33,400	1,693.00	56,546,200	
ミルボン	19,900	5,890.00	117,211,000	
ファンケル	60,100	3,920.00	235,592,000	
コーセー	27,900	15,620.00	435,798,000	
コタ	8,600	1,324.00	11,386,400	
シーボン	1,900	1,968.00	3,739,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	63,400	2,035.00	129,019,000	
ノエビアホールディングス	12,600	4,490.00	56,574,000	
アジュバンコスメジャパン	3,300	1,019.00	3,362,700	
エステー	9,500	1,931.00	18,344,500	
アグロ カネショウ	5,600	1,737.00	9,727,200	
コニシ	24,400	1,596.00	38,942,400	
長谷川香料	25,600	2,071.00	53,017,600	
星光P M C	8,500	653.00	5,550,500	
小林製薬	41,600	11,600.00	482,560,000	
荒川化学工業	13,300	1,123.00	14,935,900	
メック	10,200	1,997.00	20,369,400	
日本高純度化学	4,100	2,679.00	10,983,900	

タカラバイオ	38,900	2,916.00	113,432,400
J C U	18,000	3,475.00	62,550,000
新田ゼラチン	9,300	702.00	6,528,600
O A T アグリオ	2,800	1,391.00	3,894,800
デクセリアルズ	38,400	1,182.00	45,388,800
アース製薬	11,000	6,100.00	67,100,000
北興化学工業	13,800	1,100.00	15,180,000
大成ラミック	4,900	2,867.00	14,048,300
クミアイ化学工業	61,400	1,049.00	64,408,600
日本農薬	26,500	525.00	13,912,500
アキレス	10,200	1,502.00	15,320,400
有沢製作所	23,500	931.00	21,878,500
日東電工	102,500	8,190.00	839,475,000
レック	15,800	1,510.00	23,858,000
三光合成	17,000	294.00	4,998,000
きもと	25,300	181.00	4,579,300
藤森工業	13,300	4,275.00	56,857,500
前澤化成工業	9,400	986.00	9,268,400
未来工業	8,000	1,853.00	14,824,000
ウェーブロックホールディングス	5,100	723.00	3,687,300
J S P	8,700	1,490.00	12,963,000
エフピコ	31,200	4,275.00	133,380,000
天馬	9,900	1,898.00	18,790,200
信越ポリマー	26,700	945.00	25,231,500
東リ	37,000	271.00	10,027,000
ニフコ	54,500	3,485.00	189,932,500
バルカー	12,100	1,850.00	22,385,000
ユニ・チャーム	314,900	5,158.00	1,624,254,200
ショーエイコーポレーション	2,200	1,044.00	2,296,800
協和キリン	149,400	2,753.00	411,298,200
武田薬品工業	1,235,600	3,625.00	4,479,050,000
アステラス製薬	1,287,700	1,596.50	2,055,813,050
大日本住友製薬	110,100	1,386.00	152,598,600
塩野義製薬	186,800	5,602.00	1,046,453,600
わかもと製薬	17,700	266.00	4,708,200
あすか製薬	16,900	1,583.00	26,752,700
日本新薬	38,900	7,630.00	296,807,000
バイオフェルミン製薬	2,500	2,474.00	6,185,000
中外製薬	464,500	4,575.00	2,125,087,500
科研製薬	25,400	3,950.00	100,330,000
エーザイ	177,800	7,798.00	1,386,484,400
ロート製薬	76,200	3,340.00	254,508,000

小野薬品工業	341,100	3,174.00	1,082,651,400
久光製薬	39,300	5,910.00	232,263,000
持田製薬	20,600	4,105.00	84,563,000
参天製薬	276,800	1,656.00	458,380,800
扶桑薬品工業	5,200	2,787.00	14,492,400
日本ケミファ	2,000	2,485.00	4,970,000
ツムラ	46,000	3,295.00	151,570,000
日医工	42,100	1,015.00	42,731,500
キッセイ薬品工業	26,300	2,046.00	53,809,800
生化学工業	28,800	994.00	28,627,200
栄研化学	26,100	1,830.00	47,763,000
日水製薬	6,200	991.00	6,144,200
鳥居薬品	9,300	3,200.00	29,760,000
JCRファーマ	41,900	2,679.00	112,250,100
東和薬品	19,000	1,869.00	35,511,000
富士製薬工業	10,100	1,220.00	12,322,000
沢井製薬	30,500	4,680.00	142,740,000
ゼリア新薬工業	26,900	1,904.00	51,217,600
第一三共	1,275,000	3,600.00	4,590,000,000
キョーリン製薬ホールディングス	32,800	1,858.00	60,942,400
大幸薬品	18,300	1,748.00	31,988,400
ダイト	9,500	3,700.00	35,150,000
大塚ホールディングス	308,600	4,323.00	1,334,077,800
大正製薬ホールディングス	31,400	6,610.00	207,554,000
ペプチドリーム	75,500	4,795.00	362,022,500
日本コークス工業	125,500	71.00	8,910,500
ニチレキ	17,500	1,698.00	29,715,000
ユシロ化学工業	8,300	1,245.00	10,333,500
ビーピー・カストロール	5,300	1,294.00	6,858,200
富士石油	39,700	191.00	7,582,700
MORESCO	5,400	1,002.00	5,410,800
出光興産	164,800	2,217.00	365,361,600
ENEOSホールディングス	2,234,100	375.20	838,234,320
コスモエネルギーホールディングス	43,000	1,746.00	75,078,000
横浜ゴム	86,000	1,639.00	140,954,000
TOYO TIRE	78,200	1,829.00	143,027,800
ブリヂストン	394,900	3,679.00	1,452,837,100
住友ゴム工業	133,400	1,025.00	136,735,000
藤倉コンポジット	13,000	352.00	4,576,000
オカモト	9,000	4,255.00	38,295,000
フコク	6,500	737.00	4,790,500
ニッタ	16,700	2,303.00	38,460,100

住友理工	28,800	526.00	15,148,800
三ツ星ベルト	19,500	1,662.00	32,409,000
バンドー化学	26,100	557.00	14,537,700
日東紡績	22,100	4,185.00	92,488,500
A G C	136,400	3,525.00	480,810,000
日本板硝子	71,100	403.00	28,653,300
石塚硝子	2,700	1,895.00	5,116,500
日本山村硝子	6,400	855.00	5,472,000
日本電気硝子	55,100	2,187.00	120,503,700
オハラ	6,000	1,243.00	7,458,000
住友大阪セメント	28,200	3,305.00	93,201,000
太平洋セメント	93,900	2,916.00	273,812,400
日本ヒューム	15,100	788.00	11,898,800
日本コンクリート工業	32,500	310.00	10,075,000
三谷セキサン	7,000	4,615.00	32,305,000
アジアパイルホールディングス	21,500	457.00	9,825,500
東海カーボン	145,400	1,187.00	172,589,800
日本カーボン	8,200	3,765.00	30,873,000
東洋炭素	8,800	1,725.00	15,180,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,300	2,938.00	24,385,400
T O T O	106,100	5,940.00	630,234,000
日本碍子	178,400	1,630.00	290,792,000
日本特殊陶業	113,100	1,768.00	199,960,800
M A R U W A	5,700	10,070.00	57,399,000
品川リフラクトリーズ	4,000	2,304.00	9,216,000
黒崎播磨	3,000	2,915.00	8,745,000
ヨータイ	12,000	797.00	9,564,000
イソライト工業	8,000	434.00	3,472,000
東京窯業	19,400	329.00	6,382,600
ニッカトー	7,000	655.00	4,585,000
フジミインコーポレーテッド	13,300	3,530.00	46,949,000
クニミネ工業	6,200	1,046.00	6,485,200
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,028.00	2,570,000
ニチアス	40,700	2,313.00	94,139,100
ニチハ	20,700	3,145.00	65,101,500
日本製鉄	657,300	1,183.00	777,585,900
神戸製鋼所	268,900	479.00	128,803,100
中山製鋼所	20,500	383.00	7,851,500
合同製鐵	7,900	1,854.00	14,646,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	396,700	897.00	355,839,900
東京製鐵	71,600	677.00	48,473,200
共英製鋼	16,600	1,341.00	22,260,600

大和工業	31,200	2,535.00	79,092,000
東京鐵鋼	6,100	2,041.00	12,450,100
大阪製鐵	7,900	1,127.00	8,903,300
淀川製鋼所	19,900	2,010.00	39,999,000
丸一鋼管	47,700	2,329.00	111,093,300
モリ工業	4,400	2,381.00	10,476,400
大同特殊鋼	24,100	4,300.00	103,630,000
日本高周波鋼業	5,600	339.00	1,898,400
日本冶金工業	12,200	1,520.00	18,544,000
山陽特殊製鋼	10,100	1,142.00	11,534,200
愛知製鋼	8,300	2,617.00	21,721,100
日立金属	158,300	1,397.00	221,145,100
日本金属	3,400	734.00	2,495,600
大平洋金属	10,000	1,785.00	17,850,000
新日本電工	95,000	213.00	20,235,000
栗本鐵工所	7,300	1,708.00	12,468,400
虹技	2,200	1,225.00	2,695,000
三菱製鋼	11,000	521.00	5,731,000
日亜鋼業	21,700	315.00	6,835,500
日本精線	2,400	3,285.00	7,884,000
エンビプロ・ホールディングス	6,400	553.00	3,539,200
シンニッタン	23,200	188.00	4,361,600
新家工業	3,400	1,159.00	3,940,600
大紀アルミニウム工業所	24,300	655.00	15,916,500
日本輕金属ホールディングス	37,200	1,740.00	64,728,000
三井金属鋳業	39,700	2,921.00	115,963,700
東邦亜鉛	7,600	1,936.00	14,713,600
三菱マテリアル	97,100	1,978.00	192,063,800
住友金属鋳山	187,800	3,667.00	688,662,600
D O W Aホールディングス	37,200	3,455.00	128,526,000
古河機械金属	26,200	1,126.00	29,501,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,400	840.00	12,936,000
東邦チタニウム	26,500	703.00	18,629,500
U A C J	22,400	1,717.00	38,460,800
C Kサンエツ	3,100	3,650.00	11,315,000
古河電氣工業	45,700	2,408.00	110,045,600
住友電氣工業	549,200	1,242.50	682,381,000
フジクラ	177,300	396.00	70,210,800
昭和電線ホールディングス	17,100	1,502.00	25,684,200
東京特殊電線	2,300	2,350.00	5,405,000
タツタ電線	29,300	581.00	17,023,300
カナレ電氣	2,500	1,792.00	4,480,000

平河ヒューテック	7,400	1,064.00	7,873,600
リョービ	18,200	1,195.00	21,749,000
アーレスティ	19,700	317.00	6,244,900
アサヒホールディングス	25,800	3,300.00	85,140,000
稲葉製作所	8,300	1,387.00	11,512,100
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,113.00	9,508,500
トーカロ	40,800	1,135.00	46,308,000
アルファC o	5,200	970.00	5,044,000
SUMCO	188,000	1,729.00	325,052,000
川田テクノロジーズ	3,000	4,115.00	12,345,000
RS Technologies	4,800	3,320.00	15,936,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,840.00	3,840,000
信和	8,400	702.00	5,896,800
東洋製罐グループホールディングス	93,500	1,072.00	100,232,000
ホッカンホールディングス	8,100	1,405.00	11,380,500
コロナ	8,100	935.00	7,573,500
横河ブリッジホールディングス	27,300	1,941.00	52,989,300
駒井ハルテック	2,800	1,709.00	4,785,200
高田機工	1,300	2,569.00	3,339,700
三和ホールディングス	138,500	1,234.00	170,909,000
文化シャッター	43,300	913.00	39,532,900
三協立山	18,900	808.00	15,271,200
アルインコ	10,700	899.00	9,619,300
東洋シャッター	3,500	741.00	2,593,500
LIXILグループ	216,700	2,375.00	514,662,500
日本フィルコン	10,200	570.00	5,814,000
ノーリツ	30,400	1,710.00	51,984,000
長府製作所	14,900	2,086.00	31,081,400
リンナイ	28,600	11,880.00	339,768,000
ダイニチ工業	7,900	898.00	7,094,200
日東精工	18,400	454.00	8,353,600
三洋工業	1,900	1,925.00	3,657,500
岡部	29,800	834.00	24,853,200
ジーテクト	18,200	1,381.00	25,134,200
東プレ	27,400	1,203.00	32,962,200
高周波熱錬	28,300	462.00	13,074,600
東京製綱	10,500	554.00	5,817,000
サンコール	11,000	435.00	4,785,000
モリテック スチール	11,400	292.00	3,328,800
パイオラックス	21,700	1,594.00	34,589,800
エイチワン	14,400	637.00	9,172,800
日本発條	157,500	655.00	103,162,500

中央発條	1,800	2,963.00	5,333,400
アドバネクス	2,100	1,247.00	2,618,700
立川ブラインド工業	6,500	1,270.00	8,255,000
三益半導体工業	11,500	2,505.00	28,807,500
日本ドライケミカル	3,700	1,486.00	5,498,200
日本製鋼所	44,600	2,526.00	112,659,600
三浦工業	63,600	5,290.00	336,444,000
タクマ	49,800	1,835.00	91,383,000
ツガミ	30,500	1,601.00	48,830,500
オークマ	17,100	5,880.00	100,548,000
芝浦機械	16,700	2,146.00	35,838,200
アマダ	182,300	1,031.00	187,951,300
アイダエンジニアリング	38,600	871.00	33,620,600
滝澤鉄工所	4,600	992.00	4,563,200
F U J I	63,200	2,373.00	149,973,600
牧野フライス製作所	17,300	4,105.00	71,016,500
オーエスジー	72,500	1,871.00	135,647,500
ダイジェット工業	1,800	1,448.00	2,606,400
旭ダイヤモンド工業	38,900	440.00	17,116,000
D M G 森精機	93,000	1,507.00	140,151,000
ソディック	32,100	835.00	26,803,500
ディスコ	19,900	30,150.00	599,985,000
日東工器	8,100	1,686.00	13,656,600
日進工具	5,800	2,540.00	14,732,000
パンチ工業	13,500	415.00	5,602,500
富士ダイス	6,600	640.00	4,224,000
豊和工業	8,300	832.00	6,905,600
O K K	6,000	387.00	2,322,000
東洋機械金属	10,700	402.00	4,301,400
津田駒工業	2,800	880.00	2,464,000
エンシュウ	3,700	916.00	3,389,200
島精機製作所	23,200	1,750.00	40,600,000
オプトラン	18,400	2,039.00	37,517,600
N C ホールディングス	4,600	570.00	2,622,000
イワキポンプ	9,400	799.00	7,510,600
フリー	14,400	1,059.00	15,249,600
ヤマシンフィルタ	32,000	1,030.00	32,960,000
日阪製作所	18,200	821.00	14,942,200
やまびこ	28,500	1,349.00	38,446,500
平田機工	7,000	7,310.00	51,170,000
ペガサスミシン製造	15,200	285.00	4,332,000
マルマエ	5,500	985.00	5,417,500

タツモ	6,300	1,480.00	9,324,000
ナブテスコ	86,600	4,025.00	348,565,000
三井海洋開発	15,700	1,666.00	26,156,200
レオン自動機	14,500	1,157.00	16,776,500
S M C	46,600	60,580.00	2,823,028,000
ホソカワミクロン	5,200	6,170.00	32,084,000
ユニオンツール	5,500	3,115.00	17,132,500
オイレス工業	19,000	1,605.00	30,495,000
日精エー・エス・ビー機械	4,300	5,240.00	22,532,000
サトーホールディングス	21,000	2,102.00	44,142,000
技研製作所	13,000	4,045.00	52,585,000
日本エアーテック	4,800	1,600.00	7,680,000
カワタ	4,400	802.00	3,528,800
日精樹脂工業	12,500	883.00	11,037,500
オカダアイヨン	4,700	993.00	4,667,100
ワイエイシイホールディングス	6,300	677.00	4,265,100
小松製作所	672,800	2,508.00	1,687,382,400
住友重機械工業	85,100	2,399.00	204,154,900
日立建機	59,600	2,824.00	168,310,400
日工	20,500	670.00	13,735,000
巴工業	5,900	1,960.00	11,564,000
井関農機	14,900	1,373.00	20,457,700
T O W A	15,000	1,706.00	25,590,000
丸山製作所	3,100	1,426.00	4,420,600
北川鉄工所	6,800	1,339.00	9,105,200
ローツェ	6,500	5,250.00	34,125,000
タカキタ	5,300	700.00	3,710,000
クボタ	788,000	2,104.00	1,657,952,000
荏原実業	3,800	3,785.00	14,383,000
三菱化工機	5,200	2,189.00	11,382,800
月島機械	27,500	1,342.00	36,905,000
帝国電機製作所	12,300	1,175.00	14,452,500
新東工業	35,400	721.00	25,523,400
澁谷工業	13,000	3,505.00	45,565,000
アイチ コーポレーション	25,800	943.00	24,329,400
小森コーポレーション	37,800	705.00	26,649,000
鶴見製作所	11,500	1,733.00	19,929,500
住友精密工業	2,200	1,975.00	4,345,000
日本ギア工業	6,200	310.00	1,922,000
酒井重工業	2,800	2,358.00	6,602,400
荏原製作所	61,600	3,220.00	198,352,000
石井鐵工所	2,000	2,800.00	5,600,000

西島製作所	15,200	796.00	12,099,200	
北越工業	15,400	1,060.00	16,324,000	
ダイキン工業	189,200	23,845.00	4,511,474,000	
オルガノ	5,400	5,560.00	30,024,000	
トーヨーカネツ	6,500	1,940.00	12,610,000	
栗田工業	80,400	3,600.00	289,440,000	
椿本チエイン	21,200	2,495.00	52,894,000	
大同工業	7,300	688.00	5,022,400	
木村化工機	12,700	487.00	6,184,900	
アネスト岩田	23,200	916.00	21,251,200	
ダイフク	75,900	11,440.00	868,296,000	
サムコ	3,700	3,215.00	11,895,500	
加藤製作所	8,300	1,035.00	8,590,500	
油研工業	2,600	1,485.00	3,861,000	
タダノ	71,800	830.00	59,594,000	
フジテック	54,000	2,150.00	116,100,000	
C K D	40,700	2,140.00	87,098,000	
キトー	11,300	1,511.00	17,074,300	
平和	41,500	1,542.00	63,993,000	
理想科学工業	13,200	1,187.00	15,668,400	
S A N K Y O	33,100	2,658.00	87,979,800	
日本金銭機械	16,600	567.00	9,412,200	
マースグループホールディングス	9,500	1,630.00	15,485,000	
フクシマガリレイ	9,200	4,435.00	40,802,000	
オーイズミ	6,500	383.00	2,489,500	
ダイコク電機	6,900	894.00	6,168,600	
竹内製作所	24,900	2,427.00	60,432,300	
アマノ	38,900	2,434.00	94,682,600	
J U K I	20,700	516.00	10,681,200	
蛇の目マシン工業	13,600	734.00	9,982,400	
マックス	22,700	1,448.00	32,869,600	
グローリー	38,200	2,195.00	83,849,000	
新晃工業	13,900	1,636.00	22,740,400	
大和冷機工業	23,900	1,039.00	24,832,100	
セガサミーホールディングス	147,400	1,525.00	224,785,000	
日本ピストンリング	5,500	1,009.00	5,549,500	
リケン	6,900	2,317.00	15,987,300	
T P R	20,000	1,349.00	26,980,000	
ツバキ・ナカシマ	28,500	894.00	25,479,000	
ホシザキ	46,800	10,630.00	497,484,000	
大豊工業	12,300	592.00	7,281,600	
日本精工	279,700	877.00	245,296,900	

NTN	343,700	223.00	76,645,100
ジェイテクト	142,600	868.00	123,776,800
不二越	13,800	4,385.00	60,513,000
日本トムソン	44,300	343.00	15,194,900
THK	92,600	3,035.00	281,041,000
ユーシン精機	11,600	710.00	8,236,000
前澤給装工業	5,400	2,163.00	11,680,200
イーグル工業	18,500	879.00	16,261,500
前澤工業	10,100	477.00	4,817,700
日本ピラー工業	15,100	1,466.00	22,136,600
キッツ	60,300	548.00	33,044,400
マキタ	193,700	5,310.00	1,028,547,000
日立造船	118,100	424.00	50,074,400
三菱重工業	248,900	2,599.50	647,015,550
IHI	107,100	1,509.00	161,613,900
スター精密	22,900	1,480.00	33,892,000
日清紡ホールディングス	90,900	756.00	68,720,400
イビデン	91,100	4,320.00	393,552,000
コニカミノルタ	326,500	308.00	100,562,000
ブラザー工業	181,700	1,935.00	351,589,500
ミネベアミツミ	276,000	2,071.00	571,596,000
日立製作所	713,600	3,963.00	2,827,996,800
三菱電機	1,485,100	1,468.50	2,180,869,350
富士電機	89,500	3,385.00	302,957,500
東洋電機製造	5,500	1,098.00	6,039,000
安川電機	159,900	4,780.00	764,322,000
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,281.00	24,723,300
明電舎	27,400	1,666.00	45,648,400
オリジン	4,100	1,319.00	5,407,900
山洋電気	7,300	4,930.00	35,989,000
デンヨー	12,700	2,062.00	26,187,400
東芝テック	18,600	4,070.00	75,702,000
芝浦メカトロニクス	2,800	3,710.00	10,388,000
マブチモーター	41,200	4,485.00	184,782,000
日本電産	357,500	11,350.00	4,057,625,000
トレックス・セミコンダクター	9,000	1,230.00	11,070,000
東光高岳	8,800	1,154.00	10,155,200
ダイヘン	16,300	4,205.00	68,541,500
ヤーマン	24,500	2,188.00	53,606,000
JVCケンウッド	125,000	152.00	19,000,000
ミマキエンジニアリング	14,700	466.00	6,850,200
I-PEX	7,200	1,866.00	13,435,200

日新電機	34,900	1,137.00	39,681,300
大崎電気工業	29,700	562.00	16,691,400
オムロン	133,100	8,520.00	1,134,012,000
日東工業	21,900	1,900.00	41,610,000
I D E C	21,500	1,806.00	38,829,000
正興電機製作所	3,800	1,714.00	6,513,200
不二電機工業	2,900	1,295.00	3,755,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	49,900	2,348.00	117,165,200
サクサホールディングス	3,500	1,406.00	4,921,000
メルコホールディングス	5,300	2,998.00	15,889,400
テクノメディカ	3,700	1,540.00	5,698,000
日本電気	180,200	5,550.00	1,000,110,000
富士通	143,200	13,520.00	1,936,064,000
沖電気工業	60,400	905.00	54,662,000
岩崎通信機	6,500	840.00	5,460,000
電気興業	7,200	2,847.00	20,498,400
サンケン電気	16,200	3,660.00	59,292,000
ナカヨ	2,900	1,437.00	4,167,300
アイホン	8,500	1,550.00	13,175,000
ルネサスエレクトロニクス	636,300	900.00	572,670,000
セイコーエプソン	184,300	1,452.00	267,603,600
ワコム	100,700	720.00	72,504,000
アルバック	27,300	3,880.00	105,924,000
アクセル	7,000	787.00	5,509,000
E I Z O	11,600	3,450.00	40,020,000
日本信号	37,900	917.00	34,754,300
京三製作所	35,000	418.00	14,630,000
能美防災	19,900	2,385.00	47,461,500
ホーチキ	11,300	1,276.00	14,418,800
星和電機	8,300	625.00	5,187,500
エレコム	17,200	4,415.00	75,938,000
パナソニック	1,696,800	1,086.50	1,843,573,200
シャープ	171,900	1,290.00	221,751,000
アンリツ	95,700	2,325.00	222,502,500
富士通ゼネラル	40,300	3,090.00	124,527,000
ソニー	930,300	9,249.00	8,604,344,700
T D K	71,700	13,620.00	976,554,000
帝国通信工業	7,100	1,152.00	8,179,200
タムラ製作所	49,800	511.00	25,447,800
アルプスアルパイン	131,900	1,355.00	178,724,500
池上通信機	4,700	794.00	3,731,800
鈴木	8,000	898.00	7,184,000

日本トリム	2,200	3,865.00	8,503,000
ローランド ディー・ジー	9,100	1,562.00	14,214,200
フォスター電機	15,700	1,106.00	17,364,200
S M K	3,800	2,804.00	10,655,200
ヨコオ	9,900	2,301.00	22,779,900
ホシデン	41,300	849.00	35,063,700
ヒロセ電機	22,900	14,360.00	328,844,000
日本航空電子工業	34,100	1,427.00	48,660,700
T O A	16,000	918.00	14,688,000
マクセルホールディングス	32,500	1,116.00	36,270,000
古野電気	19,700	1,113.00	21,926,100
ユニデンホールディングス	4,100	2,217.00	9,089,700
スミダコーポレーション	13,300	931.00	12,382,300
アイコム	8,300	2,811.00	23,331,300
リオン	6,500	2,745.00	17,842,500
本多通信工業	14,000	464.00	6,496,000
横河電機	136,300	1,849.00	252,018,700
新電元工業	5,300	2,302.00	12,200,600
アズビル	93,800	4,580.00	429,604,000
東亜ディーケーケー	8,100	858.00	6,949,800
日本光電工業	61,600	3,355.00	206,668,000
チノー	5,200	1,418.00	7,373,600
共和電業	15,800	424.00	6,699,200
日本電子材料	5,900	1,436.00	8,472,400
堀場製作所	29,400	5,540.00	162,876,000
アドバンテスト	110,400	7,040.00	777,216,000
小野測器	7,400	528.00	3,907,200
エスペック	13,500	1,763.00	23,800,500
キーエンス	134,600	52,310.00	7,040,926,000
日置電機	7,300	3,785.00	27,630,500
シスメックス	106,200	10,055.00	1,067,841,000
日本マイクロニクス	26,500	965.00	25,572,500
メガチップス	14,000	2,698.00	37,772,000
O B A R A G R O U P	8,800	3,315.00	29,172,000
澤藤電機	2,100	1,808.00	3,796,800
原田工業	7,700	865.00	6,660,500
コーセル	20,400	1,001.00	20,420,400
イリソ電子工業	12,600	4,450.00	56,070,000
オブテックスグループ	24,700	1,714.00	42,335,800
千代田インテグレ	6,600	1,526.00	10,071,600
アイ・オー・データ機器	5,400	972.00	5,248,800
レーザーテック	65,300	9,860.00	643,858,000

スタンレー電気	104,300	2,969.00	309,666,700
岩崎電気	6,200	1,315.00	8,153,000
ウシオ電機	82,500	1,297.00	107,002,500
岡谷電機産業	13,400	341.00	4,569,400
ハリオス テクノ ホールディング	15,700	301.00	4,725,700
エノモト	4,900	1,262.00	6,183,800
日本セラミック	15,300	2,883.00	44,109,900
遠藤照明	8,600	561.00	4,824,600
古河電池	11,100	1,232.00	13,675,200
双信電機	8,700	410.00	3,567,000
山一電機	11,200	1,337.00	14,974,400
図研	9,900	2,625.00	25,987,500
日本電子	29,500	3,680.00	108,560,000
カシオ計算機	131,400	2,021.00	265,559,400
ファナック	139,700	24,585.00	3,434,524,500
日本シイエムケイ	36,300	411.00	14,919,300
エンプラス	7,800	2,549.00	19,882,200
大真空	5,700	1,957.00	11,154,900
ローム	61,800	8,420.00	520,356,000
浜松ホトニクス	106,600	5,650.00	602,290,000
三井ハイテック	16,600	2,459.00	40,819,400
新光電気工業	50,200	1,941.00	97,438,200
京セラ	209,000	5,982.00	1,250,238,000
太陽誘電	66,200	4,180.00	276,716,000
村田製作所	436,300	8,161.00	3,560,644,300
双葉電子工業	24,200	873.00	21,126,600
北陸電気工業	6,600	916.00	6,045,600
ニチコン	51,000	986.00	50,286,000
日本ケミコン	11,500	1,369.00	15,743,500
K O A	22,900	1,319.00	30,205,100
市光工業	23,400	514.00	12,027,600
小糸製作所	89,100	6,250.00	556,875,000
ミツバ	27,300	472.00	12,885,600
S C R E E Nホールディングス	25,800	6,200.00	159,960,000
キャノン電子	14,100	1,435.00	20,233,500
キャノン	738,000	1,903.50	1,404,783,000
リコー	378,000	659.00	249,102,000
象印マホービン	40,500	1,923.00	77,881,500
M U T O Hホールディングス	2,300	1,479.00	3,401,700
東京エレクトロン	94,200	31,800.00	2,995,560,000
トヨタ紡織	43,300	1,425.00	61,702,500
芦森工業	3,200	932.00	2,982,400

ユニプレス	28,900	881.00	25,460,900
豊田自動織機	120,200	7,360.00	884,672,000
モリタホールディングス	26,000	1,814.00	47,164,000
三櫻工業	19,000	609.00	11,571,000
デンソー	327,000	5,106.00	1,669,662,000
東海理化電機製作所	39,200	1,636.00	64,131,200
三井E & Sホールディングス	53,600	366.00	19,617,600
川崎重工業	115,600	1,588.00	183,572,800
名村造船所	47,800	149.00	7,122,200
日本車輛製造	5,400	2,439.00	13,170,600
三菱ロジスネクスト	19,700	991.00	19,522,700
近畿車輛	2,200	1,303.00	2,866,600
日産自動車	1,751,500	477.00	835,465,500
いすゞ自動車	430,300	956.00	411,366,800
トヨタ自動車	1,657,100	7,301.00	12,098,487,100
日野自動車	185,500	914.00	169,547,000
三菱自動車工業	549,700	191.00	104,992,700
エフテック	10,500	553.00	5,806,500
レシップホールディングス	5,800	539.00	3,126,200
G M B	2,800	623.00	1,744,400
ファルテック	2,700	589.00	1,590,300
武蔵精密工業	33,100	1,364.00	45,148,400
日産車体	29,000	928.00	26,912,000
新明和工業	40,000	852.00	34,080,000
極東開発工業	27,600	1,381.00	38,115,600
トピー工業	12,300	1,078.00	13,259,400
ティラド	5,400	1,324.00	7,149,600
曙ブレーキ工業	81,500	139.00	11,328,500
タチエス	24,400	1,109.00	27,059,600
N O K	79,900	1,185.00	94,681,500
フタバ産業	41,500	484.00	20,086,000
K Y B	16,600	2,502.00	41,533,200
大同メタル工業	28,600	499.00	14,271,400
プレス工業	73,900	295.00	21,800,500
ミクニ	19,100	293.00	5,596,300
太平洋工業	31,200	1,033.00	32,229,600
河西工業	20,300	350.00	7,105,000
アイシン精機	122,300	3,145.00	384,633,500
マツダ	437,000	629.00	274,873,000
今仙電機製作所	13,900	861.00	11,967,900
本田技研工業	1,169,300	2,961.50	3,462,881,950
スズキ	294,400	5,346.00	1,573,862,400

S U B A R U	461,000	2,145.00	988,845,000
安永	7,200	1,067.00	7,682,400
ヤマハ発動機	209,900	1,956.00	410,564,400
T B K	17,800	457.00	8,134,600
エクセディ	20,200	1,280.00	25,856,000
豊田合成	48,000	2,828.00	135,744,000
愛三工業	23,400	462.00	10,810,800
盟和産業	2,400	861.00	2,066,400
日本プラスト	11,800	441.00	5,203,800
ヨロズ	13,900	1,185.00	16,471,500
エフ・シー・シー	24,300	2,032.00	49,377,600
シマノ	55,600	23,380.00	1,299,928,000
テイ・エス テック	34,500	3,125.00	107,812,500
ジャムコ	7,400	690.00	5,106,000
テルモ	420,300	4,243.00	1,783,332,900
クリエートメディック	4,900	1,023.00	5,012,700
日機装	48,000	989.00	47,472,000
日本エム・ディ・エム	8,600	2,093.00	17,999,800
島津製作所	177,500	3,575.00	634,562,500
J M S	12,600	1,050.00	13,230,000
長野計器	10,800	780.00	8,424,000
ブイ・テクノロジー	7,000	5,310.00	37,170,000
東京計器	9,500	922.00	8,759,000
愛知時計電機	2,000	4,385.00	8,770,000
インターアクション	8,000	1,703.00	13,624,000
オーバル	13,400	234.00	3,135,600
東京精密	26,900	4,360.00	117,284,000
マニー	59,200	2,600.00	153,920,000
ニコン	226,800	701.00	158,986,800
トプコン	74,800	1,364.00	102,027,200
オリンパス	821,800	2,076.50	1,706,467,700
理研計器	13,100	2,961.00	38,789,100
タムロン	12,000	1,590.00	19,080,000
H O Y A	294,600	12,485.00	3,678,081,000
シード	6,400	593.00	3,795,200
ノーリツ鋼機	10,000	2,250.00	22,500,000
エー・アンド・デイ	13,600	842.00	11,451,200
朝日インテック	168,200	3,330.00	560,106,000
シチズン時計	174,100	290.00	50,489,000
リズム	4,700	640.00	3,008,000
大研医器	10,300	518.00	5,335,400
メニコン	21,000	6,970.00	146,370,000

シンシア	1,700	394.00	669,800
松風	6,700	1,607.00	10,766,900
セイコーホールディングス	21,000	1,423.00	29,883,000
ニプロ	102,800	1,149.00	118,117,200
中本パックス	3,800	1,568.00	5,958,400
スノーピーク	8,800	1,636.00	14,396,800
パラマウントベッドホールディングス	15,700	4,365.00	68,530,500
トランザクション	8,100	957.00	7,751,700
粧美堂	4,300	386.00	1,659,800
ニホンフラッシュ	13,900	1,297.00	18,028,300
前田工織	16,400	2,806.00	46,018,400
永大産業	19,400	289.00	5,606,600
アートネイチャー	15,900	656.00	10,430,400
バンダイナムコホールディングス	153,500	9,151.00	1,404,678,500
アイフィスジャパン	3,800	738.00	2,804,400
共立印刷	24,800	123.00	3,050,400
SHOEI	13,000	3,370.00	43,810,000
フランスベッドホールディングス	21,000	880.00	18,480,000
パイロットコーポレーション	26,300	3,025.00	79,557,500
萩原工業	8,200	1,608.00	13,185,600
トッパン・フォームズ	31,800	998.00	31,736,400
フジシールインターナショナル	33,300	2,013.00	67,032,900
タカラトミー	66,600	941.00	62,670,600
廣済堂	10,300	673.00	6,931,900
エステールホールディングス	4,000	614.00	2,456,000
タカノ	5,800	602.00	3,491,600
プロネクサス	12,700	1,093.00	13,881,100
ホクシン	9,200	115.00	1,058,000
ウッドワン	5,000	1,184.00	5,920,000
大建工業	10,000	1,947.00	19,470,000
凸版印刷	209,600	1,493.00	312,932,800
大日本印刷	194,400	2,003.00	389,383,200
共同印刷	4,600	2,937.00	13,510,200
NISSHA	30,500	1,293.00	39,436,500
光村印刷	1,300	1,737.00	2,258,100
TAKARA & COMPANY	7,200	2,014.00	14,500,800
アシックス	131,300	1,779.00	233,582,700
ツツミ	4,600	2,198.00	10,110,800
小松ウオール工業	4,500	1,726.00	7,767,000
ヤマハ	88,300	5,740.00	506,842,000
河合楽器製作所	4,600	2,530.00	11,638,000
クリナップ	13,800	443.00	6,113,400

ピジョン	95,400	4,695.00	447,903,000
オリバー	3,100	2,421.00	7,505,100
兼松サステック	1,000	1,614.00	1,614,000
キングジム	12,300	909.00	11,180,700
リンテック	35,300	2,172.00	76,671,600
イトーキ	29,500	330.00	9,735,000
任天堂	91,100	54,420.00	4,957,662,000
三菱鉛筆	24,500	1,447.00	35,451,500
タカラスタANDARD	30,700	1,444.00	44,330,800
コクヨ	71,200	1,420.00	101,104,000
ナカバヤシ	14,600	612.00	8,935,200
グローブライド	6,600	3,975.00	26,235,000
オカムラ	51,800	937.00	48,536,600
美津濃	13,500	1,865.00	25,177,500
東京電力ホールディングス	1,185,500	286.00	339,053,000
中部電力	454,300	1,312.00	596,041,600
関西電力	562,700	994.80	559,773,960
中国電力	214,200	1,400.00	299,880,000
北陸電力	135,800	788.00	107,010,400
東北電力	371,000	948.00	351,708,000
四国電力	133,700	779.00	104,152,300
九州電力	306,100	959.00	293,549,900
北海道電力	139,000	410.00	56,990,000
沖縄電力	28,900	1,572.00	45,430,800
電源開発	118,200	1,476.00	174,463,200
エフオン	8,000	1,038.00	8,304,000
イーレックス	21,200	1,590.00	33,708,000
レノバ	24,900	2,282.00	56,821,800
東京瓦斯	285,600	2,610.50	745,558,800
大阪瓦斯	288,200	2,204.00	635,192,800
東邦瓦斯	73,000	6,710.00	489,830,000
北海道瓦斯	8,000	1,562.00	12,496,000
広島ガス	30,600	389.00	11,903,400
西部瓦斯	16,700	3,135.00	52,354,500
静岡ガス	42,200	986.00	41,609,200
メタウォーター	14,300	2,450.00	35,035,000
SBSホールディングス	11,000	2,436.00	26,796,000
東武鉄道	154,800	3,495.00	541,026,000
相鉄ホールディングス	47,500	2,724.00	129,390,000
東急	374,600	1,402.00	525,189,200
京浜急行電鉄	190,700	1,808.00	344,785,600
小田急電鉄	220,900	3,170.00	700,253,000

京王電鉄	77,100	7,830.00	603,693,000
京成電鉄	103,300	3,770.00	389,441,000
富士急行	20,200	5,070.00	102,414,000
新京成電鉄	3,800	2,241.00	8,515,800
東日本旅客鉄道	261,400	6,559.00	1,714,522,600
西日本旅客鉄道	132,300	5,112.00	676,317,600
東海旅客鉄道	123,500	14,665.00	1,811,127,500
西武ホールディングス	193,900	1,173.00	227,444,700
鴻池運輸	23,600	1,061.00	25,039,600
西日本鉄道	41,200	3,145.00	129,574,000
ハマキョウレックス	11,400	3,035.00	34,599,000
サカイ引越センター	7,800	5,240.00	40,872,000
近鉄グループホールディングス	140,700	4,820.00	678,174,000
阪急阪神ホールディングス	187,600	3,710.00	695,996,000
南海電気鉄道	66,700	2,805.00	187,093,500
京阪ホールディングス	62,600	4,675.00	292,655,000
神戸電鉄	3,300	3,680.00	12,144,000
名古屋鉄道	115,600	3,095.00	357,782,000
山陽電気鉄道	10,000	2,118.00	21,180,000
日本通運	48,700	7,190.00	350,153,000
ヤマトホールディングス	246,600	2,637.00	650,284,200
山九	39,100	4,070.00	159,137,000
丸運	8,000	251.00	2,008,000
丸全昭和運輸	11,400	3,180.00	36,252,000
センコーグループホールディングス	77,500	1,001.00	77,577,500
トナミホールディングス	3,400	5,910.00	20,094,000
ニッコンホールディングス	50,300	2,049.00	103,064,700
日本石油輸送	1,500	2,627.00	3,940,500
福山通運	18,000	4,895.00	88,110,000
セイノーホールディングス	105,300	1,593.00	167,742,900
エスライン	4,200	950.00	3,990,000
神奈川中央交通	3,500	3,975.00	13,912,500
日立物流	25,800	3,280.00	84,624,000
丸和運輸機関	14,800	4,285.00	63,418,000
C & F ロジホールディングス	14,200	1,805.00	25,631,000
九州旅客鉄道	123,300	2,335.00	287,905,500
S Gホールディングス	295,300	2,712.00	800,853,600
日本郵船	118,200	2,102.00	248,456,400
商船三井	89,500	2,585.00	231,357,500
川崎汽船	43,300	1,550.00	67,115,000
N S ユナイテッド海運	8,700	1,340.00	11,658,000
飯野海運	69,900	387.00	27,051,300

共栄タンカー	4,100	778.00	3,189,800
乾汽船	8,100	951.00	7,703,100
日本航空	270,400	1,960.00	529,984,000
A N Aホールディングス	257,100	2,564.00	659,204,400
パスコ	2,700	1,280.00	3,456,000
トランコム	3,900	8,300.00	32,370,000
日新	12,200	1,303.00	15,896,600
三菱倉庫	44,600	3,085.00	137,591,000
三井倉庫ホールディングス	16,100	1,976.00	31,813,600
住友倉庫	50,600	1,386.00	70,131,600
澁澤倉庫	7,700	2,224.00	17,124,800
東陽倉庫	25,400	326.00	8,280,400
日本トランスシティ	31,000	577.00	17,887,000
ケイヒン	2,700	1,385.00	3,739,500
中央倉庫	8,600	1,200.00	10,320,000
川西倉庫	2,600	1,104.00	2,870,400
安田倉庫	11,500	991.00	11,396,500
ファイズホールディングス	3,000	1,067.00	3,201,000
東洋埠頭	4,300	1,452.00	6,243,600
宇徳	12,000	476.00	5,712,000
上組	78,500	1,933.00	151,740,500
サンリツ	3,300	672.00	2,217,600
キムラユニティー	3,800	1,049.00	3,986,200
キューソー流通システム	3,500	1,752.00	6,132,000
近鉄エクスプレス	29,900	2,185.00	65,331,500
東海運	8,000	306.00	2,448,000
エーアイティー	9,900	988.00	9,781,200
内外トランスライン	4,900	1,217.00	5,963,300
日本コンセプト	4,500	1,789.00	8,050,500
N E C ネットエスアイ	41,500	1,831.00	75,986,500
クロスキャット	4,000	1,329.00	5,316,000
システナ	52,100	1,910.00	99,511,000
デジタルアーツ	7,200	8,800.00	63,360,000
日鉄ソリューションズ	21,900	3,015.00	66,028,500
キューブシステム	8,000	1,418.00	11,344,000
エイジア	2,800	2,031.00	5,686,800
コア	6,400	1,365.00	8,736,000
ラクーンホールディングス	7,100	2,052.00	14,569,200
ソリトンシステムズ	7,400	2,061.00	15,251,400
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	3,380.00	21,632,000
T I S	145,900	2,059.00	300,408,100
J N S ホールディングス	5,800	605.00	3,509,000

電算システム	5,600	3,210.00	17,976,000
グリー	89,900	564.00	50,703,600
コーエーテクモホールディングス	29,900	5,290.00	158,171,000
三菱総合研究所	6,300	4,245.00	26,743,500
電算	1,700	2,396.00	4,073,200
A G S	8,600	896.00	7,705,600
ファインデックス	12,500	1,252.00	15,650,000
ブレインパッド	3,800	3,795.00	14,421,000
K L a b	26,500	1,000.00	26,500,000
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,900	919.00	16,450,100
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	2,835.00	6,237,000
ネクソン	367,700	2,642.00	971,463,400
アイスタイル	41,400	450.00	18,630,000
エムアップホールディングス	4,300	2,632.00	11,317,600
エイチーム	10,400	915.00	9,516,000
エニグモ	14,000	1,243.00	17,402,000
テクノスジャパン	11,700	717.00	8,388,900
コロプラ	48,100	913.00	43,915,300
ブロードリーフ	72,700	626.00	45,510,200
クロス・マーケティンググループ	7,200	365.00	2,628,000
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,092.00	8,736,000
システム情報	11,200	1,089.00	12,196,800
メディアドゥ	4,800	6,860.00	32,928,000
じげん	37,000	328.00	12,136,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	803.00	2,890,800
サイバーリンクス	2,400	5,170.00	12,408,000
フィックスターズ	15,800	917.00	14,488,600
C A R T A H O L D I N G S	6,100	1,292.00	7,881,200
オブティム	7,700	3,020.00	23,254,000
セレス	4,900	2,254.00	11,044,600
S H I F T	6,200	14,540.00	90,148,000
ティーガイア	13,100	1,792.00	23,475,200
セック	2,200	2,970.00	6,534,000
日本アジアグループ	15,400	789.00	12,150,600
テクマトリックス	20,700	2,078.00	43,014,600
プロシップ	4,400	1,452.00	6,388,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	35,200	2,520.00	88,704,000
G M O ペイメントゲートウェイ	30,900	13,110.00	405,099,000
ザッパラス	6,900	474.00	3,270,600
システムリサーチ	4,000	1,573.00	6,292,000
インターネットイニシアティブ	21,600	4,925.00	106,380,000
さくらインターネット	16,000	719.00	11,504,000

ヴィンクス	4,300	1,213.00	5,215,900
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	9,450.00	31,185,000
SRAホールディングス	7,900	2,439.00	19,268,100
システムインテグレータ	5,000	711.00	3,555,000
朝日ネット	10,700	889.00	9,512,300
eBASE	17,700	943.00	16,691,100
アバント	14,200	1,029.00	14,611,800
アドソル日進	5,300	2,724.00	14,437,200
フリービット	7,900	909.00	7,181,100
コムチュア	16,500	2,971.00	49,021,500
サイバーコム	2,800	1,749.00	4,897,200
アステリア	9,200	970.00	8,924,000
アイル	8,300	1,336.00	11,088,800
マークラインズ	6,200	2,345.00	14,539,000
メディカル・データ・ビジョン	16,700	2,503.00	41,800,100
gumi	19,100	843.00	16,101,300
ショーケース	3,500	763.00	2,670,500
モバイルファクトリー	3,600	1,018.00	3,664,800
テラスカイ	5,300	4,340.00	23,002,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,404.00	8,283,600
PCIホールディングス	5,700	1,269.00	7,233,300
パイプドHD	2,100	1,622.00	3,406,200
アイビーシー	2,600	1,126.00	2,927,600
ネオジャパン	2,900	2,387.00	6,922,300
PR TIMES	2,600	3,130.00	8,138,000
ランドコンピュータ	2,500	1,125.00	2,812,500
ダブルスタンダード	1,900	4,345.00	8,255,500
オープンドア	7,400	1,210.00	8,954,000
マイネット	4,800	961.00	4,612,800
アカツキ	5,200	4,910.00	25,532,000
ベネフィットジャパン	1,200	2,091.00	2,509,200
Ubicomホールディングス	3,300	2,931.00	9,672,300
LINE	33,800	5,370.00	181,506,000
カナミックネットワーク	13,700	766.00	10,494,200
ノムラシステムコーポレーション	7,100	406.00	2,882,600
チェンジ	10,200	8,100.00	82,620,000
シンクロ・フード	7,100	304.00	2,158,400
オークネット	7,900	1,389.00	10,973,100
セグエグループ	3,900	1,294.00	5,046,600
エイトレッド	2,500	2,615.00	6,537,500
AOI TYO Holdings	15,400	406.00	6,252,400
マクロミル	30,200	641.00	19,358,200

ビーグリー	3,000	1,851.00	5,553,000
オロ	4,700	3,290.00	15,463,000
ユーザーローカル	1,500	3,705.00	5,557,500
テモナ	3,300	1,222.00	4,032,600
ニーズウェル	3,100	896.00	2,777,600
サインポスト	3,400	918.00	3,121,200
ソルクシーズ	5,800	1,045.00	6,061,000
フェイス	5,500	788.00	4,334,000
プロトコーポレーション	13,300	1,072.00	14,257,600
ハイマックス	3,700	1,130.00	4,181,000
野村総合研究所	206,700	3,440.00	711,048,000
サイバネットシステム	10,700	861.00	9,212,700
C Eホールディングス	8,100	644.00	5,216,400
日本システム技術	2,500	1,536.00	3,840,000
インテージホールディングス	18,500	1,029.00	19,036,500
東邦システムサイエンス	4,200	926.00	3,889,200
ソースネクスト	70,000	315.00	22,050,000
インフォコム	16,000	3,470.00	55,520,000
HEROZ	2,200	2,942.00	6,472,400
ラクスル	11,800	5,040.00	59,472,000
F I G	16,900	269.00	4,546,100
システムサポート	3,500	1,427.00	4,994,500
イーソル	8,100	1,424.00	11,534,400
アルテリア・ネットワークス	16,300	1,600.00	26,080,000
東海ソフト	1,300	1,100.00	1,430,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,442.00	3,893,400
東名	1,000	1,184.00	1,184,000
ヴィッツ	700	2,787.00	1,950,900
トピラシステムズ	1,600	1,624.00	2,598,400
L i n k - U	1,100	1,668.00	1,834,800
フォーカスシステムズ	9,300	891.00	8,286,300
クレスコ	9,100	1,246.00	11,338,600
フジ・メディア・ホールディングス	140,700	1,056.00	148,579,200
オービック	50,500	21,080.00	1,064,540,000
ジャストシステム	23,700	6,830.00	161,871,000
T D Cソフト	13,000	1,024.00	13,312,000
Zホールディングス	2,001,800	613.10	1,227,303,580
トレンドマイクロ	77,800	5,340.00	415,452,000
I Dホールディングス	5,800	1,232.00	7,145,600
日本オラクル	29,600	11,540.00	341,584,000
アルファシステムズ	4,600	3,385.00	15,571,000
フューチャー	17,800	1,794.00	31,933,200

CAC Holdings	9,700	1,403.00	13,609,100
S Bテクノロジー	5,300	3,450.00	18,285,000
トーセ	4,300	877.00	3,771,100
オービックビジネスコンサルタント	14,900	6,850.00	102,065,000
伊藤忠テクノソリューションズ	66,500	3,670.00	244,055,000
アイティフォー	18,000	902.00	16,236,000
東計電算	2,200	4,260.00	9,372,000
エクスネット	2,600	967.00	2,514,200
大塚商会	78,900	4,890.00	385,821,000
サイボウズ	17,100	2,863.00	48,957,300
電通国際情報サービス	9,100	6,080.00	55,328,000
ACCESS	14,000	782.00	10,948,000
デジタルガレージ	26,300	4,005.00	105,331,500
EMシステムズ	21,000	819.00	17,199,000
ウェザーニューズ	5,000	5,570.00	27,850,000
C I J	10,200	919.00	9,373,800
ビジネスエンジニアリング	1,700	3,340.00	5,678,000
日本エンタープライズ	16,100	227.00	3,654,700
WOWOW	7,100	2,782.00	19,752,200
スカラ	10,100	789.00	7,968,900
インテリジェント ウェイブ	8,900	689.00	6,132,100
IMAGICA GROUP	13,100	402.00	5,266,200
ネットワンシステムズ	55,600	3,515.00	195,434,000
システムソフト	34,600	91.00	3,148,600
アルゴグラフィックス	12,500	3,255.00	40,687,500
マーベラス	22,600	824.00	18,622,400
エイベックス	25,300	1,021.00	25,831,300
日本ユニシス	45,600	3,585.00	163,476,000
兼松エレクトロニクス	8,000	4,190.00	33,520,000
都築電気	4,800	1,523.00	7,310,400
TBSホールディングス	88,800	1,804.00	160,195,200
日本テレビホールディングス	121,900	1,154.00	140,672,600
朝日放送グループホールディングス	14,900	708.00	10,549,200
テレビ朝日ホールディングス	40,200	1,755.00	70,551,000
スカパーJSATホールディングス	96,500	475.00	45,837,500
テレビ東京ホールディングス	12,100	2,459.00	29,753,900
日本BS放送	5,200	1,071.00	5,569,200
ビジョン	18,400	1,060.00	19,504,000
スマートバリュー	4,100	1,000.00	4,100,000
ワイヤレスゲート	6,400	610.00	3,904,000
コネクシオ	8,500	1,214.00	10,319,000
クロップス	3,000	778.00	2,334,000

日本電信電話	1,948,100	2,486.50	4,843,950,650
K D D I	1,062,500	3,092.00	3,285,250,000
ソフトバンク	1,324,600	1,289.50	1,708,071,700
光通信	15,000	23,970.00	359,550,000
エムティーアイ	14,500	781.00	11,324,500
G M Oインターネット	52,300	2,723.00	142,412,900
ファイバーゲート	4,800	2,150.00	10,320,000
アйдママーケティングコミュニケーション	5,100	382.00	1,948,200
K A D O K A W A	39,300	3,100.00	121,830,000
学研ホールディングス	19,700	1,505.00	29,648,500
ゼンリン	29,300	1,268.00	37,152,400
昭文社ホールディングス	7,300	494.00	3,606,200
インプレスホールディングス	12,100	169.00	2,044,900
アイネット	7,700	1,485.00	11,434,500
松竹	9,700	13,430.00	130,271,000
東宝	86,100	4,565.00	393,046,500
東映	5,500	17,150.00	94,325,000
エヌ・ティ・ティ・データ	388,200	1,375.00	533,775,000
ピー・シー・エー	2,600	4,515.00	11,739,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,467.00	7,628,400
D T S	32,700	2,188.00	71,547,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,200	5,490.00	341,478,000
シーイーシー	15,800	1,489.00	23,526,200
カブコン	68,800	5,340.00	367,392,000
アイ・エス・ビー	3,500	2,570.00	8,995,000
ジャステック	9,500	1,525.00	14,487,500
S C S K	33,700	5,820.00	196,134,000
日本システムウエア	5,000	2,054.00	10,270,000
アイネス	14,500	1,420.00	20,590,000
T K C	12,400	6,610.00	81,964,000
富士ソフト	15,600	5,150.00	80,340,000
N S D	47,000	1,954.00	91,838,000
コナミホールディングス	53,000	5,210.00	276,130,000
福井コンピュータホールディングス	5,800	3,345.00	19,401,000
J B C Cホールディングス	10,000	1,467.00	14,670,000
ミロク情報サービス	13,000	2,061.00	26,793,000
ソフトバンクグループ	1,156,300	6,577.00	7,604,985,100
ハウスイ	1,200	1,017.00	1,220,400
高千穂交易	5,700	1,042.00	5,939,400
カワニシホールディングス	1,800	1,409.00	2,536,200
伊藤忠食品	3,600	5,480.00	19,728,000
エレマテック	13,700	963.00	13,193,100

JALUX	4,100	1,387.00	5,686,700
あらた	11,600	4,835.00	56,086,000
トーメンデバイス	2,200	3,480.00	7,656,000
東京エレクトロン デバイス	5,300	2,981.00	15,799,300
フィールズ	11,200	382.00	4,278,400
双日	807,900	233.00	188,240,700
アルフレッサ ホールディングス	162,600	2,108.00	342,760,800
横浜冷凍	38,300	894.00	34,240,200
ラサ商事	7,800	894.00	6,973,200
アルコニクス	15,600	1,343.00	20,950,800
神戸物産	100,900	3,185.00	321,366,500
ハイパー	2,300	569.00	1,308,700
あい ホールディングス	20,900	1,965.00	41,068,500
ディーブイエックス	5,200	1,068.00	5,553,600
ダイワボウホールディングス	12,400	6,080.00	75,392,000
マクニカ・富士エレホールディングス	34,900	1,996.00	69,660,400
ラクト・ジャパン	6,400	2,934.00	18,777,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,600	931.00	25,695,600
八洲電機	11,300	925.00	10,452,500
メディアスホールディングス	8,300	919.00	7,627,700
レスターホールディングス	15,300	2,207.00	33,767,100
ジューテックホールディングス	3,400	1,012.00	3,440,800
大光	6,200	708.00	4,389,600
OCHIホールディングス	4,300	1,276.00	5,486,800
TOKAIホールディングス	77,300	1,043.00	80,623,900
黒谷	4,000	611.00	2,444,000
Cominix	2,600	722.00	1,877,200
三洋貿易	14,700	964.00	14,170,800
ビューティガレージ	2,400	2,923.00	7,015,200
ウイン・パートナーズ	10,600	1,066.00	11,299,600
ミタチ産業	4,400	654.00	2,877,600
シップヘルスケアホールディングス	23,400	5,000.00	117,000,000
明治電機工業	4,600	1,383.00	6,361,800
デリカフーズホールディングス	5,200	614.00	3,192,800
スターティアホールディングス	3,300	729.00	2,405,700
コメダホールディングス	31,900	1,806.00	57,611,400
ピーバンドットコム	1,500	904.00	1,356,000
アセンテック	3,100	1,947.00	6,035,700
富士興産	4,500	852.00	3,834,000
協栄産業	1,600	1,308.00	2,092,800
小野建	13,100	1,269.00	16,623,900
南陽	3,200	1,765.00	5,648,000

佐島電機	10,000	814.00	8,140,000	
エコートレーディング	3,400	609.00	2,070,600	
伯東	8,900	1,049.00	9,336,100	
コンドーテック	11,300	1,044.00	11,797,200	
中山福	8,400	515.00	4,326,000	
ナガイレーベン	19,400	2,688.00	52,147,200	
三菱食品	16,100	2,796.00	45,015,600	
松田産業	10,700	1,626.00	17,398,200	
第一興商	21,800	3,540.00	77,172,000	
メディバルホールディングス	157,900	1,975.00	311,852,500	
S P K	6,300	1,290.00	8,127,000	
萩原電気ホールディングス	5,400	2,434.00	13,143,600	
アズワン	9,500	14,800.00	140,600,000	
スズデン	5,100	1,191.00	6,074,100	
尾家産業	4,300	1,451.00	6,239,300	
シモジマ	9,000	1,418.00	12,762,000	
ドウシシャ	13,800	1,958.00	27,020,400	
小津産業	3,200	1,828.00	5,849,600	
高速	8,700	1,554.00	13,519,800	
たけびし	5,100	1,458.00	7,435,800	
リックス	3,300	1,626.00	5,365,800	
丸文	13,000	478.00	6,214,000	
ハピネット	12,200	1,459.00	17,799,800	
橋本総業ホールディングス	3,000	2,388.00	7,164,000	
日本ライフライン	43,300	1,384.00	59,927,200	
タカショー	9,500	789.00	7,495,500	
マルカ	4,700	2,189.00	10,288,300	
I D O M	39,500	612.00	24,174,000	
進和	8,700	2,036.00	17,713,200	
エスケイジャパン	3,200	440.00	1,408,000	
ダイトロン	6,200	1,371.00	8,500,200	
シークス	18,600	1,568.00	29,164,800	
田中商事	4,500	700.00	3,150,000	
オーハシテクニカ	7,500	1,378.00	10,335,000	
白銅	5,300	1,389.00	7,361,700	
ダイコー通産	900	1,419.00	1,277,100	
伊藤忠商事	1,023,100	2,757.00	2,820,686,700	
丸紅	1,522,500	610.70	929,790,750	
高島	2,300	1,655.00	3,806,500	
長瀬産業	82,300	1,375.00	113,162,500	
蝶理	9,400	1,563.00	14,692,200	
豊田通商	163,300	3,450.00	563,385,000	

三共生興	22,200	418.00	9,279,600
兼松	54,500	1,239.00	67,525,500
ツカモトコーポレーション	2,600	1,350.00	3,510,000
三井物産	1,266,400	1,877.50	2,377,666,000
日本紙パルプ商事	8,300	3,770.00	31,291,000
カメイ	19,100	1,185.00	22,633,500
東都水産	1,900	4,550.00	8,645,000
OUGホールディングス	2,300	2,866.00	6,591,800
スターゼン	5,400	4,305.00	23,247,000
山善	57,200	1,000.00	57,200,000
椿本興業	2,700	3,450.00	9,315,000
住友商事	922,900	1,328.50	1,226,072,650
内田洋行	5,800	5,130.00	29,754,000
三菱商事	959,100	2,535.00	2,431,318,500
第一実業	7,200	3,785.00	27,252,000
キャノンマーケティングジャパン	36,300	2,206.00	80,077,800
西華産業	8,300	1,244.00	10,325,200
佐藤商事	12,100	1,004.00	12,148,400
菱洋エレクトロ	14,800	2,970.00	43,956,000
東京産業	13,300	563.00	7,487,900
ユアサ商事	13,900	3,025.00	42,047,500
神鋼商事	3,700	1,883.00	6,967,100
トルク	8,800	299.00	2,631,200
阪和興業	27,300	2,368.00	64,646,400
正栄食品工業	9,500	3,850.00	36,575,000
カナデン	11,900	1,290.00	15,351,000
菱電商事	10,500	1,514.00	15,897,000
フルサト工業	8,100	1,264.00	10,238,400
岩谷産業	34,300	5,190.00	178,017,000
ナイス	6,200	1,504.00	9,324,800
昭光通商	4,700	598.00	2,810,600
ニチモウ	2,300	1,949.00	4,482,700
極東貿易	4,200	1,436.00	6,031,200
イワキ	19,300	525.00	10,132,500
三愛石油	36,000	1,192.00	42,912,000
稲畑産業	32,200	1,367.00	44,017,400
G S I クレオス	3,600	1,771.00	6,375,600
明和産業	13,600	394.00	5,358,400
クワザワホールディングス	5,200	563.00	2,927,600
ヤマエ久野	10,700	1,258.00	13,460,600
ワキタ	31,200	1,145.00	35,724,000
東邦ホールディングス	46,900	1,989.00	93,284,100

サンゲツ	39,500	1,526.00	60,277,000
ミツウロコグループホールディングス	21,600	1,290.00	27,864,000
シナネンホールディングス	6,000	2,969.00	17,814,000
伊藤忠エネクス	32,400	962.00	31,168,800
サンリオ	41,100	1,658.00	68,143,800
サンワテクノス	10,400	868.00	9,027,200
リョーサン	16,200	1,937.00	31,379,400
新光商事	21,900	824.00	18,045,600
トーヨー	6,600	2,005.00	13,233,000
三信電気	7,900	2,112.00	16,684,800
東陽テクニカ	15,700	1,089.00	17,097,300
モスフードサービス	19,200	2,812.00	53,990,400
加賀電子	14,600	2,001.00	29,214,600
ソーダニッカ	15,100	542.00	8,184,200
立花エレテック	10,800	1,698.00	18,338,400
フォーバル	6,400	898.00	5,747,200
PALTAC	23,400	5,800.00	135,720,000
三谷産業	19,300	423.00	8,163,900
西本Wismettacホールディングス	3,300	2,143.00	7,071,900
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,445.00	1,878,500
コア商事ホールディングス	2,800	1,695.00	4,746,000
国際紙パルプ商事	34,700	251.00	8,709,700
ヤマタネ	7,300	1,351.00	9,862,300
丸紅建材リース	1,400	1,727.00	2,417,800
日鉄物産	10,400	3,250.00	33,800,000
泉州電業	4,100	2,912.00	11,939,200
トラスコ中山	33,500	2,759.00	92,426,500
オートバックスセブン	54,300	1,338.00	72,653,400
モリト	10,700	631.00	6,751,700
加藤産業	21,100	3,600.00	75,960,000
北恵	3,700	939.00	3,474,300
イノテック	7,600	897.00	6,817,200
イエローハット	27,600	1,596.00	44,049,600
JKホールディングス	13,300	807.00	10,733,100
日伝	13,200	2,366.00	31,231,200
北沢産業	11,100	278.00	3,085,800
杉本商事	7,900	2,231.00	17,624,900
因幡電機産業	41,600	2,503.00	104,124,800
東テク	4,800	2,539.00	12,187,200
ミスミグループ本社	183,400	3,300.00	605,220,000
アルテック	10,800	293.00	3,164,400
タキヒヨー	4,400	1,940.00	8,536,000

蔵王産業	2,800	1,352.00	3,785,600	
スズケン	62,000	3,895.00	241,490,000	
ジェコス	10,100	958.00	9,675,800	
グローセル	14,700	415.00	6,100,500	
ローソン	37,000	5,000.00	185,000,000	
サンエー	12,200	4,190.00	51,118,000	
カワチ薬品	11,400	3,190.00	36,366,000	
エービーシー・マート	22,900	5,940.00	136,026,000	
ハードオフコーポレーション	6,200	665.00	4,123,000	
アスクル	15,400	3,885.00	59,829,000	
ゲオホールディングス	26,500	1,311.00	34,741,500	
アダストリア	20,400	1,761.00	35,924,400	
くら寿司	8,600	5,580.00	47,988,000	
キャンドゥ	7,100	1,958.00	13,901,800	
パルグループホールディングス	15,100	1,182.00	17,848,200	
エディオン	67,400	994.00	66,995,600	
サーラコーポレーション	30,100	595.00	17,909,500	
ワッツ	6,700	782.00	5,239,400	
ハローズ	5,600	3,495.00	19,572,000	
フジオフードグループ本社	12,300	1,427.00	17,552,100	
あみやき亭	3,200	2,904.00	9,292,800	
ひらまつ	26,900	192.00	5,164,800	
大黒天物産	3,500	5,630.00	19,705,000	
ハニーズホールディングス	13,100	978.00	12,811,800	
ファーマライズホールディングス	3,800	820.00	3,116,000	
アルペン	11,300	2,370.00	26,781,000	
ハブ	4,600	595.00	2,737,000	
クオールホールディングス	21,700	1,120.00	24,304,000	
ジinzホールディングス	7,800	7,210.00	56,238,000	
ビックカメラ	87,000	1,149.00	99,963,000	
D C Mホールディングス	89,700	1,183.00	106,115,100	
Monotaro	104,000	5,660.00	588,640,000	
東京一番フーズ	4,100	574.00	2,353,400	
きちりホールディングス	4,300	647.00	2,782,100	
アーランドサービスホールディングス	12,300	2,008.00	24,698,400	
J．フロント リテイリング	174,900	856.00	149,714,400	
ドトール・日レスホールディングス	21,200	1,518.00	32,181,600	
マツモトキヨシホールディングス	60,500	4,805.00	290,702,500	
broncoピリー	7,700	2,364.00	18,202,800	
Z O Z O	100,700	2,471.00	248,829,700	
トレジャー・ファクトリー	4,600	711.00	3,270,600	
物語コーポレーション	3,900	12,090.00	47,151,000	

ココカラファイン	15,300	7,190.00	110,007,000
三越伊勢丹ホールディングス	256,200	595.00	152,439,000
H a m e e	5,400	1,613.00	8,710,200
ウエルシアホールディングス	87,100	4,190.00	364,949,000
クリエイトSDホールディングス	24,700	3,675.00	90,772,500
丸善CHIホールディングス	17,100	366.00	6,258,600
ティーライフ	2,400	1,161.00	2,786,400
チムニー	4,600	1,286.00	5,915,600
シュッピン	10,200	793.00	8,088,600
オイシックス・ラ・大地	14,500	3,140.00	45,530,000
ネクステージ	24,700	1,269.00	31,344,300
ジョイフル本田	43,000	1,495.00	64,285,000
鳥貴族	4,500	1,363.00	6,133,500
ホットランド	11,100	1,232.00	13,675,200
すかいらーくホールディングス	164,100	1,576.00	258,621,600
SFPホールディングス	8,500	1,266.00	10,761,000
綿半ホールディングス	11,100	1,420.00	15,762,000
ヨシックス	2,500	1,701.00	4,252,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,700	1,120.00	47,824,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,800	1,001.00	7,807,800
B E E N O S	6,900	2,450.00	16,905,000
あさひ	11,000	1,559.00	17,149,000
日本調剤	9,000	1,580.00	14,220,000
コスモス薬品	12,900	17,680.00	228,072,000
トーエル	7,400	780.00	5,772,000
オンリー	3,000	484.00	1,452,000
セブン&アイ・ホールディングス	572,300	3,345.00	1,914,343,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	78,600	557.00	43,780,200
ツルハホールディングス	31,900	15,370.00	490,303,000
サンマルクホールディングス	11,700	1,494.00	17,479,800
フェリシモ	3,400	1,295.00	4,403,000
トリドールホールディングス	36,300	1,401.00	50,856,300
T O K Y O B A S E	13,700	467.00	6,397,900
ウイルプラスホールディングス	2,200	642.00	1,412,400
JMホールディングス	11,200	2,378.00	26,633,600
サツドラホールディングス	2,300	2,060.00	4,738,000
アレンザホールディングス	7,500	1,427.00	10,702,500
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,673.00	6,692,000
パロックジャパンリミテッド	10,500	648.00	6,804,000
クスリのアオキホールディングス	13,100	8,910.00	116,721,000
力の源ホールディングス	6,600	595.00	3,927,000

スシローグローバルホールディングス	80,300	3,200.00	256,960,000	
メディカルシステムネットワーク	14,500	648.00	9,396,000	
はるやまホールディングス	7,200	681.00	4,903,200	
ノジマ	26,100	2,911.00	75,977,100	
カップ・クリエイト	20,500	1,430.00	29,315,000	
ライトオン	10,900	639.00	6,965,100	
良品計画	194,300	2,260.00	439,118,000	
三城ホールディングス	16,400	281.00	4,608,400	
アドヴァン	22,500	1,350.00	30,375,000	
アルビス	5,600	2,471.00	13,837,600	
コナカ	18,300	244.00	4,465,200	
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,673.00	3,178,700	
G - 7ホールディングス	8,700	2,300.00	20,010,000	
イオン北海道	19,500	920.00	17,940,000	
コジマ	25,500	714.00	18,207,000	
ヒマラヤ	5,400	915.00	4,941,000	
コーナン商事	20,900	3,275.00	68,447,500	
エコス	5,500	2,261.00	12,435,500	
ワタミ	17,500	978.00	17,115,000	
マルシェ	4,300	529.00	2,274,700	
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	321,700	2,532.00	814,544,400	
西松屋チェーン	32,200	1,759.00	56,639,800	
ゼンショーホールディングス	70,200	2,711.00	190,312,200	
幸楽苑ホールディングス	9,300	1,799.00	16,730,700	
ハークスレイ	3,300	910.00	3,003,000	
サイゼリヤ	21,800	1,828.00	39,850,400	
V Tホールディングス	61,200	368.00	22,521,600	
魚力	4,200	1,679.00	7,051,800	
フジ・コーポレーション	4,000	2,377.00	9,508,000	
ユナイテッドアローズ	15,500	1,417.00	21,963,500	
ハイデイ日高	21,200	1,726.00	36,591,200	
京都きもの友禅	10,400	226.00	2,350,400	
コロナイド	48,600	1,579.00	76,739,400	
ピーシーデポコーポレーション	19,800	603.00	11,939,400	
壱番屋	10,300	5,300.00	54,590,000	
P L A N T	4,000	766.00	3,064,000	
スギホールディングス	29,200	6,980.00	203,816,000	
薬王堂ホールディングス	6,500	2,515.00	16,347,500	
スクロール	22,800	704.00	16,051,200	
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,883.00	28,245,000	
木曽路	19,200	2,459.00	47,212,800	
S R Sホールディングス	17,500	899.00	15,732,500	

タカキュー	11,300	138.00	1,559,400
リテールパートナーズ	19,500	1,480.00	28,860,000
ケーヨー	30,300	739.00	22,391,700
上新電機	17,300	2,521.00	43,613,300
日本瓦斯	23,200	5,510.00	127,832,000
ロイヤルホールディングス	25,500	1,870.00	47,685,000
いなげや	18,200	1,980.00	36,036,000
島忠	27,500	5,490.00	150,975,000
チヨダ	15,600	948.00	14,788,800
ライフコーポレーション	11,100	3,430.00	38,073,000
リンガーハット	18,000	2,276.00	40,968,000
MrMaxHD	20,400	808.00	16,483,200
テンアライド	13,500	353.00	4,765,500
AOKIホールディングス	29,800	463.00	13,797,400
オークワ	23,100	1,379.00	31,854,900
コメリ	22,700	2,893.00	65,671,100
青山商事	30,700	504.00	15,472,800
しまむら	17,000	11,270.00	191,590,000
はせがわ	8,600	296.00	2,545,600
高島屋	106,700	869.00	92,722,300
松屋	29,700	730.00	21,681,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,500	688.00	47,816,000
近鉄百貨店	5,700	3,360.00	19,152,000
丸井グループ	134,100	1,993.00	267,261,300
アクシアル リテイリング	12,200	4,705.00	57,401,000
イオン	562,900	3,021.00	1,700,520,900
イズミ	29,800	3,580.00	106,684,000
平和堂	29,800	2,115.00	63,027,000
フジ	17,700	1,938.00	34,302,600
ヤオコー	16,600	7,180.00	119,188,000
ゼビオホールディングス	18,000	820.00	14,760,000
ケーズホールディングス	141,300	1,287.00	181,853,100
Olympicグループ	7,800	1,027.00	8,010,600
日産東京販売ホールディングス	22,500	251.00	5,647,500
シルバーライフ	2,100	1,979.00	4,155,900
Genky DrugStores	6,500	4,070.00	26,455,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	736.00	2,649,600
ブックオフグループホールディングス	8,500	857.00	7,284,500
ギフト	1,500	1,733.00	2,599,500
アインホールディングス	18,000	7,330.00	131,940,000
元気寿司	3,800	2,338.00	8,884,400
ヤマダホールディングス	446,200	490.00	218,638,000

アークランドサカモト	23,000	1,825.00	41,975,000
ニトリホールディングス	63,300	21,135.00	1,337,845,500
グルメ杵屋	10,700	1,008.00	10,785,600
愛眼	11,700	226.00	2,644,200
ケーユーホールディングス	7,900	816.00	6,446,400
吉野家ホールディングス	48,200	1,940.00	93,508,000
松屋フーズホールディングス	7,100	3,450.00	24,495,000
サガミホールディングス	19,700	1,291.00	25,432,700
関西スーパーマーケット	12,300	1,240.00	15,252,000
王将フードサービス	10,800	5,970.00	64,476,000
プレナス	16,500	1,713.00	28,264,500
ミニストップ	11,000	1,418.00	15,598,000
アークス	30,000	2,207.00	66,210,000
パローホールディングス	32,500	2,571.00	83,557,500
ベルク	7,300	6,260.00	45,698,000
大庄	8,000	1,023.00	8,184,000
ファーストリテイリング	19,600	83,250.00	1,631,700,000
サンドラッグ	55,100	4,180.00	230,318,000
サックスパー ホールディングス	12,800	544.00	6,963,200
ヤマザワ	3,500	1,762.00	6,167,000
やまや	3,000	2,158.00	6,474,000
ベルーナ	31,700	925.00	29,322,500
島根銀行	3,900	648.00	2,527,200
じもとホールディングス	9,900	1,052.00	10,414,800
めぶきフィナンシャルグループ	761,100	230.00	175,053,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,800	1,173.00	23,225,400
九州フィナンシャルグループ	320,500	539.00	172,749,500
ゆうちょ銀行	415,000	901.00	373,915,000
富山第一銀行	34,900	290.00	10,121,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	836,600	384.00	321,254,400
西日本フィナンシャルホールディングス	97,500	717.00	69,907,500
関西みらいフィナンシャルグループ	86,000	539.00	46,354,000
三十三フィナンシャルグループ	13,600	1,350.00	18,360,000
第四北越フィナンシャルグループ	25,400	2,118.00	53,797,200
ひろぎんホールディングス	216,000	586.00	126,576,000
新生銀行	107,500	1,323.00	142,222,500
あおぞら銀行	87,300	1,836.00	160,282,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,019,900	461.10	4,620,175,890
りそなホールディングス	1,592,500	383.00	609,927,500
三井住友トラスト・ホールディングス	276,900	3,180.00	880,542,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,013,000	3,174.00	3,215,262,000
千葉銀行	488,800	609.00	297,679,200

群馬銀行	281,400	345.00	97,083,000	
武蔵野銀行	21,800	1,613.00	35,163,400	
千葉興業銀行	40,200	269.00	10,813,800	
筑波銀行	60,900	197.00	11,997,300	
七十七銀行	49,500	1,537.00	76,081,500	
青森銀行	11,300	2,440.00	27,572,000	
秋田銀行	9,400	1,431.00	13,451,400	
山形銀行	16,500	1,308.00	21,582,000	
岩手銀行	9,600	2,402.00	23,059,200	
東邦銀行	131,000	241.00	31,571,000	
東北銀行	7,000	1,036.00	7,252,000	
みちのく銀行	9,400	1,244.00	11,693,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	123,400	1,916.00	236,434,400	
静岡銀行	356,700	781.00	278,582,700	
十六銀行	18,400	2,082.00	38,308,800	
スルガ銀行	149,800	353.00	52,879,400	
八十二銀行	353,500	396.00	139,986,000	
山梨中央銀行	17,000	787.00	13,379,000	
大垣共立銀行	28,900	2,507.00	72,452,300	
福井銀行	12,500	1,956.00	24,450,000	
北國銀行	14,600	2,913.00	42,529,800	
清水銀行	6,000	1,793.00	10,758,000	
富山銀行	2,800	3,225.00	9,030,000	
滋賀銀行	29,400	2,440.00	71,736,000	
南都銀行	24,400	1,915.00	46,726,000	
百五銀行	131,800	335.00	44,153,000	
京都銀行	52,500	5,210.00	273,525,000	
紀陽銀行	51,900	1,663.00	86,309,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	97,500	1,069.00	104,227,500	
山陰合同銀行	86,900	564.00	49,011,600	
中国銀行	126,100	958.00	120,803,800	
鳥取銀行	5,000	1,199.00	5,995,000	
伊予銀行	209,000	705.00	147,345,000	
百十四銀行	15,600	1,696.00	26,457,600	
四国銀行	22,300	741.00	16,524,300	
阿波銀行	23,900	2,690.00	64,291,000	
大分銀行	8,400	2,440.00	20,496,000	
宮崎銀行	9,800	2,448.00	23,990,400	
佐賀銀行	8,900	1,377.00	12,255,300	
沖縄銀行	13,400	3,140.00	42,076,000	
琉球銀行	33,800	887.00	29,980,600	
セブン銀行	489,400	233.00	114,030,200	

みずほフィナンシャルグループ	1,990,400	1,406.50	2,799,497,600
高知銀行	5,300	758.00	4,017,400
山口フィナンシャルグループ	182,800	722.00	131,981,600
長野銀行	4,800	1,412.00	6,777,600
名古屋銀行	10,900	2,885.00	31,446,500
北洋銀行	220,800	239.00	52,771,200
愛知銀行	5,300	3,060.00	16,218,000
中京銀行	6,000	2,194.00	13,164,000
大光銀行	5,000	1,337.00	6,685,000
愛媛銀行	20,500	1,144.00	23,452,000
トマト銀行	5,700	1,077.00	6,138,900
京葉銀行	62,500	475.00	29,687,500
栃木銀行	70,800	182.00	12,885,600
北日本銀行	4,600	1,979.00	9,103,400
東和銀行	25,700	673.00	17,296,100
福島銀行	13,800	225.00	3,105,000
大東銀行	7,600	600.00	4,560,000
トモニホールディングス	113,200	338.00	38,261,600
フィデアホールディングス	142,200	110.00	15,642,000
池田泉州ホールディングス	168,400	161.00	27,112,400
F P G	45,600	492.00	22,435,200
マーキュリアインベストメント	6,000	635.00	3,810,000
S B Iホールディングス	168,200	2,621.00	440,852,200
ジャフコ グループ	22,600	4,470.00	101,022,000
大和証券グループ本社	1,175,700	468.50	550,815,450
野村ホールディングス	2,577,700	513.60	1,323,906,720
岡三証券グループ	125,300	361.00	45,233,300
丸三証券	43,900	485.00	21,291,500
東洋証券	53,900	124.00	6,683,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	168,900	290.00	48,981,000
光世証券	3,800	676.00	2,568,800
水戸証券	43,200	234.00	10,108,800
いちよし証券	27,800	438.00	12,176,400
松井証券	83,900	867.00	72,741,300
マネックスグループ	108,100	310.00	33,511,000
極東証券	19,900	712.00	14,168,800
岩井コスモホールディングス	14,000	1,276.00	17,864,000
藍澤証券	26,600	709.00	18,859,400
マネーパートナーズグループ	16,500	205.00	3,382,500
スパークス・グループ	68,500	235.00	16,097,500
かんぽ生命保険	51,900	1,807.00	93,783,300
S O M P Oホールディングス	275,400	4,150.00	1,142,910,000

アニコム ホールディングス	48,700	1,045.00	50,891,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	383,000	3,314.00	1,269,262,000
第一生命ホールディングス	828,900	1,670.50	1,384,677,450
東京海上ホールディングス	517,900	5,594.00	2,897,132,600
T & D ホールディングス	437,800	1,268.00	555,130,400
アドバンスクリエイト	3,100	1,849.00	5,731,900
全国保証	41,300	4,795.00	198,033,500
イントラスト	5,300	843.00	4,467,900
日本モーゲージサービス	6,200	1,120.00	6,944,000
C a s a	5,200	1,268.00	6,593,600
アルヒ	23,300	2,151.00	50,118,300
プレミアグループ	8,000	2,073.00	16,584,000
クレディセゾン	102,700	1,178.00	120,980,600
芙蓉総合リース	15,400	6,360.00	97,944,000
みずほリース	22,600	2,696.00	60,929,600
東京センチュリー	29,500	6,560.00	193,520,000
日本証券金融	64,800	504.00	32,659,200
アイフル	223,900	265.00	59,333,500
リコーリース	11,600	2,923.00	33,906,800
イオンフィナンシャルサービス	89,700	1,168.00	104,769,600
アコム	294,600	501.00	147,594,600
ジャックス	16,200	1,791.00	29,014,200
オリエントコーポレーション	397,300	116.00	46,086,800
日立キャピタル	34,600	2,363.00	81,759,800
オリックス	908,800	1,554.00	1,412,275,200
三菱UFJリース	372,000	477.00	177,444,000
九州リースサービス	7,400	604.00	4,469,600
日本取引所グループ	420,500	2,391.50	1,005,625,750
イー・ギャランティ	16,800	2,043.00	34,322,400
アサックス	7,800	721.00	5,623,800
N E C キャピタルソリューション	6,000	1,840.00	11,040,000
いちご	193,000	324.00	62,532,000
日本駐車場開発	161,400	127.00	20,497,800
スター・マイカ・ホールディングス	9,000	1,497.00	13,473,000
A D ワークスグループ	27,600	154.00	4,250,400
ヒューリック	312,800	1,037.00	324,373,600
三栄建築設計	7,100	1,763.00	12,517,300
野村不動産ホールディングス	90,100	1,955.00	176,145,500
三重交通グループホールディングス	33,900	516.00	17,492,400
サムティ	22,000	1,759.00	38,698,000
ディア・ライフ	26,000	419.00	10,894,000
日本商業開発	10,500	1,725.00	18,112,500

ハウスコム	4,100	1,295.00	5,309,500
日本管理センター	9,500	1,270.00	12,065,000
サンセイランディック	7,100	753.00	5,346,300
フージャースホールディングス	29,200	682.00	19,914,400
オープンハウス	46,700	4,020.00	187,734,000
東急不動産ホールディングス	402,700	485.00	195,309,500
飯田グループホールディングス	123,200	2,124.00	261,676,800
イーランド	5,000	772.00	3,860,000
ムゲンエステート	13,000	502.00	6,526,000
ハウストゥ	7,200	1,203.00	8,661,600
シーアールイー	5,300	1,345.00	7,128,500
グッドコムアセット	8,500	1,464.00	12,444,000
ジェイ・エス・ビー	3,400	2,845.00	9,673,000
テンポイノベーション	5,600	880.00	4,928,000
パーク24	80,000	1,503.00	120,240,000
パラカ	5,000	1,640.00	8,200,000
三井不動産	713,000	2,181.50	1,555,409,500
三菱地所	1,027,500	1,789.50	1,838,711,250
平和不動産	27,600	3,020.00	83,352,000
東京建物	146,300	1,328.00	194,286,400
ダイビル	39,400	1,238.00	48,777,200
京阪神ビルディング	24,500	2,090.00	51,205,000
住友不動産	329,900	3,370.00	1,111,763,000
テーオーシー	32,100	625.00	20,062,500
東京楽天地	2,900	4,250.00	12,325,000
スターツコーポレーション	20,700	2,719.00	56,283,300
フジ住宅	20,400	619.00	12,627,600
空港施設	19,200	464.00	8,908,800
明和地所	12,100	530.00	6,413,000
ゴールドクレスト	13,100	1,382.00	18,104,200
エスリード	7,300	1,368.00	9,986,400
日神グループホールディングス	26,900	402.00	10,813,800
日本エスコン	26,500	875.00	23,187,500
タカラレーベン	66,900	291.00	19,467,900
A V A N T I A	10,600	848.00	8,988,800
イオンモール	74,700	1,700.00	126,990,000
毎日コムネット	6,600	717.00	4,732,200
ファースト住建	8,300	985.00	8,175,500
カチタス	37,000	3,035.00	112,295,000
トーセイ	22,200	1,070.00	23,754,000
穴吹興産	4,500	1,635.00	7,357,500
サンフロンティア不動産	22,500	928.00	20,880,000

エフ・ジェー・ネクスト	14,900	973.00	14,497,700
インテリックス	4,100	544.00	2,230,400
ランドビジネス	4,900	346.00	1,695,400
サンネクスタグループ	6,700	1,009.00	6,760,300
グランディハウス	16,900	366.00	6,185,400
日本空港ビルデング	47,100	5,800.00	273,180,000
明豊ファシリティワークス	6,900	608.00	4,195,200
日本工営	9,600	2,809.00	26,966,400
L I F U L L	50,200	377.00	18,925,400
ミクシィ	27,200	2,797.00	76,078,400
ジェイエイシーリクルートメント	9,700	1,680.00	16,296,000
日本M&Aセンター	108,600	6,470.00	702,642,000
メンバーズ	4,300	2,126.00	9,141,800
中広	2,500	457.00	1,142,500
UTグループ	22,400	3,035.00	67,984,000
アイティメディア	5,800	2,274.00	13,189,200
タケエイ	15,800	1,216.00	19,212,800
E・Jホールディングス	2,700	2,120.00	5,724,000
ビーネックスグループ	18,000	1,108.00	19,944,000
コシダカホールディングス	34,800	401.00	13,954,800
アルトナー	3,700	886.00	3,278,200
パソナグループ	15,500	1,807.00	28,008,500
C D S	3,700	1,284.00	4,750,800
リンクアンドモチベーション	26,100	599.00	15,633,900
G C A	18,800	728.00	13,686,400
エス・エム・エス	44,300	3,400.00	150,620,000
サニーサイドアップグループ	5,300	658.00	3,487,400
パーソルホールディングス	142,000	1,833.00	260,286,000
リニカル	7,200	747.00	5,378,400
クックパッド	45,500	314.00	14,287,000
アイ・ケイ・ケイ	7,300	663.00	4,839,900
学情	5,300	1,002.00	5,310,600
スタジオアリス	7,300	2,045.00	14,928,500
シミックホールディングス	7,200	1,340.00	9,648,000
エプコ	3,700	1,067.00	3,947,900
N J S	3,600	1,938.00	6,976,800
総合警備保障	56,500	5,430.00	306,795,000
カカクコム	104,900	2,844.00	298,335,600
アイロムグループ	5,100	1,854.00	9,455,400
セントケア・ホールディング	9,500	956.00	9,082,000
サイネックス	2,700	749.00	2,022,300
ルネサンス	8,200	828.00	6,789,600

ディップ	19,500	2,385.00	46,507,500
デジタルホールディングス	10,000	1,671.00	16,710,000
ツクイホールディングス	33,800	608.00	20,550,400
キャリアデザインセンター	3,500	968.00	3,388,000
ベネフィット・ワン	51,700	3,115.00	161,045,500
エムスリー	313,000	8,139.00	2,547,507,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,300	265.00	2,994,500
アウトソーシング	81,500	1,364.00	111,166,000
ウェルネット	14,800	514.00	7,607,200
ワールドホールディングス	5,000	1,900.00	9,500,000
ディー・エヌ・エー	60,200	1,837.00	110,587,400
博報堂D Yホールディングス	197,500	1,466.00	289,535,000
ぐるなび	25,200	510.00	12,852,000
タカミヤ	15,500	539.00	8,354,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	859.00	9,620,800
ファンコミュニケーションズ	39,600	448.00	17,740,800
ライク	4,800	2,177.00	10,449,600
ビジネス・ブレークスルー	6,600	415.00	2,739,000
エスプール	36,800	715.00	26,312,000
WDBホールディングス	6,600	3,065.00	20,229,000
手間いらず	900	5,450.00	4,905,000
ティア	8,900	416.00	3,702,400
C D G	1,700	1,471.00	2,500,700
バリューコマース	9,600	3,215.00	30,864,000
インフォマート	143,800	1,057.00	151,996,600
J Pホールディングス	45,500	280.00	12,740,000
エコナックホールディングス	28,700	91.00	2,611,700
E P Sホールディングス	19,500	967.00	18,856,500
レッグス	3,700	1,524.00	5,638,800
プレステージ・インターナショナル	53,400	919.00	49,074,600
アミューズ	7,800	2,652.00	20,685,600
ドリームインキュベータ	4,500	1,502.00	6,759,000
クイック	9,100	1,109.00	10,091,900
T A C	9,800	214.00	2,097,200
ケネディクス	122,500	593.00	72,642,500
電通グループ	159,700	3,275.00	523,017,500
イオンファンタジー	5,600	2,224.00	12,454,400
シーティーエス	16,300	920.00	14,996,000
ネクシィーズグループ	4,600	910.00	4,186,000
H . U . グループホールディングス	39,800	2,808.00	111,758,400
アルプス技研	12,700	1,969.00	25,006,300
ダイオーズ	3,100	962.00	2,982,200

日本空調サービス	15,200	770.00	11,704,000
オリエンタルランド	150,900	17,570.00	2,651,313,000
ダスキン	35,400	2,864.00	101,385,600
明光ネットワークジャパン	18,400	587.00	10,800,800
ファルコホールディングス	8,000	1,569.00	12,552,000
ラウンドワン	39,900	853.00	34,034,700
リゾートトラスト	65,200	1,674.00	109,144,800
ビー・エム・エル	18,400	3,300.00	60,720,000
りらいあコミュニケーションズ	24,900	1,211.00	30,153,900
リソー教育	65,700	317.00	20,826,900
早稲田アカデミー	6,400	943.00	6,035,200
ユー・エス・エス	159,000	2,225.00	353,775,000
東京個別指導学院	5,500	603.00	3,316,500
サイバーエージェント	87,500	6,440.00	563,500,000
楽天	661,700	1,089.00	720,591,300
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,017.00	7,830,900
テー・オー・ダブリュー	23,500	286.00	6,721,000
山田コンサルティンググループ	9,500	953.00	9,053,500
セントラルスポーツ	5,400	2,173.00	11,734,200
フルキャストホールディングス	12,600	1,668.00	21,016,800
エン・ジャパン	25,300	3,460.00	87,538,000
リソルホールディングス	1,600	3,735.00	5,976,000
テクノプロ・ホールディングス	28,400	7,850.00	222,940,000
アトラ	3,300	266.00	877,800
インターワークス	3,600	320.00	1,152,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	13,550.00	78,590,000
Keeper 技研	10,600	1,798.00	19,058,800
ファーストロジック	3,100	764.00	2,368,400
三機サービス	3,000	976.00	2,928,000
Gunosy	9,200	746.00	6,863,200
デザインワン・ジャパン	5,400	233.00	1,258,200
イー・ガーディアン	6,300	2,933.00	18,477,900
リブセンス	8,900	256.00	2,278,400
ジャパンマテリアル	43,800	1,377.00	60,312,600
ベクトル	18,000	886.00	15,948,000
ウチヤマホールディングス	7,900	303.00	2,393,700
チャーム・ケア・コーポレーション	12,300	1,168.00	14,366,400
キャリアリンク	4,800	1,484.00	7,123,200
I B J	12,000	807.00	9,684,000
アサンテ	5,900	1,522.00	8,979,800
N・フィールド	10,100	774.00	7,817,400
バリューHR	5,800	1,631.00	9,459,800

M & Aキャピタルパートナーズ	11,600	6,080.00	70,528,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,600	2,058.00	11,524,800
E R Iホールディングス	4,400	686.00	3,018,400
アビスト	2,300	2,906.00	6,683,800
シグマクシス	9,900	1,522.00	15,067,800
ウィルグループ	9,600	895.00	8,592,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,800	312.00	6,801,600
メドピア	6,700	5,440.00	36,448,000
リクルートホールディングス	1,016,600	4,474.00	4,548,268,400
エラン	9,900	2,847.00	28,185,300
土木管理総合試験所	7,600	371.00	2,819,600
ネットマーケティング	5,900	606.00	3,575,400
日本郵政	1,163,500	824.30	959,073,050
ベルシステム24ホールディングス	23,900	1,602.00	38,287,800
鎌倉新書	11,000	1,097.00	12,067,000
S M N	3,400	779.00	2,648,600
L I T A L I C O	5,000	3,390.00	16,950,000
グローバルキッズCOMPANY	2,900	795.00	2,305,500
エアトリ	7,500	1,251.00	9,382,500
アトラエ	4,400	2,766.00	12,170,400
ストライク	5,400	5,810.00	31,374,000
ソラスト	39,300	1,550.00	60,915,000
セラク	4,600	1,963.00	9,029,800
インソース	6,000	3,280.00	19,680,000
ベイカレント・コンサルティング	8,600	15,250.00	131,150,000
Orchestra Holdings	3,100	2,356.00	7,303,600
アイモバイル	5,200	1,368.00	7,113,600
キャリアインデックス	6,200	749.00	4,643,800
M S - J a p a n	5,000	787.00	3,935,000
船場	3,100	902.00	2,796,200
グレイステクノロジー	6,600	5,910.00	39,006,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,300	4,490.00	73,187,000
フルテック	2,200	1,438.00	3,163,600
グリーンズ	3,600	465.00	1,674,000
GameWith	4,700	572.00	2,688,400
ソウルドアウト	3,600	1,515.00	5,454,000
M S & C o n s u l t i n g	3,100	600.00	1,860,000
エル・ティー・エス	1,100	4,855.00	5,340,500
ミダック	1,900	3,435.00	6,526,500
日総工産	9,800	753.00	7,379,400
キュービーネットホールディングス	6,100	1,575.00	9,607,500
R P Aホールディングス	11,200	668.00	7,481,600

スプリックス	4,300	872.00	3,749,600
マネジメントソリューションズ	7,100	1,459.00	10,358,900
プロレド・パートナーズ	2,000	5,020.00	10,040,000
フロンティア・マネジメント	1,200	5,090.00	6,108,000
ピアラ	900	2,155.00	1,939,500
コプロ・ホールディングス	1,000	3,000.00	3,000,000
ギークス	1,700	1,200.00	2,040,000
カーブスホールディングス	39,300	678.00	26,645,400
フォーラムエンジニアリング	7,700	817.00	6,290,900
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	690.00	5,244,000
リログループ	77,700	2,759.00	214,374,300
東祥	9,000	1,274.00	11,466,000
エイチ・アイ・エス	22,100	1,594.00	35,227,400
ラックランド	4,100	2,312.00	9,479,200
共立メンテナンス	23,600	3,525.00	83,190,000
イチネンホールディングス	16,100	1,268.00	20,414,800
建設技術研究所	9,300	2,070.00	19,251,000
スペース	9,500	821.00	7,799,500
長大	5,900	1,279.00	7,546,100
燦ホールディングス	6,400	1,171.00	7,494,400
スバル興業	900	8,000.00	7,200,000
東京テアトル	5,700	1,314.00	7,489,800
タナベ経営	2,900	1,388.00	4,025,200
ナガワ	4,600	9,190.00	42,274,000
よみうりランド	3,100	6,070.00	18,817,000
東京都競馬	9,300	5,070.00	47,151,000
カナモト	25,100	2,266.00	56,876,600
東京ドーム	57,800	904.00	52,251,200
西尾レントオール	13,200	2,097.00	27,680,400
トランス・コスモス	13,600	2,812.00	38,243,200
乃村工藝社	61,200	744.00	45,532,800
藤田観光	5,600	1,476.00	8,265,600
KNT-CTホールディングス	8,800	878.00	7,726,400
日本管財	15,300	2,071.00	31,686,300
トーカイ	13,800	2,046.00	28,234,800
セコム	150,600	10,160.00	1,530,096,000
セントラル警備保障	6,900	3,470.00	23,943,000
丹青社	27,200	761.00	20,699,200
メイテック	17,400	5,100.00	88,740,000
応用地質	16,800	1,277.00	21,453,600
船井総研ホールディングス	29,400	2,498.00	73,441,200
進学会ホールディングス	6,200	425.00	2,635,000

オオバ	10,400	787.00	8,184,800	
いであ	3,600	1,682.00	6,055,200	
学究社	4,400	1,185.00	5,214,000	
ベネッセホールディングス	47,400	2,308.00	109,399,200	
イオンディライト	17,600	2,675.00	47,080,000	
ナック	8,100	932.00	7,549,200	
ダイセキ	23,900	2,975.00	71,102,500	
ステップ	5,400	1,565.00	8,451,000	
合 計	155,284,700		354,864,638,360	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

（2020年12月30日現在）

資産総額	2,707,469,896円
負債総額	880,477円
純資産総額（ - ）	2,706,589,419円
発行済口数	2,802,631,988口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9657円
（1万口当たり純資産額）	（9,657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12月30日現在）

資産総額	281,494,684,494円
負債総額	122,579,694円
純資産総額（ - ）	281,372,104,800円
発行済口数	93,894,683,078口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9967円
（1万口当たり純資産額）	（29,967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12月30日現在）

資産総額	375,000,460,100円
負債総額	395,662,143円
純資産総額（ - ）	374,604,797,957円
発行済口数	217,317,649,573口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7238円
（1万口当たり純資産額）	（17,238円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2021年 2月19日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2020年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	13,396,945
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	302,014
単位型公社債投資信託	41	287,976
合計	644	13,986,935

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（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。

また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	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
評価・換算差額等		
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

（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				
	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	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 その他有価証券	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 その他有価証券	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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				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	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	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	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p>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。</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>
7. ヘッジ会計の会計処理	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p>

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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

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

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(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	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(*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)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

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

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(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	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

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

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社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

2021年 2月19日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（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SBI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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 6月15日	臨時報告書
2020年 8月19日	有価証券届出書
2020年 8月19日	有価証券報告書
2020年 9月15日	臨時報告書

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

2021年1月19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2020年5月20日から2020年11月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。