

**【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】	2022年8月19日提出
【計算期間】	第35特定期間(自 2021年11月20日至 2022年5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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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。

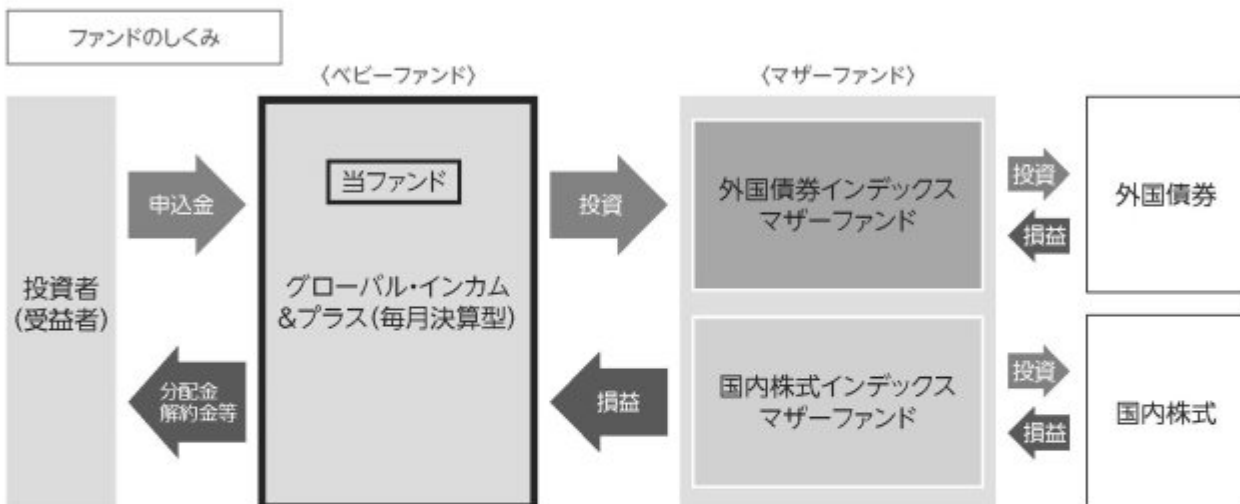
## [ 特殊型 ]

- (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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

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

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

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

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

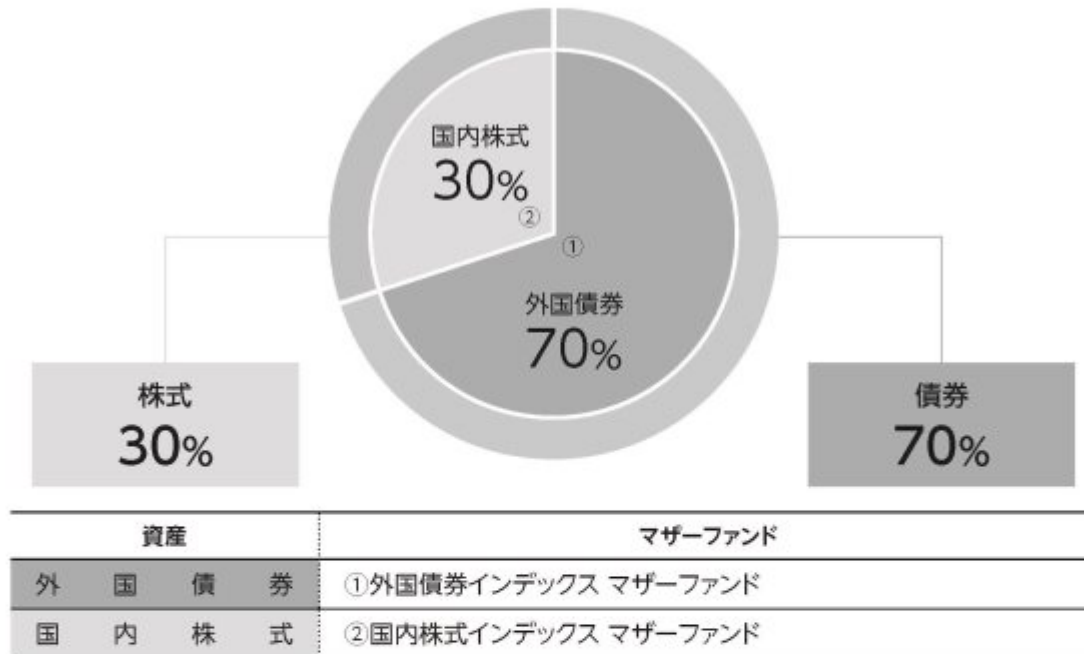
※2 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。



### 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。

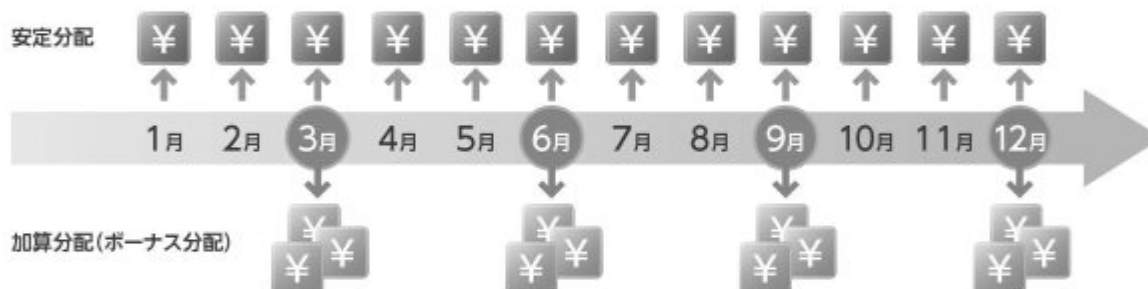
4.

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。

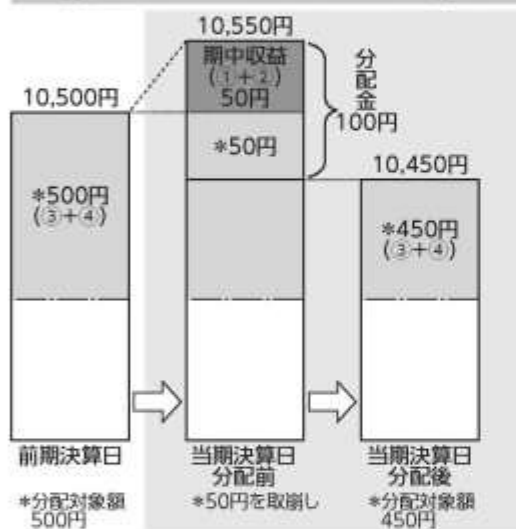
投資信託で分配金が支払われるイメージ



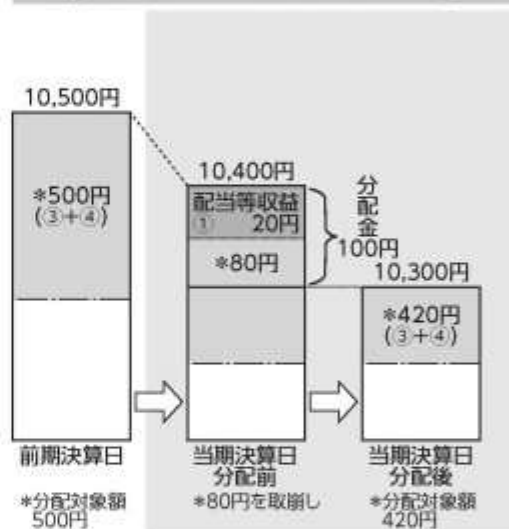
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



（前期決算日から基準価額が下落した場合）

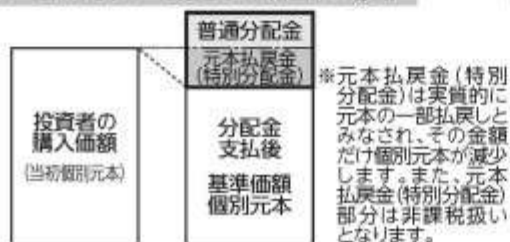


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

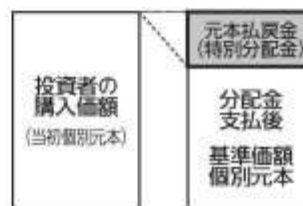
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

- 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

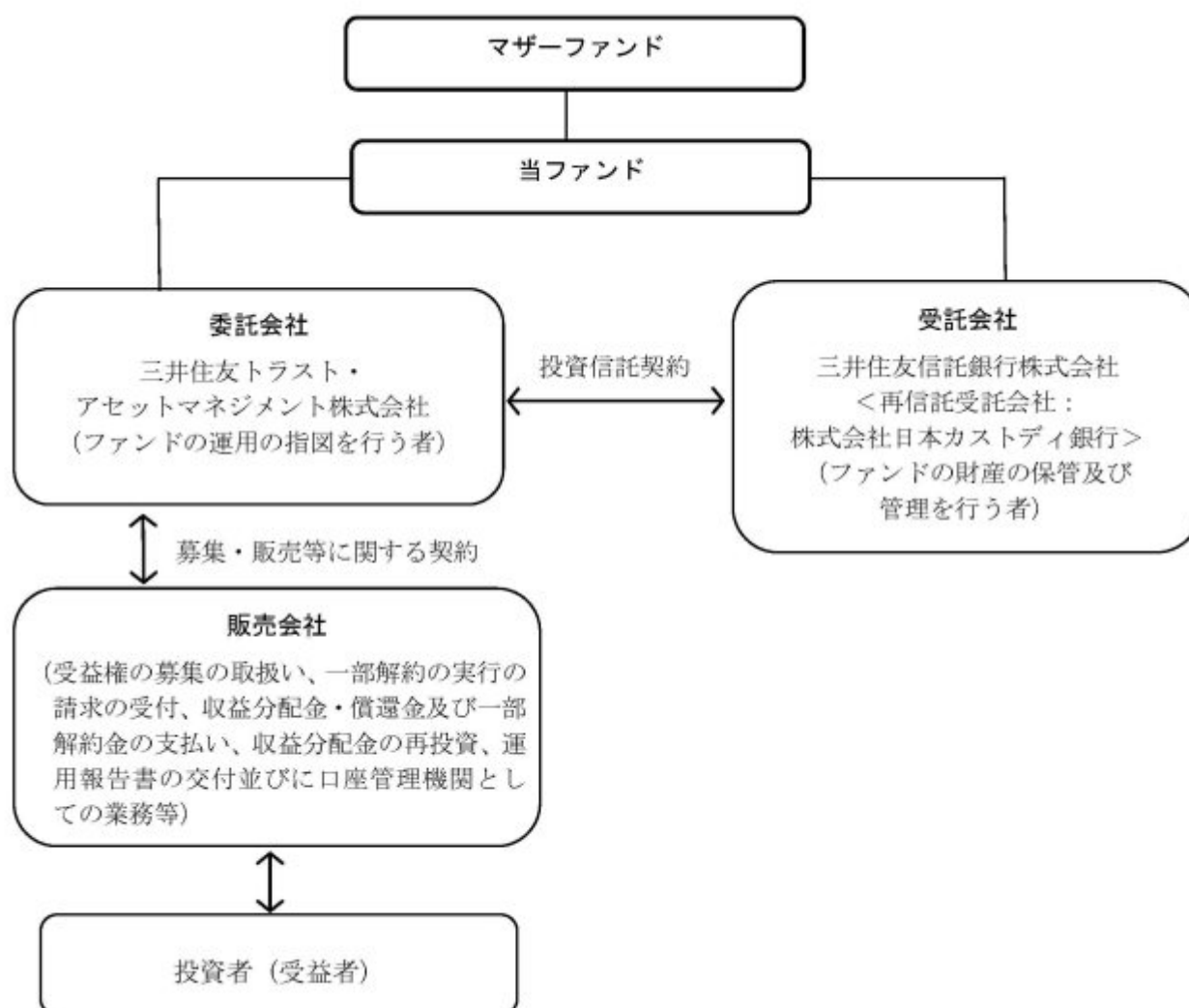
2012年4月1日

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（2022年 6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

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

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### （イ）基本方針

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

#### （ロ）運用方法

##### 投資対象

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

##### 投資態度

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

### （2）【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

受益証券に限ります。）

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

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

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下

し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

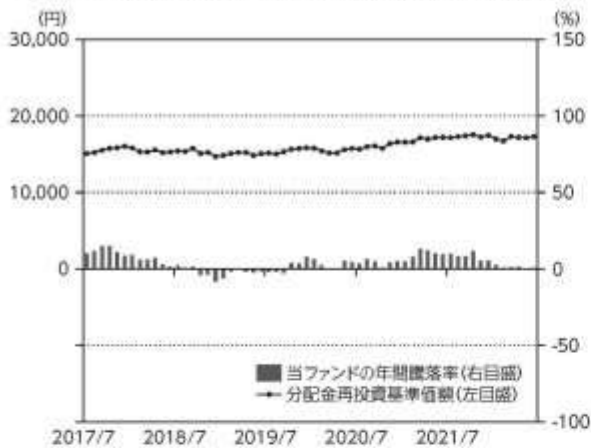
## (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

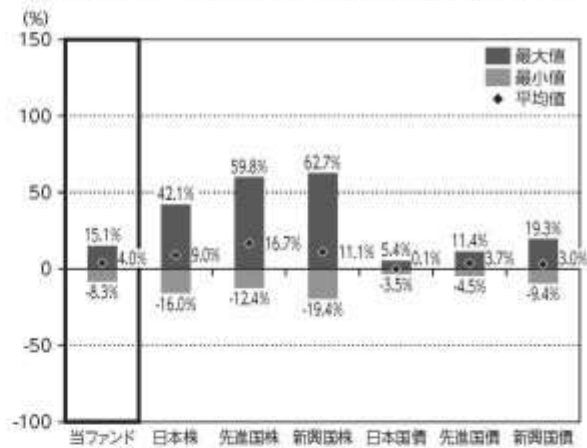
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2017年7月～2022年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの特定加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る著作権又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に關する権利・ノウハウ及び同指数に係る著作権又は商標に關するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に關するいかなる損害に對してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要な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。同指数に關する著作権等の知的財産権及びその物の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に關する著作権等の知的財産権及びその物の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数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自社の事業活動・サービスに關し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのリ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いません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は中断につき何ら責任を負いません。このインデックスに對する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index Emerging 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されています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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



じ。 )。

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

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

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

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

## ( 2 ) 【換金( 解約 ) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額 ( ) の控除はありません。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.32% ( 税抜 1.2% ) を乗じて得た額とします ( 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 )。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.583% ( 税抜 0.53% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.66% ( 税抜 0.6% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% ( 税抜 0.07% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息 ( 「諸経費」といいます。 ) は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します ( マ

ザーファンドにおいて負担する場合があります。 )。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。 ）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。 ）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しく

は、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年6月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年6月30日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,536,394,638	98.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		49,905,433	1.93
合計(純資産総額)		2,586,300,071	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	566,194,522	3.1148	1,763,582,698	3.1703	1,795,006,493	69.40
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	400,793,678	1.7962	719,905,605	1.8498	741,388,145	28.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.07
合計	98.07

(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
第33特定期間末	(2021年 5月19日)	2,696,502,691	2,699,247,639	9,824	9,834
第34特定期間末	(2021年11月19日)	2,723,112,041	2,725,798,345	10,137	10,147
第35特定期間末	(2022年 5月19日)	2,533,303,733	2,535,929,352	9,648	9,658
	2021年 6月末日	2,721,233,385		9,948	
	7月末日	2,701,527,153		9,910	
	8月末日	2,707,338,473		9,980	
	9月末日	2,702,608,881		10,039	
	10月末日	2,719,228,334		10,116	
	11月末日	2,661,349,752		9,915	
	12月末日	2,682,394,511		10,035	
	2022年 1月末日	2,587,933,037		9,753	
	2月末日	2,546,972,860		9,603	
	3月末日	2,626,546,509		9,922	
	4月末日	2,591,592,002		9,844	
	5月末日	2,573,674,754		9,803	
	6月末日	2,586,300,071		9,884	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第33特定期間	2020年11月20日～2021年 5月19日	60
第34特定期間	2021年 5月20日～2021年11月19日	60
第35特定期間	2021年11月20日～2022年 5月19日	60

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第33特定期間	2020年11月20日～2021年 5月19日	4.7
第34特定期間	2021年 5月20日～2021年11月19日	3.8
第35特定期間	2021年11月20日～2022年 5月19日	4.2

(注1)収益率は、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
第33特定期間	2020年11月20日～2021年 5月19日	7,356,311	110,256,289	2,744,948,646
第34特定期間	2021年 5月20日～2021年11月19日	5,525,447	64,169,612	2,686,304,481
第35特定期間	2021年11月20日～2022年 5月19日	9,600,230	70,285,124	2,625,619,587

(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	160,399,308,755	49.83
	フランス	27,519,732,133	8.55
	イタリア	25,796,988,332	8.01
	ドイツ	20,620,592,686	6.41
	スペイン	16,500,469,045	5.13
	イギリス	15,733,526,417	4.89

カナダ	6,458,194,403	2.01
中国	6,450,592,605	2.00
ベルギー	6,363,645,349	1.98
オランダ	5,410,914,861	1.68
オーストラリア	4,763,169,155	1.48
オーストリア	4,059,594,799	1.26
メキシコ	2,458,626,264	0.76
アイルランド	2,134,333,770	0.66
フィンランド	1,658,989,089	0.52
マレーシア	1,612,670,309	0.50
シンガポール	1,392,328,336	0.43
ポーランド	1,309,030,248	0.41
イスラエル	1,248,758,677	0.39
デンマーク	1,195,582,424	0.37
スウェーデン	835,722,079	0.26
ノルウェー	640,781,265	0.20
小計	314,563,551,001	97.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	7,336,182,471	2.28
合計(純資産総額)	321,899,733,472	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,320,143,069	0.72
	買建	ドイツ	2,081,608,087	0.65

(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		4,623,542,775	1.44

(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 1.375% 11/15/31	21,030,000	12,021.60	2,528,143,495	11,770.49	2,475,335,572	1.375	2031/11/15	0.77
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	16,120,000	12,022.50	1,938,027,161	11,684.00	1,883,461,506	1.250	2031/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,538.79	1,806,075,219	13,224.85	1,764,196,041	2.625	2029/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,454.43	1,805,892,514	12,166.12	1,764,087,654	1.250	2028/9/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,980.85	1,803,118,865	11,663.71	1,755,389,258	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	13,160.78	1,710,902,587	13,037.18	1,694,834,676	0.250	2024/3/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	11,621.00	1,638,561,494	11,317.74	1,595,802,010	0.625	2030/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	10,963.23	1,660,929,497	10,466.69	1,585,704,765	2.000	2051/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	13,323.63	1,598,835,660	13,213.91	1,585,669,522	0.250	2023/9/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,387.52	1,565,001,761	13,166.66	1,539,182,787	2.375	2027/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	10,835.09	1,571,088,558	10,322.54	1,496,768,808	1.750	2041/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,583.63	1,488,644,181	12,386.09	1,465,274,580	0.750	2026/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	13,279.85	1,460,783,514	13,166.92	1,448,362,183	0.250	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	12,591.11	1,447,977,780	12,411.18	1,427,286,247	0.500	2026/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	13,074.29	1,419,868,573	12,932.27	1,404,445,309	0.750	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	12,691.48	1,396,063,405	12,505.68	1,375,625,474	0.750	2026/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,557.48	1,376,084,358	13,407.45	1,360,856,555	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,467.77	1,390,157,330	12,129.28	1,352,414,971	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,558.00	1,381,181,299	11,253.67	1,344,814,283	0.625	2030/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	13,236.60	1,352,780,903	13,009.69	1,329,590,688	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	13,192.02	1,319,202,256	13,073.49	1,307,349,544	0.125	2024/1/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	13,098.05	1,309,805,506	12,972.32	1,297,232,012	0.250	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,768.36	1,312,172,321	11,459.76	1,277,763,657	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,372.20	1,263,202,589	12,088.70	1,234,256,818	1.125	2028/8/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	12,152.77	1,215,277,414	11,910.38	1,191,038,063	0.625	2027/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,368.47	1,196,478,836	13,117.54	1,174,020,064	2.250	2027/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	13,073.76	1,177,945,990	12,944.55	1,166,304,585	0.375	2024/7/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	13,065.75	1,175,917,838	12,941.88	1,164,769,875	0.250	2024/6/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	12,496.60	1,187,177,926	12,222.18	1,161,107,277	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,283.92	1,168,985,770	13,156.51	1,157,773,573	1.500	2024/11/30	0.36

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.72
合計	97.72

(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	59	アメリカ ドル	6,607,785.45	903,152,116	6,581,265.92	899,527,426	0.28
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	43	アメリカ ドル	5,095,405.49	696,440,022	5,053,172.09	690,667,561	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	39	アメリカ ドル	5,382,683.8	735,705,221	5,340,562.5	729,948,082	0.23
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	24	ユーロ	2,611,675.4	372,607,729	2,611,440	372,574,144	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	34	ユーロ	4,191,461.4	597,995,798	4,188,460	597,567,588	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	53	ユーロ	7,839,041.3	1,118,396,022	7,790,470	1,111,466,355	0.35

(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	18,710,000.00	2,528,096,667	2,554,960,889	0.79
	カナダドル	買建	1,760,000.00	184,930,363	186,386,992	0.06
	ユーロ	買建	11,370,000.00	1,616,968,094	1,622,217,024	0.50
	イギリスポンド	買建	1,570,000.00	259,940,104	259,977,870	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	480,430,516,380	98.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,836,326,860	1.40
合計(純資産総額)		487,266,843,240	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	6,827,325,000	1.40

(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	9,104,100	2,126.64	19,361,143,224	2,100.00	19,118,610,000	3.92
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,251,000	11,983.35	14,991,176,535	11,095.00	13,879,845,000	2.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,196,600	3,985.51	8,754,577,908	3,896.00	8,557,953,600	1.76
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,529,200	738.27	8,511,662,484	729.40	8,409,398,480	1.73
日本	株式	キーエンス	電気機器	181,000	51,522.72	9,325,613,224	46,380.00	8,394,780,000	1.72
日本	株式	任天堂	その他製品	112,700	58,338.89	6,574,793,356	58,680.00	6,613,236,000	1.36
日本	株式	日立製作所	電気機器	960,500	6,775.22	6,507,606,484	6,438.00	6,183,699,000	1.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,175,100	5,357.46	6,295,561,049	5,235.00	6,151,648,500	1.26
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,428,700	4,544.31	6,492,469,517	4,289.00	6,127,694,300	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,569,700	3,744.60	5,877,906,710	3,818.00	5,993,114,600	1.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,700	59,422.35	7,528,812,677	44,300.00	5,612,810,000	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,367,100	4,692.04	6,414,487,884	3,995.00	5,461,564,500	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,289,700	4,498.09	5,801,186,673	4,037.00	5,206,518,900	1.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,278,200	3,981.00	5,088,514,200	4,032.00	5,153,702,400	1.06
日本	株式	第一三共	医薬品	1,448,700	3,463.24	5,017,195,788	3,437.00	4,979,181,900	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,460,100	3,184.83	4,650,170,283	3,293.00	4,808,109,300	0.99
日本	株式	ダイキン工業	機械	218,100	20,643.77	4,502,406,237	21,750.00	4,743,675,000	0.97
日本	株式	信越化学工業	化学	310,000	18,244.16	5,655,689,600	15,300.00	4,743,000,000	0.97
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,968,300	1,491.88	4,428,377,015	1,506.50	4,471,743,950	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	385,500	13,971.24	5,385,916,498	11,585.00	4,466,017,500	0.92

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	548,100	7,368.25	4,038,537,825	7,903.00	4,331,634,300	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,179,200	3,720.92	4,387,708,864	3,667.00	4,324,126,400	0.89
日本	株式	三井物産	卸売業	1,425,600	3,188.38	4,545,354,528	2,994.50	4,268,959,200	0.88
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,000	8,247.08	4,494,658,600	7,396.00	4,030,820,000	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	203,000	19,698.38	3,998,771,140	18,920.00	3,840,760,000	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	175,300	21,329.79	3,739,112,283	21,240.00	3,723,372,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	443,900	8,642.13	3,836,241,507	8,380.00	3,719,882,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,361,600	1,530.90	3,615,373,440	1,543.00	3,643,948,800	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,707,400	2,044.30	3,490,443,364	2,115.00	3,611,151,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	58,500	66,306.84	3,878,950,694	60,470.00	3,537,495,000	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	2.22
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.19
		化学	6.19
		医薬品	5.40
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.59
		機械	5.23
		電気機器	17.10
		輸送用機器	7.96
		精密機器	2.59
		その他製品	2.49
		電気・ガス業	1.35
		陸運業	3.03
海運業	0.61		
空運業	0.43		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	8.99		
卸売業	5.43		

	小売業	4.26
	銀行業	5.32
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.32
	その他金融業	1.14
	不動産業	2.02
	サービス業	5.13
	小計	98.60
合計		98.60

(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	365	円	7,009,494,450	6,827,325,000	1.40

(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：2022年6月30日

**基準価額・純資産の推移**

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

基準価額	9,884円
純資産総額	25,86億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年2月	10円
2022年3月	10円
2022年4月	10円
2022年5月	10円
2022年6月	10円
直近1年間 分配金合計額	120円
設定来 分配金合計額	5,206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	69.4%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.5%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.4%
		T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.4%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.4%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	28.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	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。

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

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

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1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、振替機関等は、委託会社から振替

機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >



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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1)わが国の取引所に上場されている株式

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

2)公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

(a)価格情報会社の提供する価額

(b)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2004年12月 1日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎月20日から翌月19日までとします。（第1計算期間は、2004年12月1日から2005年2月21日までとします。）なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

## < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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35特定期間(2021年11月20日から2022年5月19日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・インカム&amp;プラス（毎月決算型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第34特定期間 (2021年11月19日現在)	第35特定期間 (2022年 5月19日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	51,299,789	49,223,440
親投資信託受益証券	2,677,564,803	2,482,313,983
未収入金	-	7,230,000
流動資産合計	2,728,864,592	2,538,767,423
資産合計	2,728,864,592	2,538,767,423
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,686,304	2,625,619
未払解約金	-	25,354
未払受託者報酬	178,118	163,392
未払委託者報酬	2,875,331	2,637,630
未払利息	84	33
その他未払費用	12,714	11,662
流動負債合計	5,752,551	5,463,690
負債合計	5,752,551	5,463,690
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,686,304,481	2,625,619,587
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,807,560	92,315,854
（分配準備積立金）	92,062,701	87,345,742
元本等合計	2,723,112,041	2,533,303,733
純資産合計	2,723,112,041	2,533,303,733
負債純資産合計	2,728,864,592	2,538,767,423

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日	第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日
営業収益		
受取利息	149	139
有価証券売買等損益	119,815,412	96,850,820
営業収益合計	119,815,561	96,850,681
営業費用		
支払利息	13,766	8,156
受託者報酬	1,055,391	997,444
委託者報酬	17,036,975	16,101,590
その他費用	75,326	71,183
営業費用合計	18,181,458	17,178,373
営業利益又は営業損失（ ）	101,634,103	114,029,054
経常利益又は経常損失（ ）	101,634,103	114,029,054
当期純利益又は当期純損失（ ）	101,634,103	114,029,054
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（ ）	616,615	9,765
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	48,445,955	36,807,560
剰余金増加額又は欠損金減少額	509,841	954,391
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	509,841	954,391
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,916	160,197
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,916	160,197
分配金	16,269,898	15,898,319
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,807,560	92,315,854



## （ 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34特定期間 (2021年11月19日現在)	第35特定期間 (2022年 5月19日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,686,304,481口	2,625,619,587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 - 円	元本の欠損 92,315,854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 1.0137円 (1万口当たり純資産額) (10,137円)	1口当たり純資産額 0.9648円 (1万口当たり純資産額) (9,648円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日	第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日																																																						
分配金の計算過程 第197期 自 2021年 5月20日 至 2021年 6月21日	分配金の計算過程 第203期 自 2021年11月20日 至 2021年12月20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>2,511,253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>8,866,236円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>94,376,441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>105,753,930円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,738,940,385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>386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	2,511,253円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	8,866,236円	分配準備積立金額	D	94,376,441円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	105,753,930円	当ファンドの期末残存口数	F	2,738,940,385口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	386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>- 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>8,881,681円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>91,623,849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>100,505,530円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,675,206,415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>375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	- 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	8,881,681円	分配準備積立金額	D	91,623,849円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,505,530円	当ファンドの期末残存口数	F	2,675,206,415口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	375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	2,511,253円																																																					
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																					
収益調整金額	C	8,866,236円																																																					
分配準備積立金額	D	94,376,441円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	105,753,930円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,738,940,385口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	386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	- 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	8,881,681円																																																					
分配準備積立金額	D	91,623,849円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,505,530円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,675,206,415口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	375円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					

第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日			第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日		
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,738,940円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,675,206円
第198期 自 2021年 6月22日 至 2021年 7月19日			第204期 自 2021年12月21日 至 2022年 1月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,450,284円	費用控除後の配当等収益額	A	589,529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	8,888,744円	収益調整金額	C	8,856,163円
分配準備積立金額	D	93,970,511円	分配準備積立金額	D	88,486,602円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,309,539円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	97,932,294円
当ファンドの期末残存口数	F	2,734,793,374口	当ファンドの期末残存口数	F	2,661,870,001口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	385円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	367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	$I=F \times H / 10,000$	2,734,793円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,661,870円
第199期 自 2021年 7月20日 至 2021年 8月19日			第205期 自 2022年 1月20日 至 2022年 2月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 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	8,856,150円	収益調整金額	C	8,870,114円
分配準備積立金額	D	93,107,978円	分配準備積立金額	D	86,079,884円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,964,128円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	94,949,998円
当ファンドの期末残存口数	F	2,718,508,091口	当ファンドの期末残存口数	F	2,652,914,417口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	375円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	357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	$I=F \times H / 10,000$	2,718,508円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,652,914円
第200期 自 2021年 8月20日 至 2021年 9月21日			第206期 自 2022年 2月22日 至 2022年 3月22日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,813,176円	費用控除後の配当等収益額	A	2,267,152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	8,855,250円	収益調整金額	C	8,907,703円
分配準備積立金額	D	89,688,568円	分配準備積立金額	D	83,172,075円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,356,994円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	94,346,930円
当ファンドの期末残存口数	F	2,699,278,108口	当ファンドの期末残存口数	F	2,646,656,955口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	375円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	356円

第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日			第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日		
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,699,278円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,646,656円
第201期 自 2021年 9月22日 至 2021年10月19日			第207期 自 2022年 3月23日 至 2022年 4月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	8,128,358円	費用控除後の配当等収益額	A	10,125,573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	8,856,593円	収益調整金額	C	8,954,636円
分配準備積立金額	D	89,538,077円	分配準備積立金額	D	82,385,408円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	106,523,028円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,465,617円
当ファンドの期末残存口数	F	2,692,075,882口	当ファンドの期末残存口数	F	2,636,054,932口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	395円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	384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	$I=F \times H / 10,000$	2,692,075円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,636,054円
第202期 自 2021年10月20日 至 2021年11月19日			第208期 自 2022年 4月20日 至 2022年 5月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	510,094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	8,859,416円	収益調整金額	C	8,977,267円
分配準備積立金額	D	94,749,005円	分配準備積立金額	D	89,461,267円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	103,608,421円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	98,948,628円
当ファンドの期末残存口数	F	2,686,304,481口	当ファンドの期末残存口数	F	2,625,619,587口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	385円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	376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	$I=F \times H / 10,000$	2,686,304円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,625,619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35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第35特定期間 (2022年 5月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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34特定期間	第35特定期間
	自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日	自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,744,948,646円	2,686,304,481円
期中追加設定元本額	5,525,447円	9,600,230円
期中一部解約元本額	64,169,612円	70,285,124円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第34特定期間 （2021年11月19日現在）	第35特定期間 （2022年 5月19日現在）
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	1,197	44,402,631
合計	1,197	44,402,631

（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	402,322,773	738,946,237	
	外国債券インデックス マザーファンド	569,839,755	1,743,367,746	
合計		972,162,528	2,482,313,983	

(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

	2022年 5月19日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	518,808,994
コール・ローン	4,165,303,731
国債証券	296,351,484,593
派生商品評価勘定	6,678,155
未収利息	1,594,899,572
前払金	864,720
前払費用	85,355,951
差入委託証拠金	679,535,524
流動資産合計	303,402,931,240
資産合計	303,402,931,240
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,481,124
前受収益	12,947
未払金	63,096,253
未払解約金	261,758,327
未払利息	2,858
流動負債合計	367,351,509
負債合計	367,351,509
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	99,051,911,463
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	203,983,668,268
元本等合計	303,035,579,731
純資産合計	303,035,579,731
負債純資産合計	303,402,931,240

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年 5月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,051,911,463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 3.0594円 (1万口当たり純資産額) (30,594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

	2022年 5月19日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月19日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



2022年 5月19日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 5月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月20日
期首元本額	97,685,548,105円
期中追加設定元本額	9,067,664,464円
期中一部解約元本額	7,701,301,106円
期末元本額	99,051,911,463円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,323,894,698円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	569,839,755円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	387,700,518円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,164,747,016円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,653,367円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,176,461,628円
世界経済インデックスファンド	13,591,544,526円
D C マイセレクション 2 5	1,946,774,162円
D C マイセレクション 5 0	1,670,516,067円
D C マイセレクション 7 5	1,152,077,573円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,293,812,497円
D C マイセレクション S 2 5	923,824,918円

区分	2022年 5月19日現在
DCマイセレクションS50	731,871,931円
DCマイセレクションS75	414,230,115円
DCターゲット・イヤーフンド2025	30,230,354円
DCターゲット・イヤーフンド2035	91,670,147円
DCターゲット・イヤーフンド2045	46,987,375円
DC世界経済インデックスファンド	12,565,581,324円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	599,241,165円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,650,011円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,324,475円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	23,161,956円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	47,930,499円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	71,940,031円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	73,784,318円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	70,266,398円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,321,664,353円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	446,603,182円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,767,240,191円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	83,581,412円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	53,860,232円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	451,196,749円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	170,008,549円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	212,072,293円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	737,949,757円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,527,161,965円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,152,939円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,343,992円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,035,373円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,411,756,777円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	539,156,050円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,971,770,686円
コア投資戦略ファンド（切替型）	537,685,860円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	250,155,168円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	111,546,075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）	1,314,051,772円
SMT インデックスバランス・オープン	196,279,664円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	15,414,736,374円
SMT 世界経済インデックス・オープン	248,873,034円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	309,057,503円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	497,734,331円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,087,760円
グローバル経済コア	840,740,710円

区分	2022年 5月19日現在
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,392,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,772,686円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	10,789,165円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	11,554,646円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,070,185円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,648,861円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,727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)	283,476,216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)	10,974,972,474円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,750,201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)	305,221,475円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	339,246,636円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,174,457,124円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	73,819,870円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	100,833,760円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		31,894,121,071
合計		31,894,121,071

(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

(2022年 5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 買建	4,034,507,111	うち1年超	864,720
			-	
合計		4,034,507,111	-	864,720

## (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

（2022年 5月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,998,174,636	-	3,963,236,387	34,938,249
	アメリカドル	2,168,575,859	-	2,148,001,470	20,574,389
	カナダドル	159,909,493	-	159,512,800	396,693
	ユーロ	1,423,545,675	-	1,409,931,642	13,614,033
	イギリスポンド	246,143,609	-	245,790,475	353,134
	合計	3,998,174,636	-	3,963,236,387	34,938,249

### (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取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取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取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% 01/15/24	10,000,000.00	9,605,859.40	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,512,308.77	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,350,732.45	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,656,296.89	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,872,070.30	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,822,765.26	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,742,500.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,130,600.59	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,453,339.86	

T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,532,617.20	
T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,834,843.76	
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,558,437.50	
T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	922,304.69	
T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,784,203.11	
T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,654,062.56	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,868,066.42	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,289,921.88	
T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,642,500.00	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,293,437.52	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,704,550.79	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,439,687.52	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,567,946.87	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,829,902.33	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,742,968.75	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,245,507.79	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,991,250.00	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,747,226.57	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,656,093.76	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	10,513,964.81	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,754,084.37	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,614,532.82	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,105,019.54	
T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,744,832.03	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,108,445.33	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,585,351.60	
T 0.625% 03/31/27	4,500,000.00	4,036,640.62	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	11,830,781.25	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,279,375.04	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,978,250.00	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,206,445.32	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,807,031.30	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,526,484.37	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,137,617.16	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,760,234.39	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,671,875.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,801,806.67	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,323,787.50	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,273,573.24	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,371,250.00	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,500,078.14	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,474,015.62	

T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,504,359.39
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	13,020,601.56
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,112,187.50
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,235,312.48
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,218,775.78
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,168,171.87
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,147,920.67
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,682,074.24
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,263,125.04
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,594,117.18
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,254,375.04
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,601,210.98
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,493,835.93
T 1.25% 08/15/31	16,120,000.00	13,991,656.25
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	13,078,886.75
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,509,726.58
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,620,037.87
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,848,906.24
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,952,929.70
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,618,304.73
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,468,212.90
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,943,671.88
T 1.375% 11/15/31	18,030,000.00	15,766,389.93
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,429,687.50
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,444,835.96
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,629,687.50
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,853,328.12
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,077,539.10
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,252,968.75
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,858,398.47
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,732,335.97
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,160,667.58
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	10,041,968.75
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	994,218.75
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,194,179.68
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,469,873.05
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,649,500.00
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,935,656.25
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,521,394.54
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,675,153.50
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,352,937.51
T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	11,328,125.00
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,771,484.39

T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,365,054.72	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	5,032,500.00	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,818,125.00	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,981,386.34	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,883,515.64	
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	7,094,882.85	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,231,640.66	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,641,562.48	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,056,769.54	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,332,937.50	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,350,312.51	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,493,265.61	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,737,375.02	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,925,195.30	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,664,872.65	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,977,578.12	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,684,996.13	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,924,992.19	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,320,703.12	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,946,269.54	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,523,804.71	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,268,785.19	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,458,714.06	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,592,070.34	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,219,281.25	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,013,212.91	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,306,156.27	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,386,732.44	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,479,169.90	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,321,742.17	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,737,050.02	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,549,625.00	
T 2.375% 05/15/27	2,690,000.00	2,621,383.99	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,735,282.07	
T 2.375% 05/15/51	5,050,000.00	4,337,476.55	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,959,179.70	
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,240,281.25	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,464,442.58	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,955,468.75	
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,484,894.53	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	3,472,500.00	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,875,003.92	

T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	4,382,847.68
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,559,775.40
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,644,932.05
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	13,093,001.62
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,206,669.94
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,920,863.26
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,505,537.10
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,768,392.95
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,006,972.66
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,487,058.62
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,901,446.07
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,481,308.58
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,005,351.56
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,195,187.50
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,700,371.11
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,506,738.28
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,870,082.01
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,329,107.80
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,596,906.26
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,794,324.23
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,001,250.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,231,357.04
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,879,925.80
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,284,537.50
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,821,939.83
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,460,853.12
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,904,075.00
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,137,742.19
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,779,409.19
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,946,134.73
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,329,687.50
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,042,298.45
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,494,726.60
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,274,607.05
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,933,593.75
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,153,098.43
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,266,426.96
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,420,078.12
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,702,139.87
T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,905,769.60
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,825,172.68
T 2% 11/15/41	5,700,000.00	4,649,507.84
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,029,820.31



T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,947,968.76
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,864,214.06
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,016,446.87
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,488,593.79
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,718,554.68
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,042,686.73
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,499,578.12
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	816,079.68
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,520,937.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,102,343.76
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,146,562.50
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,213,046.89
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,591,035.16
T 3% 02/15/47	800,000.00	762,937.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,291,121.11
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,858,593.75
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,556,339.07
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,372,265.62
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,063,292.98
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	5,254,992.18
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,214,929.69
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,017,968.75
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,656,500.00
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,043,226.56
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,698,093.75
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,178,281.25
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,227,007.82
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,271,140.62
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,474,300.00
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,296,503.91
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	656,734.37
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,028,578.12
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,669,260.94
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	917,226.56
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,375,687.50
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,477,632.81
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,321,414.06
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,886,667.97
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,682,396.48
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,300,933.59
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,729,083.98
アメリカドル 小計	1,234,970,000.00	1,151,474,587.73

カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,072,109.60
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,293,152.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,545,062.00
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,322,477.60
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,302,481.60
	CAN 0.5% 12/01/30	2,590,000.00	2,114,709.10
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,257,828.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	667,737.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,381,521.60
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,768,539.20
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,190,885.20
	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	478,333.10
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,058,561.70
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,293,536.80
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,517,737.60
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,166,928.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,670,600.80
	CAN 1.75% 12/01/53	1,830,000.00	1,392,007.80
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	741,344.40
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,418,126.40
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,282,129.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,773,180.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,211,578.20
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,323,709.10
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,592,943.00
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	723,922.80
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,248,757.50
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,182,220.50
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,433,046.60
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,859,515.30
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,412,385.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,197,126.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,383,326.10
CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,205,846.40	
CAN 5% 06/01/37	420,000.00	518,733.60	
カナダドル 小計		64,950,000.00	61,002,098.60 (6,088,619,461)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,257,512.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	31,259,824.00
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,831,250.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	42,862,664.00
	MBONO 5% 03/06/25	3,700,000.00	3,335,661.00

	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,779,288.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	35,980,000.00	33,548,831.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,040,000.00	21,087,407.20
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,646,636.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	38,007,419.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,542,925.80
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,765,433.20
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,359,780.00
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,681,043.40
	メキシコペソ 小計	369,820,000.00	349,965,676.10 (2,245,239,791)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,242,631.10
	BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,032,090.90
	BGB 0.35% 06/22/32	480,000.00	424,584.00
	BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	947,198.80
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,620,113.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	360,825.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,690,988.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,676,361.70
	BGB 0.8% 06/22/28	1,260,000.00	1,240,646.40
	BGB 0.9% 06/22/29	1,560,000.00	1,528,347.60
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	407,627.10
	BGB 0% 10/22/31	1,680,000.00	1,458,895.20
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,460,460.00
	BGB 1.4% 06/22/53	610,000.00	516,627.30
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	755,520.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,138,679.60
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,208,584.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,051,722.00
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,296,530.00
	BGB 1% 06/22/31	2,770,000.00	2,669,587.50
	BGB 2.15% 06/22/66	780,000.00	797,308.20
	BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,209,570.80
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	810,217.10
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,239,360.20
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,586,676.00
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,177,660.80
	BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	2,526,893.60
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,305,026.40
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,326,315.60
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,498,546.60
	BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,143,803.60

BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,090,784.80
BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,147,385.50
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,877,067.20
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,496,594.40
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,895,592.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	563,412.00
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,811,084.40
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,824,202.80
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,043,450.00
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,113,707.40
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,582,352.00
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	670,442.20
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,136,622.50
BTPS 0.9% 04/01/31	2,230,000.00	1,892,667.90
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	765,397.80
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,112,496.50
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,943,088.20
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,240,722.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,793,962.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	985,300.00
BTPS 0% 01/30/24	940,000.00	925,730.80
BTPS 0% 04/01/26	1,460,000.00	1,358,471.60
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,938,350.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,378,863.20
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,458,810.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,793,222.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,890,934.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,764,488.20
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,397,077.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,289,535.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,402,016.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	913,587.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,405,710.20
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,802,237.70
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,701,083.70
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,327,910.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,202,628.00
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,011,130.00
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,819,593.80
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,486,407.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,717,604.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,731,095.00
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,227,840.00

BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	535,980.60	
BTPS 2.15% 09/01/52	920,000.00	720,994.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,296,074.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	1,671,529.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,515,867.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,544,491.10	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,983,564.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,029,060.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,032,865.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,036,559.20	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	1,000,083.90	
BTPS 2.8% 12/01/28	3,190,000.00	3,277,948.30	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,005,781.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,237,219.20	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,110,544.70	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,410,514.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	1,977,963.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,877,057.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,213,852.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,231,893.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,271,668.50	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,061,047.40	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,466,948.80	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,925,147.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,294,011.20	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,724,560.40	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,840,566.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	3,003,354.80	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,620,737.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,934,820.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,746,910.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,248,254.80	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,872,070.40	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,017,728.40	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,589,720.20	
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,814,716.80	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,421,052.00	
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,709,045.20	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,723,708.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	896,336.00	
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,811,149.70	
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,960,680.80	

DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,540,159.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,085,297.60
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,990,580.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,620,384.00
DBR 0.5% 08/15/27	1,940,000.00	1,915,381.40
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,305,078.10
DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,873,676.00
DBR 0% 02/15/32	2,790,000.00	2,525,563.80
DBR 0% 05/15/35	2,260,000.00	1,950,244.40
DBR 0% 05/15/36	3,380,000.00	2,875,298.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,234,551.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,285,520.00
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	3,886,853.50
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	622,651.10
DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,151,437.00
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	3,225,450.80
DBR 0% 08/15/52	1,260,000.00	893,529.00
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,839,113.60
DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,370,125.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,698,247.40
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,067,021.40
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,343,815.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,694,022.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,027,360.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,696,092.40
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	4,290,753.60
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,970,183.10
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,932,701.20
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,087,591.10
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,069,711.40
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,192,449.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,153,661.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,252,826.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,945,977.60
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,917,694.80
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,993,754.40
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,553,484.50
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,744,762.50
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,263,514.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,540,348.80
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,562,441.30
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,599,016.00
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,105,023.50

FRTR 0.5% 05/25/40	3,160,000.00	2,508,344.80	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	535,124.70	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,493,019.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,167,911.10	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,350,000.00	2,454,578.50	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,060,000.00	1,480,872.20	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,721,534.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,827,690.00	
FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	2,013,530.50	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,053,856.30	
FRTR 0% 02/25/27	3,560,000.00	3,400,369.60	
FRTR 0% 03/25/24	3,750,000.00	3,727,425.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,276,385.80	
FRTR 0% 05/25/32	1,970,000.00	1,694,909.20	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,796,646.60	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,384,237.20	
FRTR 0% 11/25/31	4,990,000.00	4,345,192.20	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,090,000.00	3,909,753.70	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,822,200.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,770,000.00	6,848,464.30	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	3,278,639.30	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,479,691.40	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,684,556.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,326,673.20	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,285,840.00	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,660,509.00	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,325,460.80	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,251,946.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,865,761.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,581,806.30	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,646,650.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	4,270,366.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,050,000.00	5,577,573.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,985,327.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,410,761.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,936,691.10	
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,619,134.20	
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	3,143,861.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,450,051.30	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,671,368.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	6,114,452.40	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,240,233.00	

IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	897,952.20
IRISH 0.2% 10/18/30	1,090,000.00	985,381.80
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	413,040.70
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	513,382.10
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	396,250.00
IRISH 0.9% 05/15/28	690,000.00	681,147.30
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	734,969.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,188,348.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	646,235.10
IRISH 1.35% 03/18/31	810,000.00	806,922.00
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	724,352.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	812,570.80
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,654,596.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,311,640.00
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,180,820.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,024,290.90
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,315,811.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,284,035.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,480,855.40
NETHER 0.5% 01/15/40	1,040,000.00	886,225.60
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,297,101.60
NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	646,590.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,549,220.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,676,982.00
NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,221,481.40
NETHER 0% 01/15/26	790,000.00	768,464.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,769,896.00
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,294,423.60
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	762,748.80
NETHER 0% 01/15/52	1,490,000.00	1,008,342.60
NETHER 0% 07/15/30	1,500,000.00	1,366,980.00
NETHER 0% 07/15/31	1,820,000.00	1,632,467.20
NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,572,139.80
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,252,259.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	3,031,283.40
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,057,779.40
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,132,315.00
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,908,468.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,165,319.90
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,313,716.30
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,999,175.10
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,700,837.50
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,061,302.00



OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,814,508.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,436,755.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,509,728.20	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,386,430.20	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	489,834.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,688,013.60	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,067,393.40	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	283,976.00	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,189,563.10	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	617,151.60	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,065,336.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	181,232.70	
RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	480,843.30	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,308,074.00	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,449,760.00	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	913,334.40	
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,120,560.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,429,358.40	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	485,093.40	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,087,013.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,002,880.10	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	231,182.10	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,019,442.60	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,362,225.90	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	839,540.70	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,179,900.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,069,919.80	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	665,133.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,426,187.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,588,789.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,499,496.80	
RFGB 0.125% 04/15/36	330,000.00	266,696.10	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	295,752.40	
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	477,835.20	
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	384,360.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	611,921.40	
RFGB 0.5% 04/15/43	380,000.00	297,369.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	847,728.00	
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	624,682.50	
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	721,004.40	
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	758,032.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	692,856.60	

RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	568,814.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	415,094.40
RFGB 0% 09/15/26	200,000.00	192,102.00
RFGB 0% 09/15/30	800,000.00	715,480.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	529,905.60
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	467,357.10
RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	737,945.60
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	605,000.00
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	752,564.30
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	915,805.40
SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,703,604.20
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,267,855.70
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,599,298.10
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,088,458.00
SPGB 0.5% 10/31/31	1,960,000.00	1,706,297.60
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,730,077.50
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,928,982.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,364,652.80
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,167,401.40
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,228,244.00
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,605,188.80
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,464,122.40
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,774,210.40
SPGB 0% 04/30/23	1,630,000.00	1,629,657.70
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,083,814.90
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	1,827,729.80
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,910,889.50
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,757,920.00
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	3,053,176.40
SPGB 1.4% 07/30/28	3,570,000.00	3,541,975.50
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,658,284.90
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,040,212.80
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	423,515.40
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,666,456.50
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,107,706.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,609,420.00
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	756,477.00
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,892,923.10
SPGB 1.95% 07/30/30	1,990,000.00	2,013,959.60
SPGB 1% 07/30/42	650,000.00	500,123.00
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,698,742.50
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,916,555.20
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,488,458.40

	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,912,992.50
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,200,243.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,362,866.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,039,666.40
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,677,273.20
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,129,357.00
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,849,947.40
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,164,810.80
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	3,030,182.40
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,578,896.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,092,422.50
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,257,381.20
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,549,482.80
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,845,241.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,457,415.20
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,347,906.00
	ユーロ 小計	772,270,000.00	792,704,439.10 (106,824,850,213)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,444,228.00
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,225,090.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,080,081.40
	UKT 0.25% 01/31/25	1,110,000.00	1,071,594.00
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,833,160.70
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,807,681.30
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,162,681.40
	UKT 0.5% 01/31/29	1,020,000.00	942,051.60
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	816,180.60
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,657,789.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,336,796.00
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	608,722.40
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,342,937.20
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	898,794.00
	UKT 0.875% 07/31/33	510,000.00	455,414.70
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,605,293.00
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	429,400.00
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	402,313.60
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	934,610.00
	UKT 1.25% 07/31/51	830,000.00	678,666.10
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,406,152.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,597,296.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,086,571.70
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	367,264.80

	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,622,316.60
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,676,548.20
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,374,905.20
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,204,736.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,081,068.60
	UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,500,972.20
	UKT 1% 01/31/32	400,000.00	368,736.00
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	793,424.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,525,625.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,510,000.00	1,770,882.70
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,737,100.30
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,807,892.60
	UKT 3.25% 01/22/44	2,180,000.00	2,599,519.20
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,842,187.70
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,872,264.60
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,198,640.00
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	2,071,451.20
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,557,674.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,119,964.40
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,559,991.60
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,315,740.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,696,064.00
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,180,591.00
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,942,947.10
	UKT 4.5% 09/07/34	1,860,000.00	2,363,483.40
	UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	3,075,038.20
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,811,173.80
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,262,051.00
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,375,542.40
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,516,798.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,586,600.00
	イギリスポンド 小計	93,140,000.00	99,602,698.50 (15,809,936,332)
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,583,286.50
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,368,660.00
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	7,016,133.60
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,535,375.00
	SGB 1% 11/12/26	8,440,000.00	8,190,176.00
	SGB 2.25% 06/01/32	4,980,000.00	5,196,132.00
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,537,336.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,527,689.20
	スウェーデンクローナ 小計	62,360,000.00	61,954,788.30 (794,879,933)

ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,590,000.00	3,121,038.30
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,790,528.00
	NGB 1.5% 02/19/26	4,670,000.00	4,473,299.60
	NGB 1.75% 02/17/27	4,680,000.00	4,474,548.00
	NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,591,242.80
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,897,214.40
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	3,015,047.00
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,804,089.80
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,676,629.60
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,849,705.60
ノルウェークローネ 小計		58,140,000.00	55,693,343.10 (724,013,460)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	4,306,813.50
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,580,075.00
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	11,781,309.40
	DGB 0% 11/15/24	2,550,000.00	2,510,347.50
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,125,910.90
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,697,980.00
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,687,587.30
	DGB 4.5% 11/15/39	13,290,000.00	19,472,375.10
デンマーククローネ 小計		62,040,000.00	65,162,398.70 (1,180,091,040)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,170,047.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,044,761.20
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,887,364.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,771,038.00
	POLGB 1.75% 04/25/32	650,000.00	425,405.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,591,744.90
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,318,220.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,860,000.00	5,849,179.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,093,249.60
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,669,345.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,838,973.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,467,363.50
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,340,929.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	575,022.00
ポーランドズロチ 小計		51,380,000.00	43,042,643.80 (1,247,233,776)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,224,988.90
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,133,003.60
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,833,409.20
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,255,129.60
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,737,753.70

	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,150,758.40
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,495,848.80
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,636,237.50
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,956,581.60
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,140,000.00	1,084,995.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,520,000.00	3,331,750.40
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,384,940.40
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,419,485.50
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	968,940.00
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,896,321.50
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,619,064.40
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,364,160.90
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,590,566.40
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,206,952.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,064,560.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,654,538.40
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,481,054.40
	ACGB 3% 11/21/33	1,000,000.00	961,920.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	1,979,964.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,547,029.10
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,501,145.60
	オーストラリアドル 小計	54,440,000.00	50,481,099.30 (4,510,486,222)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	702,082.50
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	500,828.80
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	591,311.50
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	672,437.70
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	264,774.40
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,063,854.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	822,431.20
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	729,430.60
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	396,885.70
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	530,037.10
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	742,048.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	612,561.60
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	625,077.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	656,929.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,200,000.00	1,212,060.00
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	408,909.40
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	873,342.60
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	916,414.40
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,614,422.40

シンガポールドル 小計		14,290,000.00	13,935,839.50 (1,288,229,003)
マレーシアリングット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,298,932.20
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,916,313.60
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,469,894.40
	MGS 3.733% 06/15/28	2,870,000.00	2,784,100.90
	MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,297,411.20
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	938,862.90
	MGS 3.828% 07/05/34	1,180,000.00	1,073,304.40
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,541,677.20
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,035,994.60
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,446,825.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,119,807.40
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,949,787.80
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,111,032.40
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	597,870.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,129,110.40
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,797,817.80
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	1,991,340.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,294,860.80
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	2,918,310.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	1,904,586.60
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,539,400.00
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,862,631.20
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,742,688.90
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,406,192.40
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,257,131.60
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,295,493.20
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,623,904.80	
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,011,490.90	
マレーシアリングット 小計		50,920,000.00	49,356,772.60 (1,438,715,371)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	831,302.55
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,210,000.00	1,169,474.92
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	813,993.52
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,327,134.92
	ILGOV 1.3% 04/30/32	280,000.00	248,860.55
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,802,574.10
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,244,860.04
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,244,075.00
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,540,229.22
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	2,010,121.20
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,739,866.52

	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,242,652.46
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,384,674.95
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,030,000.00	2,741,872.28
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,604,537.40
	イスラエルシェケル 小計	31,160,000.00	31,946,229.63 (1,209,957,057)
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,183,176.80
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,714,744.00
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,072,622.40
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,982,630.00
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,635,424.80
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,190,907.20
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,360,162.80
	CGB 2.8% 03/24/29	7,900,000.00	7,908,769.00
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,791,431.00
	CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,476,480.40
	CGB 2.89% 11/18/31	5,510,000.00	5,538,486.70
	CGB 2.91% 10/14/28	10,280,000.00	10,371,389.20
	CGB 3.01% 05/13/28	7,230,000.00	7,351,897.80
	CGB 3.02% 05/27/31	6,850,000.00	6,936,241.50
	CGB 3.03% 03/11/26	26,760,000.00	27,305,636.40
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,086,393.50
	CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,598,700.80
	CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,549,863.20
	CGB 3.53% 10/18/51	2,950,000.00	3,061,510.00
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,548,719.90
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,069,780.40
	CGB 3.86% 07/22/49	5,580,000.00	6,075,225.00
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,635,627.90
	オフショア人民元 小計	266,140,000.00	269,445,820.70 (5,105,351,632)
	合計		296,351,484,593 (296,351,484,593)

## 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	220銘柄	100.0%	49.9%
カナダドル	国債証券	35銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	345銘柄	100.0%	36.0%
イギリスポンド	国債証券	55銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券	26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券	23銘柄	100.0%	1.7%

(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

	2022年 5月19日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,598,741,899
株式	471,674,020,080
派生商品評価勘定	61,889,100
未収入金	2,029,800
未収配当金	5,912,059,581
前払金	122,106,550
差入委託証拠金	300,944,400
流動資産合計	480,671,791,410
資産合計	480,671,791,410
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	184,070,450
未払解約金	137,700,199
未払利息	1,783
流動負債合計	321,772,432
負債合計	321,772,432

	2022年 5月19日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	261,530,666,067
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	218,819,352,911
元本等合計	480,350,018,978
純資産合計	480,350,018,978
負債純資産合計	480,671,791,410

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 5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）

	2022年 5月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,530,666,067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 1.8367円 (1万口当たり純資産額) (18,367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

	2022年 5月19日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 5月19日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2022年 5月19日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 5月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年11月20日
期首元本額	251,467,289,772円
期中追加設定元本額	20,853,063,700円
期中一部解約元本額	10,789,687,405円
期末元本額	261,530,666,067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）	402,322,773円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,973,221,727円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,307,969円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,778,579,622円
世界経済インデックスファンド	3,815,162,819円
日本株式インデックス・オープン	3,333,918,560円
DCマイセレクション25	6,222,408,094円
DCマイセレクション50	18,872,982,488円
DCマイセレクション75	19,209,352,861円
DC日本株式インデックス・オープン	6,188,839,761円
DCマイセレクションS25	3,064,787,665円
DCマイセレクションS50	9,018,728,996円

区分	2022年 5月19日現在
DCマイセレクションS75	6,907,470,219円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,207,082,788円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	195,894,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	699,045,966円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	510,920,818円
DC世界経済インデックスファンド	3,561,708,426円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,794,648,982円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,350,367円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,158,127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）	186,454,647円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,356,825円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	31,325,672円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	113,885,822円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,967,549円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	74,211,525円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	921,074,231円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	437,434,934円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,834,193,077円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	56,557,097円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,007,286円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	486,923,769円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	279,614,742円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	352,327,314円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	35,193,792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）	586,733,097円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,569,767円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,715,762円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,089,649,570円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	472,204,706円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	416,238,322円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,762,760,621円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,377,307円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,191,193円
SMT インデックスバランス・オープン	57,764,069円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,734,780,406円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	515,918,123円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,232,379円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	173,556,205円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,402,526円

区分	2022年 5月19日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,593,870円
グローバル経済コア	217,312,301円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	27,382,083円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	104,084,386円
DCターゲット・イヤーフンド2055	25,075,748円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,141,170,962円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	190,609,842円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	10,457,961円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	9,043,988円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	3,569,522円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	4,855,828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）	44,390,408,622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）	940,021,302円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	296,380,645円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	50,542,273円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	58,692,527円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,650,096,098円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	13,057,353円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	258,653,140円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 5月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	15,913,724,743	
合計	15,913,724,743	

(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

（2022年 5月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,743,226,550	-	8,621,120,000	122,106,550
合計		8,743,226,550	-	8,621,120,000	122,106,550

(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	8,800	3,235.00	28,468,000	
日本水産	251,000	535.00	134,285,000	
マルハニチロ	38,200	2,372.00	90,610,400	
雪国まいたけ	18,800	878.00	16,506,400	
カネコ種苗	7,300	1,829.00	13,351,700	
サカタのタネ	29,700	4,300.00	127,710,000	
ホクト	20,900	1,928.00	40,295,200	
ホクリヨウ	3,500	621.00	2,173,500	
住石ホールディングス	45,000	204.00	9,180,000	
日鉄鉱業	5,600	5,700.00	31,920,000	
三井松島ホールディングス	10,800	3,290.00	35,532,000	
I N P E X	951,100	1,535.00	1,459,938,500	
石油資源開発	30,200	2,693.00	81,328,600	
K & O エナジーグループ	11,100	1,568.00	17,404,800	
ショーボンドホールディングス	34,500	5,470.00	188,715,000	
ミライト・ホールディングス	82,800	1,669.00	138,193,200	
タマホーム	15,600	2,578.00	40,216,800	
サンヨーホームズ	3,000	725.00	2,175,000	
日本アクア	10,200	591.00	6,028,200	
ファーストコーポレーション	6,300	760.00	4,788,000	
ベステラ	5,200	1,173.00	6,099,600	
Robot Home	42,900	194.00	8,322,600	
キャンディル	4,200	516.00	2,167,200	
ダイセキ環境ソリューション	4,900	989.00	4,846,100	
第一カッター興業	6,100	1,293.00	7,887,300	
安藤・間	124,200	805.00	99,981,000	
東急建設	73,200	590.00	43,188,000	
コムシスホールディングス	82,900	2,465.00	204,348,500	
ビーアールホールディングス	34,100	313.00	10,673,300	
高松コンストラクショングループ	15,000	2,057.00	30,855,000	
東建コーポレーション	7,100	8,530.00	60,563,000	

ソネック	2,600	1,011.00	2,628,600	
ヤマウラ	12,000	932.00	11,184,000	
オリエンタル白石	86,400	233.00	20,131,200	
大成建設	157,400	3,830.00	602,842,000	
大林組	579,700	916.00	531,005,200	
清水建設	540,800	690.00	373,152,000	
飛鳥建設	15,900	1,017.00	16,170,300	
長谷工コーポレーション	170,900	1,544.00	263,869,600	
松井建設	22,200	659.00	14,629,800	
銭高組	2,400	3,695.00	8,868,000	
鹿島建設	424,700	1,361.00	578,016,700	
不動テトラ	12,600	1,591.00	20,046,600	
大末建設	6,200	1,568.00	9,721,600	
鉄建建設	12,600	1,792.00	22,579,200	
西松建設	35,900	4,040.00	145,036,000	
三井住友建設	133,900	441.00	59,049,900	
大豊建設	8,700	4,390.00	38,193,000	
佐田建設	12,800	445.00	5,696,000	
ナカノフドー建設	14,200	304.00	4,316,800	
奥村組	33,400	2,839.00	94,822,600	
東鉄工業	26,200	2,118.00	55,491,600	
イチケン	4,300	1,814.00	7,800,200	
富士ピー・エス	7,700	480.00	3,696,000	
浅沼組	6,600	5,240.00	34,584,000	
戸田建設	240,300	678.00	162,923,400	
熊谷組	29,400	2,675.00	78,645,000	
北野建設	3,600	2,066.00	7,437,600	
植木組	5,100	1,416.00	7,221,600	
矢作建設工業	25,400	806.00	20,472,400	
ピーエス三菱	19,500	586.00	11,427,000	
日本ハウスホールディングス	40,300	411.00	16,563,300	
大東建託	60,800	11,020.00	670,016,000	
新日本建設	25,200	698.00	17,589,600	
東亜道路工業	3,100	5,030.00	15,593,000	
日本道路	5,200	6,360.00	33,072,000	
東亜建設工業	14,100	2,521.00	35,546,100	
日本国土開発	53,900	524.00	28,243,600	
若築建設	9,700	1,873.00	18,168,100	
東洋建設	66,600	921.00	61,338,600	
五洋建設	229,800	643.00	147,761,400	
世紀東急工業	28,500	799.00	22,771,500	
福田組	6,300	4,500.00	28,350,000	



住友林業	144,600	1,875.00	271,125,000
日本基礎技術	15,700	611.00	9,592,700
巴コーポレーション	24,800	419.00	10,391,200
大和ハウス工業	522,200	3,206.00	1,674,173,200
ライト工業	34,800	1,714.00	59,647,200
積水ハウス	617,100	2,203.00	1,359,471,300
日特建設	12,300	761.00	9,360,300
北陸電気工事	11,700	752.00	8,798,400
ユアテック	34,000	672.00	22,848,000
日本リーテック	12,000	1,048.00	12,576,000
四電工	6,200	1,665.00	10,323,000
中電工	26,200	2,079.00	54,469,800
関電工	96,500	804.00	77,586,000
きんでん	128,600	1,450.00	186,470,000
東京エネシス	19,000	920.00	17,480,000
トーエネック	6,000	3,070.00	18,420,000
住友電設	14,700	2,177.00	32,001,900
日本電設工業	30,100	1,550.00	46,655,000
エクシオグループ	87,000	2,080.00	180,960,000
新日本空調	14,800	1,764.00	26,107,200
九電工	43,000	2,684.00	115,412,000
三機工業	38,600	1,484.00	57,282,400
日揮ホールディングス	177,900	1,741.00	309,723,900
中外炉工業	5,800	1,635.00	9,483,000
ヤマト	16,400	734.00	12,037,600
太平電業	12,400	2,588.00	32,091,200
高砂熱学工業	50,900	1,586.00	80,727,400
三晃金属工業	2,300	2,659.00	6,115,700
朝日工業社	7,700	1,499.00	11,542,300
明星工業	34,300	678.00	23,255,400
大気社	27,500	3,025.00	83,187,500
ダイダン	12,500	1,921.00	24,012,500
日比谷総合設備	18,100	1,800.00	32,580,000
フィル・カンパニー	3,300	1,177.00	3,884,100
テスホールディングス	16,500	1,473.00	24,304,500
インフロニア・ホールディングス	241,800	931.00	225,115,800
東洋エンジニアリング	24,900	633.00	15,761,700
レイズネクスト	27,600	1,119.00	30,884,400
ニッポン	52,500	1,614.00	84,735,000
日清製粉グループ本社	202,800	1,567.00	317,787,600
日東富士製粉	2,800	3,990.00	11,172,000
昭和産業	17,000	2,392.00	40,664,000

鳥越製粉	15,800	637.00	10,064,600
中部飼料	20,800	1,013.00	21,070,400
フィード・ワン	24,100	656.00	15,809,600
東洋精糖	3,200	979.00	3,132,800
日本甜菜製糖	9,900	1,626.00	16,097,400
D M三井製糖ホールディングス	16,600	1,886.00	31,307,600
塩水港精糖	22,600	207.00	4,678,200
日新製糖	9,000	1,725.00	15,525,000
森永製菓	42,500	3,990.00	169,575,000
中村屋	4,300	3,165.00	13,609,500
江崎グリコ	49,600	3,750.00	186,000,000
名糖産業	7,900	1,595.00	12,600,500
井村屋グループ	10,300	2,278.00	23,463,400
不二家	10,600	2,389.00	25,323,400
山崎製パン	133,800	1,601.00	214,213,800
第一屋製パン	3,700	509.00	1,883,300
モロゾフ	5,900	3,230.00	19,057,000
亀田製菓	10,500	4,200.00	44,100,000
寿スピリッツ	17,700	6,920.00	122,484,000
カルビー	86,600	2,460.00	213,036,000
森永乳業	34,200	4,745.00	162,279,000
六甲バター	13,500	1,490.00	20,115,000
ヤクルト本社	134,100	7,080.00	949,428,000
明治ホールディングス	116,300	6,590.00	766,417,000
雪印メグミルク	44,400	1,750.00	77,700,000
プリマハム	23,800	2,120.00	50,456,000
日本ハム	70,600	3,965.00	279,929,000
林兼産業	5,800	485.00	2,813,000
丸大食品	18,200	1,475.00	26,845,000
S Foods	17,100	2,968.00	50,752,800
柿安本店	6,600	2,419.00	15,965,400
伊藤ハム米久ホールディングス	122,400	650.00	79,560,000
サッポロホールディングス	61,800	2,696.00	166,612,800
アサヒグループホールディングス	427,200	4,231.00	1,807,483,200
キリンホールディングス	698,400	1,919.00	1,340,229,600
宝ホールディングス	121,300	963.00	116,811,900
オエノンホールディングス	52,700	298.00	15,704,600
養命酒製造	5,600	1,735.00	9,716,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,300	1,454.00	188,002,200
サントリー食品インターナショナル	127,100	4,995.00	634,864,500
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,020.00	48,694,000
伊藤園	57,700	5,660.00	326,582,000

キーコーヒー	18,200	2,058.00	37,455,600
ユニカフェ	5,700	919.00	5,238,300
ジャパンフーズ	2,700	1,121.00	3,026,700
日清オイリオグループ	23,100	3,115.00	71,956,500
不二製油グループ本社	41,200	1,779.00	73,294,800
かどや製油	1,900	3,515.00	6,678,500
J・オイルミルズ	17,700	1,540.00	27,258,000
キッコーマン	129,200	6,790.00	877,268,000
味の素	399,900	3,119.00	1,247,288,100
ブルドックソース	7,600	1,870.00	14,212,000
キューピー	94,300	2,176.00	205,196,800
ハウス食品グループ本社	67,100	2,812.00	188,685,200
カゴメ	72,100	3,285.00	236,848,500
焼津水産化学工業	8,700	979.00	8,517,300
アリアケジャパン	17,400	5,000.00	87,000,000
ピエトロ	2,500	1,770.00	4,425,000
エバラ食品工業	4,200	2,809.00	11,797,800
やまみ	1,600	1,539.00	2,462,400
ニチレイ	81,400	2,344.00	190,801,600
東洋水産	89,100	4,640.00	413,424,000
イトアンドホールディングス	7,200	2,227.00	16,034,400
大冷	2,100	1,903.00	3,996,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,800	516.00	5,056,800
日清食品ホールディングス	69,400	8,690.00	603,086,000
永谷園ホールディングス	8,400	1,943.00	16,321,200
一正蒲鉾	7,900	813.00	6,422,700
フジッコ	17,700	1,950.00	34,515,000
ロック・フィールド	19,900	1,409.00	28,039,100
日本たばこ産業	1,018,900	2,300.00	2,343,470,000
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,382.00	14,234,600
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,647.00	19,928,700
なとり	10,600	1,983.00	21,019,800
イフジ産業	3,300	997.00	3,290,100
ピククルスコーポレーション	9,100	1,248.00	11,356,800
ファーマフーズ	23,900	1,664.00	39,769,600
ユーグレナ	97,200	861.00	83,689,200
紀文食品	14,800	1,015.00	15,022,000
ミヨシ油脂	7,100	1,097.00	7,788,700
理研ビタミン	18,500	1,648.00	30,488,000
片倉工業	19,500	2,204.00	42,978,000
ゲンゼ	11,600	3,645.00	42,282,000
東洋紡	73,700	1,067.00	78,637,900

ユニチカ	52,700	251.00	13,227,700
富士紡ホールディングス	8,200	3,265.00	26,773,000
倉敷紡績	15,300	1,858.00	28,427,400
シキボウ	9,700	872.00	8,458,400
日本毛織	53,000	942.00	49,926,000
トーア紡コーポレーション	6,800	377.00	2,563,600
帝国繊維	20,700	1,404.00	29,062,800
帝人	171,000	1,332.00	227,772,000
東レ	1,279,500	637.90	816,193,050
住江織物	3,500	1,915.00	6,702,500
日本フェルト	11,600	419.00	4,860,400
イチカワ	2,700	1,395.00	3,766,500
日東製網	2,000	1,360.00	2,720,000
アツギ	14,300	523.00	7,478,900
ダイニック	6,700	706.00	4,730,200
セーレン	37,000	2,015.00	74,555,000
ソトー	7,000	831.00	5,817,000
東海染工	2,300	1,146.00	2,635,800
小松マテーレ	29,700	1,479.00	43,926,300
ワコールホールディングス	43,800	1,974.00	86,461,200
ホギメディカル	24,400	3,095.00	75,518,000
T S Iホールディングス	60,700	315.00	19,120,500
マツオカコーポレーション	5,900	1,005.00	5,929,500
ワールド	24,400	1,448.00	35,331,200
三陽商会	8,700	846.00	7,360,200
ナイガイ	7,000	293.00	2,051,000
オンワードホールディングス	109,200	245.00	26,754,000
ルックホールディングス	6,000	1,594.00	9,564,000
ゴールドウイン	32,600	7,160.00	233,416,000
デサント	34,800	2,601.00	90,514,800
キング	9,100	510.00	4,641,000
ヤマトインターナショナル	16,200	288.00	4,665,600
特種東海製紙	10,800	3,245.00	35,046,000
王子ホールディングス	755,400	567.00	428,311,800
日本製紙	84,300	972.00	81,939,600
三菱製紙	25,400	292.00	7,416,800
北越コーポレーション	117,900	609.00	71,801,100
中越パルプ工業	7,100	911.00	6,468,100
巴川製紙所	5,500	631.00	3,470,500
大王製紙	86,100	1,396.00	120,195,600
阿波製紙	4,600	320.00	1,472,000
レンゴー	164,700	735.00	121,054,500

トモク	10,600	1,461.00	15,486,600
ザ・バック	13,300	2,273.00	30,230,900
北の達人コーポレーション	66,300	175.00	11,602,500
クラレ	264,200	1,087.00	287,185,400
旭化成	1,201,900	1,049.50	1,261,394,050
共和レザー	11,000	576.00	6,336,000
昭和電工	161,600	2,394.00	386,870,400
住友化学	1,330,000	524.00	696,920,000
住友精化	7,900	2,884.00	22,783,600
日産化学	95,300	7,230.00	689,019,000
ラサ工業	6,500	1,850.00	12,025,000
クレハ	14,300	9,510.00	135,993,000
多木化学	6,900	4,580.00	31,602,000
テイカ	12,600	1,142.00	14,389,200
石原産業	31,600	1,031.00	32,579,600
片倉コープアグリ	4,200	1,273.00	5,346,600
日本曹達	22,600	3,800.00	85,880,000
東ソー	254,800	1,927.00	490,999,600
トクヤマ	57,900	1,705.00	98,719,500
セントラル硝子	29,500	2,605.00	76,847,500
東亜合成	98,100	988.00	96,922,800
大阪ソーダ	16,200	3,030.00	49,086,000
関東電化工業	38,300	973.00	37,265,900
デンカ	65,900	3,355.00	221,094,500
信越化学工業	310,300	17,755.00	5,509,376,500
日本カーバイド工業	6,600	1,390.00	9,174,000
堺化学工業	12,700	1,863.00	23,660,100
第一稀元素化学工業	16,700	1,070.00	17,869,000
エア・ウォーター	166,600	1,746.00	290,883,600
日本酸素ホールディングス	169,800	2,423.00	411,425,400
日本化学工業	5,600	2,133.00	11,944,800
東邦アセチレン	4,000	1,159.00	4,636,000
日本パーカラライジング	88,300	888.00	78,410,400
高圧ガス工業	28,300	630.00	17,829,000
チタン工業	2,100	1,713.00	3,597,300
四国化成工業	23,000	1,232.00	28,336,000
戸田工業	3,900	2,587.00	10,089,300
ステラ ケミファ	9,300	2,343.00	21,789,900
保土谷化学工業	5,600	3,675.00	20,580,000
日本触媒	29,600	5,130.00	151,848,000
大日精化工業	14,600	1,821.00	26,586,600
カネカ	45,300	3,295.00	149,263,500

三菱瓦斯化学	163,700	2,026.00	331,656,200
三井化学	160,400	3,100.00	497,240,000
J S R	172,800	3,605.00	622,944,000
東京応化工業	29,200	7,310.00	213,452,000
大阪有機化学工業	14,900	2,689.00	40,066,100
三菱ケミカルホールディングス	1,210,200	777.30	940,688,460
K Hネオケム	29,800	2,610.00	77,778,000
ダイセル	261,200	813.00	212,355,600
住友ベークライト	28,200	4,280.00	120,696,000
積水化学工業	378,800	1,729.00	654,945,200
日本ゼオン	157,900	1,357.00	214,270,300
アイカ工業	49,000	2,941.00	144,109,000
U B E	87,400	1,964.00	171,653,600
積水樹脂	27,200	1,661.00	45,179,200
タキロンシーアイ	40,100	524.00	21,012,400
旭有機材	10,500	1,896.00	19,908,000
ニチバン	10,600	1,626.00	17,235,600
リケンテクノス	42,700	430.00	18,361,000
大倉工業	9,000	1,679.00	15,111,000
積水化成品工業	23,900	406.00	9,703,400
群栄化学工業	4,100	2,611.00	10,705,100
タイガースポリマー	9,500	422.00	4,009,000
ミライアル	5,900	1,720.00	10,148,000
ダイキアクシス	7,200	724.00	5,212,800
ダイキョーニシカワ	39,100	484.00	18,924,400
竹本容器	6,600	793.00	5,233,800
森六ホールディングス	9,600	1,856.00	17,817,600
恵和	5,100	5,000.00	25,500,000
日本化薬	137,000	1,067.00	146,179,000
カーリットホールディングス	17,400	616.00	10,718,400
日本精化	13,900	1,980.00	27,522,000
扶桑化学工業	16,000	3,735.00	59,760,000
トリケミカル研究所	19,100	2,397.00	45,782,700
A D E K A	81,300	2,390.00	194,307,000
日油	60,100	4,530.00	272,253,000
新日本理化	29,200	259.00	7,562,800
ハリマ化成グループ	13,300	767.00	10,201,100
花王	409,500	5,017.00	2,054,461,500
第一工業製薬	6,700	2,333.00	15,631,100
石原ケミカル	9,100	1,240.00	11,284,000
日華化学	6,200	779.00	4,829,800
ニイタカ	3,700	2,256.00	8,347,200

三洋化成工業	11,100	4,590.00	50,949,000
有機合成薬品工業	12,900	272.00	3,508,800
大日本塗料	22,100	745.00	16,464,500
日本ペイントホールディングス	696,700	951.00	662,561,700
関西ペイント	181,600	1,569.00	284,930,400
神東塗料	14,600	151.00	2,204,600
中国塗料	42,500	886.00	37,655,000
日本特殊塗料	13,000	891.00	11,583,000
藤倉化成	23,100	449.00	10,371,900
太陽ホールディングス	27,300	3,120.00	85,176,000
D I C	74,600	2,496.00	186,201,600
サカタインクス	36,800	923.00	33,966,400
東洋インキＳＣホールディングス	38,000	1,933.00	73,454,000
T & K T O K A	14,900	815.00	12,143,500
富士フィルムホールディングス	332,800	6,885.00	2,291,328,000
資生堂	352,700	5,163.00	1,820,990,100
ライオン	212,100	1,359.00	288,243,900
高砂香料工業	12,200	2,323.00	28,340,600
マンダム	38,800	1,351.00	52,418,800
ミルボン	23,400	4,985.00	116,649,000
ファンケル	76,600	2,198.00	168,366,800
コーセー	35,600	10,820.00	385,192,000
コタ	13,200	1,380.00	18,216,000
シーボン	2,500	1,715.00	4,287,500
ポーラ・オルビスホールディングス	80,800	1,465.00	118,372,000
ノエビアホールディングス	15,400	5,210.00	80,234,000
アジュバンホールディングス	4,300	960.00	4,128,000
新日本製薬	6,400	1,348.00	8,627,200
エステー	12,200	1,455.00	17,751,000
アグロ カネショウ	6,300	1,197.00	7,541,100
コニシ	30,300	1,500.00	45,450,000
長谷川香料	32,600	2,401.00	78,272,600
星光P M C	10,700	555.00	5,938,500
小林製薬	53,100	9,080.00	482,148,000
荒川化学工業	15,000	995.00	14,925,000
メック	13,800	2,729.00	37,660,200
日本高純度化学	5,000	2,327.00	11,635,000
タカラバイオ	49,500	1,852.00	91,674,000
J C U	20,500	3,670.00	75,235,000
新田ゼラチン	11,500	595.00	6,842,500
O A T アグリオ	7,800	1,620.00	12,636,000
デクセリアルズ	49,300	3,980.00	196,214,000

アース製薬	15,600	5,240.00	81,744,000
北興化学工業	17,000	1,016.00	17,272,000
大成ラミック	5,500	2,651.00	14,580,500
クミアイ化学工業	70,500	951.00	67,045,500
日本農薬	33,700	697.00	23,488,900
アキレス	12,100	1,312.00	15,875,200
有沢製作所	27,000	1,078.00	29,106,000
日東電工	114,400	8,870.00	1,014,728,000
レック	23,900	752.00	17,972,800
三光合成	21,600	344.00	7,430,400
きもと	29,000	223.00	6,467,000
藤森工業	16,200	3,440.00	55,728,000
前澤化成工業	11,700	1,256.00	14,695,200
未来工業	6,800	1,478.00	10,050,400
ウェーブロックホールディングス	7,200	661.00	4,759,200
J S P	11,100	1,376.00	15,273,600
エフピコ	34,800	2,565.00	89,262,000
天馬	14,900	2,144.00	31,945,600
信越ポリマー	34,000	1,069.00	36,346,000
東リ	45,800	206.00	9,434,800
ニフコ	63,200	2,787.00	176,138,400
バルカー	15,400	2,555.00	39,347,000
ユニ・チャーム	364,900	4,373.00	1,595,707,700
ショーエイコーポレーション	5,100	588.00	2,998,800
協和キリン	211,700	2,752.00	582,598,400
武田薬品工業	1,488,100	3,681.00	5,477,696,100
アステラス製薬	1,618,700	1,963.00	3,177,508,100
住友ファーマ	116,900	1,106.00	129,291,400
塩野義製薬	232,000	6,748.00	1,565,536,000
わかもと製薬	21,200	268.00	5,681,600
日本新薬	46,800	7,630.00	357,084,000
中外製薬	592,200	3,525.00	2,087,505,000
科研製薬	28,800	3,640.00	104,832,000
エーザイ	220,800	5,470.00	1,207,776,000
ロート製薬	94,900	3,455.00	327,879,500
小野薬品工業	414,100	3,473.00	1,438,169,300
久光製薬	46,700	3,525.00	164,617,500
持田製薬	22,800	3,050.00	69,540,000
参天製薬	345,500	1,009.00	348,609,500
扶桑薬品工業	6,500	2,156.00	14,014,000
日本ケミファ	2,200	1,920.00	4,224,000
ツムラ	57,200	2,940.00	168,168,000



日医工	57,300	435.00	24,925,500
キッセイ薬品工業	31,500	2,530.00	79,695,000
生化学工業	33,400	788.00	26,319,200
栄研化学	31,600	1,626.00	51,381,600
日水製薬	7,000	956.00	6,692,000
鳥居薬品	10,200	3,015.00	30,753,000
JCRファーマ	53,400	2,345.00	125,223,000
東和薬品	27,300	2,460.00	67,158,000
富士製薬工業	11,200	921.00	10,315,200
ゼリア新薬工業	32,300	1,993.00	64,373,900
第一三共	1,449,800	3,277.00	4,750,994,600
キョーリン製薬ホールディングス	36,700	1,709.00	62,720,300
大幸薬品	28,500	623.00	17,755,500
ダイト	12,200	2,641.00	32,220,200
大塚ホールディングス	382,600	4,485.00	1,715,961,000
大正製薬ホールディングス	41,700	4,750.00	198,075,000
ペプチドリーム	99,300	1,564.00	155,305,200
あすか製薬ホールディングス	20,400	982.00	20,032,800
サワイグループホールディングス	39,800	3,900.00	155,220,000
日本コークス工業	160,000	131.00	20,960,000
ニチレキ	23,000	1,216.00	27,968,000
ユシロ化学工業	9,500	983.00	9,338,500
ビーピー・カストロール	6,800	1,194.00	8,119,200
富士石油	47,500	315.00	14,962,500
MORESCO	6,300	1,165.00	7,339,500
出光興産	204,300	3,400.00	694,620,000
ENEOSホールディングス	2,848,200	511.10	1,455,715,020
コスモエネルギーホールディングス	61,400	3,530.00	216,742,000
横浜ゴム	103,000	1,658.00	170,774,000
TOYO TIRE	96,600	1,747.00	168,760,200
ブリヂストン	531,500	4,878.00	2,592,657,000
住友ゴム工業	164,900	1,156.00	190,624,400
藤倉コンポジット	15,200	832.00	12,646,400
オカモト	10,500	3,750.00	39,375,000
フコク	8,300	960.00	7,968,000
ニッタ	19,000	2,754.00	52,326,000
住友理工	36,700	550.00	20,185,000
三ツ星ベルト	23,000	2,675.00	61,525,000
バンドー化学	30,500	864.00	26,352,000
日東紡績	26,700	2,241.00	59,834,700
AGC	169,400	4,770.00	808,038,000
日本板硝子	89,200	373.00	33,271,600

石塚硝子	3,100	1,741.00	5,397,100
日本山村硝子	7,100	771.00	5,474,100
日本電気硝子	74,100	2,702.00	200,218,200
オハラ	7,600	1,174.00	8,922,400
住友大阪セメント	33,600	3,265.00	109,704,000
太平洋セメント	107,600	1,923.00	206,914,800
日本ヒューム	18,000	684.00	12,312,000
日本コンクリート工業	36,600	284.00	10,394,400
三谷セキサン	8,500	5,000.00	42,500,000
アジアパイルホールディングス	28,600	450.00	12,870,000
東海カーボン	154,400	1,018.00	157,179,200
日本カーボン	9,800	4,185.00	41,013,000
東洋炭素	12,000	2,872.00	34,464,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,070.00	41,514,000
TOTO	128,300	4,280.00	549,124,000
日本碍子	199,000	1,839.00	365,961,000
日本特殊陶業	140,100	2,407.00	337,220,700
MARUWA	6,600	14,300.00	94,380,000
品川リフラクトリーズ	4,500	3,470.00	15,615,000
黒崎播磨	3,200	4,000.00	12,800,000
ヨータイ	12,100	1,443.00	17,460,300
東京窯業	22,700	292.00	6,628,400
ニッカトー	8,600	471.00	4,050,600
フジインコーポレーテッド	15,200	5,550.00	84,360,000
クニミネ工業	6,100	908.00	5,538,800
エーアンドエーマテリアル	3,200	855.00	2,736,000
ニチアス	42,600	2,145.00	91,377,000
ニチハ	25,600	2,210.00	56,576,000
日本製鉄	819,400	2,100.00	1,720,740,000
神戸製鋼所	341,800	675.00	230,715,000
中山製鋼所	28,600	410.00	11,726,000
合同製鐵	9,800	1,227.00	12,024,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	481,600	1,524.00	733,958,400
東京製鐵	60,800	1,320.00	80,256,000
共英製鋼	20,300	1,253.00	25,435,900
大和工業	33,100	4,060.00	134,386,000
東京鐵鋼	8,100	1,176.00	9,525,600
大阪製鐵	10,000	1,324.00	13,240,000
淀川製鋼所	23,200	2,199.00	51,016,800
丸一鋼管	57,600	2,763.00	159,148,800
モリ工業	5,200	2,440.00	12,688,000
大同特殊鋼	29,000	3,485.00	101,065,000

日本高周波鋼業	7,100	330.00	2,343,000
日本冶金工業	13,400	2,111.00	28,287,400
山陽特殊製鋼	18,200	1,920.00	34,944,000
愛知製鋼	10,600	1,917.00	20,320,200
日立金属	201,700	2,008.00	405,013,600
日本金属	4,700	1,108.00	5,207,600
大太平洋金属	11,500	2,733.00	31,429,500
新日本電工	115,300	350.00	40,355,000
栗本鐵工所	8,300	1,607.00	13,338,100
虹技	2,600	964.00	2,506,400
三菱製鋼	12,100	951.00	11,507,100
日亜鋼業	23,600	259.00	6,112,400
日本精線	3,100	4,190.00	12,989,000
エンビプロ・ホールディングス	12,500	958.00	11,975,000
シンニッタン	22,900	218.00	4,992,200
新家工業	4,400	1,393.00	6,129,200
大紀アルミニウム工業所	26,600	1,336.00	35,537,600
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,592.00	75,460,800
三井金属鉱業	50,600	3,285.00	166,221,000
東邦亜鉛	10,200	2,398.00	24,459,600
三菱マテリアル	118,600	1,951.00	231,388,600
住友金属鉱山	228,000	5,159.00	1,176,252,000
DOWAホールディングス	48,600	4,515.00	219,429,000
古河機械金属	30,200	1,224.00	36,964,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,700	1,342.00	29,121,400
東邦チタニウム	33,600	1,824.00	61,286,400
UACJ	27,500	2,206.00	60,665,000
CKサンエツ	3,800	4,075.00	15,485,000
古河電気工業	56,800	2,187.00	124,221,600
住友電気工業	684,600	1,387.00	949,540,200
フジクラ	208,800	760.00	158,688,000
昭和電線ホールディングス	16,400	1,681.00	27,568,400
東京特殊電線	2,700	2,260.00	6,102,000
タツタ電線	33,200	469.00	15,570,800
カナレ電気	2,900	1,652.00	4,790,800
平河ヒューテック	10,500	1,071.00	11,245,500
リョービ	21,800	1,084.00	23,631,200
アーレスティ	20,300	359.00	7,287,700
アサヒホールディングス	75,000	2,051.00	153,825,000
稲葉製作所	10,200	1,267.00	12,923,400
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,325.00	18,620,000
トーカロ	48,300	1,339.00	64,673,700

アルファC o	7,000	934.00	6,538,000
SUMCO	295,000	1,963.00	579,085,000
川田テクノロジーズ	3,700	3,295.00	12,191,500
RS Technologies	6,100	6,350.00	38,735,000
ジェイテックコーポレーション	2,400	1,904.00	4,569,600
信和	11,600	792.00	9,187,200
東洋製罐グループホールディングス	111,300	1,368.00	152,258,400
ホッカンホールディングス	9,800	1,190.00	11,662,000
コロナ	9,900	815.00	8,068,500
横河ブリッジホールディングス	30,400	1,873.00	56,939,200
駒井ハルテック	3,300	1,761.00	5,811,300
高田機工	1,700	2,548.00	4,331,600
三和ホールディングス	176,500	1,227.00	216,565,500
文化シャッター	58,000	929.00	53,882,000
三協立山	23,500	591.00	13,888,500
アルインコ	13,200	839.00	11,074,800
東洋シャッター	4,100	570.00	2,337,000
LIXIL	294,700	2,488.00	733,213,600
日本フィルコン	12,600	507.00	6,388,200
ノーリツ	33,800	1,455.00	49,179,000
長府製作所	19,000	1,813.00	34,447,000
リンナイ	34,300	8,420.00	288,806,000
ダイニチ工業	9,000	612.00	5,508,000
日東精工	22,700	486.00	11,032,200
三洋工業	2,300	1,802.00	4,144,600
岡部	32,800	628.00	20,598,400
ジーテクト	22,400	1,256.00	28,134,400
東プレ	32,800	1,014.00	33,259,200
高周波熱錬	30,500	594.00	18,117,000
東京製綱	11,500	896.00	10,304,000
サンコール	16,000	618.00	9,888,000
モリテック スチール	14,600	297.00	4,336,200
パイオラックス	26,100	1,378.00	35,965,800
エイチワン	17,800	574.00	10,217,200
日本発條	167,400	904.00	151,329,600
中央発條	9,000	657.00	5,913,000
アドバネクス	2,400	1,767.00	4,240,800
立川ブラインド工業	7,900	1,063.00	8,397,700
三益半導体工業	14,600	2,295.00	33,507,000
日本ドライケミカル	4,600	1,503.00	6,913,800
日本製鋼所	54,000	3,065.00	165,510,000
三浦工業	78,700	2,736.00	215,323,200

タクマ	60,300	1,409.00	84,962,700
ツガミ	40,400	1,209.00	48,843,600
オークマ	20,600	5,110.00	105,266,000
芝浦機械	21,200	2,817.00	59,720,400
アマダ	295,800	1,014.00	299,941,200
アイダエンジニアリング	46,500	908.00	42,222,000
滝澤鉄工所	5,500	1,283.00	7,056,500
F U J I	82,500	2,144.00	176,880,000
牧野フライス製作所	20,100	4,175.00	83,917,500
オーエスジー	85,700	1,671.00	143,204,700
ダイジェット工業	2,300	928.00	2,134,400
旭ダイヤモンド工業	48,500	585.00	28,372,500
D M G 森精機	108,700	1,769.00	192,290,300
ソディック	40,900	742.00	30,347,800
ディスコ	27,600	33,200.00	916,320,000
日東工器	9,900	1,499.00	14,840,100
日進工具	14,800	1,238.00	18,322,400
パンチ工業	16,000	460.00	7,360,000
富士ダイス	9,600	635.00	6,096,000
豊和工業	9,900	740.00	7,326,000
O K K	6,800	1,104.00	7,507,200
東洋機械金属	12,300	574.00	7,060,200
津田駒工業	3,500	522.00	1,827,000
エンシュウ	4,500	729.00	3,280,500
島精機製作所	27,500	1,898.00	52,195,000
オプトラン	23,500	1,862.00	43,757,000
N C ホールディングス	4,400	1,709.00	7,519,600
イワキポンプ	12,000	939.00	11,268,000
フリー	16,700	984.00	16,432,800
ヤマシンフィルタ	35,300	310.00	10,943,000
日阪製作所	21,900	783.00	17,147,700
やまびこ	34,700	1,193.00	41,397,100
野村マイクロ・サイエンス	6,400	4,115.00	26,336,000
平田機工	8,700	4,270.00	37,149,000
ペガサスミシン製造	19,100	558.00	10,657,800
マルマエ	7,700	2,103.00	16,193,100
タツモ	8,800	1,364.00	12,003,200
ナプテスコ	104,500	3,025.00	316,112,500
三井海洋開発	20,000	1,222.00	24,440,000
レオン自動機	20,100	1,238.00	24,883,800
S M C	55,400	65,790.00	3,644,766,000
ホソカワミクロン	12,900	2,465.00	31,798,500

ユニオンツール	7,000	3,695.00	25,865,000
オイレス工業	25,600	1,504.00	38,502,400
日精エー・エス・ピー機械	6,600	2,815.00	18,579,000
サトーホールディングス	24,700	1,800.00	44,460,000
技研製作所	16,600	3,470.00	57,602,000
日本エアージェット	8,700	1,051.00	9,143,700
カワタ	5,900	1,038.00	6,124,200
日精樹脂工業	12,900	920.00	11,868,000
オカダアイオン	6,000	1,464.00	8,784,000
ワイエイシイホールディングス	7,500	1,846.00	13,845,000
小松製作所	858,100	3,140.00	2,694,434,000
住友重機械工業	106,100	2,953.00	313,313,300
日立建機	76,000	2,830.00	215,080,000
日工	25,500	615.00	15,682,500
巴工業	7,300	2,387.00	17,425,100
井関農機	16,900	1,199.00	20,263,100
TOWA	16,200	1,855.00	30,051,000
丸山製作所	3,700	1,550.00	5,735,000
北川鉄工所	8,300	1,332.00	11,055,600
ローツェ	9,300	10,860.00	100,998,000
タカキタ	6,500	578.00	3,757,000
クボタ	917,300	2,268.50	2,080,895,050
荏原実業	8,800	2,340.00	20,592,000
三菱化工機	6,000	2,020.00	12,120,000
月島機械	33,300	879.00	29,270,700
帝国電機製作所	12,900	1,588.00	20,485,200
新東工業	39,900	666.00	26,573,400
澁谷工業	16,100	2,281.00	36,724,100
アイチ コーポレーション	27,200	859.00	23,364,800
小森コーポレーション	47,200	741.00	34,975,200
鶴見製作所	14,300	1,778.00	25,425,400
住友精密工業	2,900	2,542.00	7,371,800
日本ギア工業	7,100	262.00	1,860,200
酒井重工業	3,300	2,952.00	9,741,600
荏原製作所	75,800	5,460.00	413,868,000
石井鐵工所	2,600	2,936.00	7,633,600
西島製作所	16,700	1,247.00	20,824,900
北越工業	17,300	823.00	14,237,900
ダイキン工業	229,700	19,980.00	4,589,406,000
オルガノ	5,500	10,280.00	56,540,000
トーヨーカネツ	7,000	2,626.00	18,382,000
栗田工業	100,200	4,775.00	478,455,000

椿本チエイン	24,800	3,015.00	74,772,000
大同工業	8,400	820.00	6,888,000
木村化工機	15,700	632.00	9,922,400
アネスト岩田	29,600	841.00	24,893,600
ダイフク	99,300	8,280.00	822,204,000
サムコ	4,900	2,469.00	12,098,100
加藤製作所	9,300	778.00	7,235,400
油研工業	3,200	1,747.00	5,590,400
タダノ	96,700	931.00	90,027,700
フジテック	64,600	2,461.00	158,980,600
C K D	53,300	1,781.00	94,927,300
キトー	15,700	2,680.00	42,076,000
平和	52,900	1,876.00	99,240,400
理想科学工業	14,700	2,131.00	31,325,700
S A N K Y O	40,900	4,250.00	173,825,000
日本金銭機械	19,300	680.00	13,124,000
マースグループホールディングス	12,100	1,663.00	20,122,300
フクシマガリレイ	12,600	3,530.00	44,478,000
オーイズミ	6,800	410.00	2,788,000
ダイコク電機	8,800	1,146.00	10,084,800
竹内製作所	28,800	2,355.00	67,824,000
アマノ	49,600	2,419.00	119,982,400
J U K I	26,300	692.00	18,199,600
ジャノメ	16,200	673.00	10,902,600
マックス	24,300	1,566.00	38,053,800
グローリー	47,400	1,960.00	92,904,000
新晃工業	17,700	1,455.00	25,753,500
大和冷機工業	27,500	1,009.00	27,747,500
セガサミーホールディングス	187,800	2,374.00	445,837,200
日本ピストンリング	7,000	1,266.00	8,862,000
リケン	7,800	2,268.00	17,690,400
T P R	24,100	1,200.00	28,920,000
ツバキ・ナカシマ	41,700	907.00	37,821,900
ホシザキ	55,400	7,480.00	414,392,000
大豊工業	15,600	631.00	9,843,600
日本精工	345,800	728.00	251,742,400
N T N	386,000	247.00	95,342,000
ジェイテクト	175,000	975.00	170,625,000
不二越	15,200	3,635.00	55,252,000
日本トムソン	49,200	557.00	27,404,400
T H K	106,900	2,627.00	280,826,300
ユーシン精機	14,800	660.00	9,768,000

前澤給装工業	13,600	780.00	10,608,000
イーグル工業	22,500	954.00	21,465,000
前澤工業	12,300	617.00	7,589,100
日本ピラー工業	18,200	2,775.00	50,505,000
キッツ	60,400	663.00	40,045,200
マキタ	225,000	3,728.00	838,800,000
三井E & Sホールディングス	68,400	344.00	23,529,600
日立造船	157,100	798.00	125,365,800
三菱重工業	290,900	4,947.00	1,439,082,300
I H I	118,300	3,620.00	428,246,000
スター精密	27,300	1,604.00	43,789,200
日清紡ホールディングス	109,300	1,003.00	109,627,900
イビデン	96,900	4,810.00	466,089,000
コニカミノルタ	406,600	436.00	177,277,600
ブラザー工業	226,600	2,259.00	511,889,400
ミネベアミツミ	318,500	2,351.00	748,793,500
日立製作所	910,600	6,545.00	5,959,877,000
東芝	330,900	5,520.00	1,826,568,000
三菱電機	1,851,300	1,396.00	2,584,414,800
富士電機	111,200	5,790.00	643,848,000
東洋電機製造	6,700	936.00	6,271,200
安川電機	198,600	4,245.00	843,057,000
シンフォニアテクノロジー	21,600	1,343.00	29,008,800
明電舎	30,300	2,096.00	63,508,800
オリジン	4,600	1,244.00	5,722,400
山洋電気	8,100	5,320.00	43,092,000
デンヨー	15,200	1,610.00	24,472,000
PHCホールディングス	29,900	1,580.00	47,242,000
東芝テック	20,300	3,940.00	79,982,000
芝浦メカトロニクス	3,500	10,360.00	36,260,000
マブチモーター	44,200	3,500.00	154,700,000
日本電産	467,500	8,123.00	3,797,502,500
トレックス・セミコンダクター	9,600	2,670.00	25,632,000
東光高岳	11,300	1,750.00	19,775,000
ダイヘン	19,700	3,910.00	77,027,000
ヤーマン	31,900	1,171.00	37,354,900
JVCケンウッド	160,500	190.00	30,495,000
ミマキエンジニアリング	19,000	573.00	10,887,000
I - P E X	9,700	1,400.00	13,580,000
日新電機	44,400	1,450.00	64,380,000
大崎電気工業	33,800	490.00	16,562,000
オムロン	157,600	7,217.00	1,137,399,200



日東工業	23,800	2,162.00	51,455,600
I D E C	23,400	2,623.00	61,378,200
正興電機製作所	6,800	1,113.00	7,568,400
不二電機工業	4,600	1,146.00	5,271,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,600	2,063.00	125,017,800
サクサホールディングス	4,400	1,500.00	6,600,000
メルコホールディングス	4,900	3,550.00	17,395,000
テクノメディカ	5,000	1,522.00	7,610,000
日本電気	235,300	5,220.00	1,228,266,000
富士通	170,400	19,705.00	3,357,732,000
沖電気工業	75,200	777.00	58,430,400
岩崎通信機	7,700	836.00	6,437,200
電気興業	9,700	2,456.00	23,823,200
サンケン電気	17,200	5,400.00	92,880,000
ナカヨ	3,300	1,100.00	3,630,000
アイホン	10,000	1,709.00	17,090,000
ルネサスエレクトロニクス	1,029,200	1,431.00	1,472,785,200
セイコーエプソン	227,100	1,952.00	443,299,200
ワコム	148,000	1,023.00	151,404,000
アルバック	37,700	5,270.00	198,679,000
アクセル	9,100	832.00	7,571,200
E I Z O	14,300	3,345.00	47,833,500
日本信号	45,500	873.00	39,721,500
京三製作所	39,400	434.00	17,099,600
能美防災	24,500	1,683.00	41,233,500
ホーチキ	14,000	1,230.00	17,220,000
星和電機	10,700	465.00	4,975,500
エレコム	44,200	1,549.00	68,465,800
パナソニック ホールディングス	2,019,400	1,113.50	2,248,601,900
シャープ	203,900	1,075.00	219,192,500
アンリツ	121,900	1,477.00	180,046,300
富士通ゼネラル	51,400	2,327.00	119,607,800
ソニーグループ	1,186,100	11,390.00	13,509,679,000
T D K	274,500	4,270.00	1,172,115,000
帝国通信工業	9,200	1,342.00	12,346,400
タムラ製作所	71,400	554.00	39,555,600
アルプスアルパイン	164,200	1,380.00	226,596,000
池上通信機	5,600	594.00	3,326,400
日本電波工業	20,100	1,202.00	24,160,200
鈴木	10,900	757.00	8,251,300
メイコー	20,800	4,030.00	83,824,000
日本トリム	4,100	2,354.00	9,651,400

ローランド ディー・ジー	11,600	3,025.00	35,090,000
フォスター電機	18,600	709.00	13,187,400
S M K	4,400	2,108.00	9,275,200
ヨコオ	14,000	2,377.00	33,278,000
ホシデン	45,300	1,196.00	54,178,800
ヒロセ電機	28,400	17,030.00	483,652,000
日本航空電子工業	41,600	1,949.00	81,078,400
T O A	20,300	817.00	16,585,100
マクセル	37,600	1,227.00	46,135,200
古野電気	23,700	979.00	23,202,300
ユニデンホールディングス	4,100	2,878.00	11,799,800
スミダコーポレーション	19,200	829.00	15,916,800
アイコム	6,700	2,390.00	16,013,000
リオン	7,500	2,435.00	18,262,500
本多通信工業	17,300	491.00	8,494,300
横河電機	184,200	2,216.00	408,187,200
新電元工業	7,100	3,285.00	23,323,500
アズビル	111,000	3,620.00	401,820,000
東亜ディーケーケー	10,700	945.00	10,111,500
日本光電工業	76,900	3,160.00	243,004,000
チノー	6,000	1,607.00	9,642,000
共和電業	18,100	327.00	5,918,700
日本電子材料	9,400	1,776.00	16,694,400
堀場製作所	34,200	6,410.00	219,222,000
アドバンテスト	140,800	8,610.00	1,212,288,000
小野測器	10,200	445.00	4,539,000
エスベック	15,600	1,800.00	28,080,000
キーエンス	171,600	50,260.00	8,624,616,000
日置電機	9,200	7,210.00	66,332,000
シスメックス	152,100	7,892.00	1,200,373,200
日本マイクロニクス	32,200	1,436.00	46,239,200
メガチップス	17,100	3,660.00	62,586,000
O B A R A G R O U P	8,600	2,879.00	24,759,400
澤藤電機	3,100	1,452.00	4,501,200
原田工業	10,300	910.00	9,373,000
コーセル	22,500	753.00	16,942,500
イリソ電子工業	16,300	3,310.00	53,953,000
オブテックスグループ	31,700	1,942.00	61,561,400
千代田インテグレ	8,300	1,919.00	15,927,700
レーザーテック	81,400	17,455.00	1,420,837,000
スタンレー電気	129,300	2,239.00	289,502,700
岩崎電気	7,100	2,404.00	17,068,400

ウシオ電機	95,300	1,681.00	160,199,300
岡谷電機産業	17,800	272.00	4,841,600
ハリオス テクノ ホールディング	20,300	282.00	5,724,600
エノモト	6,000	1,646.00	9,876,000
日本セラミック	18,100	2,130.00	38,553,000
遠藤照明	10,200	781.00	7,966,200
古河電池	14,500	1,129.00	16,370,500
双信電機	11,300	556.00	6,282,800
山一電機	14,000	1,823.00	25,522,000
図研	12,800	2,785.00	35,648,000
日本電子	38,600	6,100.00	235,460,000
カシオ計算機	126,900	1,189.00	150,884,100
ファナック	166,200	19,980.00	3,320,676,000
日本シイエムケイ	38,100	478.00	18,211,800
エンプラス	5,100	3,420.00	17,442,000
大真空	25,900	1,071.00	27,738,900
ローム	82,900	9,870.00	818,223,000
浜松ホトニクス	132,800	5,810.00	771,568,000
三井ハイテック	17,900	11,050.00	197,795,000
新光電気工業	55,900	4,925.00	275,307,500
京セラ	266,500	6,978.00	1,859,637,000
太陽誘電	89,600	5,080.00	455,168,000
村田製作所	543,100	8,101.00	4,399,653,100
双葉電子工業	34,200	690.00	23,598,000
北陸電気工業	8,100	1,122.00	9,088,200
ニチコン	57,500	1,293.00	74,347,500
日本ケミコン	18,600	1,782.00	33,145,200
K O A	28,500	1,650.00	47,025,000
市光工業	26,000	363.00	9,438,000
小糸製作所	101,100	4,670.00	472,137,000
ミツバ	33,000	404.00	13,332,000
S C R E E Nホールディングス	31,900	11,600.00	370,040,000
キャノン電子	18,200	1,504.00	27,372,800
キャノン	940,800	3,213.00	3,022,790,400
リコー	500,500	1,054.00	527,527,000
象印マホービン	50,700	1,352.00	68,546,400
M U T O Hホールディングス	3,000	2,059.00	6,177,000
東京エレクトロン	120,100	57,660.00	6,924,966,000
トヨタ紡織	73,600	2,007.00	147,715,200
芦森工業	3,600	1,052.00	3,787,200
ユニプレス	29,100	831.00	24,182,100
豊田自動織機	146,900	8,110.00	1,191,359,000

モリタホールディングス	30,300	1,304.00	39,511,200
三櫻工業	26,200	640.00	16,768,000
デンソー	401,500	7,346.00	2,949,419,000
東海理化電機製作所	49,900	1,342.00	66,965,800
川崎重工業	134,900	2,489.00	335,766,100
名村造船所	54,200	334.00	18,102,800
日本車輛製造	6,600	2,078.00	13,714,800
三菱ロジスネクスト	25,100	825.00	20,707,500
近畿車輛	2,800	1,165.00	3,262,000
日産自動車	2,232,900	483.00	1,078,490,700
いすゞ自動車	578,900	1,508.00	872,981,200
トヨタ自動車	9,271,800	2,005.00	18,589,959,000
日野自動車	236,400	686.00	162,170,400
三菱自動車工業	700,800	377.00	264,201,600
エフテック	12,800	554.00	7,091,200
レシップホールディングス	7,500	559.00	4,192,500
G M B	3,400	707.00	2,403,800
ファルテック	3,300	578.00	1,907,400
武蔵精密工業	42,200	1,324.00	55,872,800
日産車体	27,700	532.00	14,736,400
新明和工業	52,100	952.00	49,599,200
極東開発工業	33,500	1,297.00	43,449,500
トピー工業	15,100	1,239.00	18,708,900
ティラド	4,600	2,626.00	12,079,600
曙ブレーキ工業	103,900	147.00	15,273,300
タチエス	32,500	1,090.00	35,425,000
N O K	84,800	1,108.00	93,958,400
フタバ産業	45,600	366.00	16,689,600
K Y B	18,700	2,893.00	54,099,100
大同メタル工業	36,300	506.00	18,367,800
プレス工業	89,200	403.00	35,947,600
ミクニ	23,400	351.00	8,213,400
太平洋工業	38,400	1,001.00	38,438,400
河西工業	23,200	244.00	5,660,800
アイシン	138,600	3,875.00	537,075,000
マツダ	581,900	1,122.00	652,891,800
今仙電機製作所	12,400	559.00	6,931,600
本田技研工業	1,455,300	3,198.00	4,654,049,400
スズキ	413,800	3,658.00	1,513,680,400
S U B A R U	527,500	2,111.50	1,113,816,250
安永	8,600	678.00	5,830,800
ヤマハ発動機	247,000	2,556.00	631,332,000

T B K	20,200	342.00	6,908,400
エクセディ	28,600	1,620.00	46,332,000
豊田合成	58,600	1,983.00	116,203,800
愛三工業	29,700	715.00	21,235,500
盟和産業	2,700	1,001.00	2,702,700
日本プラスト	14,500	445.00	6,452,500
ヨロズ	16,700	772.00	12,892,400
エフ・シー・シー	30,900	1,331.00	41,127,900
シマノ	73,900	22,150.00	1,636,885,000
テイ・エス テック	79,900	1,267.00	101,233,300
ジャムコ	11,100	843.00	9,357,300
テルモ	535,800	3,959.00	2,121,232,200
クリエートメディック	5,700	978.00	5,574,600
日機装	53,900	803.00	43,281,700
日本エム・ディ・エム	10,900	1,537.00	16,753,300
島津製作所	237,900	4,755.00	1,131,214,500
J M S	15,600	568.00	8,860,800
長野計器	13,400	1,122.00	15,034,800
ブイ・テクノロジー	8,300	2,930.00	24,319,000
東京計器	12,100	1,097.00	13,273,700
愛知時計電機	7,700	1,455.00	11,203,500
インターアクション	9,500	1,986.00	18,867,000
オーバル	17,000	320.00	5,440,000
東京精密	31,200	4,885.00	152,412,000
マニー	73,300	1,399.00	102,546,700
ニコン	281,700	1,475.00	415,507,500
トプコン	89,000	1,814.00	161,446,000
オリンパス	967,500	2,612.50	2,527,593,750
理研計器	14,400	4,055.00	58,392,000
タムロン	14,200	2,352.00	33,398,400
H O Y A	369,400	12,605.00	4,656,287,000
シード	8,900	486.00	4,325,400
ノーリツ鋼機	17,000	2,243.00	38,131,000
A & D ホロンホールディングス	21,300	999.00	21,278,700
朝日インテック	207,600	2,003.00	415,822,800
シチズン時計	209,500	534.00	111,873,000
リズム	5,900	1,633.00	9,634,700
大研医器	15,000	503.00	7,545,000
メニコン	61,400	2,459.00	150,982,600
シンシア	2,100	481.00	1,010,100
松風	7,400	1,466.00	10,848,400
セイコーホールディングス	26,800	2,354.00	63,087,200

ニプロ	137,800	1,019.00	140,418,200
中本パックス	5,300	1,577.00	8,358,100
スノーピーク	24,700	2,359.00	58,267,300
パラマウントベッドホールディングス	36,300	1,974.00	71,656,200
トランザクション	10,900	1,020.00	11,118,000
粧美堂	5,300	414.00	2,194,200
ニホンフラッシュ	15,700	854.00	13,407,800
前田工織	19,600	2,658.00	52,096,800
永大産業	23,400	276.00	6,458,400
アートネイチャー	16,200	733.00	11,874,600
バンダイナムコホールディングス	165,300	8,941.00	1,477,947,300
アイフィスジャパン	4,800	682.00	3,273,600
共立印刷	29,800	147.00	4,380,600
SHOEI	17,400	5,000.00	87,000,000
フランスベッドホールディングス	24,300	880.00	21,384,000
パイロットコーポレーション	30,300	4,570.00	138,471,000
萩原工業	12,000	1,120.00	13,440,000
フジシールインターナショナル	43,600	1,555.00	67,798,000
タカラトミー	78,200	1,244.00	97,280,800
広済堂ホールディングス	11,700	919.00	10,752,300
エステールホールディングス	4,400	633.00	2,785,200
タカノ	6,500	800.00	5,200,000
プロネクサス	14,700	1,047.00	15,390,900
ホクシン	13,300	146.00	1,941,800
ウッドワン	5,800	1,191.00	6,907,800
大建工業	10,600	1,926.00	20,415,600
凸版印刷	274,100	2,371.00	649,891,100
大日本印刷	217,600	2,868.00	624,076,800
共同印刷	5,200	2,674.00	13,904,800
NISSHA	36,900	1,446.00	53,357,400
光村印刷	1,600	1,281.00	2,049,600
TAKARA & COMPANY	11,300	1,870.00	21,131,000
アシックス	160,000	2,329.00	372,640,000
ツツミ	4,700	1,811.00	8,511,700
ローランド	13,200	4,255.00	56,166,000
小松ウオール工業	5,800	1,835.00	10,643,000
ヤマハ	110,100	5,170.00	569,217,000
河合楽器製作所	5,100	2,850.00	14,535,000
クリナップ	17,600	536.00	9,433,600
ピジョン	114,400	2,050.00	234,520,000
兼松サステック	1,200	1,649.00	1,978,800
キングジム	15,700	918.00	14,412,600

リンテック	39,100	2,319.00	90,672,900
イトーキ	34,900	365.00	12,738,500
任天堂	106,900	59,160.00	6,324,204,000
三菱鉛筆	29,300	1,278.00	37,445,400
タカスタンダード	36,200	1,245.00	45,069,000
コクヨ	88,300	1,629.00	143,840,700
ナカバヤシ	16,400	490.00	8,036,000
グロープライド	16,000	2,236.00	35,776,000
オカムラ	61,100	1,067.00	65,193,700
美津濃	17,700	2,240.00	39,648,000
東京電力ホールディングス	1,416,900	506.00	716,951,400
中部電力	564,400	1,304.00	735,977,600
関西電力	699,000	1,263.00	882,837,000
中国電力	288,300	881.00	253,992,300
北陸電力	169,000	546.00	92,274,000
東北電力	433,600	740.00	320,864,000
四国電力	166,100	769.00	127,730,900
九州電力	381,000	849.00	323,469,000
北海道電力	164,500	496.00	81,592,000
沖縄電力	40,200	1,209.00	48,601,800
電源開発	154,200	2,160.00	333,072,000
エフオン	11,400	541.00	6,167,400
イーレックス	26,700	2,187.00	58,392,900
レノバ	37,100	1,824.00	67,670,400
東京瓦斯	354,300	2,657.00	941,375,100
大阪瓦斯	334,800	2,488.00	832,982,400
東邦瓦斯	82,500	2,961.00	244,282,500
北海道瓦斯	9,400	1,576.00	14,814,400
広島ガス	35,100	320.00	11,232,000
西部ガスホールディングス	20,200	1,962.00	39,632,400
静岡ガス	47,800	842.00	40,247,600
メタウォーター	19,700	2,054.00	40,463,800
SBSホールディングス	14,000	3,005.00	42,070,000
東武鉄道	180,900	2,982.00	539,443,800
相鉄ホールディングス	59,100	2,270.00	134,157,000
東急	465,300	1,554.00	723,076,200
京浜急行電鉄	232,300	1,367.00	317,554,100
小田急電鉄	267,200	1,777.00	474,814,400
京王電鉄	93,200	4,295.00	400,294,000
京成電鉄	125,000	3,325.00	415,625,000
富士急行	21,500	3,965.00	85,247,500
新京成電鉄	4,400	2,700.00	11,880,000

東日本旅客鉄道	318,400	6,627.00	2,110,036,800
西日本旅客鉄道	219,900	4,813.00	1,058,378,700
東海旅客鉄道	149,400	16,350.00	2,442,690,000
西武ホールディングス	240,900	1,391.00	335,091,900
鴻池運輸	29,000	1,118.00	32,422,000
西日本鉄道	50,200	2,829.00	142,015,800
ハマキョウレックス	13,000	2,857.00	37,141,000
サカイ引越センター	8,700	4,435.00	38,584,500
近鉄グループホールディングス	175,600	3,785.00	664,646,000
阪急阪神ホールディングス	219,200	3,470.00	760,624,000
南海電気鉄道	78,300	2,510.00	196,533,000
京阪ホールディングス	76,500	3,070.00	234,855,000
神戸電鉄	4,300	3,285.00	14,125,500
名古屋鉄道	188,900	2,207.00	416,902,300
山陽電気鉄道	13,500	2,091.00	28,228,500
アルプス物流	12,500	1,111.00	13,887,500
ヤマトホールディングス	251,300	2,283.00	573,717,900
山九	46,000	3,780.00	173,880,000
丸運	9,700	236.00	2,289,200
丸全昭和運輸	13,700	2,975.00	40,757,500
センコーグループホールディングス	89,300	858.00	76,619,400
トナミホールディングス	4,000	3,365.00	13,460,000
ニッコンホールディングス	58,800	2,006.00	117,952,800
日本石油輸送	2,000	2,576.00	5,152,000
福山通運	27,300	3,320.00	90,636,000
セイノーホールディングス	113,900	1,011.00	115,152,900
エスライン	5,200	850.00	4,420,000
神奈川中央交通	4,400	3,340.00	14,696,000
日立物流	34,600	8,470.00	293,062,000
丸和運輸機関	35,400	1,684.00	59,613,600
C & F ロジホールディングス	17,100	1,069.00	18,279,900
九州旅客鉄道	132,500	2,584.00	342,380,000
S Gホールディングス	326,300	2,244.00	732,217,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	59,100	7,390.00	436,749,000
日本郵船	150,200	9,630.00	1,446,426,000
商船三井	291,600	3,295.00	960,822,000
川崎汽船	55,200	8,770.00	484,104,000
NSユニテッド海運	10,200	3,755.00	38,301,000
飯野海運	83,000	672.00	55,776,000
共栄タンカー	5,900	1,111.00	6,554,900
乾汽船	11,800	1,789.00	21,110,200
日本航空	402,600	2,232.00	898,603,200



ANAホールディングス	446,000	2,484.50	1,108,087,000
パスコ	3,400	1,276.00	4,338,400
トランコム	5,000	6,850.00	34,250,000
日新	13,900	1,613.00	22,420,700
三菱倉庫	53,400	3,015.00	161,001,000
三井倉庫ホールディングス	18,500	2,895.00	53,557,500
住友倉庫	59,000	2,108.00	124,372,000
澁澤倉庫	10,100	2,219.00	22,411,900
東陽倉庫	28,500	309.00	8,806,500
日本トランスシティ	36,800	539.00	19,835,200
ケイヒン	3,100	1,366.00	4,234,600
中央倉庫	10,400	990.00	10,296,000
川西倉庫	3,300	1,072.00	3,537,600
安田倉庫	13,800	957.00	13,206,600
ファイズホールディングス	3,800	716.00	2,720,800
東洋埠頭	5,300	1,388.00	7,356,400
上組	94,900	2,611.00	247,783,900
サンリツ	4,800	743.00	3,566,400
キムラユニティー	4,700	1,474.00	6,927,800
キューソー流通システム	8,900	1,084.00	9,647,600
近鉄エクスプレス	33,900	4,165.00	141,193,500
東海運	10,200	293.00	2,988,600
エーアイティー	11,200	1,523.00	17,057,600
内外トランスライン	6,900	1,954.00	13,482,600
日本コンセプト	5,700	1,432.00	8,162,400
NEC ネットエスアイ	61,600	1,790.00	110,264,000
クロスキャット	10,300	841.00	8,662,300
システナ	265,500	446.00	118,413,000
デジタルアーツ	10,000	6,580.00	65,800,000
日鉄ソリューションズ	28,700	3,705.00	106,333,500
キューブシステム	9,600	902.00	8,659,200
WOW WORLD	2,800	1,030.00	2,884,000
コア	8,000	1,416.00	11,328,000
手間いらず	2,700	5,080.00	13,716,000
ラクーンホールディングス	15,900	1,420.00	22,578,000
ソリトンシステムズ	9,400	1,240.00	11,656,000
ソフトクリエイイトホールディングス	8,100	4,060.00	32,886,000
T I S	172,300	3,420.00	589,266,000
J N S ホールディングス	8,600	391.00	3,362,600
グリー	84,800	862.00	73,097,600
G M O ペパボ	2,000	2,080.00	4,160,000
コーエーテクモホールディングス	59,300	4,330.00	256,769,000

三菱総合研究所	9,700	4,015.00	38,945,500
電算	2,100	2,195.00	4,609,500
A G S	9,000	752.00	6,768,000
ファインデックス	16,000	604.00	9,664,000
ブレインパッド	15,900	1,079.00	17,156,100
K L a b	33,300	447.00	14,885,100
ポールトゥウィンホールディングス	27,100	1,029.00	27,885,900
ネクソン	420,700	3,000.00	1,262,100,000
アイスタイル	49,200	187.00	9,200,400
エムアップホールディングス	21,700	1,073.00	23,284,100
エイチーム	12,700	723.00	9,182,100
エニグモ	20,400	527.00	10,750,800
テクノスジャパン	14,800	467.00	6,911,600
コロプラ	61,400	615.00	37,761,000
ブロードリーフ	92,600	360.00	33,336,000
クロス・マーケティンググループ	7,300	727.00	5,307,100
デジタルハーツホールディングス	8,500	1,829.00	15,546,500
システム情報	14,100	972.00	13,705,200
メディアドゥ	6,600	1,770.00	11,682,000
じげん	53,200	344.00	18,300,800
ブイキューブ	19,100	991.00	18,928,100
エンカレッジ・テクノロジー	4,500	505.00	2,272,500
サイバーリンクス	6,400	1,006.00	6,438,400
フィックスターズ	19,400	813.00	15,772,200
C A R T A H O L D I N G S	7,600	1,881.00	14,295,600
オブティム	13,200	758.00	10,005,600
セレス	7,100	1,382.00	9,812,200
S H I F T	10,100	19,070.00	192,607,000
ティーガイア	16,600	1,626.00	26,991,600
セック	2,800	2,382.00	6,669,600
テクマトリックス	31,500	1,546.00	48,699,000
プロシップ	6,300	1,306.00	8,227,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	48,300	2,404.00	116,113,200
G M O ペイメントゲートウェイ	36,000	10,150.00	365,400,000
ザッパラス	7,400	402.00	2,974,800
システムリサーチ	5,500	1,934.00	10,637,000
インターネットイニシアティブ	49,500	4,505.00	222,997,500
さくらインターネット	20,200	558.00	11,271,600
ヴィンクス	5,400	1,019.00	5,502,600
G M O グローバルサイン・ホールディングス	4,200	5,710.00	23,982,000
S R A ホールディングス	9,000	2,788.00	25,092,000
システムインテグレータ	6,300	478.00	3,011,400

朝日ネット	17,300	591.00	10,224,300
e B A S E	22,600	448.00	10,124,800
アバント	20,100	1,177.00	23,657,700
アドソル日進	6,800	1,530.00	10,404,000
ODKソリューションズ	4,200	537.00	2,255,400
フリービット	9,800	892.00	8,741,600
コムチュア	20,900	2,804.00	58,603,600
サイバーコム	3,000	1,067.00	3,201,000
アステリア	13,600	995.00	13,532,000
アイル	10,000	1,351.00	13,510,000
マークラインズ	9,400	2,345.00	22,043,000
メディカル・データ・ビジョン	23,700	865.00	20,500,500
g u m i	26,100	522.00	13,624,200
ショーケース	4,400	464.00	2,041,600
モバイルファクトリー	4,400	1,043.00	4,589,200
テラスカイ	6,900	1,283.00	8,852,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,400	1,273.00	10,693,200
P C Iホールディングス	8,200	1,061.00	8,700,200
パイプドHD	3,500	2,697.00	9,439,500
アイビーシー	3,300	476.00	1,570,800
ネオジャパン	5,400	1,194.00	6,447,600
P R T I M E S	4,000	2,044.00	8,176,000
ラクス	85,400	1,479.00	126,306,600
ランドコンピュータ	4,400	879.00	3,867,600
ダブルスタンダード	5,700	2,025.00	11,542,500
オープンドア	11,100	1,887.00	20,945,700
マイネット	6,600	500.00	3,300,000
アカツキ	8,400	2,796.00	23,486,400
ベネフィットジャパン	1,500	1,985.00	2,977,500
U b i c o mホールディングス	4,900	2,726.00	13,357,400
カナミックネットワーク	21,100	470.00	9,917,000
ノムラシステムコーポレーション	10,400	215.00	2,236,000
チェンジ	35,800	1,611.00	57,673,800
シンクロ・フード	10,200	264.00	2,692,800
オークネット	10,000	1,704.00	17,040,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	710.00	2,698,000
セグエグループ	5,200	513.00	2,667,600
エイトレッド	2,700	1,934.00	5,221,800
マクロミル	39,100	1,019.00	39,842,900
ビーグリー	4,500	1,373.00	6,178,500
オロ	6,000	1,848.00	11,088,000
ユーザーローカル	5,800	1,642.00	9,523,600

テモナ	4,300	364.00	1,565,200
ニーズウェル	4,900	667.00	3,268,300
マネーフォワード	37,800	2,992.00	113,097,600
サインポスト	6,000	871.00	5,226,000
電算システムホールディングス	7,700	2,308.00	17,771,600
ソルクシーズ	16,300	358.00	5,835,400
フェイス	5,100	687.00	3,503,700
プロトコーポレーション	19,900	974.00	19,382,600
ハイマックス	5,100	1,196.00	6,099,600
野村総合研究所	347,100	3,270.00	1,135,017,000
サイバネットシステム	13,500	721.00	9,733,500
C Eホールディングス	10,000	448.00	4,480,000
日本システム技術	3,600	2,164.00	7,790,400
インテージホールディングス	21,500	1,437.00	30,895,500
東邦システムサイエンス	5,100	862.00	4,396,200
ソースネクスト	81,300	175.00	14,227,500
インフォコム	20,400	1,987.00	40,534,800
シンプレクス・ホールディングス	29,500	1,810.00	53,395,000
HEROZ	5,500	888.00	4,884,000
ラクスル	21,000	2,075.00	43,575,000
I P S	5,200	2,120.00	11,024,000
F I G	20,800	293.00	6,094,400
システムサポート	6,900	1,034.00	7,134,600
イーソル	11,700	546.00	6,388,200
アルテリア・ネットワークス	21,700	1,268.00	27,515,600
東海ソフト	3,100	961.00	2,979,100
ウイングアーク1st	14,300	1,257.00	17,975,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,300	1,499.00	6,445,700
サーバーワークス	3,300	2,049.00	6,761,700
東名	1,800	810.00	1,458,000
ヴィッツ	1,900	1,203.00	2,285,700
トビラシステムズ	4,000	762.00	3,048,000
S a n s a n	63,800	1,063.00	67,819,400
L i n k - U	3,600	604.00	2,174,400
ギフティ	16,600	1,053.00	17,479,800
ベース	3,200	6,010.00	19,232,000
J M D C	23,300	4,935.00	114,985,500
フォーカスシステムズ	12,300	911.00	11,205,300
クレスコ	13,600	1,976.00	26,873,600
フジ・メディア・ホールディングス	174,600	1,088.00	189,964,800
オービック	58,600	18,930.00	1,109,298,000
ジャストシステム	26,500	4,695.00	124,417,500

TDCソフト	15,900	1,033.00	16,424,700
Zホールディングス	2,679,500	418.50	1,121,370,750
トレンドマイクロ	96,600	7,290.00	704,214,000
IDホールディングス	11,900	827.00	9,841,300
日本オラクル	30,200	7,900.00	238,580,000
アルファシステムズ	5,000	3,770.00	18,850,000
フューチャー	39,300	1,632.00	64,137,600
CAC Holdings	10,600	1,370.00	14,522,000
SBテクノロジー	8,100	2,179.00	17,649,900
トーセ	5,100	715.00	3,646,500
オービックビジネスコンサルタント	17,800	4,150.00	73,870,000
伊藤忠テクノソリューションズ	84,700	3,050.00	258,335,000
アイティフォー	22,700	757.00	17,183,900
東計電算	2,200	5,430.00	11,946,000
エクスネット	3,100	992.00	3,075,200
大塚商会	100,600	3,750.00	377,250,000
サイボウズ	25,000	1,140.00	28,500,000
電通国際情報サービス	25,600	3,970.00	101,632,000
ACCESS	21,300	570.00	12,141,000
デジタルガレージ	30,700	3,920.00	120,344,000
EMシステムズ	30,900	971.00	30,003,900
ウェザーニューズ	6,100	6,610.00	40,321,000
CIJ	14,700	751.00	11,039,700
ビジネスエンジニアリング	2,200	4,120.00	9,064,000
日本エンタープライズ	20,100	164.00	3,296,400
WOWOW	8,600	1,489.00	12,805,400
スカラ	15,900	775.00	12,322,500
インテリジェント ウェイブ	9,600	603.00	5,788,800
IMAGICA GROUP	15,200	690.00	10,488,000
ネットワンシステムズ	68,600	2,618.00	179,594,800
システムソフト	46,800	105.00	4,914,000
アルゴグラフィックス	14,500	3,055.00	44,297,500
マーベラス	29,500	714.00	21,063,000
エイベックス	32,200	1,099.00	35,387,800
BIPROGY	58,100	2,752.00	159,891,200
兼松エレクトロニクス	10,200	3,785.00	38,607,000
都築電気	9,200	1,340.00	12,328,000
TBSホールディングス	104,300	1,695.00	176,788,500
日本テレビホールディングス	155,200	1,217.00	188,878,400
朝日放送グループホールディングス	17,500	667.00	11,672,500
テレビ朝日ホールディングス	44,800	1,447.00	64,825,600
スカパーJ SATホールディングス	157,700	459.00	72,384,300

テレビ東京ホールディングス	12,600	1,966.00	24,771,600
日本BS放送	6,500	1,031.00	6,701,500
ビジョン	31,000	1,241.00	38,471,000
スマートバリュー	4,600	521.00	2,396,600
USEN-NEXT HOLDINGS	16,600	1,972.00	32,735,200
ワイヤレスゲート	8,300	290.00	2,407,000
コネクシオ	13,300	1,405.00	18,686,500
クロップス	3,600	1,012.00	3,643,200
日本電信電話	1,989,700	3,883.00	7,726,005,100
KDDI	1,354,500	4,498.00	6,092,541,000
ソフトバンク	2,814,100	1,475.00	4,150,797,500
光通信	21,400	13,910.00	297,674,000
エムティーアイ	17,200	451.00	7,757,200
GMOインターネット	65,100	2,505.00	163,075,500
ファイバーゲート	8,600	1,122.00	9,649,200
アйдママーケティングコミュニケーション	4,700	282.00	1,325,400
KADOKAWA	101,000	2,915.00	294,415,000
学研ホールディングス	26,500	829.00	21,968,500
ゼンリン	30,500	915.00	27,907,500
昭文社ホールディングス	8,000	392.00	3,136,000
インプレスホールディングス	15,400	209.00	3,218,600
アイネット	9,400	1,242.00	11,674,800
松竹	11,800	13,080.00	154,344,000
東宝	109,700	4,935.00	541,369,500
東映	5,800	17,940.00	104,052,000
エヌ・ティ・ティ・データ	494,700	1,972.00	975,548,400
ピー・シー・エー	11,000	1,174.00	12,914,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	1,516.00	8,489,600
DTS	34,700	2,976.00	103,267,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,500	6,180.00	534,570,000
シーイーシー	20,100	1,181.00	23,738,100
カブコン	175,200	3,615.00	633,348,000
アイ・エス・ビー	8,900	1,032.00	9,184,800
ジャステック	10,900	1,131.00	12,327,900
SCSK	128,700	2,141.00	275,546,700
日本システムウエア	7,100	2,383.00	16,919,300
アイネス	17,500	1,468.00	25,690,000
TKC	30,400	3,345.00	101,688,000
富士ソフト	19,200	6,810.00	130,752,000
NSD	58,300	2,167.00	126,336,100
コナミホールディングス	67,500	8,550.00	577,125,000
福井コンピュータホールディングス	8,600	3,265.00	28,079,000

J B C Cホールディングス	12,700	1,595.00	20,256,500
ミロク情報サービス	16,500	1,180.00	19,470,000
ソフトバンクグループ	1,114,100	5,055.00	5,631,775,500
高千穂交易	7,000	1,748.00	12,236,000
オルパヘルスケアホールディングス	3,100	1,722.00	5,338,200
伊藤忠食品	4,200	4,805.00	20,181,000
エレマテック	15,000	1,261.00	18,915,000
あらた	14,500	3,775.00	54,737,500
トーメンデバイス	2,800	5,700.00	15,960,000
東京エレクトロン デバイス	5,500	5,510.00	30,305,000
フィールズ	16,300	1,089.00	17,750,700
双日	201,100	1,981.00	398,379,100
アルフレッサ ホールディングス	202,700	1,738.00	352,292,600
横浜冷凍	50,000	848.00	42,400,000
ラサ商事	9,000	956.00	8,604,000
アルコニックス	23,400	1,308.00	30,607,200
神戸物産	139,400	2,838.00	395,617,200
ハイパー	4,700	455.00	2,138,500
あい ホールディングス	26,600	1,662.00	44,209,200
ディーブイエックス	6,400	1,005.00	6,432,000
ダイワボウホールディングス	86,900	1,701.00	147,816,900
マクニカ・富士エレホールディングス	44,500	2,749.00	122,330,500
ラクト・ジャパン	6,400	2,030.00	12,992,000
グリムス	8,300	1,431.00	11,877,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,600	697.00	22,025,200
八洲電機	13,500	966.00	13,041,000
メディアスホールディングス	10,700	1,024.00	10,956,800
レスターホールディングス	17,700	1,976.00	34,975,200
ジュテックホールディングス	4,100	1,026.00	4,206,600
大光	8,000	721.00	5,768,000
O C H Iホールディングス	5,000	1,210.00	6,050,000
T O K A Iホールディングス	90,400	865.00	78,196,000
黒谷	5,100	577.00	2,942,700
C o m i n i x	3,300	710.00	2,343,000
三洋貿易	18,200	951.00	17,308,200
ビューティガレージ	3,000	2,446.00	7,338,000
ウイン・パートナーズ	13,500	1,022.00	13,797,000
ミタチ産業	4,700	886.00	4,164,200
シップヘルスケアホールディングス	57,800	2,212.00	127,853,600
明治電機工業	6,000	1,049.00	6,294,000
デリカフーズホールディングス	7,300	533.00	3,890,900
スターティアホールディングス	4,300	628.00	2,700,400

コメダホールディングス	40,700	2,212.00	90,028,400
ピーバンドットコム	2,700	526.00	1,420,200
アセンテック	6,400	729.00	4,665,600
富士興産	4,700	985.00	4,629,500
協栄産業	1,900	1,286.00	2,443,400
フルサト・マルカホールディングス	17,500	4,125.00	72,187,500
ヤマエグループホールディングス	11,900	1,108.00	13,185,200
小野建	17,600	1,395.00	24,552,000
南陽	3,700	1,811.00	6,700,700
佐島電機	11,600	1,210.00	14,036,000
エコートレーディング	4,000	564.00	2,256,000
伯東	11,400	2,857.00	32,569,800
コンドーテック	14,000	1,046.00	14,644,000
中山福	9,900	332.00	3,286,800
ナガイレーベン	24,000	1,862.00	44,688,000
三菱食品	17,900	3,130.00	56,027,000
松田産業	13,600	2,013.00	27,376,800
第一興商	35,400	3,650.00	129,210,000
メディバルホールディングス	191,700	1,775.00	340,267,500
S P K	7,400	1,308.00	9,679,200
萩原電気ホールディングス	6,700	1,988.00	13,319,600
アズワン	26,800	6,500.00	174,200,000
スズデン	6,300	2,029.00	12,782,700
尾家産業	4,800	890.00	4,272,000
シモジマ	11,500	923.00	10,614,500
ドウシシャ	17,600	1,512.00	26,611,200
小津産業	4,100	1,997.00	8,187,700
高速	10,700	1,542.00	16,499,400
たけびし	6,800	1,465.00	9,962,000
リックス	4,100	1,818.00	7,453,800
丸文	16,000	767.00	12,272,000
ハピネット	15,100	1,550.00	23,405,000
橋本総業ホールディングス	3,600	1,894.00	6,818,400
日本ライフライン	55,300	965.00	53,364,500
タカショー	14,300	711.00	10,167,300
I D O M	56,600	655.00	37,073,000
進和	11,000	2,083.00	22,913,000
エスケイジャパン	4,600	443.00	2,037,800
ダイトロン	7,700	2,066.00	15,908,200
シークス	25,700	1,111.00	28,552,700
田中商事	5,800	608.00	3,526,400
オーハシテクニカ	9,800	1,244.00	12,191,200



白銅	6,000	2,430.00	14,580,000
ダイコー通産	2,200	1,264.00	2,780,800
伊藤忠商事	1,242,200	3,570.00	4,434,654,000
丸紅	1,771,400	1,350.00	2,391,390,000
高島	2,700	2,445.00	6,601,500
長瀬産業	94,800	1,777.00	168,459,600
蝶理	10,400	1,885.00	19,604,000
豊田通商	180,400	4,430.00	799,172,000
三共生興	23,900	533.00	12,738,700
兼松	67,900	1,322.00	89,763,800
ツカモトコーポレーション	3,100	1,233.00	3,822,300
三井物産	1,416,100	3,057.00	4,329,017,700
日本紙パルプ商事	9,400	3,630.00	34,122,000
カメイ	21,400	1,049.00	22,448,600
東都水産	1,000	4,395.00	4,395,000
OUGホールディングス	2,700	2,681.00	7,238,700
スターゼン	13,400	1,949.00	26,116,600
山善	74,700	905.00	67,603,500
椿本興業	3,600	3,495.00	12,582,000
住友商事	1,152,500	1,816.50	2,093,516,250
内田洋行	7,800	4,370.00	34,086,000
三菱商事	1,339,200	4,257.00	5,700,974,400
第一実業	8,100	2,996.00	24,267,600
キャノンマーケティングジャパン	46,200	2,988.00	138,045,600
西華産業	9,000	1,644.00	14,796,000
佐藤商事	14,600	1,133.00	16,541,800
菱洋エレクトロ	11,000	2,106.00	23,166,000
東京産業	16,400	691.00	11,332,400
ユアサ商事	16,800	3,150.00	52,920,000
神鋼商事	4,200	3,715.00	15,603,000
トルク	10,100	197.00	1,989,700
阪和興業	35,700	2,898.00	103,458,600
正栄食品工業	12,100	4,000.00	48,400,000
カナデン	15,200	975.00	14,820,000
菱電商事	14,800	1,631.00	24,138,800
岩谷産業	43,600	5,610.00	244,596,000
ナイス	6,200	1,662.00	10,304,400
ニチモウ	2,500	2,484.00	6,210,000
極東貿易	5,400	2,573.00	13,894,200
アステナホールディングス	25,600	431.00	11,033,600
三愛オブリ	44,600	957.00	42,682,200
稲畑産業	39,300	2,117.00	83,198,100

G S Iクレオス	8,900	1,275.00	11,347,500
明和産業	17,300	686.00	11,867,800
クワザワホールディングス	7,200	480.00	3,456,000
ワキタ	37,800	1,067.00	40,332,600
東邦ホールディングス	56,800	2,038.00	115,758,400
サンゲツ	47,600	1,529.00	72,780,400
ミツウロコグループホールディングス	25,000	944.00	23,600,000
シナネンホールディングス	6,700	3,275.00	21,942,500
伊藤忠エネクス	41,300	1,026.00	42,373,800
サンリオ	55,900	2,494.00	139,414,600
サンワテクノス	10,700	1,386.00	14,830,200
リョーサン	20,100	2,206.00	44,340,600
新光商事	26,900	944.00	25,393,600
トーホー	8,000	1,117.00	8,936,000
三信電気	8,300	1,566.00	12,997,800
東陽テクニカ	18,400	1,035.00	19,044,000
モスフードサービス	24,500	3,005.00	73,622,500
加賀電子	16,300	3,130.00	51,019,000
ソーダニッカ	17,400	605.00	10,527,000
立花エレテック	13,600	1,528.00	20,780,800
フォーバル	7,700	856.00	6,591,200
P A L T A C	26,200	4,435.00	116,197,000
三谷産業	29,200	305.00	8,906,000
西本Wismettacホールディングス	4,200	3,375.00	14,175,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	2,015.00	3,425,500
コア商事ホールディングス	11,700	811.00	9,488,700
国際紙パルプ商事	37,500	348.00	13,050,000
ヤマタネ	8,500	1,647.00	13,999,500
丸紅建材リース	1,600	1,798.00	2,876,800
日鉄物産	12,700	5,040.00	64,008,000
泉州電業	4,900	5,060.00	24,794,000
トラスコ中山	38,800	1,812.00	70,305,600
オートバックスセブン	61,100	1,365.00	83,401,500
モリト	13,600	737.00	10,023,200
加藤産業	24,700	3,165.00	78,175,500
北恵	4,800	885.00	4,248,000
イノテック	11,300	1,326.00	14,983,800
イエローハット	31,300	1,626.00	50,893,800
J Kホールディングス	14,400	906.00	13,046,400
日伝	14,500	1,969.00	28,550,500
北沢産業	12,000	228.00	2,736,000
杉本商事	8,700	2,194.00	19,087,800

因幡電機産業	48,700	2,578.00	125,548,600
東テク	6,000	2,934.00	17,604,000
ミスミグループ本社	234,100	2,893.00	677,251,300
アルテック	12,300	248.00	3,050,400
タキヒヨー	5,400	1,045.00	5,643,000
蔵王産業	3,600	1,964.00	7,070,400
スズケン	70,900	3,500.00	248,150,000
ジェコス	12,900	788.00	10,165,200
グローセル	21,300	415.00	8,839,500
ローソン	41,300	4,525.00	186,882,500
サンエー	13,700	4,025.00	55,142,500
カワチ薬品	14,600	2,016.00	29,433,600
エービーシー・マート	29,200	5,280.00	154,176,000
ハードオフコーポレーション	8,600	816.00	7,017,600
アスクル	42,400	1,447.00	61,352,800
ゲオホールディングス	24,400	1,201.00	29,304,400
アダストリア	20,200	2,066.00	41,733,200
くら寿司	19,600	2,931.00	57,447,600
キャンドウ	7,000	2,560.00	17,920,000
アイケイ	6,500	537.00	3,490,500
パルグループホールディングス	16,500	1,493.00	24,634,500
エディオン	85,900	1,214.00	104,282,600
サーラコーポレーション	38,400	632.00	24,268,800
ワッツ	9,500	725.00	6,887,500
ハローズ	8,600	3,315.00	28,509,000
フジオフードグループ本社	15,100	1,344.00	20,294,400
あみやき亭	4,500	2,886.00	12,987,000
大黒天物産	6,000	4,485.00	26,910,000
ハニーズホールディングス	16,200	1,069.00	17,317,800
ファーマライズホールディングス	4,800	724.00	3,475,200
アルペン	14,000	1,885.00	26,390,000
ハブ	6,700	479.00	3,209,300
クオールホールディングス	23,200	1,187.00	27,538,400
ジーンズホールディングス	11,800	4,280.00	50,504,000
ビックカメラ	110,900	1,114.00	123,542,600
D C Mホールディングス	115,400	1,051.00	121,285,400
Monotaro	235,900	1,900.00	448,210,000
東京一番フーズ	5,100	593.00	3,024,300
きちりホールディングス	5,000	383.00	1,915,000
アーランドサービスホールディングス	13,800	2,038.00	28,124,400
J．フロント リテイリング	217,700	988.00	215,087,600
ドトール・日レスホールディングス	31,500	1,514.00	47,691,000

マツキヨココカラ&カンパニー	113,000	4,750.00	536,750,000
ブロンコピリー	10,500	2,334.00	24,507,000
Z O Z O	128,400	2,570.00	329,988,000
トレジャー・ファクトリー	5,800	968.00	5,614,400
物語コーポレーション	9,300	5,030.00	46,779,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,300	1,034.00	321,884,200
H a m e e	7,000	1,049.00	7,343,000
マーケットエンタープライズ	2,300	789.00	1,814,700
ウエルシアホールディングス	98,700	2,606.00	257,212,200
クリエイティブSDホールディングス	27,600	2,902.00	80,095,200
丸善CHIホールディングス	21,800	386.00	8,414,800
ミサワ	4,300	614.00	2,640,200
ティーライフ	2,700	1,399.00	3,777,300
チムニー	5,700	1,165.00	6,640,500
シュッピン	15,800	1,332.00	21,045,600
オイシックス・ラ・大地	27,000	1,815.00	49,005,000
ネクステージ	38,000	1,933.00	73,454,000
ジョイフル本田	56,300	1,511.00	85,069,300
鳥貴族ホールディングス	6,800	1,780.00	12,104,000
ホットランド	14,200	1,335.00	18,957,000
すかいらーくホールディングス	236,500	1,541.00	364,446,500
S F Pホールディングス	9,100	1,426.00	12,976,600
綿半ホールディングス	13,900	1,332.00	18,514,800
ヨシックスホールディングス	3,800	1,947.00	7,398,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	54,500	1,064.00	57,988,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,000	975.00	9,750,000
B E E N O S	9,600	1,749.00	16,790,400
あさひ	15,700	1,305.00	20,488,500
日本調剤	11,600	1,189.00	13,792,400
コスモス薬品	18,800	11,210.00	210,748,000
トーエル	9,100	870.00	7,917,000
セブン&アイ・ホールディングス	694,800	5,302.00	3,683,829,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	107,900	829.00	89,449,100
ツルハホールディングス	40,700	6,880.00	280,016,000
サンマルクホールディングス	15,000	1,515.00	22,725,000
フェリシモ	4,400	1,119.00	4,923,600
トリドールホールディングス	46,500	2,222.00	103,323,000
T O K Y O B A S E	18,200	300.00	5,460,000
ウイルプラスホールディングス	3,900	888.00	3,463,200
J Mホールディングス	13,300	1,560.00	20,748,000
サツドラホールディングス	8,900	642.00	5,713,800

アレンザホールディングス	13,900	985.00	13,691,500
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,676.00	8,715,200
パロックジャパンリミテッド	13,400	796.00	10,666,400
クスリのアオキホールディングス	18,000	5,450.00	98,100,000
力の源ホールディングス	9,500	610.00	5,795,000
FOOD & LIFE COMPANIES	104,700	2,915.00	305,200,500
メディカルシステムネットワーク	18,200	433.00	7,880,600
はるやまホールディングス	9,500	448.00	4,256,000
ノジマ	30,300	2,849.00	86,324,700
カップ・クリエイト	26,100	1,402.00	36,592,200
ライトオン	13,900	711.00	9,882,900
良品計画	214,800	1,280.00	274,944,000
パリティホールディングス	24,300	268.00	6,512,400
アドヴァングループ	18,400	775.00	14,260,000
アルビス	6,000	2,219.00	13,314,000
コナカ	21,400	337.00	7,211,800
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,646.00	4,115,000
G-7ホールディングス	20,900	1,377.00	28,779,300
イオン北海道	30,200	1,077.00	32,525,400
コジマ	32,600	603.00	19,657,800
ヒマラヤ	6,600	909.00	5,999,400
コーナン商事	26,600	3,615.00	96,159,000
エコス	6,800	2,006.00	13,640,800
ワタミ	22,600	915.00	20,679,000
マルシェ	6,000	463.00	2,778,000
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	373,000	1,846.00	688,558,000
西松屋チェーン	39,800	1,519.00	60,456,200
ゼンショーホールディングス	91,100	2,971.00	270,658,100
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,262.00	14,513,000
ハークスレイ	8,500	524.00	4,454,000
サイゼリヤ	27,800	2,328.00	64,718,400
V Tホールディングス	70,900	456.00	32,330,400
魚力	5,300	2,234.00	11,840,200
フジ・コーポレーション	10,200	1,132.00	11,546,400
ユナイテッドアローズ	19,700	1,868.00	36,799,600
ハイデイ日高	27,100	1,940.00	52,574,000
YU-WA Creation Holdings	12,500	206.00	2,575,000
コロワイド	76,600	1,778.00	136,194,800
ピーシーデポコーポレーション	22,700	308.00	6,991,600
壱番屋	13,200	4,910.00	64,812,000

P L A N T	5,100	661.00	3,371,100	
スギホールディングス	37,300	5,200.00	193,960,000	
薬王堂ホールディングス	9,500	1,857.00	17,641,500	
スクロール	29,100	800.00	23,280,000	
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,730.00	29,237,000	
木曽路	25,400	2,060.00	52,324,000	
S R S ホールディングス	26,800	834.00	22,351,200	
千趣会	34,500	387.00	13,351,500	
リテールパートナーズ	28,600	1,089.00	31,145,400	
ケーヨー	34,700	938.00	32,548,600	
上新電機	20,500	1,846.00	37,843,000	
日本瓦斯	90,800	1,905.00	172,974,000	
ロイヤルホールディングス	32,700	2,141.00	70,010,700	
いなげや	21,700	1,248.00	27,081,600	
チヨダ	17,900	688.00	12,315,200	
ライフコーポレーション	16,500	2,624.00	43,296,000	
リンガーハット	22,500	2,230.00	50,175,000	
M r M a x H D	23,800	595.00	14,161,000	
A O K I ホールディングス	36,600	654.00	23,936,400	
オークワ	28,600	855.00	24,453,000	
コメリ	28,900	2,668.00	77,105,200	
青山商事	38,000	805.00	30,590,000	
しまむら	21,700	11,540.00	250,418,000	
はせがわ	11,100	261.00	2,897,100	
高島屋	132,500	1,244.00	164,830,000	
松屋	35,700	782.00	27,917,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,100	870.00	74,907,000	
近鉄百貨店	6,700	2,591.00	17,359,700	
丸井グループ	143,200	2,373.00	339,813,600	
アクシアル リテイリング	13,900	2,994.00	41,616,600	
イオン	683,500	2,308.00	1,577,518,000	
イズミ	32,400	2,749.00	89,067,600	
平和堂	33,400	1,888.00	63,059,200	
フジ	47,700	2,206.00	105,226,200	
ヤオコー	21,200	6,640.00	140,768,000	
ゼビオホールディングス	25,700	855.00	21,973,500	
ケーズホールディングス	167,800	1,309.00	219,650,200	
O l y m p i c グループ	9,700	627.00	6,081,900	
日産東京販売ホールディングス	28,900	225.00	6,502,500	
シルバーライフ	4,000	1,457.00	5,828,000	
Genky DrugStores	8,300	3,060.00	25,398,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,600	849.00	3,905,400	

ブックオフグループホールディングス	10,900	1,000.00	10,900,000
ギフトホールディングス	3,100	2,104.00	6,522,400
アインホールディングス	24,400	5,640.00	137,616,000
元気寿司	5,400	2,497.00	13,483,800
ヤマダホールディングス	698,300	461.00	321,916,300
アークランドサカモト	29,400	1,474.00	43,335,600
ニトリホールディングス	74,000	12,540.00	927,960,000
グルメ杵屋	15,100	1,025.00	15,477,500
愛眼	13,600	190.00	2,584,000
ケーユーホールディングス	10,000	1,039.00	10,390,000
吉野家ホールディングス	65,200	2,428.00	158,305,600
松屋フーズホールディングス	9,100	3,755.00	34,170,500
サガミホールディングス	28,200	1,145.00	32,289,000
関西フードマーケット	17,800	1,260.00	22,428,000
王将フードサービス	12,400	6,180.00	76,632,000
プレナス	21,000	1,938.00	40,698,000
ミニストップ	13,900	1,403.00	19,501,700
アークス	34,900	1,970.00	68,753,000
パローホールディングス	40,400	1,838.00	74,255,200
ベルク	8,300	5,210.00	43,243,000
大庄	10,300	1,068.00	11,000,400
ファーストリテイリング	24,900	58,160.00	1,448,184,000
サンドラッグ	70,300	2,720.00	191,216,000
サクスパー ホールディングス	18,200	527.00	9,591,400
ヤマザワ	4,400	1,502.00	6,608,800
やまや	3,800	2,447.00	9,298,600
ベルーナ	40,500	645.00	26,122,500
島根銀行	5,900	512.00	3,020,800
じもとホールディングス	13,000	582.00	7,566,000
めぶきフィナンシャルグループ	853,600	237.00	202,303,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,800	1,877.00	42,795,600
九州フィナンシャルグループ	363,200	363.00	131,841,600
ゆうちょ銀行	440,800	983.00	433,306,400
富山第一銀行	43,500	352.00	15,312,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,019,200	435.00	443,352,000
西日本フィナンシャルホールディングス	109,900	734.00	80,666,600
三十三フィナンシャルグループ	16,500	1,370.00	22,605,000
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	2,419.00	70,151,000
ひろぎんホールディングス	263,200	598.00	157,393,600
おきなわフィナンシャルグループ	16,500	2,065.00	34,072,500
十六フィナンシャルグループ	24,000	2,218.00	53,232,000
北國フィナンシャルホールディングス	16,900	3,925.00	66,332,500

プロクレアホールディングス	19,600	1,780.00	34,888,000
新生銀行	121,800	2,044.00	248,959,200
あおぞら銀行	104,300	2,618.00	273,057,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,451,800	715.50	8,193,762,900
りそなホールディングス	2,070,100	483.50	1,000,893,350
三井住友トラスト・ホールディングス	338,300	3,828.00	1,295,012,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,265,800	3,890.00	4,923,962,000
千葉銀行	591,300	675.00	399,127,500
群馬銀行	333,800	349.00	116,496,200
武蔵野銀行	26,500	1,727.00	45,765,500
千葉興業銀行	42,700	259.00	11,059,300
筑波銀行	72,800	178.00	12,958,400
七十七銀行	55,600	1,584.00	88,070,400
秋田銀行	11,700	1,520.00	17,784,000
山形銀行	19,100	826.00	15,776,600
岩手銀行	12,000	1,885.00	22,620,000
東邦銀行	148,400	199.00	29,531,600
東北銀行	8,800	982.00	8,641,600
ふくおかフィナンシャルグループ	149,800	2,230.00	334,054,000
静岡銀行	431,500	767.00	330,960,500
スルガ銀行	163,700	364.00	59,586,800
八十二銀行	400,600	426.00	170,655,600
山梨中央銀行	19,800	974.00	19,285,200
大垣共立銀行	35,200	1,737.00	61,142,400
福井銀行	15,600	1,307.00	20,389,200
清水銀行	7,400	1,462.00	10,818,800
富山銀行	3,200	1,901.00	6,083,200
滋賀銀行	33,500	2,332.00	78,122,000
南都銀行	27,800	1,924.00	53,487,200
百五銀行	171,800	314.00	53,945,200
京都銀行	63,900	5,190.00	331,641,000
紀陽銀行	60,700	1,357.00	82,369,900
ほくほくフィナンシャルグループ	111,000	793.00	88,023,000
山陰合同銀行	108,400	632.00	68,508,800
中国銀行	145,400	896.00	130,278,400
鳥取銀行	5,900	1,182.00	6,973,800
伊予銀行	234,700	615.00	144,340,500
百十四銀行	19,000	1,682.00	31,958,000
四国銀行	27,100	790.00	21,409,000
阿波銀行	27,300	1,993.00	54,408,900
大分銀行	10,500	1,726.00	18,123,000
宮崎銀行	11,100	2,007.00	22,277,700



佐賀銀行	10,300	1,422.00	14,646,600
琉球銀行	40,500	773.00	31,306,500
セブン銀行	554,600	244.00	135,322,400
みずほフィナンシャルグループ	2,338,600	1,511.50	3,534,793,900
高知銀行	6,500	759.00	4,933,500
山口フィナンシャルグループ	207,200	683.00	141,517,600
長野銀行	6,000	1,241.00	7,446,000
名古屋銀行	12,800	2,931.00	37,516,800
北洋銀行	265,900	217.00	57,700,300
愛知銀行	6,400	4,950.00	31,680,000
中京銀行	6,400	1,564.00	10,009,600
大光銀行	6,100	1,271.00	7,753,100
愛媛銀行	25,500	820.00	20,910,000
トマト銀行	6,400	1,016.00	6,502,400
京葉銀行	77,900	449.00	34,977,100
栃木銀行	88,100	239.00	21,055,900
北日本銀行	5,700	1,518.00	8,652,600
東和銀行	32,100	510.00	16,371,000
福島銀行	20,900	213.00	4,451,700
大東銀行	8,700	646.00	5,620,200
トモニホールディングス	141,200	309.00	43,630,800
フィデアホールディングス	17,100	1,231.00	21,050,100
池田泉州ホールディングス	209,300	181.00	37,883,300
F P G	63,100	808.00	50,984,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,700	1,168.00	17,169,600
マーキュリアホールディングス	8,700	584.00	5,080,800
S B Iホールディングス	230,600	2,466.00	568,659,600
ジャフコ グループ	71,500	1,494.00	106,821,000
大和証券グループ本社	1,365,700	608.40	830,891,880
野村ホールディングス	2,851,600	478.70	1,365,060,920
岡三証券グループ	143,500	333.00	47,785,500
丸三証券	56,000	469.00	26,264,000
東洋証券	61,200	187.00	11,444,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,900	359.00	73,559,100
光世証券	4,400	454.00	1,997,600
水戸証券	49,400	259.00	12,794,600
いちよし証券	34,500	588.00	20,286,000
松井証券	91,700	810.00	74,277,000
マネックスグループ	154,400	460.00	71,024,000
極東証券	24,100	664.00	16,002,400
岩井コスモホールディングス	17,800	1,166.00	20,754,800
アイザワ証券グループ	29,200	651.00	19,009,200

マネーパートナーズグループ	20,900	224.00	4,681,600
スパークス・グループ	87,200	242.00	21,102,400
かんぽ生命保険	188,000	2,136.00	401,568,000
S O M P Oホールディングス	293,000	4,982.00	1,459,726,000
アニコム ホールディングス	57,400	638.00	36,621,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	407,200	3,726.00	1,517,227,200
第一生命ホールディングス	868,900	2,487.00	2,160,954,300
東京海上ホールディングス	573,000	6,659.00	3,815,607,000
T & Dホールディングス	461,700	1,469.00	678,237,300
アドバンスクリエイト	9,000	940.00	8,460,000
全国保証	44,600	4,235.00	188,881,000
あんしん保証	8,800	273.00	2,402,400
イントラスト	8,600	562.00	4,833,200
日本モーゲージサービス	10,800	947.00	10,227,600
C a s a	7,100	818.00	5,807,800
アルヒ	28,000	959.00	26,852,000
プレミアグループ	9,600	3,755.00	36,048,000
ネットプロテクションズホールディングス	57,400	549.00	31,512,600
クレディセゾン	116,500	1,518.00	176,847,000
芙蓉総合リース	18,400	7,180.00	132,112,000
みずほリース	27,000	2,935.00	79,245,000
東京センチュリー	33,800	4,090.00	138,242,000
日本証券金融	73,800	851.00	62,803,800
アイフル	314,400	342.00	107,524,800
リコーリース	16,600	3,335.00	55,361,000
イオンフィナンシャルサービス	101,900	1,190.00	121,261,000
アコム	369,500	323.00	119,348,500
ジャックス	20,100	3,235.00	65,023,500
オリエントコーポレーション	508,200	123.00	62,508,600
オリックス	1,109,600	2,301.00	2,553,189,600
三菱H C キャピタル	661,900	619.00	409,716,100
九州リースサービス	9,400	578.00	5,433,200
日本取引所グループ	455,900	1,819.50	829,510,050
イー・ギャランティ	27,700	1,939.00	53,710,300
アサックス	10,300	575.00	5,922,500
N E C キャピタルソリューション	7,800	1,916.00	14,944,800
いちご	213,200	298.00	63,533,600
日本駐車場開発	207,400	165.00	34,221,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,494.00	16,583,400
S R E ホールディングス	5,400	1,945.00	10,503,000
A D ワークスグループ	36,900	148.00	5,461,200
ヒューリック	434,200	1,036.00	449,831,200

三栄建築設計	8,400	1,570.00	13,188,000
野村不動産ホールディングス	97,100	3,170.00	307,807,000
三重交通グループホールディングス	41,100	472.00	19,399,200
サムティ	29,900	2,018.00	60,338,200
ディア・ライフ	26,600	528.00	14,044,800
地主	12,600	2,061.00	25,968,600
プレサンスコーポレーション	24,100	1,504.00	36,246,400
ハウスコム	4,500	1,060.00	4,770,000
日本管理センター	10,500	990.00	10,395,000
サンセイランディック	7,300	840.00	6,132,000
フージャースホールディングス	23,900	777.00	18,570,300
オープンハウスグループ	59,700	5,060.00	302,082,000
東急不動産ホールディングス	538,300	667.00	359,046,100
飯田グループホールディングス	156,500	1,950.00	305,175,000
イーランド	4,000	1,393.00	5,572,000
ムゲンエステート	14,400	488.00	7,027,200
And Doホールディングス	9,200	844.00	7,764,800
シーアールイー	6,800	1,513.00	10,288,400
ケイアイスター不動産	8,700	4,840.00	42,108,000
グッドコムアセット	9,400	1,107.00	10,405,800
ジェイ・エス・ビー	4,200	3,400.00	14,280,000
ロードスターキャピタル	5,800	1,357.00	7,870,600
テンポイノベーション	7,000	844.00	5,908,000
フェイスネットワーク	3,500	1,334.00	4,669,000
パーク24	111,400	1,962.00	218,566,800
パラカ	5,900	1,730.00	10,207,000
三井不動産	809,000	2,659.00	2,151,131,000
三菱地所	1,173,200	1,818.00	2,132,877,600
平和不動産	31,600	3,740.00	118,184,000
東京建物	177,100	1,788.00	316,654,800
京阪神ビルディング	28,500	1,261.00	35,938,500
住友不動産	373,600	3,221.00	1,203,365,600
テーオーシー	34,200	604.00	20,656,800
東京楽天地	3,300	4,005.00	13,216,500
スターツコーポレーション	26,000	2,228.00	57,928,000
フジ住宅	24,000	627.00	15,048,000
空港施設	21,500	519.00	11,158,500
明和地所	11,300	593.00	6,700,900
ゴールドクレスト	15,700	1,643.00	25,795,100
エスリード	8,200	1,671.00	13,702,200
日神グループホールディングス	33,700	446.00	15,030,200
日本エスコン	34,800	753.00	26,204,400

タカラレーベン	78,200	313.00	24,476,600
A V A N T I A	11,100	830.00	9,213,000
イオンモール	94,600	1,553.00	146,913,800
毎日コムネット	8,500	705.00	5,992,500
ファースト住建	8,300	1,088.00	9,030,400
カチタス	46,800	2,772.00	129,729,600
トーセイ	27,100	1,122.00	30,406,200
穴吹興産	4,700	2,209.00	10,382,300
サンフロンティア不動産	27,200	1,031.00	28,043,200
F Jネクストホールディングス	19,800	1,074.00	21,265,200
インテリックス	4,200	637.00	2,675,400
ランドビジネス	7,300	239.00	1,744,700
サンネクスタグループ	7,200	1,226.00	8,827,200
グランディハウス	15,500	516.00	7,998,000
日本空港ビルデング	67,800	5,040.00	341,712,000
明豊ファシリティワークス	8,800	623.00	5,482,400
日本工営	11,600	2,957.00	34,301,200
L I F U L L	57,000	180.00	10,260,000
ミクシィ	41,500	2,109.00	87,523,500
ジェイエシーリクルートメント	14,800	1,734.00	25,663,200
日本M & Aセンターホールディングス	297,000	1,295.00	384,615,000
メンバーズ	5,300	3,010.00	15,953,000
中広	3,800	385.00	1,463,000
UTグループ	26,200	2,528.00	66,233,600
アイティメディア	8,800	1,737.00	15,285,600
E・Jホールディングス	10,700	1,156.00	12,369,200
夢真ビーネックスグループ	59,200	1,447.00	85,662,400
コシダカホールディングス	48,800	759.00	37,039,200
アルトナー	4,800	836.00	4,012,800
パソナグループ	19,800	1,943.00	38,471,400
C D S	4,700	1,940.00	9,118,000
リンクアンドモチベーション	39,900	440.00	17,556,000
エス・エム・エス	61,600	2,973.00	183,136,800
サニーサイドアップグループ	6,700	591.00	3,959,700
パーソルホールディングス	181,000	2,496.00	451,776,000
リニカル	10,600	807.00	8,554,200
クックパッド	58,300	232.00	13,525,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,400	590.00	5,546,000
学情	7,700	954.00	7,345,800
スタジオアリス	8,200	2,205.00	18,081,000
シミックホールディングス	9,900	1,437.00	14,226,300
エプコ	4,300	700.00	3,010,000

N J S	4,200	2,047.00	8,597,400
総合警備保障	70,100	3,650.00	255,865,000
カカクコム	132,900	2,592.00	344,476,800
アイロムグループ	6,500	2,100.00	13,650,000
セントケア・ホールディング	12,200	770.00	9,394,000
サイネックス	3,600	584.00	2,102,400
ルネサンス	12,900	906.00	11,687,400
ディップ	31,900	3,830.00	122,177,000
デジタルホールディングス	12,900	1,332.00	17,182,800
新日本科学	22,300	1,442.00	32,156,600
キャリアデザインセンター	4,600	1,064.00	4,894,400
ベネフィット・ワン	66,000	1,932.00	127,512,000
エムスリー	319,300	3,751.00	1,197,694,300
ツカダ・グローバルホールディング	11,500	307.00	3,530,500
アウトソーシング	103,900	1,195.00	124,160,500
ウェルネット	18,200	468.00	8,517,600
ワールドホールディングス	7,400	2,227.00	16,479,800
ディー・エヌ・エー	69,100	1,933.00	133,570,300
博報堂D Yホールディングス	244,500	1,300.00	317,850,000
ぐるなび	29,400	402.00	11,818,800
タカミヤ	22,900	343.00	7,854,700
ジャパンベストレスキューシステム	11,600	797.00	9,245,200
ファンコミュニケーションズ	44,500	421.00	18,734,500
ライク	6,200	2,067.00	12,815,400
ビジネス・ブレークスルー	7,500	408.00	3,060,000
エスプール	51,400	1,241.00	63,787,400
W D Bホールディングス	8,400	2,255.00	18,942,000
ティア	11,300	444.00	5,017,200
C D G	2,200	1,287.00	2,831,400
アドウェイズ	27,500	778.00	21,395,000
バリューコマース	14,300	3,210.00	45,903,000
インフォマート	198,900	461.00	91,692,900
J Pホールディングス	48,000	220.00	10,560,000
エコナックホールディングス	35,900	90.00	3,231,000
C Lホールディングス	4,200	971.00	4,078,200
プレステージ・インターナショナル	68,400	643.00	43,981,200
アミューズ	10,000	2,022.00	20,220,000
ドリームインキュベータ	5,300	2,091.00	11,082,300
クイック	12,200	1,420.00	17,324,000
T A C	11,300	219.00	2,474,700
電通グループ	180,900	4,325.00	782,392,500
イオンファンタジー	7,100	2,313.00	16,422,300

シーティーエス	20,800	857.00	17,825,600
ネクシィーズグループ	6,700	498.00	3,336,600
H.U.グループホールディングス	47,400	2,692.00	127,600,800
アルプス技研	14,700	1,862.00	27,371,400
ダイオーズ	3,900	1,036.00	4,040,400
日本空調サービス	19,400	790.00	15,326,000
オリエンタルランド	206,700	17,935.00	3,707,164,500
ダスキン	41,100	2,703.00	111,093,300
明光ネットワークジャパン	21,800	579.00	12,622,200
ファルコホールディングス	8,600	2,139.00	18,395,400
ラウンドワン	50,700	1,603.00	81,272,100
リゾートトラスト	81,000	2,022.00	163,782,000
ビー・エム・エル	23,100	3,365.00	77,731,500
りらいあコミュニケーションズ	27,000	1,037.00	27,999,000
リソー教育	83,600	334.00	27,922,400
早稲田アカデミー	10,400	1,065.00	11,076,000
ユー・エス・エス	202,700	2,465.00	499,655,500
東京個別指導学院	16,500	588.00	9,702,000
サイバーエージェント	426,300	1,337.00	569,963,100
楽天グループ	900,400	772.00	695,108,800
クリーク・アンド・リバー社	9,600	2,009.00	19,286,400
モーニングスター	32,300	512.00	16,537,600
テー・オー・ダブリュー	35,600	331.00	11,783,600
山田コンサルティンググループ	9,700	1,115.00	10,815,500
セントラルスポーツ	6,900	2,375.00	16,387,500
フルキャストホールディングス	15,600	2,241.00	34,959,600
エン・ジャパン	30,300	1,954.00	59,206,200
リソルホールディングス	2,000	4,530.00	9,060,000
テクノプロ・ホールディングス	108,500	2,840.00	308,140,000
アトラグループ	4,000	250.00	1,000,000
インターワークス	6,100	370.00	2,257,000
アイ・アールジャパンホールディングス	8,500	4,125.00	35,062,500
Keeper 技研	11,800	3,115.00	36,757,000
ファーストロジック	3,700	759.00	2,808,300
三機サービス	3,400	1,186.00	4,032,400
Gunosy	10,300	913.00	9,403,900
デザインワン・ジャパン	6,700	191.00	1,279,700
イー・ガーディアン	7,000	2,973.00	20,811,000
リブセンス	12,100	157.00	1,899,700
ジャパンマテリアル	55,800	1,815.00	101,277,000
ベクトル	25,700	1,125.00	28,912,500
ウチヤマホールディングス	10,100	284.00	2,868,400

チャーム・ケア・コーポレーション	13,800	1,117.00	15,414,600
キャリアリンク	6,900	1,806.00	12,461,400
I B J	15,300	702.00	10,740,600
アサンテ	8,200	1,479.00	12,127,800
バリューHR	15,100	1,202.00	18,150,200
M & Aキャピタルパートナーズ	15,000	3,160.00	47,400,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,300	1,184.00	8,643,200
E R Iホールディングス	5,300	1,341.00	7,107,300
アビスト	2,900	2,861.00	8,296,900
シグマクシス・ホールディングス	22,100	1,113.00	24,597,300
ウィルグループ	13,700	1,110.00	15,207,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,500	166.00	4,067,000
メドピア	13,700	2,114.00	28,961,800
レアジョブ	3,900	538.00	2,098,200
リクルートホールディングス	1,362,700	4,602.00	6,271,145,400
エラン	25,300	998.00	25,249,400
土木管理総合試験所	9,400	321.00	3,017,400
ネットマーケティング	9,300	710.00	6,603,000
日本郵政	2,264,500	945.50	2,141,084,750
ベルシステム24ホールディングス	26,200	1,381.00	36,182,200
鎌倉新書	21,200	556.00	11,787,200
S M N	4,500	589.00	2,650,500
グローバルキッズCOMPANY	3,600	673.00	2,422,800
エアトリ	11,400	2,726.00	31,076,400
アトラエ	12,900	1,427.00	18,408,300
ストライク	7,300	3,740.00	27,302,000
ソラスト	44,900	725.00	32,552,500
セラク	6,000	1,164.00	6,984,000
インソース	18,500	2,090.00	38,665,000
ベイカレント・コンサルティング	12,800	40,700.00	520,960,000
Orchestra Holdings	3,600	2,528.00	9,100,800
アイモバイル	6,700	1,356.00	9,085,200
キャリアインデックス	6,800	581.00	3,950,800
MS - Japan	7,800	783.00	6,107,400
船場	4,100	684.00	2,804,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,600	1,548.00	89,164,800
フルテック	2,800	1,310.00	3,668,000
GameWith	6,100	458.00	2,793,800
MS & Consulting	3,100	703.00	2,179,300
ウェルビー	12,200	839.00	10,235,800
エル・ティー・エス	2,400	3,450.00	8,280,000
ミダックホールディングス	8,300	2,480.00	20,584,000

日総工産	14,700	600.00	8,820,000
キュービーネットホールディングス	8,600	1,295.00	11,137,000
R P Aホールディングス	26,400	380.00	10,032,000
スプリックス	5,800	965.00	5,597,000
マネジメントソリューションズ	9,000	4,585.00	41,265,000
プロレド・パートナーズ	4,600	536.00	2,465,600
テノ・ホールディングス	2,800	628.00	1,758,400
フロンティア・マネジメント	5,100	1,272.00	6,487,200
ピアラ	3,400	813.00	2,764,200
コプロ・ホールディングス	3,900	891.00	3,474,900
ギークス	3,400	849.00	2,886,600
カーブスホールディングス	50,100	706.00	35,370,600
フォーラムエンジニアリング	12,400	933.00	11,569,200
F a s t F i t n e s s J a p a n	3,500	1,586.00	5,551,000
ダイレクトマーケティングミックス	20,300	1,727.00	35,058,100
ポピンズ	4,400	1,962.00	8,632,800
L I T A L I C O	14,800	2,291.00	33,906,800
アドバンテッジリスクマネジメント	9,800	490.00	4,802,000
リログループ	99,100	2,003.00	198,497,300
東祥	13,800	1,307.00	18,036,600
ビーウィズ	5,100	1,387.00	7,073,700
T R Eホールディングス	28,000	2,095.00	58,660,000
人・夢・技術グループ	7,300	2,358.00	17,213,400
エイチ・アイ・エス	39,500	2,132.00	84,214,000
ラックランド	5,600	2,976.00	16,665,600
共立メンテナンス	32,300	4,685.00	151,325,500
イチネンホールディングス	18,800	1,220.00	22,936,000
建設技術研究所	10,400	2,407.00	25,032,800
スペース	12,900	909.00	11,726,100
燦ホールディングス	8,100	1,766.00	14,304,600
スバル興業	1,100	8,500.00	9,350,000
東京テアトル	6,900	1,210.00	8,349,000
タナベ経営	7,500	687.00	5,152,500
ナガワ	5,600	9,060.00	50,736,000
東京都競馬	13,600	3,505.00	47,668,000
カナモト	31,300	1,862.00	58,280,600
西尾レントオール	16,300	2,605.00	42,461,500
トランス・コスモス	23,100	3,125.00	72,187,500
乃村工藝社	77,900	861.00	67,071,900
藤田観光	7,900	2,322.00	18,343,800
K N T - C Tホールディングス	11,200	1,624.00	18,188,800
日本管財	19,500	2,520.00	49,140,000



トーカイ	15,600	1,669.00	26,036,400	
セコム	178,300	8,526.00	1,520,185,800	
セントラル警備保障	8,900	2,229.00	19,838,100	
丹青社	36,500	788.00	28,762,000	
メイテック	21,500	6,580.00	141,470,000	
応用地質	19,500	1,710.00	33,345,000	
船井総研ホールディングス	36,200	2,052.00	74,282,400	
進学会ホールディングス	7,000	328.00	2,296,000	
オオバ	12,400	754.00	9,349,600	
いであ	4,900	1,798.00	8,810,200	
学究社	6,000	1,595.00	9,570,000	
ベネッセホールディングス	60,500	2,053.00	124,206,500	
イオンディライト	22,400	2,780.00	62,272,000	
ナック	8,900	940.00	8,366,000	
ダイセキ	33,100	4,455.00	147,460,500	
ステップ	6,800	1,752.00	11,913,600	
合 計	201,331,600		471,674,020,080	

## (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&amp;プラス（毎月決算型）】

## 【純資産額計算書】

（2022年 6月30日現在）

資産総額	2,589,076,997円
負債総額	2,776,926円
純資産総額（ - ）	2,586,300,071円
発行済口数	2,616,750,818口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9884円
（1万口当たり純資産額）	（9,884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

（2022年 6月30日現在）

資産総額	322,008,766,751円
負債総額	109,033,279円
純資産総額（ - ）	321,899,733,472円
発行済口数	101,537,480,307口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1703円
（1万口当たり純資産額）	（31,703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

（2022年 6月30日現在）

資産総額	492,552,511,968円
負債総額	5,285,668,728円
純資産総額（ - ）	487,266,843,240円
発行済口数	263,413,044,162口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8498円
（1万口当たり純資産額）	（18,498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（2022年 6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 8月19日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	13,694,779
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	226,954
単位型公社債投資信託	51	220,516
合計	662	14,142,249

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位: 百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
--	--	--



営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	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	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 6．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

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

##### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用           ：発生事業年度に損益処理

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

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

#### 7．収益及び費用の計上基準

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

##### （1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

#### (2) 投資一任業務

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

#### (3) 投資助言業務

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

#### (4) 成功報酬

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

### 8. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

### 9. 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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月21日)を適用する予定であります。

#### (会計方針の変更)

##### 1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取る見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

##### 2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

## （未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## （1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## （2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

## （3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

## （追加情報）

## 退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

## （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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
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

## 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
2021年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

#### 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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（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 8 . ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券	
その他有価証券	9,950
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	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(\*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（2022年3月31日）

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0



当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

## 1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
合計		3,567	-	41	41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(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	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
	合計		8,057	-	71

## (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。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

#### 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。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 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（2021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（2022年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	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

2022年 8月19日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（2022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） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	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（2022年3月末日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（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
2021年12月15日	臨時報告書
2022年 2月18日	有価証券届出書
2022年 2月18日	有価証券報告書
2022年 3月15日	臨時報告書

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年8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

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 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2021年11月20日から2022年5月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2022年5月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。