

**【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】	2023年2月21日提出
【計算期間】	第36特定期間(自 2022年5月20日至 2022年11月21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 ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  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。

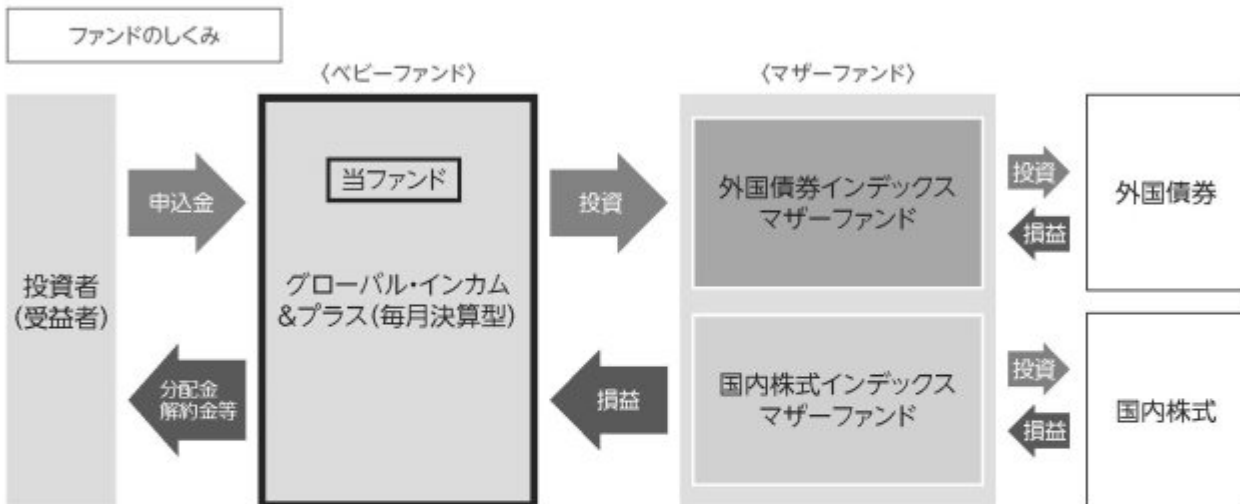
## [ 特殊型 ]

- (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。

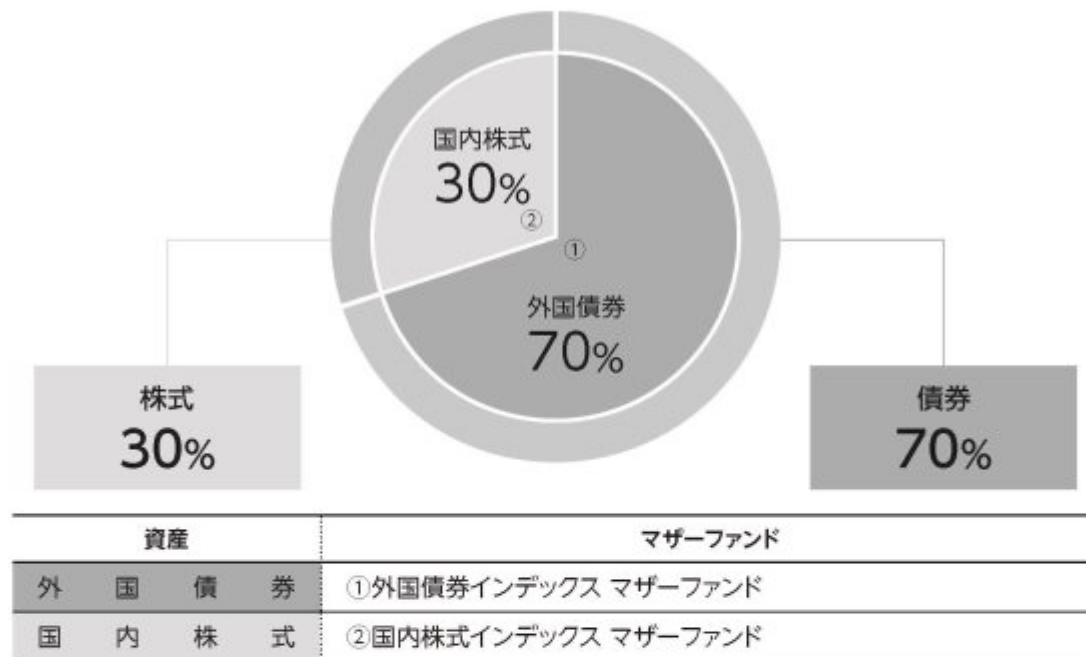
※2 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

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。

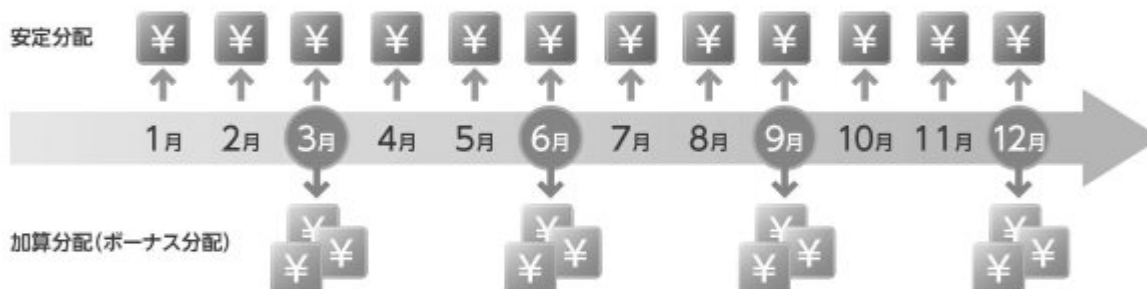
4.

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。

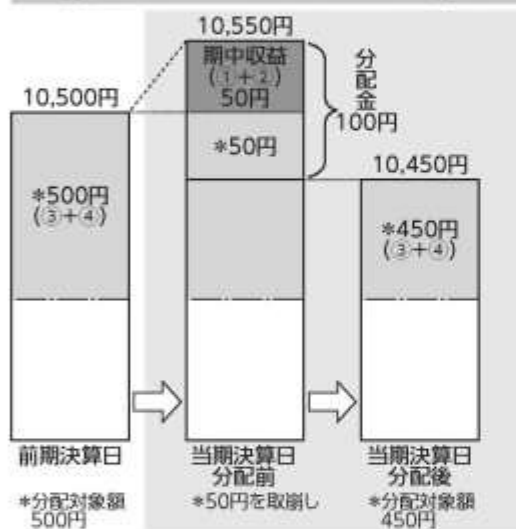
投資信託で分配金が支払われるイメージ



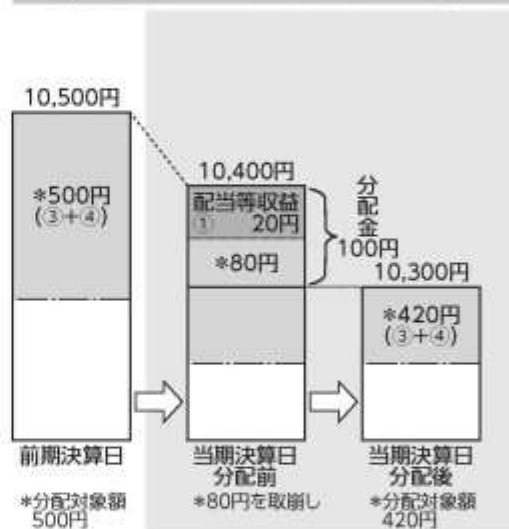
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（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）

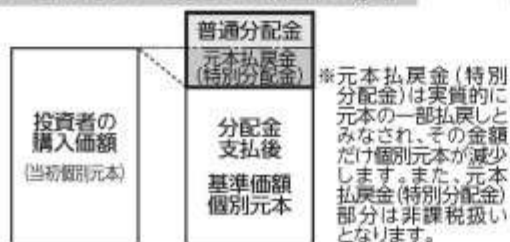


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

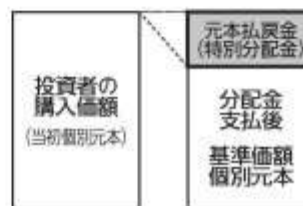
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

- 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

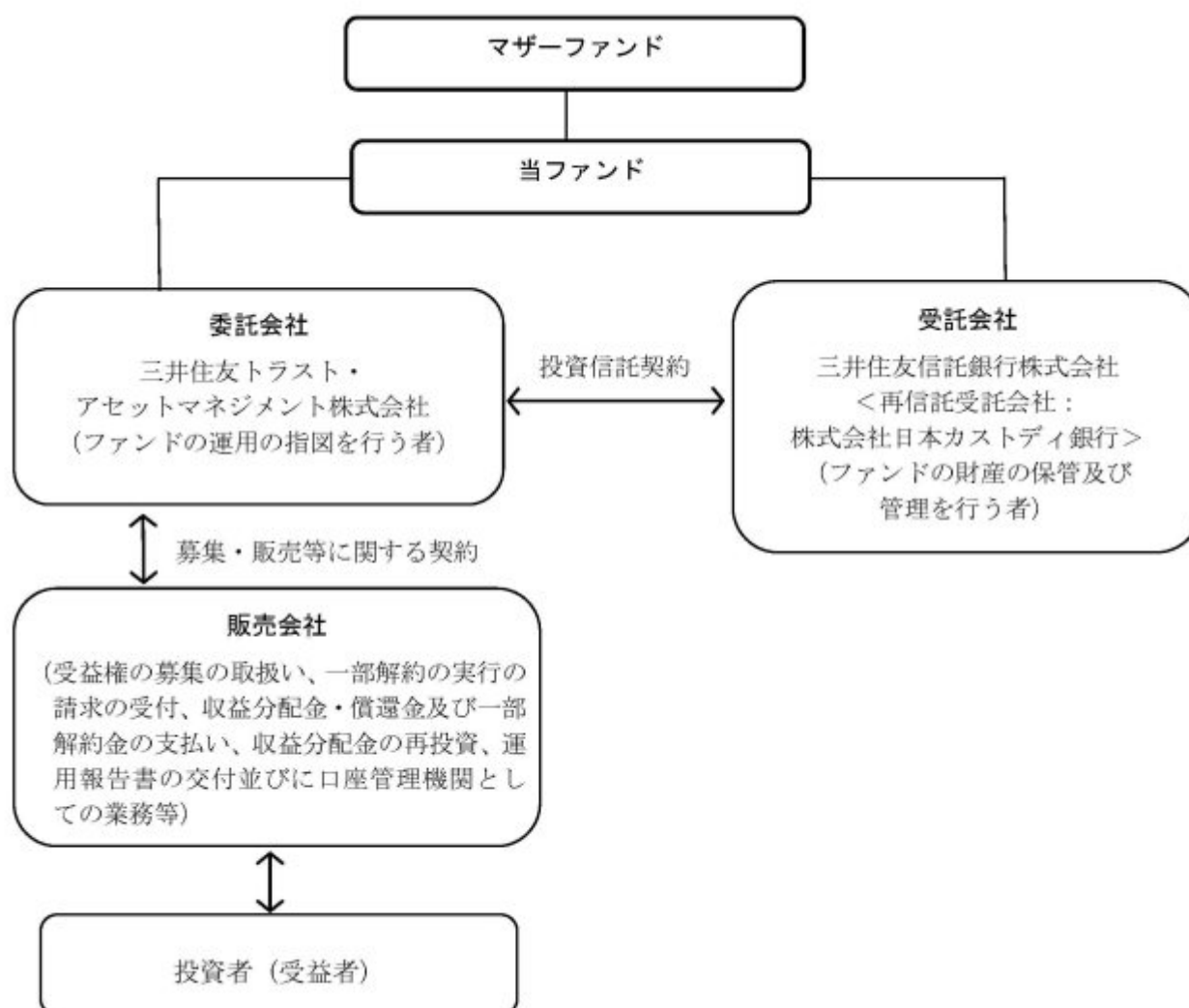
2012年4月1日

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12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

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

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### （イ）基本方針

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

#### （ロ）運用方法

##### 投資対象

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

##### 投資態度

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

### （2）【投資対象】

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

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

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の

受益証券に限ります。）

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

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

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場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ます。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第31条）

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

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

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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。

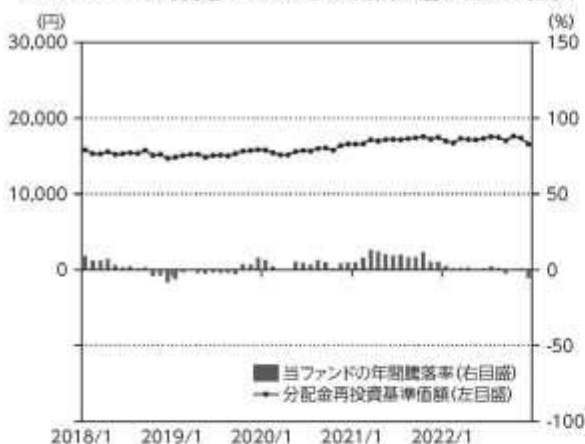
## (2) リスクの管理体制

### 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】

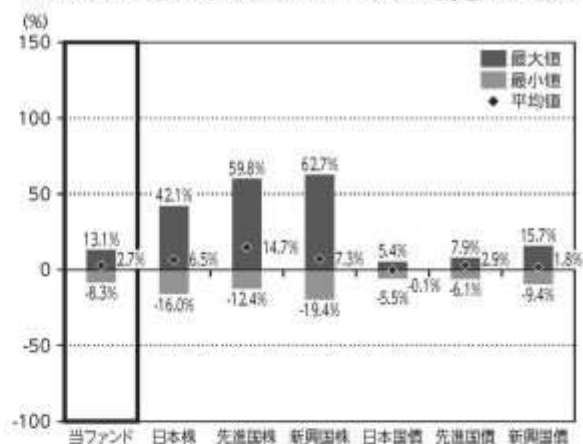
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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



\*2018年1月～2022年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は利益は、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権利又は利益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、保証又は取壊されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIロックス・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロックス・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動にサービスマンとして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により提供されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、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あり、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権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・エマージング・ マーケット・グローバル・デベロップメント・ インデックス(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.32%（税抜 1.2%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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



受託会社	年率 0.077% （税抜 0.07%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
------	----------------------	-------------------------

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

## 八．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、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

### 二．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12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,335,126,157	97.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		49,750,725	2.09
合計（純資産総額）		2,384,876,882	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	543,200,031	3.0993	1,683,539,857	2.9688	1,612,652,252	67.62
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	381,232,603	1.9355	737,875,704	1.8951	722,473,905	30.29

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.91
合計	97.91

（注）投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第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
第36特定期間末	(2022年11月21日)	2,544,018,682	2,546,592,677	9,884	9,894
	2021年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	
	7月末日	2,611,925,268		10,018	
	8月末日	2,578,458,156		9,949	
	9月末日	2,510,880,156		9,705	
	10月末日	2,576,898,990		10,023	
	11月末日	2,536,020,162		9,881	
	12月末日	2,384,876,882		9,398	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第36特定期間	2022年 5月20日～2022年11月21日	60

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第36特定期間	2022年 5月20日～2022年11月21日	3.1

(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
第36特定期間	2022年 5月20日～2022年11月21日	17,708,067	69,332,181	2,573,995,473

(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	143,790,304,546	49.50
	フランス	24,261,758,557	8.35
	イタリア	21,242,780,763	7.31
	ドイツ	18,976,196,540	6.53
	スペイン	14,296,325,641	4.92
	イギリス	13,126,363,780	4.52
	中国	10,289,458,037	3.54
	カナダ	5,791,268,628	1.99
	ベルギー	5,286,109,252	1.82
	オランダ	4,520,565,310	1.56
	オーストラリア	4,473,142,673	1.54
	オーストリア	3,338,333,198	1.15
	メキシコ	2,428,524,666	0.84
	アイルランド	1,807,572,366	0.62
	マレーシア	1,564,914,663	0.54
	フィンランド	1,460,653,932	0.50
	シンガポール	1,357,266,030	0.47
	ポーランド	1,263,274,577	0.43
	イスラエル	1,022,054,193	0.35
	デンマーク	943,646,148	0.32
ニュージーランド	632,466,631	0.22	
ノルウェー	597,764,280	0.21	
スウェーデン	582,682,140	0.20	
	小計	283,053,426,551	97.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,454,605,210	2.57
合計(純資産総額)		290,508,031,761	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	2,562,538,644	0.88
	買建	ドイツ	2,197,941,581	0.76

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

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		5,307,081,712	1.83

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	12,299.85	1,697,379,603	12,129.60	1,673,886,094	2.750	2032/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,091.76	1,753,306,530	11,430.86	1,657,474,835	1.250	2028/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,144.55	1,753,483,916	12,310.77	1,642,257,508	2.625	2029/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,777.55	1,661,082,625	12,589.13	1,636,587,551	0.250	2024/3/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,631.98	1,750,613,647	10,865.07	1,635,193,284	1.125	2031/2/15	0.56
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,887.71	1,507,718,547	1,883.71	1,504,525,795	1.990	2025/4/9	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	12,997.69	1,519,430,302	12,399.15	1,449,461,366	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,635.13	1,556,781,197	10,808.31	1,446,152,060	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,693.59	1,463,571,655	12,301.70	1,418,386,549	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,217.21	1,445,296,188	11,771.42	1,392,559,342	0.750	2026/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,692.00	1,396,025,066	11,442.78	1,366,268,317	0.500	2027/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,693.58	1,378,523,263	12,396.04	1,346,210,598	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,947.84	1,400,286,849	11,298.93	1,324,235,582	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,149.74	1,324,322,379	12,057.55	1,314,273,754	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,162.69	1,336,014,005	12,758.37	1,294,975,494	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,807.88	1,280,788,260	12,657.42	1,265,742,588	0.125	2024/1/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,282.15	1,353,858,480	10,543.68	1,265,242,662	0.625	2030/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,851.16	1,313,389,127	12,296.00	1,256,651,476	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,221.44	1,340,962,528	10,481.74	1,252,568,513	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,104.72	1,349,677,185	11,214.44	1,250,410,722	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,716.65	1,271,665,135	12,498.68	1,249,868,125	0.250	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,584.29	1,233,261,304	12,469.91	1,222,051,404	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,670.96	1,287,307,440	10,848.22	1,196,559,218	1.375	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,425.67	1,273,963,031	10,654.09	1,187,932,079	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,011.94	1,226,419,254	11,368.65	1,160,739,962	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	11,968.17	1,136,976,744	11,883.90	1,128,971,174	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,685.29	1,141,676,156	12,461.87	1,121,568,993	0.250	2024/6/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,693.06	1,143,645,251	12,441.14	1,120,947,014	0.375	2024/7/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,245.56	1,111,061,337	11,214.18	1,107,961,639	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,979.20	1,161,638,437	12,375.31	1,107,590,392	2.250	2027/2/15	0.38

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。



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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.43
合計	97.43

(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	69	アメリカドル	7,478,521.45	992,399,796	7,453,078.47	989,023,513	0.34
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	53	アメリカドル	6,006,046.96	797,002,431	5,959,187.5	790,784,181	0.27
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	47	アメリカドル	5,999,616.01	796,149,045	5,898,500	782,730,950	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	27	ユーロ	2,867,336.7	405,642,122	2,849,850	403,168,279	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	40	ユーロ	4,726,904	668,715,109	4,647,200	657,439,384	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	60	ユーロ	8,328,436	1,178,223,841	8,039,400	1,137,333,918	0.39

(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	21,250,000.00	2,879,588,493	2,812,348,250	0.97
	カナダドル	買建	2,140,000.00	213,514,890	208,937,830	0.07
	ユーロ	買建	12,870,000.00	1,849,410,009	1,818,253,008	0.63
	イギリスポンド	買建	1,670,000.00	276,967,785	266,598,800	0.09
	オフショア人民元	買建	10,580,000.00	205,908,686	200,943,824	0.07

(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	490,165,608,950	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,160,901,770	1.04
合計(純資産総額)		495,326,510,720	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	5,031,390,000	1.02

(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	9,875,200	2,117.06	20,906,432,545	1,812.50	17,898,800,000	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,272,200	11,938.63	15,188,326,022	10,035.00	12,766,527,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,247,400	738.13	8,302,043,362	889.00	9,998,938,600	2.02
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,900	51,541.91	9,272,390,884	51,420.00	9,250,458,000	1.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,311,300	3,983.17	9,206,316,589	3,762.00	8,695,110,600	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,294,300	3,993.11	5,168,294,612	5,296.00	6,854,612,800	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	1,571,400	3,552.63	5,582,605,919	4,250.00	6,678,450,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,596,300	3,750.59	5,987,067,425	4,111.00	6,562,389,300	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1,135,400	5,833.06	6,622,859,188	5,532.00	6,281,032,800	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	912,000	6,773.07	6,177,048,101	6,691.00	6,102,192,000	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,900	5,368.83	5,599,158,077	5,644.00	5,886,127,600	1.19

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,800	4,678.19	6,403,509,909	4,177.00	5,717,477,600	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,393,800	4,532.04	6,316,768,902	3,982.00	5,550,111,600	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,300	3,192.29	4,444,625,807	3,853.00	5,364,531,900	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,700	4,484.17	5,334,828,807	4,283.00	5,095,485,100	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,783,600	2,475.33	4,415,010,147	2,827.50	5,043,129,000	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,900	58,791.72	7,460,670,476	38,880.00	4,933,872,000	1.00
日本	株式	信越化学工業	化学	304,000	18,170.91	5,523,956,640	16,225.00	4,932,400,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	384,200	13,943.27	5,357,004,334	12,705.00	4,881,261,000	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,172,500	3,728.08	4,371,185,186	4,146.00	4,861,185,000	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,561,600	1,537.36	3,938,124,581	1,856.00	4,754,329,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,900	3,189.50	4,662,740,016	3,032.00	4,432,480,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,800	20,710.74	4,490,089,414	20,200.00	4,379,360,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,897,700	1,492.06	4,323,567,057	1,488.00	4,311,777,600	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,700	19,680.58	3,851,489,926	19,160.00	3,749,612,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,800	5,412.40	3,549,453,935	5,660.00	3,711,828,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,500	8,212.80	4,480,087,260	6,588.00	3,593,754,000	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	176,500	21,324.65	3,763,801,308	19,835.00	3,500,877,500	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,728,600	2,045.38	3,535,653,052	2,006.50	3,468,435,900	0.70
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,142.27	3,895,779,745	55,580.00	3,273,662,000	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	1.95
		食料品	3.49
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.06
		医薬品	5.74
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.55
		機械	4.98
電気機器	16.39		

輸送用機器	7.23
精密機器	2.55
その他製品	2.32
電気・ガス業	1.26
陸運業	3.08
海運業	0.63
空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.86
卸売業	5.98
小売業	4.72
銀行業	6.40
証券、商品先物取引業	0.74
保険業	2.52
その他金融業	1.13
不動産業	1.96
サービス業	5.32
小計	98.96
合計	98.96

(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	266	円	5,088,489,700	5,031,390,000	1.02

(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12月30日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額 9,398円  
純資産総額 23.85億円

**分配の推移**

(1万円当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年8月	10円
2022年9月	10円
2022年10月	10円
2022年11月	10円
2022年12月	10円
直近1年間 分配金合計額	120円
設定後 分配金合計額	5,266円

※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。

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	67.6%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.4%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.4%
		T 2.625% 02/15/29	アメリカ	国債	-	2.625%	2029/02/15	0.4%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.4%
		T 0.25% 03/15/24	アメリカ	国債	-	0.250%	2024/03/15	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	30.3%	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%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**

※収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。  
※ファンド内には、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】**

## &lt; 申込手続 &gt;

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録

を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。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。

## &lt; 基準価額の照会方法 &gt;

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】

## &lt; 投資信託契約の終了（償還）と手続き &gt;

## (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を

述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるとき

は、速やかに登記又は登録をするものとします。

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36特定期間(2022年5月20日から2022年11月21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35特定期間 （2022年 5月19日現在）	第36特定期間 （2022年11月21日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	49,223,440	50,966,490
親投資信託受益証券	2,482,313,983	2,498,681,021
未収入金	7,230,000	-
流動資産合計	2,538,767,423	2,549,647,511
資産合計	2,538,767,423	2,549,647,511
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,625,619	2,573,995
未払解約金	25,354	1,311
未払受託者報酬	163,392	177,379
未払委託者報酬	2,637,630	2,863,355
未払利息	33	130
その他未払費用	11,662	12,659
流動負債合計	5,463,690	5,628,829
負債合計	5,463,690	5,628,829
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,625,619,587	2,573,995,473
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,315,854	29,976,791
（分配準備積立金）	87,345,742	86,239,240
元本等合計	2,533,303,733	2,544,018,682
純資産合計	2,533,303,733	2,544,018,682
負債純資産合計	2,538,767,423	2,549,647,511

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11月21日
営業収益		
受取利息	139	92
有価証券売買等損益	96,850,820	94,667,038
営業収益合計	96,850,681	94,667,130
営業費用		
支払利息	8,156	12,484
受託者報酬	997,444	1,008,604
委託者報酬	16,101,590	16,281,718
その他費用	71,183	71,984
営業費用合計	17,178,373	17,374,790
営業利益又は営業損失（ ）	114,029,054	77,292,340
経常利益又は経常損失（ ）	114,029,054	77,292,340
当期純利益又は当期純損失（ ）	114,029,054	77,292,340
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（ ）	9,765	33,218
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	36,807,560	92,315,854
剰余金増加額又は欠損金減少額	954,391	738,077
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	954,391	738,077
剰余金減少額又は欠損金増加額	160,197	166,882
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	160,197	166,882
分配金	15,898,319	15,557,690
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,315,854	29,976,791

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他	ファンドの計算期間 第36特定期間は当特定期間末日が休業日のため、2022年 5月20日から2022年11月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第35特定期間 (2022年 5月19日現在)	第36特定期間 (2022年11月21日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,625,619,587口	2,573,995,473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 92,315,854円	元本の欠損 29,976,791円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9648円 (1万口当たり純資産額) (9,648円)	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)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11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	分配金の計算過程 第209期 自 2022年 5月20日 至 2022年 6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>- 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> </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	<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>2,372,772円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,044,289円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>87,017,140円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,372,772円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	9,044,289円	分配準備積立金額	D	87,017,140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																													
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	2,372,772円																													
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																													
収益調整金額	C	9,044,289円																													
分配準備積立金額	D	87,017,140円																													



第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日			第36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11月21日		
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,505,530円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,434,201円
当ファンドの期末残存口数	F	2,675,206,415口	当ファンドの期末残存口数	F	2,618,473,956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	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,675,206円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,618,473円
第204期 自 2021年12月21日 至 2022年 1月19日			第210期 自 2022年 6月21日 至 2022年 7月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	589,529円	費用控除後の配当等収益額	A	3,619,536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	8,856,163円	収益調整金額	C	9,046,803円
分配準備積立金額	D	88,486,602円	分配準備積立金額	D	86,413,558円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	97,932,294円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,079,897円
当ファンドの期末残存口数	F	2,661,870,001口	当ファンドの期末残存口数	F	2,608,753,345口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	367円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	379円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,661,870円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,608,753円
第205期 自 2022年 1月20日 至 2022年 2月21日			第211期 自 2022年 7月20日 至 2022年 8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	2,508,321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	8,870,114円	収益調整金額	C	9,175,097円
分配準備積立金額	D	86,079,884円	分配準備積立金額	D	86,804,537円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,949,998円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,487,955円
当ファンドの期末残存口数	F	2,652,914,417口	当ファンドの期末残存口数	F	2,595,421,221口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	357円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	379円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,652,914円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,595,421円
第206期 自 2022年 2月22日 至 2022年 3月22日			第212期 自 2022年 8月20日 至 2022年 9月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,267,152円	費用控除後の配当等収益額	A	212,660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	8,907,703円	収益調整金額	C	9,196,060円

第35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日			第36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11月21日		
分配準備積立金額	D	83,172,075円	分配準備積立金額	D	86,418,188円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,346,930円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	95,826,908円
当ファンドの期末残存口数	F	2,646,656,955口	当ファンドの期末残存口数	F	2,587,882,600口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	356円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	370円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,646,656円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,587,882円
第207期 自 2022年 3月23日 至 2022年 4月19日			第213期 自 2022年 9月21日 至 2022年10月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,125,573円	費用控除後の配当等収益額	A	7,676,950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	8,954,636円	収益調整金額	C	9,172,262円
分配準備積立金額	D	82,385,408円	分配準備積立金額	D	83,536,965円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	101,465,617円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,386,177円
当ファンドの期末残存口数	F	2,636,054,932口	当ファンドの期末残存口数	F	2,573,166,835口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	384円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	390円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,636,054円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,573,166円
第208期 自 2022年 4月20日 至 2022年 5月19日			第214期 自 2022年10月20日 至 2022年11月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	510,094円	費用控除後の配当等収益額	A	364,809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	8,977,267円	収益調整金額	C	9,396,995円
分配準備積立金額	D	89,461,267円	分配準備積立金額	D	88,448,426円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,948,628円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,210,230円
当ファンドの期末残存口数	F	2,625,619,587口	当ファンドの期末残存口数	F	2,573,995,473口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	376円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	381円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,625,619円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,573,995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36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11月21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36特定期間 (2022年11月21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35特定期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第36特定期間 自 2022年 5月20日 至 2022年11月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,686,304,481円	2,625,619,587円
期中追加設定元本額	9,600,230円	17,708,067円
期中一部解約元本額	70,285,124円	69,332,181円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第35特定期間 （2022年 5月19日現在）	第36特定期間 （2022年11月21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	44,402,631	7,245,669
合計	44,402,631	7,245,669

（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	391,769,847	772,844,377	
	外国債券インデックス マザーファンド	551,420,744	1,725,836,644	
合計		943,190,591	2,498,681,021	

(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11月21日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	581,010,736
コール・ローン	6,641,395,933
国債証券	296,564,710,491
派生商品評価勘定	15,324,458
未収入金	4,756,378
未収利息	1,654,691,294
前払費用	100,499,179
差入委託証拠金	499,238,906
流動資産合計	306,061,627,375
資産合計	306,061,627,375
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,718,952
前受金	1,775,590
未払金	3,524,226,586
未払解約金	60,575,446
未払利息	17,012
その他未払費用	1
流動負債合計	3,594,313,587
負債合計	3,594,313,587
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	96,640,177,956
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	205,827,135,832
元本等合計	302,467,313,788
純資産合計	302,467,313,788
負債純資産合計	306,061,627,375

注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年11月21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11月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,640,177,956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	<p>1口当たり純資産額 3.1298円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (31,298円)</p>

## （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11月21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11月21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11月21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11月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月20日
期首元本額	99,051,911,463円
期中追加設定元本額	10,936,306,479円
期中一部解約元本額	13,348,039,986円
期末元本額	96,640,177,956円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,258,946,712円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	551,420,744円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,225,427,658円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,444,473円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,822,752,913円
世界経済インデックスファンド	15,507,523,461円
D C マイセレクション 2 5	1,925,665,900円
D C マイセレクション 5 0	1,684,127,286円
D C マイセレクション 7 5	1,169,848,920円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,321,310,413円
D C マイセレクション S 2 5	970,650,936円



区分	2022年11月21日現在
DCマイセレクションS50	775,506,431円
DCマイセレクションS75	443,595,963円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	24,937,910円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	92,078,781円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	48,158,774円
DC世界経済インデックスファンド	13,454,361,854円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	504,216,844円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,592,694円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,003,475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）	20,701,829円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	39,279,339円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	61,302,826円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	70,160,237円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	64,451,521円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,126,589,041円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	412,320,574円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,657,006,622円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	61,102,806円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,200,216円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	407,052,737円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	153,603,548円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	199,216,600円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	697,493,711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）	3,263,618,156円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	677,802,405円
外国債券ファンド・シリーズ1	735,312,603円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109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）	596,600,174円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,279,731,312円
コア投資戦略ファンド（切替型）	439,121,979円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	253,986,001円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,504,569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）	1,267,646,590円
SMT インデックスバランス・オープン	197,246,734円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,977,871,924円
SMT 世界経済インデックス・オープン	285,993,970円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	356,493,646円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	576,216,491円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,839,924円
グローバル経済コア	854,423,417円

区分	2022年11月21日現在
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	18,072,613円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	1,820,850円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,887,444円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,893,704円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,900,198円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,022,203円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,894,563円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	58,961,224円
10資産分散投資ファンド	7,886円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	151,176,412円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,268,195,617円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,753,470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）	272,550,211円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	183,535,523円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	999,267,634円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	105,185,617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）	51,921,612円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		19,997,388,723
合計		19,997,388,723

(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11月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,046,127,250	-	3,047,902,840	1,775,590
	合計	3,046,127,250	-	3,047,902,840	1,775,590

## (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はありません。

## 通貨関連

（2022年11月21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	7,095,097,307	-	7,100,927,223	5,829,916
	アメリカドル	3,737,886,859	-	3,744,716,355	6,829,496
	カナダドル	206,639,275	-	206,257,940	381,335
	メキシコペソ	30,822,722	-	30,824,448	1,726
	ユーロ	2,463,905,484	-	2,463,133,285	772,199
	イギリスポンド	336,156,657	-	336,756,643	599,986
	ポーランドズロチ	15,554,333	-	15,563,761	9,428
	オーストラリアドル	54,209,827	-	54,206,925	2,902
	シンガポールドル	17,354,176	-	17,355,665	1,489
	オフショア人民元	232,567,974	-	232,112,201	455,773
合計		7,095,097,307	-	7,100,927,223	5,829,916

### (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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	9,488,867.20	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,450,950.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,095,561.52	

T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,260,878.89
T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,365,429.70
T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	9,833,417.99
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,400,937.50
T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,426,085.92
T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,670,046.88
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,702,832.05
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,203,859.38
T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,530,781.25
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,081,562.48
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,589,980.46
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,268,125.04
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,403,936.76
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,650,722.67
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,647,753.90
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,119,437.50
T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,304,603.17
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,670,820.32
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,554,531.24
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	3,989,003.89
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,601,787.50
T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,228,289.12
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	2,989,218.75
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,931,225.00
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,950,078.12
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,325,195.35
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,475,488.30
T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,509,062.56
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,034,062.48
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,415,293.02
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,720,728.88
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,117,382.82
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,533,945.32
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,209,726.60
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,353,125.00
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,454,257.86
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,550,781.24
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,427,035.93
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,083,679.74
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,225,129.49
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,117,812.48
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,302,968.78

T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,943,519.58
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,333,031.28
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,286,914.06
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,895,703.12
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,912,187.52
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,065,543.75
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,211,812.50
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,712,400.36
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,470,642.59
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,929,375.04
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	4,660,187.50
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	6,917,500.00
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,452,031.24
T 1.25% 08/15/31	13,380,000.00	10,857,661.00
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,440,546.87
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,257,343.75
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,362,689.43
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,745,468.76
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	5,516,929.73
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,035,862.50
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	17,146,021.87
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,872,343.78
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,220,125.00
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,401,640.64
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,515,169.56
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,809,472.67
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,037,314.48
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,288,843.72
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,507,714.82
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,157,687.52
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,082,104.29
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,399,972.71
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,850,351.56
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,429,687.50
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,546,031.26
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,122,210.97
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,339,530.45
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,270,390.64
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,977,937.50
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,292,843.74
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,180,571.89
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,622,187.50
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,953,759.42

T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,563,945.35	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,218,843.75	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,655,312.52	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,785,139.46	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,717,578.14	
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	5,927,296.87	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,941,523.42	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,452,500.00	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	4,934,648.46	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,147,503.93	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,005,776.96	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,356,578.11	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,602,281.23	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,784,179.70	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,611,691.40	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,884,843.76	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,309,166.03	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	3,015,039.08	
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,707,212.89	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,045,312.50	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,759,648.42	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,842,981.25	
T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,648,585.57	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	2,956,241.42	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,885,234.37	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,033,603.49	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,714,263.64	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,150,093.77	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,038,000.00	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,379,326.15	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,157,632.82	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,170,117.21	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,592,262.52	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,460,914.08	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,448,773.44	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,881,289.42	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,282,842.18	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,889,011.75	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,811,035.15	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,979,546.87	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,380,267.98	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,794,531.25	

T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,282,633.60
T 2.5% 02/15/46	3,950,000.00	2,942,441.42
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,649,884.73
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,079,003.91
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,462,644.93
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,339,500.00
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,971,894.56
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,420,429.70
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,545,368.75
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,927,050.77
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,157,000.00
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,301,890.62
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,288,593.75
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,990,585.96
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,162,796.87
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,617,261.73
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,276,228.11
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,139,062.50
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,382,097.67
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,859,218.76
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,853,893.75
T 2.875% 05/15/32	8,500,000.00	7,857,187.50
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,383,222.67
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,498,645.31
T 2.875% 05/15/52	5,800,000.00	4,694,375.00
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,683,017.20
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,259,302.35
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,692,150.00
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,843,234.37
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,000,585.95
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,947,373.03
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,022,128.92
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,315,625.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	5,993,941.43
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,178,828.30
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,274,306.62
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,478,484.00
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,169,960.93
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,420,764.11
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	5,818,156.25
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	905,789.06
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,703,125.00
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	4,989,539.06

T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,548,331.25
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,800,878.93
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,007,890.60
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,511,015.62
T 3.25% 05/15/42	1,750,000.00	1,533,574.22
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,645,272.67
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,688,015.62
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	727,289.06
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,200,875.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,840,625.00
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	1,901,406.26
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,808,984.39
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,414,656.25
T 3% 02/15/47	800,000.00	654,562.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	3,648,652.36
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,132,031.25
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,364,470.32
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,051,367.20
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,628,438.29
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,676,679.68
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,334,687.50
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,054,640.64
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,823,046.90
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,302,562.50
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	930,515.62
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,405,628.91
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,054,843.75
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,984,164.07
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,025,410.16
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,098,981.26
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,171,579.68
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	587,683.59
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,810,234.37
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,489,429.69
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	817,500.00
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,236,210.94
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,380,691.40
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,151,246.10
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,788,320.32
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,582,708.98
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,204,957.03
アメリカドル 小計	1,217,400,000.00	1,068,019,524.46



カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,041,785.60
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,281,584.00
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,266,918.40
	CAN 0.5% 12/01/30	3,360,000.00	2,742,364.80
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,249,157.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	660,289.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,358,208.00
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,721,783.00
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,488,868.00
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,382,240.40
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,533,523.20
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,268,866.40
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,493,719.10
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,150,068.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,773,088.00
	CAN 1.75% 12/01/53	2,520,000.00	1,799,406.00
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	732,450.60
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,392,621.30
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,248,227.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,233,024.00
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	721,612.40
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	482,975.10
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,300,952.80
	CAN 2.5% 12/01/32	500,000.00	473,425.00
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	822,964.80
	CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	739,860.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	959,752.50
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	677,395.60
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	385,953.50
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,172,106.90
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,624,863.10
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,170,057.20
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,087,884.00
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,121,271.20
CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,151,640.00	
CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,176,427.20	
CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,375,998.40	
CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,054,680.00	
カナダドル 小計		64,620,000.00	59,318,011.50 (6,217,713,965)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,023,071.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,599,728.00

	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,832,750.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	40,600,267.80	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,680,000.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,450,888.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	46,470,000.00	42,399,692.70	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,459,261.20	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,880,482.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	28,650,000.00	27,613,443.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	24,811,634.40	
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,228,879.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,330,766.50	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	24,825,860.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,353,133.80	
	メキシコペソ 小計	375,940,000.00	349,089,858.40	(2,518,020,057)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	879,590.40	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,910,000.00	1,556,726.40	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	665,973.80	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,378,862.60	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	299,724.80	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,595,124.40	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,587,856.40	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,350,967.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,140,000.00	1,955,082.60	
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	699,262.20	
	BGB 0% 10/22/31	1,780,000.00	1,434,555.40	
	BGB 1.25% 04/22/33	740,000.00	655,321.80	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	741,321.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	667,680.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	960,714.80	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,010,061.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	925,816.50	
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,403,833.80	
	BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,851,180.30	
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	752,936.80	
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	678,393.10	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,730,000.00	1,744,047.60	
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	393,104.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	1,051,309.20	
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,058,520.70	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,730,000.00	2,051,728.10	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,228,965.60	

BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,213,390.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,242,592.00
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,823,203.60
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	485,960.00
BKO 0.4% 09/13/24	1,300,000.00	1,262,235.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,800,568.00
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,838,903.20
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,431,158.40
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	551,626.40
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,729,505.70
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,767,036.50
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,950,745.20
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,443,722.80
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,058,480.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,081,656.30
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	695,874.60
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,986,832.50
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,836,360.40
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,344,367.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,691,263.40
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	970,920.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,581,230.40
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,488,899.60
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,895,090.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,310,854.40
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,434,270.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,752,506.00
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	917,830.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,820,539.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,667,818.00
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	523,887.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,226,860.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,353,008.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	807,325.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,334,109.10
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,700,244.50
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,765,995.00
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,197,481.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,078,912.80
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,882,801.60
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	986,730.00
BTPS 1.8% 03/01/41	1,360,000.00	981,022.40
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,421,727.00

BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,631,582.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,609,932.20	
BTPS 2.1% 07/15/26	900,000.00	872,379.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	380,030.80	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	713,265.60	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,194,294.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,350,822.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,296,430.40	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,373,409.90	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,237,050.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,944,837.50	
BTPS 2.5% 12/01/32	1,250,000.00	1,110,725.00	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	930,681.60	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,710,000.00	1,400,934.60	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	866,574.40	
BTPS 2.8% 06/15/29	1,820,000.00	1,748,910.80	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,020,000.00	1,964,773.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	1,034,199.20	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,127,021.60	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,137,181.60	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,256,756.80	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	872,246.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,042,614.10	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,701,226.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,968,886.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	3,970,414.80	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,192,398.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,450,992.90	
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,117,117.10	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,813,635.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,181,400.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,828,091.60	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,324,259.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,573,217.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,355,530.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	3,978,549.20	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,636,318.40	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,845,159.40	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,254,615.10	
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,195,619.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,153,824.00	
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,340,092.80	

BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,625,540.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	847,376.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,626,958.20
DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,171,843.80
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,389,223.50
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,978,822.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,864,100.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,655,710.20
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,742,860.90
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,147,665.00
DBR 0% 02/15/31	2,030,000.00	1,731,590.00
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,053,647.80
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,833,290.20
DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	2,058,447.30
DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,187,591.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,072,650.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,299,391.80
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	577,540.00
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,691,819.70
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,697,620.00
DBR 0% 08/15/52	1,990,000.00	1,130,419.50
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,690,728.80
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,532,915.60
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,071,711.60
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,271,725.80
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	3,074,016.40
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,644,043.50
DBR 1.8% 08/15/53	850,000.00	812,005.00
DBR 1% 05/15/38	1,160,000.00	986,904.80
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,965,500.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,545,542.00
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,628,363.20
DBR 2.5% 08/15/46	3,210,000.00	3,506,090.40
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,638,179.20
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	3,918,404.60
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,772,188.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	2,917,302.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,530,000.00	3,233,061.70
DBR 4.75% 07/04/40	2,030,000.00	2,797,360.30
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,583,483.60
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,767,855.20
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,382,585.20
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,602,050.00

DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,245,979.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,335,458.40	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,363,996.30	
FRTR 0.5% 05/25/26	3,550,000.00	3,347,082.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,533,630.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,204,531.70	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	434,956.50	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,263,675.60	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	1,990,814.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,806,110.30	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,080,000.00	1,865,278.80	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,580,252.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,357,839.50	
FRTR 0% 02/25/24	2,850,000.00	2,777,581.50	
FRTR 0% 02/25/25	4,900,000.00	4,663,771.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,154,757.60	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,154,752.80	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,142,083.20	
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,552,368.10	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,614,455.20	
FRTR 0% 11/25/29	6,130,000.00	5,238,636.70	
FRTR 0% 11/25/30	6,630,000.00	5,523,254.10	
FRTR 0% 11/25/31	4,770,000.00	3,867,563.70	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,787,077.40	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,750,000.00	3,964,160.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,802,144.60	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,730,195.00	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,380,000.00	1,054,085.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,554,094.80	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,126,096.00	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,411,780.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,101,852.80	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,106,027.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	4,980,000.00	5,071,831.20	
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	492,840.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,580,000.00	5,724,075.60	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,043,586.40	
FRTR 2% 11/25/32	2,670,000.00	2,558,046.90	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,230,000.00	3,467,308.10	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	5,839,064.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,300,000.00	5,327,829.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,940,000.00	3,566,367.00	

FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,022,967.20
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,572,497.20
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,877,825.30
FRTR 5.5% 04/25/29	6,520,000.00	7,758,148.00
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,595,996.00
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,105,618.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	851,182.50
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	813,513.60
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	383,853.70
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	465,344.60
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	338,465.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	714,583.10
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	688,967.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,113,048.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	594,497.70
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	734,865.90
IRISH 1.5% 05/15/50	880,000.00	671,193.60
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	509,611.20
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	962,970.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,220,345.50
IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	959,475.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	986,451.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,245,979.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,205,426.30
NETHER 0.25% 07/15/29	750,000.00	661,755.00
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,317,894.20
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,342,226.60
NETHER 0.5% 07/15/32	1,220,000.00	1,033,364.40
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,467,866.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,576,444.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,591,401.60
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,114,137.50
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,689,083.20
NETHER 0% 01/15/29	1,710,000.00	1,496,626.20
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	670,416.00
NETHER 0% 01/15/52	1,410,000.00	764,445.60
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,146,676.50
NETHER 0% 07/15/31	1,490,000.00	1,238,577.40
NETHER 2.5% 01/15/33	1,630,000.00	1,659,372.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,558,130.30
NETHER 2% 01/15/54	480,000.00	456,936.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,989,442.80
NETHER 3.75% 01/15/42	1,960,000.00	2,379,048.00

NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,597,339.20	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,009,775.60	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,237,359.40	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,875,976.00	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,192,175.00	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,339,319.00	
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,612,024.00	
OBL 0% 10/10/25	5,000,000.00	4,725,350.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,318,106.70	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,438,636.50	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	428,148.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,254,829.50	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,008,555.20	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	141,066.80	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,116,684.80	
RAGB 0.75% 03/20/51	860,000.00	540,329.40	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,970,425.60	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	161,089.50	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,250,000.00	1,078,462.50	
RAGB 0% 02/20/30	1,210,000.00	1,012,975.70	
RAGB 0% 02/20/31	1,430,000.00	1,161,889.30	
RAGB 0% 04/20/25	960,000.00	911,510.40	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,389,873.60	
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	633,910.10	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	412,036.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,042,725.70	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	734,904.60	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	181,920.60	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	982,060.20	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	391,400.20	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	664,532.10	
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	708,946.80	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	891,195.90	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	527,654.40	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,116,987.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,488,121.40	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,386,452.80	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	312,373.60	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	238,054.60	
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	439,765.20	
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	326,150.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	585,924.80	



RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	323,042.30
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	796,772.10
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	583,121.50
RFGB 0.5% 09/15/29	550,000.00	482,751.50
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	694,840.00
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	424,771.60
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,569.20
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	275,121.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	429,806.00
RFGB 1.125% 04/15/34	530,000.00	449,010.70
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	336,063.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	387,222.50
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	444,155.60
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	511,602.00
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	560,560.00
RFGB 2% 04/15/24	510,000.00	509,510.40
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	870,811.10
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,156,085.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,216,101.70
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,900,846.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,097,171.40
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,062,998.20
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,802,636.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,258,610.40
SPGB 0.8% 07/30/29	1,130,000.00	998,795.70
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,049,068.40
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,171,403.60
SPGB 0% 01/31/26	3,060,000.00	2,838,578.40
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,406,932.80
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,690,622.10
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,037,711.40
SPGB 0% 05/31/25	1,670,000.00	1,574,242.20
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,008,559.90
SPGB 1.25% 10/31/30	3,020,000.00	2,697,313.00
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,081,572.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,041,167.10
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,840,806.80
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,504,228.60
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,891,374.40
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	356,235.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,920,600.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,002,023.50
SPGB 1.85% 07/30/35	2,000,000.00	1,734,720.00

	SPGB 1.9% 10/31/52	1,190,000.00	855,514.80
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,269,571.00
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,591,163.20
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	600,046.90
	SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,358,692.90
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,801,064.20
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,026,246.00
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,904,106.60
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,760,000.00	1,569,638.40
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,362,676.50
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,800,000.00	1,688,202.00
	SPGB 3.45% 07/30/43	570,000.00	573,898.80
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,786,639.40
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,572,920.00
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,829,450.80
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,590,000.00	2,641,644.60
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,015,540.40
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,590,000.00	1,911,084.60
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,896,782.40
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,482,771.20
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	3,968,130.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,243,034.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,564,589.60
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,320,919.60
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,258,005.00
	ユーロ 小計	735,320,000.00	697,415,777.80 (100,992,778,783)
イギリス債券	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,146,574.80
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,181,167.00
	UKT 0.125% 01/31/28	1,460,000.00	1,241,657.00
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,765,735.20
	UKT 0.25% 07/31/31	2,770,000.00	2,142,761.20
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,658,714.30
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,725,783.50
	UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,626,912.80
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	587,415.80
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,596,334.00
	UKT 0.625% 07/31/35	1,910,000.00	1,355,546.10
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	542,918.00
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	684,227.70
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	978,440.40
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,453,177.00

	UKT 1.125% 01/31/39	1,420,000.00	995,334.80
	UKT 1.125% 10/22/73	870,000.00	474,489.30
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	867,112.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,010,000.00	1,226,481.90
	UKT 1.25% 10/22/41	2,460,000.00	1,688,544.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,507,728.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,596,574.20
	UKT 1.5% 07/31/53	1,070,000.00	694,932.90
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	977,498.50
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	902,905.40
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,001,205.20
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	924,443.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,558,624.60
	UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,737,677.40
	UKT 1% 01/31/32	3,600,000.00	2,944,224.00
	UKT 1% 04/22/24	1,800,000.00	1,746,810.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,820,000.00	1,597,068.20
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,675,077.30
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,727,846.00
	UKT 3.25% 01/22/44	2,010,000.00	1,915,811.40
	UKT 3.5% 01/22/45	2,120,000.00	2,103,252.00
	UKT 3.5% 07/22/68	1,830,000.00	2,042,591.10
	UKT 3.75% 07/22/52	1,100,000.00	1,174,866.00
	UKT 4.125% 01/29/27	740,000.00	760,202.00
	UKT 4.25% 03/07/36	1,940,000.00	2,095,762.60
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,274,216.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,750,960.80
	UKT 4.25% 12/07/27	1,660,000.00	1,726,499.60
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,900,605.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,320,000.00	1,472,710.80
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,713,729.20
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,271,066.40
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,740,235.10
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,321,522.50
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,621,592.80
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,885,752.00
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,479,287.50
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,226,444.80
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,427,462.50
	イギリス債券 小計	94,000,000.00	84,436,512.10 (14,066,278,550)
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,537,931.80
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,981,829.00

	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,925,111.20
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,395,875.00
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,203,211.60
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,654,306.90
	SGB 2.5% 05/12/25	6,360,000.00	6,380,224.80
	SGB 3.5% 03/30/39	4,440,000.00	5,462,443.20
スウェーデンクローナ 小計		58,910,000.00	57,540,933.50 (758,389,503)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,690,171.80
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,676,998.40
	NGB 1.5% 02/19/26	4,820,000.00	4,551,959.80
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,978,822.60
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,337,881.90
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,872,472.50
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,062,438.40
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,713,027.00
	NGB 3% 03/14/24	7,530,000.00	7,496,566.80
ノルウェークローネ 小計		46,600,000.00	43,380,339.20 (596,045,860)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,701,346.30
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,315,700.00
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,359,429.60
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,677,491.20
	DGB 0% 11/15/31	6,960,000.00	5,692,932.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,516,855.50
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,445,092.20
	DGB 4.5% 11/15/39	12,270,000.00	15,950,877.30
デンマーククローネ 小計		57,470,000.00	55,659,724.10 (1,083,694,828)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,756,315.50
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,069,360.80
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,914,127.20
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,728,998.50
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,650,000.00	1,711,873.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,595,910.70
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,130,000.00	2,951,652.60
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,492,325.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,479,525.40
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,910,000.00	3,156,855.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,801,653.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,180,000.00	2,878,695.00
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,960,000.00	1,700,241.20

	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	559,884.00
ポージランドズロチ 小計		49,650,000.00	40,797,419.10 (1,256,960,322)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,520,000.00	2,379,988.80
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,922,403.00
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,527,763.60
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,224,195.00
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,837,013.50
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,207,255.40
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	2,024,880.00
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,892,007.10
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,937,394.80
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,395,136.80
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,760,000.00	2,573,976.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,372,893.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,351,856.80
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,076,472.00
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,874,763.40
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,598,945.20
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,070,000.00	1,974,324.60
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,565,043.20
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,173,622.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,018,404.80
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,460,000.00	1,435,895.40
	ACGB 3% 03/21/47	1,360,000.00	1,135,028.80
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,729,894.40
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,196,562.50
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,483,250.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,453,237.60
オーストラリアドル 小計		54,090,000.00	49,362,207.70 (4,610,923,821)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	477,994.40
	NZGB 0.5% 05/15/24	930,000.00	879,677.70
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	589,244.90
	NZGB 1.5% 05/15/31	720,000.00	585,597.60
	NZGB 1.75% 05/15/41	470,000.00	307,013.40
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	820,462.50
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	520,619.40
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	374,124.40
	NZGB 2% 05/15/32	580,000.00	483,447.40
	NZGB 3.5% 04/14/33	540,000.00	509,695.20
	NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	777,195.40
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	849,987.60

ニュージーランドドル 小計		8,170,000.00	7,175,059.90 (618,561,913)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	699,825.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	760,711.50
	SIGB 1.625% 07/01/31	840,000.00	746,802.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	624,916.60
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	261,427.20
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,051,855.20
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	808,271.30
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	928,090.20
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	391,205.40
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	599,074.90
	SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	336,126.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	740,559.20
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	615,869.10
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	641,602.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	619,875.90
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	670,248.80
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	851,123.50
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	756,931.20
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	296,027.20
	SIGB 3% 09/01/24	1,210,000.00	1,209,576.50
シンガポールドル 小計		14,200,000.00	13,610,118.70 (1,389,184,815)
マレーシアリングgit	MGS 2.632% 04/15/31	1,800,000.00	1,587,348.00
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,919,788.80
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,471,374.20
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	672,426.80
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,543,980.00
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,636,093.20
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,667,127.60
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,594,332.30
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,373,082.50
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,108,959.20
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,121,649.30
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,946,005.40
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,110,226.80
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	598,002.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,127,456.80
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,291,379.20
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,123,503.20
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,293,721.60
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,469,706.50

	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,700,912.50
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,532,300.00
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	586,925.20
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,795,470.30
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,061,560.50
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,472,496.40
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,351,136.00
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	1,896,837.60
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,707,820.80
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,055,636.70
	マレーシアリングット 小計	50,650,000.00	49,817,259.40 (1,525,269,976)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	957,601.09
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,036,804.60
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,268,648.60
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	803,113.85
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,552,457.12
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,232,831.87
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,193,783.34
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,423,022.22
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,909,529.14
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,618,889.07
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,052,016.58
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,775,022.61
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,739,645.61
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,489,857.69
	イスラエルシェケル 小計	27,720,000.00	27,053,223.39 (1,093,172,061)
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000.00	79,059,319.50
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,463,325.00
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,708,730.00
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,562,174.40
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	19,896,400.00
	CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	14,839,870.50
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,325,855.20
	CGB 2.75% 02/17/32	23,500,000.00	23,239,150.00
	CGB 2.75% 06/15/29	25,700,000.00	25,602,340.00
	CGB 2.8% 03/24/29	19,750,000.00	19,759,480.00
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,749,607.50
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	29,788,092.20
	CGB 2.89% 11/18/31	20,780,000.00	20,821,144.40
	CGB 2.91% 10/14/28	10,720,000.00	10,828,272.00

	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,112,093.80
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,043,330.10
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,619,448.80
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,115,163.50
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,755,153.60
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,618,188.40
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,799,330.50
	CGB 3.72% 04/12/51	7,890,000.00	8,517,412.80
	CGB 3.81% 09/14/50	8,860,000.00	9,695,232.20
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,191,537.40
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,324,957.20
	オフショア人民元 小計	499,450,000.00	505,435,609.00 (9,930,495,584)
	合計		296,564,710,491 (296,564,710,491)

## 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 214銘柄	100.0%	50.5%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 350銘柄	100.0%	34.1%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.7%
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 9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%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 12銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 25銘柄	100.0%	3.3%

(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11月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,132,130,584
株式	505,863,987,550
派生商品評価勘定	344,487,750
未収配当金	5,197,684,605
差入委託証拠金	323,100,000
流動資産合計	513,861,390,489
資産合計	513,861,390,489
負債の部	
流動負債	
前受金	344,530,100
未払解約金	126,241,125
未払利息	5,461
流動負債合計	470,776,686
負債合計	470,776,686
純資産の部	
元本等	
元本	260,249,979,125
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	253,140,634,678
元本等合計	513,390,613,803
純資産合計	513,390,613,803
負債純資産合計	513,861,390,489

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  先物取引

2022年11月21日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年11月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,249,979,125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 1.9727円 (1万口当たり純資産額) (19,727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11月21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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	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。

	2022年11月21日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年11月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2022年11月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月20日
期首元本額	261,530,666,067円
期中追加設定元本額	11,904,309,218円
期中一部解約元本額	13,184,996,160円
期末元本額	260,249,979,125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）	391,769,847円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,074,002,810円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,524,116円
S M T T O P I X インデックス・オープン	12,074,491,611円
世界経済インデックスファンド	4,348,726,826円
日本株式インデックス・オープン	3,244,531,517円
D C マイセレクション 2 5	6,154,453,515円
D C マイセレクション 5 0	19,014,976,552円
D C マイセレクション 7 5	19,355,704,940円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,228,726,388円
D C マイセレクション S 2 5	3,219,281,918円
D C マイセレクション S 5 0	9,522,233,378円
D C マイセレクション S 7 5	7,391,911,045円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,591,192,828円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	159,522,091円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	682,646,180円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	512,422,258円
D C 世界経済インデックスファンド	3,813,806,752円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,434,403,003円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,247,114円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	170,662,607円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,488,931円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	100,517,813円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	24,636,469円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	67,888,060円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	802,470,001円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	417,925,622円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,705,911,232円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	41,231,675円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,430,090円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	453,433,261円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	252,026,069円

区分	2022年11月21日現在
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	330,628,578円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	34,095,150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)	579,169,163円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,995,676,245円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,763,721,587円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,826,576,837円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,384,583,887円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	521,897,742円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	446,199,169円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	223,692,664円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,982,171円
SMT インデックスバランス・オープン	58,048,547円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,396,693,431円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	529,549,455円
SMT 世界経済インデックス・オープン	53,069,928円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	200,933,805円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	36,288,742円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,840,099円
グローバル経済コア	221,181,708円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,052,844円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	240,282,595円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,256,279円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	232,281,285円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	20,393,344円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	17,746,963円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	6,938,223円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,811,563円
10資産分散投資ファンド	32,436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)	44,369,987,525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)	789,056,240円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	333,541,918円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	25,803,878円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	348,761,100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)	45,703,220,421円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	18,802,726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)	212,347,711円

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年11月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		13,185,835,939
合計		13,185,835,939

(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11月21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	6,740,334,900	-	7,084,865,000	344,530,100
	合計	6,740,334,900	-	7,084,865,000	344,530,100

(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	9,400	3,640.00	34,216,000	
日本水産	249,000	517.00	128,733,000	
マルハニチロ	38,500	2,440.00	93,940,000	
雪国まいたけ	21,200	1,018.00	21,581,600	
カネコ種苗	8,200	1,421.00	11,652,200	
サカタのタネ	31,500	4,715.00	148,522,500	
ホクト	22,200	1,904.00	42,268,800	
ホクリヨウ	3,500	694.00	2,429,000	
住石ホールディングス	38,700	201.00	7,778,700	
日鉄鉱業	10,000	3,150.00	31,500,000	
三井松島ホールディングス	11,300	2,963.00	33,481,900	

INPEX	920,900	1,506.00	1,386,875,400
石油資源開発	28,800	4,105.00	118,224,000
K&Oエナジーグループ	11,300	2,219.00	25,074,700
ショーボンドホールディングス	33,900	6,070.00	205,773,000
ミライト・ワン	86,300	1,517.00	130,917,100
タマホーム	17,600	2,489.00	43,806,400
サンヨーホームズ	3,000	706.00	2,118,000
日本アクア	10,400	880.00	9,152,000
ファーストコーポレーション	6,400	720.00	4,608,000
ベストテラ	5,400	1,010.00	5,454,000
Robot Home	42,400	185.00	7,844,000
キャンディル	3,800	493.00	1,873,400
ダイセキ環境ソリューション	5,000	814.00	4,070,000
第一カッター興業	6,400	1,188.00	7,603,200
安藤・間	144,300	860.00	124,098,000
東急建設	70,900	648.00	45,943,200
コムシスホールディングス	84,300	2,489.00	209,822,700
ピーアールホールディングス	39,500	335.00	13,232,500
高松コンストラクショングループ	16,200	1,943.00	31,476,600
東建コーポレーション	8,100	8,090.00	65,529,000
ソネック	2,700	940.00	2,538,000
ヤマウラ	12,600	1,003.00	12,637,800
オリエンタル白石	89,500	276.00	24,702,000
大成建設	173,400	4,020.00	697,068,000
大林組	622,900	1,007.00	627,260,300
清水建設	523,600	728.00	381,180,800
飛鳥建設	19,200	1,018.00	19,545,600
長谷工コーポレーション	179,800	1,505.00	270,599,000
松井建設	16,200	567.00	9,185,400
銭高組	2,200	2,672.00	5,878,400
鹿島建設	386,200	1,523.00	588,182,600
不動テトラ	12,000	1,510.00	18,120,000
大末建設	6,300	1,170.00	7,371,000
鉄建建設	12,500	1,785.00	22,312,500
西松建設	29,500	3,795.00	111,952,500
三井住友建設	140,400	417.00	58,546,800
大豊建設	7,200	4,250.00	30,600,000
佐田建設	11,100	429.00	4,761,900
ナカノフドー建設	12,400	319.00	3,955,600
奥村組	28,200	2,890.00	81,498,000
東鉄工業	24,000	2,554.00	61,296,000
イチケン	3,900	1,773.00	6,914,700

富士ピー・エス	7,800	443.00	3,455,400
浅沼組	13,900	2,858.00	39,726,200
戸田建設	214,300	705.00	151,081,500
熊谷組	30,200	2,497.00	75,409,400
北野建設	3,300	2,343.00	7,731,900
植木組	4,900	1,272.00	6,232,800
矢作建設工業	23,700	734.00	17,395,800
ピーエス三菱	22,100	598.00	13,215,800
日本ハウスホールディングス	34,500	433.00	14,938,500
新日本建設	24,400	758.00	18,495,200
東亜道路工業	3,500	5,860.00	20,510,000
日本道路	3,500	6,170.00	21,595,000
東亜建設工業	14,900	2,291.00	34,135,900
日本国土開発	52,200	580.00	30,276,000
若築建設	7,700	2,749.00	21,167,300
東洋建設	56,400	832.00	46,924,800
五洋建設	246,900	649.00	160,238,100
世紀東急工業	23,000	792.00	18,216,000
福田組	6,600	4,765.00	31,449,000
住友林業	133,600	2,332.00	311,555,200
日本基礎技術	11,100	530.00	5,883,000
巴コーポレーション	19,500	382.00	7,449,000
大和ハウス工業	486,700	3,160.00	1,537,972,000
ライト工業	33,200	1,957.00	64,972,400
積水ハウス	545,600	2,501.50	1,364,818,400
日特建設	16,600	905.00	15,023,000
北陸電気工事	11,900	669.00	7,961,100
ユアテック	38,400	716.00	27,494,400
日本リーテック	11,500	732.00	8,418,000
四電工	7,300	1,727.00	12,607,100
中電工	27,000	2,057.00	55,539,000
関電工	95,400	880.00	83,952,000
きんでん	122,600	1,475.00	180,835,000
東京エネシス	17,300	937.00	16,210,100
トーエネック	5,800	3,390.00	19,662,000
住友電設	16,600	2,475.00	41,085,000
日本電設工業	28,600	1,653.00	47,275,800
エクシオグループ	85,300	2,107.00	179,727,100
新日本空調	9,700	1,931.00	18,730,700
九電工	42,400	3,290.00	139,496,000
三機工業	38,600	1,536.00	59,289,600
日揮ホールディングス	172,300	1,865.00	321,339,500



中外炉工業	5,700	1,568.00	8,937,600	
ヤマト	14,500	690.00	10,005,000	
太平電業	10,800	3,140.00	33,912,000	
高砂熱学工業	42,000	1,783.00	74,886,000	
三晃金属工業	2,100	2,933.00	6,159,300	
朝日工業社	7,200	1,956.00	14,083,200	
明星工業	30,000	715.00	21,450,000	
大気社	21,000	3,500.00	73,500,000	
ダイダン	11,400	2,158.00	24,601,200	
日比谷総合設備	14,900	1,915.00	28,533,500	
フィル・カンパニー	3,100	1,109.00	3,437,900	
テスホールディングス	18,700	1,096.00	20,495,200	
インフロニア・ホールディングス	182,500	1,045.00	190,712,500	
東洋エンジニアリング	23,000	590.00	13,570,000	
レイズネクスト	25,200	1,228.00	30,945,600	
ニッポン	47,100	1,600.00	75,360,000	
日清製粉グループ本社	161,700	1,617.00	261,468,900	
日東富士製粉	3,100	4,415.00	13,686,500	
昭和産業	15,200	2,435.00	37,012,000	
鳥越製粉	14,000	614.00	8,596,000	
中部飼料	24,200	1,037.00	25,095,400	
フィード・ワン	25,600	676.00	17,305,600	
東洋精糖	3,300	872.00	2,877,600	
日本甜菜製糖	10,200	1,623.00	16,554,600	
D M三井製糖ホールディングス	17,300	1,957.00	33,856,100	
塩水港精糖	20,900	200.00	4,180,000	
日新製糖	9,000	1,693.00	15,237,000	
森永製菓	36,000	3,705.00	133,380,000	
中村屋	4,400	3,115.00	13,706,000	
江崎グリコ	50,000	3,585.00	179,250,000	
名糖産業	6,900	1,631.00	11,253,900	
井村屋グループ	9,600	2,240.00	21,504,000	
不二家	12,000	2,676.00	32,112,000	
山崎製パン	117,000	1,564.00	182,988,000	
第一屋製パン	3,300	399.00	1,316,700	
モロゾフ	5,600	3,630.00	20,328,000	
亀田製菓	11,100	4,305.00	47,785,500	
寿スピリッツ	18,600	7,750.00	144,150,000	
カルビー	80,000	2,877.00	230,160,000	
森永乳業	31,800	4,420.00	140,556,000	
六甲バター	12,800	1,428.00	18,278,400	
ヤクルト本社	124,900	8,300.00	1,036,670,000	

明治ホールディングス	108,400	6,680.00	724,112,000
雪印メグミルク	42,300	1,751.00	74,067,300
プリマハム	23,500	2,058.00	48,363,000
日本ハム	68,400	3,715.00	254,106,000
林兼産業	5,300	478.00	2,533,400
丸大食品	17,600	1,426.00	25,097,600
S Foods	19,300	2,903.00	56,027,900
柿安本店	6,800	2,195.00	14,926,000
伊藤ハム米久ホールディングス	135,900	679.00	92,276,100
サッポロホールディングス	57,600	3,515.00	202,464,000
アサヒグループホールディングス	404,000	4,304.00	1,738,816,000
キリンホールディングス	789,100	2,184.00	1,723,394,400
宝ホールディングス	119,400	1,052.00	125,608,800
オエノンホールディングス	52,300	282.00	14,748,600
養命酒製造	5,800	1,795.00	10,411,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,000	1,458.00	199,746,000
サントリー食品インターナショナル	123,100	4,635.00	570,568,500
ダイトーグループホールディングス	9,900	4,680.00	46,332,000
伊藤園	65,200	5,500.00	358,600,000
キーコーヒー	19,600	2,060.00	40,376,000
ユニカフェ	5,800	982.00	5,695,600
ジャパンフーズ	2,700	1,074.00	2,899,800
日清オイリオグループ	24,600	3,275.00	80,565,000
不二製油グループ本社	40,700	2,088.00	84,981,600
かどや製油	1,800	3,495.00	6,291,000
J - オイルミルズ	17,800	1,557.00	27,714,600
キッコーマン	115,900	7,700.00	892,430,000
味の素	427,900	4,221.00	1,806,165,900
ブルドックソース	7,000	1,717.00	12,019,000
キューピー	94,000	2,487.00	233,778,000
ハウス食品グループ本社	53,500	2,740.00	146,590,000
カゴメ	81,500	3,040.00	247,760,000
焼津水産化学工業	7,800	809.00	6,310,200
アリアケジャパン	15,300	4,745.00	72,598,500
ピエトロ	2,500	1,800.00	4,500,000
エバラ食品工業	4,700	3,145.00	14,781,500
やまみ	1,700	1,306.00	2,220,200
ニチレイ	80,100	2,779.00	222,597,900
東洋水産	88,400	5,610.00	495,924,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,253.00	16,672,200
大冷	2,200	1,891.00	4,160,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	488.00	5,416,800

日清食品ホールディングス	62,300	10,470.00	652,281,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,024.00	17,406,400
一正蒲鉾	7,500	741.00	5,557,500
フジッコ	18,000	1,914.00	34,452,000
ロック・フィールド	21,300	1,501.00	31,971,300
日本たばこ産業	1,151,100	2,795.00	3,217,324,500
ケンコーマヨネーズ	12,000	1,636.00	19,632,000
わらべや日洋ホールディングス	12,900	1,784.00	23,013,600
なとり	11,000	2,070.00	22,770,000
イフジ産業	3,000	921.00	2,763,000
ファーマフーズ	27,000	1,332.00	35,964,000
ユーグレナ	112,600	871.00	98,074,600
紀文食品	13,600	935.00	12,716,000
ピクルスホールディングス	10,200	1,056.00	10,771,200
ミヨシ油脂	6,200	1,012.00	6,274,400
理研ビタミン	15,100	1,817.00	27,436,700
片倉工業	16,700	1,855.00	30,978,500
ゲンゼ	13,500	3,835.00	51,772,500
東洋紡	77,400	1,031.00	79,799,400
ユニチカ	55,800	257.00	14,340,600
富士紡ホールディングス	7,200	3,300.00	23,760,000
倉敷紡績	13,600	2,125.00	28,900,000
シキボウ	9,900	862.00	8,533,800
日本毛織	52,200	1,003.00	52,356,600
トーア紡コーポレーション	6,900	355.00	2,449,500
帝国繊維	20,400	1,644.00	33,537,600
帝人	171,300	1,292.00	221,319,600
東レ	1,192,500	737.60	879,588,000
住江織物	3,200	1,799.00	5,756,800
日本フェルト	11,200	401.00	4,491,200
イチカワ	2,600	1,302.00	3,385,200
日東製網	2,000	1,346.00	2,692,000
アツギ	10,900	373.00	4,065,700
ダイニック	4,600	615.00	2,829,000
セーレン	34,600	2,587.00	89,510,200
ソトー	5,900	813.00	4,796,700
東海染工	1,900	1,128.00	2,143,200
小松マテーレ	26,100	793.00	20,697,300
ワコールホールディングス	34,400	2,400.00	82,560,000
ホギメディカル	23,900	3,485.00	83,291,500
T S Iホールディングス	64,100	471.00	30,191,100
マツオカコーポレーション	5,000	1,046.00	5,230,000

ワールド	23,000	1,315.00	30,245,000
三陽商会	6,800	1,289.00	8,765,200
ナイガイ	6,700	262.00	1,755,400
オンワードホールディングス	116,100	316.00	36,687,600
ルックホールディングス	5,200	2,331.00	12,121,200
ゴールドウイン	31,500	9,500.00	299,250,000
デサント	30,700	3,430.00	105,301,000
キング	8,200	480.00	3,936,000
ヤマトインターナショナル	14,900	249.00	3,710,100
特種東海製紙	8,900	2,864.00	25,489,600
王子ホールディングス	741,000	529.00	391,989,000
日本製紙	92,600	961.00	88,988,600
三菱製紙	21,400	278.00	5,949,200
北越コーポレーション	112,400	794.00	89,245,600
中越パルプ工業	7,200	928.00	6,681,600
巴川製紙所	5,600	781.00	4,373,600
大王製紙	78,600	1,092.00	85,831,200
阿波製紙	4,300	302.00	1,298,600
レンゴー	162,000	890.00	144,180,000
トモク	10,300	1,625.00	16,737,500
ザ・パック	13,200	2,504.00	33,052,800
北の達人コーポレーション	74,900	303.00	22,694,700
クラレ	282,800	1,076.00	304,292,800
旭化成	1,110,800	1,015.50	1,128,017,400
共和レザー	10,200	499.00	5,089,800
昭和電工	171,900	2,179.00	374,570,100
住友化学	1,319,600	492.00	649,243,200
住友精化	7,400	4,010.00	29,674,000
日産化学	84,500	6,570.00	555,165,000
ラサ工業	6,900	2,221.00	15,324,900
クレハ	15,200	10,030.00	152,456,000
多木化学	6,900	5,550.00	38,295,000
テイカ	12,000	1,296.00	15,552,000
石原産業	32,200	1,062.00	34,196,400
片倉コープアグリ	3,600	1,473.00	5,302,800
日本曹達	19,100	4,265.00	81,461,500
東ソー	237,500	1,610.00	382,375,000
トクヤマ	57,400	1,839.00	105,558,600
セントラル硝子	28,500	3,755.00	107,017,500
東亜合成	91,500	1,146.00	104,859,000
大阪ソーダ	10,700	4,150.00	44,405,000
関東電化工業	34,400	986.00	33,918,400

デンカ	64,700	3,320.00	214,804,000
信越化学工業	304,400	17,450.00	5,311,780,000
日本カーバイド工業	6,700	1,292.00	8,656,400
堺化学工業	13,500	1,895.00	25,582,500
第一稀元素化学工業	16,200	1,233.00	19,974,600
エア・ウォーター	167,800	1,601.00	268,647,800
日本酸素ホールディングス	172,600	2,287.00	394,736,200
日本化学工業	5,900	1,824.00	10,761,600
東邦アセチレン	3,800	1,129.00	4,290,200
日本パーカラライジング	88,100	996.00	87,747,600
高压ガス工業	25,800	662.00	17,079,600
チタン工業	2,200	1,594.00	3,506,800
四国化成工業	21,100	1,324.00	27,936,400
戸田工業	4,100	3,020.00	12,382,000
ステラ ケミファ	10,500	2,625.00	27,562,500
保土谷化学工業	5,000	3,030.00	15,150,000
日本触媒	27,100	5,450.00	147,695,000
大日精化工業	12,400	1,719.00	21,315,600
カネカ	40,600	3,440.00	139,664,000
三菱瓦斯化学	132,800	1,942.00	257,897,600
三井化学	149,600	3,095.00	463,012,000
J S R	166,100	2,749.00	456,608,900
東京応化工業	31,100	6,770.00	210,547,000
大阪有機化学工業	13,400	2,139.00	28,662,600
三菱ケミカルグループ	1,200,400	719.00	863,087,600
K Hネオケム	29,600	2,839.00	84,034,400
ダイセル	261,500	983.00	257,054,500
住友ベークライト	26,300	4,230.00	111,249,000
積水化学工業	369,400	1,924.00	710,725,600
日本ゼオン	106,700	1,358.00	144,898,600
アイカ工業	44,900	3,270.00	146,823,000
U B E	91,700	2,007.00	184,041,900
積水樹脂	25,900	1,801.00	46,645,900
タキロンシーアイ	38,900	515.00	20,033,500
旭有機材	11,800	2,692.00	31,765,600
ニチバン	11,000	1,771.00	19,481,000
リケンテクノス	38,300	502.00	19,226,600
大倉工業	8,200	1,958.00	16,055,600
積水化成成品工業	25,000	392.00	9,800,000
群栄化学工業	4,200	2,417.00	10,151,400
タイガースポリマー	8,100	400.00	3,240,000
ミライアル	5,400	1,718.00	9,277,200

ダイキアクシス	6,500	721.00	4,686,500
ダイキョーニシカワ	39,300	608.00	23,894,400
竹本容器	6,000	751.00	4,506,000
森六ホールディングス	9,000	1,760.00	15,840,000
恵和	5,800	3,515.00	20,387,000
日本化薬	135,900	1,196.00	162,536,400
カーリットホールディングス	16,000	693.00	11,088,000
日本精化	10,100	2,224.00	22,462,400
扶桑化学工業	16,500	3,625.00	59,812,500
トリケミカル研究所	23,700	2,420.00	57,354,000
A D E K A	62,000	2,219.00	137,578,000
日油	55,000	5,620.00	309,100,000
新日本理化	24,500	265.00	6,492,500
ハリマ化成グループ	12,500	823.00	10,287,500
花王	433,200	5,530.00	2,395,596,000
第一工業製薬	6,400	2,012.00	12,876,800
石原ケミカル	8,100	1,238.00	10,027,800
日華化学	7,100	881.00	6,255,100
ニイタカ	3,600	2,168.00	7,804,800
三洋化成工業	10,900	4,325.00	47,142,500
有機合成薬品工業	13,100	299.00	3,916,900
大日本塗料	21,700	766.00	16,622,200
日本ペイントホールディングス	787,100	1,093.00	860,300,300
関西ペイント	162,900	1,878.00	305,926,200
神東塗料	14,800	131.00	1,938,800
中国塗料	32,900	1,037.00	34,117,300
日本特殊塗料	11,300	863.00	9,751,900
藤倉化成	23,900	403.00	9,631,700
太陽ホールディングス	27,000	2,554.00	68,958,000
D I C	69,500	2,470.00	171,665,000
サカタインクス	39,600	1,087.00	43,045,200
東洋インキＳＣホールディングス	34,800	1,860.00	64,728,000
T & K T O K A	15,800	912.00	14,409,600
富士フイルムホールディングス	341,800	7,335.00	2,507,103,000
資生堂	371,900	5,784.00	2,151,069,600
ライオン	213,700	1,475.00	315,207,500
高砂香料工業	12,000	2,875.00	34,500,000
マンダム	38,500	1,380.00	53,130,000
ミルボン	26,400	5,650.00	149,160,000
ファンケル	77,900	2,649.00	206,357,100
コーセー	36,200	14,590.00	528,158,000
コタ	14,900	1,648.00	24,555,200

シーボン	2,300	1,588.00	3,652,400
ポーラ・オルビスホールディングス	91,300	1,779.00	162,422,700
ノエビアホールディングス	15,900	5,710.00	90,789,000
アジュバンホールディングス	4,300	927.00	3,986,100
新日本製薬	10,200	1,410.00	14,382,000
エステー	13,700	1,536.00	21,043,200
アグロ カネショウ	7,100	1,489.00	10,571,900
コニシ	29,700	1,789.00	53,133,300
長谷川香料	36,900	2,943.00	108,596,700
星光PMC	9,100	529.00	4,813,900
小林製薬	54,500	8,640.00	470,880,000
荒川化学工業	15,100	975.00	14,722,500
メック	14,700	2,470.00	36,309,000
日本高純度化学	4,600	2,462.00	11,325,200
タカラバイオ	48,000	1,811.00	86,928,000
JCU	20,100	3,260.00	65,526,000
新田ゼラチン	11,000	1,034.00	11,374,000
OATアグリオ	7,300	1,675.00	12,227,500
デクセリアルズ	51,400	3,285.00	168,849,000
アース製薬	16,100	5,440.00	87,584,000
北興化学工業	17,900	913.00	16,342,700
大成ラミック	5,600	3,060.00	17,136,000
クミアイ化学工業	70,800	930.00	65,844,000
日本農薬	32,700	718.00	23,478,600
アキレス	11,600	1,378.00	15,984,800
有沢製作所	29,100	1,282.00	37,306,200
日東電工	129,300	8,640.00	1,117,152,000
レック	25,300	818.00	20,695,400
三光合成	24,500	456.00	11,172,000
きもと	26,200	234.00	6,130,800
藤森工業	14,100	3,220.00	45,402,000
前澤化成工業	11,500	1,387.00	15,950,500
未来工業	6,400	1,477.00	9,452,800
ウェーブロックホールディングス	5,300	600.00	3,180,000
JSP	12,500	1,482.00	18,525,000
エフピコ	33,700	3,795.00	127,891,500
天馬	15,100	2,143.00	32,359,300
信越ポリマー	32,900	1,273.00	41,881,700
東リ	39,900	202.00	8,059,800
ニフコ	64,300	3,620.00	232,766,000
バルカー	14,900	2,722.00	40,557,800
ユニ・チャーム	371,100	5,088.00	1,888,156,800

ショーエイコーポレーション	5,200	565.00	2,938,000	
協和キリン	215,200	3,270.00	703,704,000	
武田薬品工業	1,576,200	3,958.00	6,238,599,600	
アステラス製薬	1,706,800	2,104.50	3,591,960,600	
住友ファーマ	132,100	1,073.00	141,743,300	
塩野義製薬	227,600	6,978.00	1,588,192,800	
わかもと製薬	16,700	232.00	3,874,400	
日本新薬	42,000	8,520.00	357,840,000	
中外製薬	557,500	3,512.00	1,957,940,000	
科研製薬	30,500	3,945.00	120,322,500	
エーザイ	216,600	8,943.00	1,937,053,800	
ロート製薬	86,300	4,325.00	373,247,500	
小野薬品工業	343,600	3,505.00	1,204,318,000	
久光製薬	39,600	3,830.00	151,668,000	
持田製薬	21,300	3,275.00	69,757,500	
参天製薬	345,900	1,122.00	388,099,800	
扶桑薬品工業	5,600	2,109.00	11,810,400	
日本ケミファ	1,800	1,662.00	2,991,600	
ツムラ	56,100	2,987.00	167,570,700	
キッセイ薬品工業	27,500	2,513.00	69,107,500	
生化学工業	34,000	949.00	32,266,000	
栄研化学	28,900	1,944.00	56,181,600	
鳥居薬品	9,600	2,950.00	28,320,000	
JCRファーマ	60,300	1,955.00	117,886,500	
東和薬品	27,400	2,094.00	57,375,600	
富士製薬工業	11,500	1,032.00	11,868,000	
ゼリア新薬工業	24,700	2,214.00	54,685,800	
第一三共	1,551,600	4,615.00	7,160,634,000	
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	1,842.00	71,101,200	
大幸薬品	32,200	538.00	17,323,600	
ダイト	13,400	2,578.00	34,545,200	
大塚ホールディングス	407,500	4,652.00	1,895,690,000	
大正製薬ホールディングス	39,600	5,500.00	217,800,000	
ペプチドリーム	86,300	1,808.00	156,030,400	
あすか製薬ホールディングス	18,300	1,203.00	22,014,900	
サワイグループホールディングス	40,700	4,210.00	171,347,000	
日本コークス工業	160,600	83.00	13,329,800	
ニチレキ	21,000	1,260.00	26,460,000	
ユシロ化学工業	9,200	793.00	7,295,600	
ビーピー・カストロール	6,900	944.00	6,513,600	
富士石油	36,300	272.00	9,873,600	
MORESCO	5,800	1,100.00	6,380,000	



出光興産	197,800	3,150.00	623,070,000
E N E O Sホールディングス	3,217,800	463.50	1,491,450,300
コスモエネルギーホールディングス	67,600	3,860.00	260,936,000
横浜ゴム	101,300	2,137.00	216,478,100
TOYO TIRE	102,300	1,533.00	156,825,900
ブリヂストン	568,700	5,283.00	3,004,442,100
住友ゴム工業	174,700	1,153.00	201,429,100
藤倉コンポジット	12,600	875.00	11,025,000
オカモト	9,900	3,780.00	37,422,000
フコク	9,400	1,047.00	9,841,800
ニッタ	18,100	2,936.00	53,141,600
住友理工	34,500	610.00	21,045,000
三ツ星ベルト	26,000	3,485.00	90,610,000
バンドー化学	28,200	1,012.00	28,538,400
日東紡績	21,300	2,133.00	45,432,900
A G C	181,300	4,550.00	824,915,000
日本板硝子	90,800	550.00	49,940,000
石塚硝子	2,800	1,495.00	4,186,000
日本山村硝子	6,800	587.00	3,991,600
日本電気硝子	72,700	2,591.00	188,365,700
オハラ	8,500	1,295.00	11,007,500
住友大阪セメント	25,100	3,200.00	80,320,000
太平洋セメント	113,500	2,102.00	238,577,000
日本ヒューム	15,800	648.00	10,238,400
日本コンクリート工業	35,000	233.00	8,155,000
三谷セキサン	7,500	4,110.00	30,825,000
アジアパイルホールディングス	28,000	512.00	14,336,000
東海カーボン	149,500	1,058.00	158,171,000
日本カーボン	10,200	4,345.00	44,319,000
東洋炭素	11,200	3,810.00	42,672,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,900	4,025.00	35,822,500
T O T O	117,600	4,705.00	553,308,000
日本碍子	210,800	1,754.00	369,743,200
日本特殊陶業	135,600	2,654.00	359,882,400
M A R U W A	6,600	18,360.00	121,176,000
品川リフラクトリーズ	5,000	3,990.00	19,950,000
黒崎播磨	3,700	4,995.00	18,481,500
ヨータイ	12,000	1,368.00	16,416,000
東京窯業	16,700	273.00	4,559,100
ニッカトー	8,200	497.00	4,075,400
フジミインコーポレーテッド	14,200	6,920.00	98,264,000
クニミネ工業	5,300	825.00	4,372,500

エーアンドエーマテリアル	3,400	858.00	2,917,200
ニチアス	45,100	2,419.00	109,096,900
ニチハ	22,300	2,908.00	64,848,400
日本製鉄	820,500	2,228.00	1,828,074,000
神戸製鋼所	368,600	611.00	225,214,600
中山製鋼所	37,800	774.00	29,257,200
合同製鐵	9,100	1,928.00	17,544,800
J F E ホールディングス	489,700	1,494.00	731,611,800
東京製鐵	51,500	1,381.00	71,121,500
共英製鋼	20,900	1,327.00	27,734,300
大和工業	30,200	4,795.00	144,809,000
東京鐵鋼	8,700	1,402.00	12,197,400
大阪製鐵	8,500	1,160.00	9,860,000
淀川製鋼所	20,800	2,560.00	53,248,000
丸一鋼管	55,800	2,884.00	160,927,200
モリ工業	4,200	2,892.00	12,146,400
大同特殊鋼	23,100	4,355.00	100,600,500
日本高周波鋼業	6,300	319.00	2,009,700
日本冶金工業	13,400	4,070.00	54,538,000
山陽特殊製鋼	18,100	2,277.00	41,213,700
愛知製鋼	10,600	2,332.00	24,719,200
日本金属	4,000	950.00	3,800,000
大平洋金属	13,000	1,920.00	24,960,000
新日本電工	117,200	450.00	52,740,000
栗本鐵工所	8,700	1,770.00	15,399,000
虹技	2,300	887.00	2,040,100
三菱製鋼	11,500	997.00	11,465,500
日亜鋼業	18,800	237.00	4,455,600
日本精線	2,500	4,310.00	10,775,000
エンビプロ・ホールディングス	12,700	752.00	9,550,400
シンニッタン	20,000	219.00	4,380,000
新家工業	4,000	2,543.00	10,172,000
大紀アルミニウム工業所	26,200	1,346.00	35,265,200
日本軽金属ホールディングス	49,500	1,548.00	76,626,000
三井金属鋳業	53,300	3,140.00	167,362,000
東邦亜鉛	10,900	2,125.00	23,162,500
三菱マテリアル	122,300	2,142.00	261,966,600
住友金属鋳山	212,500	4,542.00	965,175,000
D O W A ホールディングス	41,200	4,455.00	183,546,000
古河機械金属	27,000	1,265.00	34,155,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,900	3,820.00	102,758,000
東邦チタニウム	33,200	2,685.00	89,142,000

U A C J	25,700	2,213.00	56,874,100
C Kサンエツ	4,400	4,050.00	17,820,000
古河電気工業	61,100	2,535.00	154,888,500
住友電気工業	632,800	1,611.50	1,019,757,200
フジクラ	196,600	1,123.00	220,781,800
昭和電線ホールディングス	20,600	1,645.00	33,887,000
東京特殊電線	2,500	5,640.00	14,100,000
タツタ電線	37,600	434.00	16,318,400
カナレ電気	2,900	1,483.00	4,300,700
平河ヒューテック	10,700	1,113.00	11,909,100
リョービ	19,600	1,232.00	24,147,200
アーレスティ	20,600	388.00	7,992,800
アサヒホールディングス	74,200	2,009.00	149,067,800
稲葉製作所	10,700	1,380.00	14,766,000
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,370.00	17,187,000
トーカロ	50,400	1,228.00	61,891,200
アルファC o	6,700	943.00	6,318,100
S U M C O	348,800	2,061.00	718,876,800
川田テクノロジーズ	4,300	3,410.00	14,663,000
R S Technologies	6,000	8,890.00	53,340,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	1,680.00	4,200,000
信和	10,100	780.00	7,878,000
東洋製罐グループホールディングス	121,200	1,580.00	191,496,000
ホッカンホールディングス	9,800	1,321.00	12,945,800
コロナ	10,200	848.00	8,649,600
横河ブリッジホールディングス	24,200	1,893.00	45,810,600
駒井ハルテック	3,000	1,529.00	4,587,000
高田機工	1,500	2,384.00	3,576,000
三和ホールディングス	168,700	1,267.00	213,742,900
文化シャッター	52,700	1,130.00	59,551,000
三協立山	25,100	570.00	14,307,000
アルインコ	14,000	996.00	13,944,000
東洋シャッター	4,200	486.00	2,041,200
L I X I L	266,900	2,118.00	565,294,200
日本フィルコン	11,900	479.00	5,700,100
ノーリツ	27,000	1,493.00	40,311,000
長府製作所	18,500	1,990.00	36,815,000
リンナイ	33,200	10,170.00	337,644,000
ダイニチ工業	9,100	666.00	6,060,600
日東精工	26,600	516.00	13,725,600
三洋工業	2,100	1,716.00	3,603,600
岡部	29,500	713.00	21,033,500

ジーテクト	20,400	1,508.00	30,763,200
東プレ	32,300	1,245.00	40,213,500
高周波熱錬	29,900	671.00	20,062,900
東京製綱	10,800	881.00	9,514,800
サンコール	16,300	635.00	10,350,500
モリテック スチール	13,500	244.00	3,294,000
パイオラックス	25,300	1,746.00	44,173,800
エイチワン	18,900	653.00	12,341,700
日本発條	162,100	907.00	147,024,700
中央発條	10,200	693.00	7,068,600
アドバネクス	2,200	1,137.00	2,501,400
立川ブラインド工業	8,300	1,116.00	9,262,800
三益半導体工業	16,500	2,608.00	43,032,000
日本ドライケミカル	4,400	1,501.00	6,604,400
日本製鋼所	49,500	3,015.00	149,242,500
三浦工業	74,900	3,335.00	249,791,500
タクマ	55,300	1,289.00	71,281,700
ツガミ	40,000	1,118.00	44,720,000
オークマ	18,000	5,150.00	92,700,000
芝浦機械	20,000	2,620.00	52,400,000
アマダ	286,300	1,109.00	317,506,700
アイダエンジニアリング	37,100	813.00	30,162,300
TAKISAWA	4,800	1,087.00	5,217,600
FUJI	78,000	2,095.00	163,410,000
牧野フライス製作所	19,900	4,495.00	89,450,500
オーエスジー	85,700	1,984.00	170,028,800
ダイジェット工業	2,000	839.00	1,678,000
旭ダイヤモンド工業	52,000	721.00	37,492,000
D M G 森精機	108,800	1,843.00	200,518,400
ソディック	49,600	772.00	38,291,200
ディスコ	28,800	40,500.00	1,166,400,000
日東工器	8,800	1,547.00	13,613,600
日進工具	15,100	1,097.00	16,564,700
パンチ工業	15,300	424.00	6,487,200
富士ダイス	8,500	571.00	4,853,500
豊和工業	10,000	871.00	8,710,000
ニデックオーケーケー	7,200	1,001.00	7,207,200
東洋機械金属	12,600	546.00	6,879,600
津田駒工業	3,300	574.00	1,894,200
エンシュウ	4,000	720.00	2,880,000
島精機製作所	28,600	2,024.00	57,886,400
オプトラン	26,500	2,624.00	69,536,000

NCホールディングス	3,700	2,084.00	7,710,800
イワキポンプ	12,000	1,284.00	15,408,000
フリュー	18,900	1,149.00	21,716,100
ヤマシンフィルタ	43,000	493.00	21,199,000
日阪製作所	17,500	825.00	14,437,500
やまびこ	29,400	1,140.00	33,516,000
野村マイクロ・サイエンス	6,100	4,770.00	29,097,000
平田機工	8,600	5,600.00	48,160,000
ペガサスミシン製造	19,900	939.00	18,686,100
マルマエ	8,700	1,888.00	16,425,600
タツモ	9,900	1,810.00	17,919,000
ナプテスコ	112,600	3,330.00	374,958,000
三井海洋開発	22,500	1,576.00	35,460,000
レオン自動機	18,900	1,118.00	21,130,200
S M C	58,200	64,240.00	3,738,768,000
ホソカワミクロン	13,800	2,870.00	39,606,000
ユニオンツール	7,900	3,645.00	28,795,500
オイレス工業	25,100	1,489.00	37,373,900
日精エー・エス・ピー機械	8,200	4,005.00	32,841,000
サトーホールディングス	25,600	1,939.00	49,638,400
技研製作所	18,800	3,345.00	62,886,000
日本エアーテック	9,100	1,159.00	10,546,900
カワタ	5,300	830.00	4,399,000
日精樹脂工業	13,500	938.00	12,663,000
オカダアイヨン	5,600	1,520.00	8,512,000
ワイエイシイホールディングス	7,700	1,344.00	10,348,800
小松製作所	840,500	3,098.00	2,603,869,000
住友重機械工業	106,200	2,860.00	303,732,000
日立建機	71,500	3,095.00	221,292,500
日工	26,900	618.00	16,624,200
巴工業	7,700	2,451.00	18,872,700
井関農機	16,900	1,245.00	21,040,500
T O W A	18,300	2,027.00	37,094,100
丸山製作所	3,100	1,610.00	4,991,000
北川鉄工所	7,200	1,160.00	8,352,000
ローツェ	9,400	8,530.00	80,182,000
タカキタ	5,200	469.00	2,438,800
クボタ	949,200	2,055.00	1,950,606,000
荏原実業	9,000	2,190.00	19,710,000
三菱化工機	5,900	2,123.00	12,525,700
月島機械	24,400	986.00	24,058,400
帝国電機製作所	13,600	2,368.00	32,204,800

新東工業	36,500	676.00	24,674,000
澁谷工業	16,900	2,483.00	41,962,700
アイチ コーポレーション	25,600	810.00	20,736,000
小森コーポレーション	41,800	828.00	34,610,400
鶴見製作所	13,800	2,053.00	28,331,400
住友精密工業	2,600	3,640.00	9,464,000
日本ギア工業	6,300	332.00	2,091,600
酒井重工業	2,900	3,485.00	10,106,500
荏原製作所	73,400	5,030.00	369,202,000
石井鐵工所	2,100	2,480.00	5,208,000
西島製作所	15,600	1,397.00	21,793,200
北越工業	18,100	1,160.00	20,996,000
ダイキン工業	214,100	22,580.00	4,834,378,000
オルガノ	24,700	2,874.00	70,987,800
トーヨーカネツ	6,900	2,440.00	16,836,000
栗田工業	100,300	6,060.00	607,818,000
椿本チエイン	25,500	3,170.00	80,835,000
大同工業	7,400	764.00	5,653,600
木村化工機	13,900	683.00	9,493,700
アネスト岩田	30,600	917.00	28,060,200
ダイフク	92,500	7,070.00	653,975,000
サムコ	5,900	3,710.00	21,889,000
加藤製作所	8,700	777.00	6,759,900
油研工業	2,800	1,772.00	4,961,600
タダノ	94,800	924.00	87,595,200
フジテック	65,700	3,055.00	200,713,500
C K D	49,700	2,062.00	102,481,400
平和	59,700	2,389.00	142,623,300
理想科学工業	16,000	2,274.00	36,384,000
S A N K Y O	35,300	4,775.00	168,557,500
日本金銭機械	19,800	864.00	17,107,200
マースグループホールディングス	10,600	1,966.00	20,839,600
フクシマガリレイ	13,200	4,240.00	55,968,000
オーイズミ	7,000	415.00	2,905,000
ダイコク電機	9,900	1,449.00	14,345,100
竹内製作所	32,600	3,050.00	99,430,000
アマノ	50,900	2,498.00	127,148,200
J U K I	27,900	663.00	18,497,700
ジャノメ	18,300	633.00	11,583,900
マックス	22,100	2,018.00	44,597,800
グローリー	46,500	2,202.00	102,393,000
新晃工業	18,100	1,548.00	28,018,800

大和冷機工業	27,600	1,245.00	34,362,000
セガサミーホールディングス	144,200	1,802.00	259,848,400
日本ピストンリング	6,100	1,214.00	7,405,400
リケン	7,100	2,276.00	16,159,600
T P R	21,100	1,231.00	25,974,100
ツバキ・ナカシマ	44,300	1,032.00	45,717,600
ホシザキ	115,500	4,605.00	531,877,500
大豊工業	15,600	711.00	11,091,600
日本精工	329,600	769.00	253,462,400
N T N	353,600	283.00	100,068,800
ジェイテクト	159,700	1,012.00	161,616,400
不二越	13,300	4,045.00	53,798,500
日本トムソン	44,100	597.00	26,327,700
T H K	103,500	2,689.00	278,311,500
ユーシン精機	14,300	684.00	9,781,200
前澤給装工業	12,700	919.00	11,671,300
イーグル工業	19,900	1,108.00	22,049,200
前澤工業	11,700	617.00	7,218,900
日本ピラー工業	16,700	2,748.00	45,891,600
キッツ	66,200	851.00	56,336,200
マキタ	223,200	3,050.00	680,760,000
三井E & Sホールディングス	81,100	422.00	34,224,200
日立造船	147,100	873.00	128,418,300
三菱重工業	313,700	5,196.00	1,629,985,200
I H I	113,000	3,400.00	384,200,000
スター精密	33,900	1,690.00	57,291,000
日清紡ホールディングス	146,000	1,009.00	147,314,000
イビデン	103,000	5,570.00	573,710,000
コニカミノルタ	401,400	557.00	223,579,800
ブラザー工業	239,800	2,197.00	526,840,600
ミネベアミツミ	312,200	2,214.00	691,210,800
日立製作所	900,500	7,297.00	6,570,948,500
東芝	345,200	4,882.00	1,685,266,400
三菱電機	1,853,700	1,392.00	2,580,350,400
富士電機	109,100	5,870.00	640,417,000
東洋電機製造	6,400	860.00	5,504,000
安川電機	212,500	4,405.00	936,062,500
シンフォニアテクノロジー	19,800	1,447.00	28,650,600
明電舎	27,200	2,033.00	55,297,600
オリジン	4,000	1,311.00	5,244,000
山洋電気	7,800	6,090.00	47,502,000
デンヨー	13,700	1,464.00	20,056,800

PHCホールディングス	25,200	1,645.00	41,454,000
東芝テック	26,800	3,695.00	99,026,000
芝浦メカトロニクス	3,500	11,520.00	40,320,000
マブチモーター	44,700	4,155.00	185,728,500
日本電産	435,600	8,680.00	3,781,008,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,100	519.00	7,317,900
トレックス・セミコンダクター	8,600	2,962.00	25,473,200
東光高岳	11,100	1,867.00	20,723,700
ダブル・スコープ	58,600	1,800.00	105,480,000
ダイヘン	16,200	4,130.00	66,906,000
ヤーマン	35,300	1,308.00	46,172,400
JVCケンウッド	164,700	382.00	62,915,400
ミマキエンジニアリング	17,700	674.00	11,929,800
I-PEX	10,300	1,310.00	13,493,000
日新電機	43,000	1,397.00	60,071,000
大崎電気工業	42,500	526.00	22,355,000
オムロン	164,400	7,060.00	1,160,664,000
日東工業	24,200	2,255.00	54,571,000
I D E C	26,500	3,155.00	83,607,500
正興電機製作所	7,200	1,017.00	7,322,400
不二電機工業	4,000	1,120.00	4,480,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,100	2,156.00	127,419,600
サクサホールディングス	3,700	1,376.00	5,091,200
メルコホールディングス	4,900	3,155.00	15,459,500
テクノメディカ	4,600	1,685.00	7,751,000
日本電気	253,700	4,865.00	1,234,250,500
富士通	178,700	18,530.00	3,311,311,000
沖電気工業	81,100	742.00	60,176,200
岩崎通信機	7,800	782.00	6,099,600
電気興業	8,400	2,121.00	17,816,400
サンケン電気	16,700	7,110.00	118,737,000
ナカヨ	2,900	1,081.00	3,134,900
アイホン	10,900	1,853.00	20,197,700
ルネサスエレクトロニクス	1,170,100	1,384.50	1,620,003,450
セイコーエプソン	238,900	2,150.00	513,635,000
ワコム	142,800	652.00	93,105,600
アルバック	42,600	6,000.00	255,600,000
アクセル	7,000	1,443.00	10,101,000
E I Z O	13,100	3,830.00	50,173,000
日本信号	40,800	1,036.00	42,268,800
京三製作所	37,600	414.00	15,566,400
能美防災	24,500	1,612.00	39,494,000



ホーチキ	13,700	1,359.00	18,618,300
星和電機	8,200	449.00	3,681,800
エレコム	43,200	1,494.00	64,540,800
パナソニック ホールディングス	2,118,600	1,261.50	2,672,613,900
シャープ	216,000	978.00	211,248,000
アンリツ	126,300	1,511.00	190,839,300
富士通ゼネラル	50,800	3,215.00	163,322,000
ソニーグループ	1,256,200	11,255.00	14,138,531,000
T D K	284,100	4,945.00	1,404,874,500
帝国通信工業	8,400	1,428.00	11,995,200
タムラ製作所	77,000	806.00	62,062,000
アルプスアルパイン	160,500	1,331.00	213,625,500
池上通信機	5,700	531.00	3,026,700
日本電波工業	21,800	1,660.00	36,188,000
鈴木	11,000	906.00	9,966,000
メイコー	19,700	3,155.00	62,153,500
日本トリム	4,200	2,398.00	10,071,600
ローランド ディー・ジー・	10,200	3,160.00	32,232,000
フォスター電機	16,600	971.00	16,118,600
S M K	4,300	2,715.00	11,674,500
ヨコオ	14,400	2,478.00	35,683,200
ホシデン	43,300	1,796.00	77,766,800
ヒロセ電機	29,700	18,440.00	547,668,000
日本航空電子工業	36,800	2,424.00	89,203,200
T O A	20,600	767.00	15,800,200
マクセル	39,300	1,395.00	54,823,500
古野電気	23,800	1,017.00	24,204,600
スミダコーポレーション	16,800	1,429.00	24,007,200
アイコム	6,900	2,641.00	18,222,900
リオン	7,600	1,982.00	15,063,200
横河電機	196,200	2,498.00	490,107,600
新電元工業	6,900	3,400.00	23,460,000
アズビル	124,100	4,075.00	505,707,500
東亜ディーケーケー	8,900	853.00	7,591,700
日本光電工業	82,200	3,230.00	265,506,000
チノー	7,400	1,863.00	13,786,200
共和電業	16,800	346.00	5,812,800
日本電子材料	11,700	1,538.00	17,994,600
堀場製作所	39,500	6,450.00	254,775,000
アドバンテスト	139,900	9,120.00	1,275,888,000
小野測器	7,800	385.00	3,003,000
エスペック	14,500	2,067.00	29,971,500

キーエンス	177,700	58,760.00	10,441,652,000	
日置電機	9,400	6,890.00	64,766,000	
シスメックス	153,200	8,454.00	1,295,152,800	
日本マイクロニクス	29,500	1,479.00	43,630,500	
メガチップス	14,800	2,541.00	37,606,800	
OBARA GROUP	8,500	3,595.00	30,557,500	
澤藤電機	2,500	1,300.00	3,250,000	
原田工業	8,400	812.00	6,820,800	
コーセル	24,300	861.00	20,922,300	
イリソ電子工業	16,400	5,080.00	83,312,000	
オブテックスグループ	32,800	2,077.00	68,125,600	
千代田インテグレ	7,400	2,400.00	17,760,000	
レーザーテック	87,700	25,135.00	2,204,339,500	
スタンレー電気	126,500	2,880.00	364,320,000	
岩崎電気	5,900	2,528.00	14,915,200	
ウシオ電機	93,000	1,776.00	165,168,000	
岡谷電機産業	15,400	267.00	4,111,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	17,300	467.00	8,079,100	
エノモト	4,800	1,832.00	8,793,600	
日本セラミック	18,300	2,632.00	48,165,600	
遠藤照明	8,600	744.00	6,398,400	
古河電池	13,500	1,087.00	14,674,500	
双信電機	8,300	421.00	3,494,300	
山一電機	15,700	1,910.00	29,987,000	
図研	15,600	3,195.00	49,842,000	
日本電子	44,600	5,020.00	223,892,000	
カシオ計算機	132,300	1,360.00	179,928,000	
ファナック	174,300	20,515.00	3,575,764,500	
日本シイエムケイ	38,500	595.00	22,907,500	
エンプラス	5,300	4,440.00	23,532,000	
大真空	22,100	857.00	18,939,700	
ローム	82,100	10,790.00	885,859,000	
浜松ホトニクス	142,600	7,190.00	1,025,294,000	
三井ハイテック	18,400	8,230.00	151,432,000	
新光電気工業	62,900	4,005.00	251,914,500	
京セラ	275,900	7,019.00	1,936,542,100	
太陽誘電	86,600	4,395.00	380,607,000	
村田製作所	538,600	7,640.00	4,114,904,000	
双葉電子工業	34,600	585.00	20,241,000	
北陸電気工業	7,000	1,274.00	8,918,000	
ニチコン	36,600	1,429.00	52,301,400	
日本ケミコン	17,800	1,824.00	32,467,200	

K O A	27,100	2,251.00	61,002,100
市光工業	26,700	440.00	11,748,000
小糸製作所	213,800	2,230.00	476,774,000
ミツバ	33,300	522.00	17,382,600
S C R E E Nホールディングス	30,400	8,970.00	272,688,000
キャノン電子	19,900	1,588.00	31,601,200
キャノン	974,300	3,180.00	3,098,274,000
リコー	465,700	1,057.00	492,244,900
象印マホービン	53,300	1,591.00	84,800,300
M U T O Hホールディングス	2,700	1,766.00	4,768,200
東京エレクトロン	125,300	44,750.00	5,607,175,000
イノテック	12,200	1,306.00	15,933,200
トヨタ紡織	74,800	1,975.00	147,730,000
芦森工業	3,300	1,185.00	3,910,500
ユニプレス	31,900	883.00	28,167,700
豊田自動織機	129,800	7,690.00	998,162,000
モリタホールディングス	31,200	1,232.00	38,438,400
三櫻工業	27,100	656.00	17,777,600
デンソー	366,300	7,604.00	2,785,345,200
東海理化電機製作所	50,100	1,599.00	80,109,900
川崎重工業	133,800	2,860.00	382,668,000
名村造船所	45,500	498.00	22,659,000
日本車輛製造	6,800	1,965.00	13,362,000
三菱ロジスネクスト	28,300	884.00	25,017,200
近畿車輛	2,500	1,072.00	2,680,000
日産自動車	2,522,600	497.70	1,255,498,020
いすゞ自動車	516,300	1,796.00	927,274,800
トヨタ自動車	9,751,100	2,003.00	19,531,453,300
日野自動車	228,900	632.00	144,664,800
三菱自動車工業	692,800	591.00	409,444,800
エフテック	12,300	520.00	6,396,000
レシップホールディングス	7,000	479.00	3,353,000
G M B	3,500	774.00	2,709,000
ファルテック	2,800	610.00	1,708,000
武蔵精密工業	43,400	1,792.00	77,772,800
日産車体	31,300	825.00	25,822,500
新明和工業	55,800	1,019.00	56,860,200
極東開発工業	31,200	1,359.00	42,400,800
トピー工業	14,400	1,696.00	24,422,400
ティラド	4,500	2,531.00	11,389,500
曙ブレーキ工業	108,400	163.00	17,669,200
タチエス	28,100	1,132.00	31,809,200

N O K	69,000	1,291.00	89,079,000
フタバ産業	47,600	361.00	17,183,600
K Y B	17,100	3,530.00	60,363,000
大同メタル工業	34,700	486.00	16,864,200
プレス工業	79,300	427.00	33,861,100
ミクニ	20,300	355.00	7,206,500
太平洋工業	40,700	1,063.00	43,264,100
河西工業	23,600	173.00	4,082,800
アイシン	137,000	3,820.00	523,340,000
マツダ	587,400	1,105.00	649,077,000
今仙電機製作所	11,200	541.00	6,059,200
本田技研工業	1,443,500	3,348.00	4,832,838,000
スズキ	326,200	5,048.00	1,646,657,600
S U B A R U	561,900	2,310.00	1,297,989,000
安永	7,700	724.00	5,574,800
ヤマハ発動機	279,100	3,395.00	947,544,500
T B K	17,600	268.00	4,716,800
エクセディ	29,000	1,672.00	48,488,000
豊田合成	51,800	2,335.00	120,953,000
愛三工業	29,300	709.00	20,773,700
盟和産業	2,500	928.00	2,320,000
日本プラスト	13,900	436.00	6,060,400
ヨロズ	16,600	809.00	13,429,400
エフ・シー・シー	31,500	1,429.00	45,013,500
シマノ	72,600	23,040.00	1,672,704,000
テイ・エス テック	81,300	1,689.00	137,315,700
ジャムコ	9,600	1,596.00	15,321,600
テルモ	554,800	3,949.00	2,190,905,200
クリエートメディック	5,800	908.00	5,266,400
日機装	44,400	1,008.00	44,755,200
日本エム・ディ・エム	10,600	1,032.00	10,939,200
島津製作所	216,300	4,190.00	906,297,000
J M S	16,500	501.00	8,266,500
長野計器	12,900	1,166.00	15,041,400
ブイ・テクノロジー	8,700	2,859.00	24,873,300
東京計器	13,600	1,164.00	15,830,400
愛知時計電機	6,900	1,383.00	9,542,700
インターアクション	10,700	1,538.00	16,456,600
オーバル	15,700	538.00	8,446,600
東京精密	39,000	4,420.00	172,380,000
マニー	78,100	2,228.00	174,006,800
ニコン	276,100	1,321.00	364,728,100

トプコン	93,500	1,614.00	150,909,000
オリンパス	1,110,100	2,733.00	3,033,903,300
理研計器	11,000	5,070.00	55,770,000
タムロン	13,300	3,190.00	42,427,000
H O Y A	383,700	14,300.00	5,486,910,000
シード	9,000	491.00	4,419,000
ノーリツ鋼機	16,800	2,570.00	43,176,000
A & D ホロンホールディングス	25,900	1,024.00	26,521,600
朝日インテック	234,500	2,503.00	586,953,500
シチズン時計	195,300	592.00	115,617,600
リズム	5,500	1,742.00	9,581,000
大研医器	13,400	453.00	6,070,200
メニコン	60,900	2,830.00	172,347,000
シンシア	1,700	525.00	892,500
松風	8,000	2,366.00	18,928,000
セイコーグループ	27,500	3,025.00	83,187,500
ニプロ	148,100	1,027.00	152,098,700
K Y O R I T S U	26,400	129.00	3,405,600
中本パックス	5,400	1,530.00	8,262,000
スノーピーク	30,400	2,167.00	65,876,800
パラマウントベッドホールディングス	41,000	2,586.00	106,026,000
トランザクション	13,700	1,181.00	16,179,700
粧美堂	4,800	355.00	1,704,000
ニホンフラッシュ	16,600	975.00	16,185,000
前田工織	19,300	3,400.00	65,620,000
永大産業	18,900	224.00	4,233,600
アートネイチャー	18,300	752.00	13,761,600
バンダイナムコホールディングス	162,200	8,855.00	1,436,281,000
アイフィスジャパン	4,900	618.00	3,028,200
S H O E I	18,700	5,800.00	108,460,000
フランスベッドホールディングス	22,000	918.00	20,196,000
パイロットコーポレーション	27,800	4,945.00	137,471,000
萩原工業	11,900	1,045.00	12,435,500
フジシールインターナショナル	36,000	1,816.00	65,376,000
タカラトミー	82,000	1,207.00	98,974,000
広済堂ホールディングス	11,900	1,913.00	22,764,700
エステールホールディングス	4,100	622.00	2,550,200
タカノ	6,600	657.00	4,336,200
プロネクサス	14,700	959.00	14,097,300
ホクシン	13,600	149.00	2,026,400
ウッドワン	5,900	920.00	5,428,000
大建工業	10,800	2,113.00	22,820,400

凸版印刷	232,200	2,109.00	489,709,800
大日本印刷	210,700	2,802.00	590,381,400
共同印刷	5,000	2,896.00	14,480,000
N I S S H A	33,800	1,752.00	59,217,600
光村印刷	1,500	1,161.00	1,741,500
T A K A R A & C O M P A N Y	12,200	2,105.00	25,681,000
アシックス	163,900	3,085.00	505,631,500
ツツミ	4,000	1,968.00	7,872,000
ローランド	13,000	3,985.00	51,805,000
小松ウオール工業	6,500	1,860.00	12,090,000
ヤマハ	111,900	5,340.00	597,546,000
河合楽器製作所	4,800	2,568.00	12,326,400
クリナップ	19,900	644.00	12,815,600
ピジョン	113,100	2,037.00	230,384,700
兼松サステック	1,200	1,561.00	1,873,200
キングジム	15,700	907.00	14,239,900
リンテック	35,600	2,270.00	80,812,000
イトーキ	36,400	483.00	17,581,200
任天堂	1,121,200	5,887.00	6,600,504,400
三菱鉛筆	25,200	1,416.00	35,683,200
タカラスタANDARD	34,400	1,288.00	44,307,200
コクヨ	85,500	1,813.00	155,011,500
ナカバヤシ	19,100	496.00	9,473,600
グローブライド	14,300	2,545.00	36,393,500
オカムラ	53,500	1,460.00	78,110,000
美津濃	17,700	2,840.00	50,268,000
東京電力ホールディングス	1,600,800	464.00	742,771,200
中部電力	654,400	1,263.00	826,507,200
関西電力	685,700	1,157.00	793,354,900
中国電力	282,800	719.00	203,333,200
北陸電力	167,600	517.00	86,649,200
東北電力	434,100	629.00	273,048,900
四国電力	151,600	721.00	109,303,600
九州電力	409,400	728.00	298,043,200
北海道電力	171,600	446.00	76,533,600
沖縄電力	41,600	1,022.00	42,515,200
電源開発	133,700	2,073.00	277,160,100
エフオン	12,900	586.00	7,559,400
イーレックス	31,500	2,437.00	76,765,500
レノバ	47,200	2,733.00	128,997,600
東京瓦斯	375,400	2,491.00	935,121,400
大阪瓦斯	359,700	2,084.00	749,614,800

東邦瓦斯	69,900	2,669.00	186,563,100
北海道瓦斯	10,600	1,660.00	17,596,000
広島ガス	37,500	340.00	12,750,000
西部ガスホールディングス	16,700	1,650.00	27,555,000
静岡ガス	40,500	987.00	39,973,500
メタウォーター	22,200	1,849.00	41,047,800
SBSホールディングス	15,800	2,976.00	47,020,800
東武鉄道	195,100	3,215.00	627,246,500
相鉄ホールディングス	58,700	2,147.00	126,028,900
東急	498,000	1,654.00	823,692,000
京浜急行電鉄	201,400	1,407.00	283,369,800
小田急電鉄	269,200	1,750.00	471,100,000
京王電鉄	93,900	4,935.00	463,396,500
京成電鉄	114,500	3,685.00	421,932,500
富士急行	21,900	4,860.00	106,434,000
東日本旅客鉄道	301,200	7,750.00	2,334,300,000
西日本旅客鉄道	226,900	5,652.00	1,282,438,800
東海旅客鉄道	136,800	16,365.00	2,238,732,000
西武ホールディングス	214,800	1,313.00	282,032,400
鴻池運輸	30,300	1,536.00	46,540,800
西日本鉄道	47,400	2,740.00	129,876,000
ハマキョウレックス	13,900	3,460.00	48,094,000
サカイ引越センター	8,400	4,585.00	38,514,000
近鉄グループホールディングス	177,300	4,670.00	827,991,000
阪急阪神ホールディングス	236,400	4,160.00	983,424,000
南海電気鉄道	84,700	2,902.00	245,799,400
京阪ホールディングス	73,300	3,445.00	252,518,500
神戸電鉄	4,800	3,235.00	15,528,000
名古屋鉄道	195,900	2,191.00	429,216,900
山陽電気鉄道	13,300	2,223.00	29,565,900
アルプス物流	14,100	1,137.00	16,031,700
ヤマトホールディングス	227,000	2,288.00	519,376,000
山九	45,100	4,885.00	220,313,500
丸運	8,700	218.00	1,896,600
丸全昭和運輸	11,000	3,200.00	35,200,000
センコーグループホールディングス	93,900	1,004.00	94,275,600
トナミホールディングス	3,900	3,735.00	14,566,500
ニッコンホールディングス	56,800	2,427.00	137,853,600
日本石油輸送	1,800	2,222.00	3,999,600
福山通運	14,800	3,400.00	50,320,000
セイノーホールディングス	110,300	1,184.00	130,595,200
エスライン	5,000	813.00	4,065,000

神奈川中央交通	5,000	3,350.00	16,750,000
日立物流	39,100	8,900.00	347,990,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	42,800	1,481.00	63,386,800
C & F ロジホールディングス	17,100	1,222.00	20,896,200
九州旅客鉄道	125,400	2,889.00	362,280,600
S Gホールディングス	340,200	2,044.00	695,368,800
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,200	7,850.00	519,670,000
日本郵船	475,000	2,743.00	1,302,925,000
商船三井	313,100	3,080.00	964,348,000
川崎汽船	151,700	2,522.00	382,587,400
N S ユナイテッド海運	10,000	3,580.00	35,800,000
飯野海運	67,200	863.00	57,993,600
共栄タンカー	5,100	915.00	4,666,500
乾汽船	23,400	1,745.00	40,833,000
日本航空	435,500	2,637.00	1,148,413,500
A N Aホールディングス	482,400	2,863.00	1,381,111,200
パスコ	3,400	1,288.00	4,379,200
ランコム	5,100	7,780.00	39,678,000
日新	13,500	2,026.00	27,351,000
三菱倉庫	38,100	3,220.00	122,682,000
三井倉庫ホールディングス	16,600	3,555.00	59,013,000
住友倉庫	48,700	2,006.00	97,692,200
澁澤倉庫	7,100	2,055.00	14,590,500
東陽倉庫	23,500	249.00	5,851,500
日本トランスシティ	35,700	499.00	17,814,300
ケイヒン	3,100	1,518.00	4,705,800
中央倉庫	8,500	928.00	7,888,000
川西倉庫	3,000	988.00	2,964,000
安田倉庫	12,100	926.00	11,204,600
ファイズホールディングス	3,200	962.00	3,078,400
東洋埠頭	5,100	1,262.00	6,436,200
上組	88,200	2,762.00	243,608,400
サンリツ	3,900	728.00	2,839,200
キムラユニティー	8,400	779.00	6,543,600
キューソー流通システム	10,600	1,055.00	11,183,000
東海運	10,400	280.00	2,912,000
エーアイティー	11,100	1,434.00	15,917,400
内外トランスライン	6,400	2,180.00	13,952,000
日本コンセプト	5,500	1,775.00	9,762,500
N E C ネットエスアイ	59,600	1,692.00	100,843,200
クロスキャット	10,300	1,416.00	14,584,800
システナ	300,000	434.00	130,200,000



デジタルアーツ	11,300	6,480.00	73,224,000
日鉄ソリューションズ	30,500	3,490.00	106,445,000
キューブシステム	10,800	1,020.00	11,016,000
コア	8,100	1,452.00	11,761,200
手間いらず	3,100	5,130.00	15,903,000
ラクーンホールディングス	17,900	1,325.00	23,717,500
ソリトンシステムズ	9,400	1,148.00	10,791,200
ソフトクリエイティブホールディングス	7,400	3,485.00	25,789,000
T I S	200,200	3,995.00	799,799,000
J N Sホールディングス	8,600	354.00	3,044,400
グリー	95,800	806.00	77,214,800
G M Oペパボ	2,700	2,117.00	5,715,900
コーエーテクモホールディングス	111,700	2,415.00	269,755,500
三菱総合研究所	8,800	5,060.00	44,528,000
電算	2,200	1,610.00	3,542,000
A G S	7,800	636.00	4,960,800
ファインデックス	14,500	588.00	8,526,000
ブレインパッド	18,100	929.00	16,814,900
K L a b	35,100	502.00	17,620,200
ポルトゥウィンホールディングス	30,700	938.00	28,796,600
ネクソン	460,300	2,781.00	1,280,094,300
アイスタイル	57,400	503.00	28,872,200
エムアップホールディングス	22,000	1,367.00	30,074,000
エイチーム	13,500	804.00	10,854,000
エニグモ	23,100	602.00	13,906,200
テクノスジャパン	15,100	477.00	7,202,700
コロブラ	69,400	690.00	47,886,000
ブロードリーフ	104,500	500.00	52,250,000
クロス・マーケティンググループ	7,400	784.00	5,801,600
デジタルハーツホールディングス	11,200	1,918.00	21,481,600
システム情報	16,000	906.00	14,496,000
メディアドゥ	7,300	1,935.00	14,125,500
じげん	52,600	352.00	18,515,200
ブイキューブ	21,600	804.00	17,366,400
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	519.00	2,387,400
サイバーリンクス	5,900	1,108.00	6,537,200
フィックスターズ	20,300	1,114.00	22,614,200
C A R T A H O L D I N G S	8,700	1,697.00	14,763,900
オブティム	14,900	1,178.00	17,552,200
セレス	7,400	983.00	7,274,200
S H I F T	13,000	27,330.00	355,290,000
ティーガイア	18,800	1,669.00	31,377,200

セック	2,600	2,259.00	5,873,400
テクマトリックス	32,700	1,661.00	54,314,700
プロシップ	7,900	1,521.00	12,015,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	54,600	2,141.00	116,898,600
GMOペイメントゲートウェイ	40,700	12,690.00	516,483,000
ザッパラス	7,200	364.00	2,620,800
システムリサーチ	5,700	2,037.00	11,610,900
インターネットイニシアティブ	99,500	2,375.00	236,312,500
さくらインターネット	20,500	530.00	10,865,000
ヴィンクス	5,400	1,630.00	8,802,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,500	4,310.00	23,705,000
SRAホールディングス	9,200	3,230.00	29,716,000
システムインテグレータ	5,800	458.00	2,656,400
朝日ネット	19,500	581.00	11,329,500
eBASE	25,500	615.00	15,682,500
アバントグループ	22,700	1,421.00	32,256,700
アドソル日進	7,600	1,457.00	11,073,200
ODKソリューションズ	4,300	596.00	2,562,800
フリービット	11,100	1,180.00	13,098,000
コムチュア	23,700	2,532.00	60,008,400
サイバーコム	3,000	1,517.00	4,551,000
アステリア	14,200	824.00	11,700,800
アイル	10,100	1,890.00	19,089,000
マークライنز	9,700	2,725.00	26,432,500
メディカル・データ・ビジョン	26,800	1,025.00	27,470,000
gumi	29,400	783.00	23,020,200
ショーケース	4,700	361.00	1,696,700
モバイルファクトリー	4,000	953.00	3,812,000
テラスカイ	7,700	2,337.00	17,994,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,400	1,874.00	17,615,600
PCIホールディングス	7,600	1,045.00	7,942,000
アイビーシー	3,200	468.00	1,497,600
ネオジャパン	6,200	1,006.00	6,237,200
PR TIMES	4,600	2,430.00	11,178,000
ラクス	84,400	1,912.00	161,372,800
ランドコンピュータ	4,600	878.00	4,038,800
ダブルスタンダード	7,300	2,254.00	16,454,200
オープンドア	12,600	1,800.00	22,680,000
マイネット	6,200	450.00	2,790,000
アカツキ	8,600	2,204.00	18,954,400
ベネフィットジャパン	1,200	1,283.00	1,539,600
Ubicomホールディングス	5,600	2,046.00	11,457,600

カナミックネットワーク	25,900	674.00	17,456,600	
ノムラシステムコーポレーション	18,500	125.00	2,312,500	
チェンジ	43,700	2,000.00	87,400,000	
シンクロ・フード	10,500	569.00	5,974,500	
オークネット	9,400	1,861.00	17,493,400	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	600.00	2,280,000	
セグエグループ	5,200	945.00	4,914,000	
エイトレッド	2,800	1,512.00	4,233,600	
マクロミル	40,600	1,100.00	44,660,000	
ビーグリー	3,100	1,313.00	4,070,300	
オロ	5,500	1,683.00	9,256,500	
ユーザーローカル	6,600	1,579.00	10,421,400	
テモナ	4,200	254.00	1,066,800	
ニーズウェル	5,800	694.00	4,025,200	
マネーフォワード	42,900	5,020.00	215,358,000	
サインポスト	6,400	736.00	4,710,400	
電算システムホールディングス	8,700	2,390.00	20,793,000	
ソルクシーズ	15,000	365.00	5,475,000	
フェイス	5,400	532.00	2,872,800	
プロトコーポレーション	22,500	1,217.00	27,382,500	
ハイマックス	5,700	1,495.00	8,521,500	
野村総合研究所	365,500	3,355.00	1,226,252,500	
サイバネットシステム	15,200	1,016.00	15,443,200	
C Eホールディングス	9,600	520.00	4,992,000	
日本システム技術	7,100	1,669.00	11,849,900	
インテージホールディングス	24,300	1,455.00	35,356,500	
東邦システムサイエンス	5,200	1,001.00	5,205,200	
ソースネクスト	91,400	260.00	23,764,000	
インフォコム	23,100	2,045.00	47,239,500	
シンプレクス・ホールディングス	29,800	2,355.00	70,179,000	
HEROZ	6,200	1,210.00	7,502,000	
ラクスル	25,200	3,045.00	76,734,000	
メルカリ	80,200	2,872.00	230,334,400	
I P S	5,900	3,115.00	18,378,500	
F I G	21,200	419.00	8,882,800	
システムサポート	7,800	1,550.00	12,090,000	
イーソル	11,800	814.00	9,605,200	
アルテリア・ネットワークス	16,800	1,265.00	21,252,000	
東海ソフト	3,200	922.00	2,950,400	
ウイングアーク1 s t	18,400	2,297.00	42,264,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,900	1,669.00	8,178,100	
サーバーワークス	3,700	2,746.00	10,160,200	

東名	1,500	1,459.00	2,188,500
ヴィッツ	2,000	1,000.00	2,000,000
トピラシステムズ	4,700	1,161.00	5,456,700
S a n s a n	66,600	1,695.00	112,887,000
L i n k - U	3,700	936.00	3,463,200
ギフトィ	19,300	2,137.00	41,244,100
ベース	6,100	3,800.00	23,180,000
J M D C	29,200	5,250.00	153,300,000
フォーカスシステムズ	13,200	1,012.00	13,358,400
クレスコ	13,900	1,761.00	24,477,900
フジ・メディア・ホールディングス	171,300	1,050.00	179,865,000
オービック	59,500	21,800.00	1,297,100,000
ジャストシステム	25,700	3,315.00	85,195,500
T D C ソフト	15,200	1,493.00	22,693,600
Zホールディングス	2,535,300	359.50	911,440,350
トレンドマイクロ	102,900	7,160.00	736,764,000
I Dホールディングス	12,300	918.00	11,291,400
日本オラクル	34,100	8,580.00	292,578,000
アルファシステムズ	5,700	4,385.00	24,994,500
フューチャー	44,500	1,647.00	73,291,500
C A C H o l d i n g s	11,100	1,504.00	16,694,400
S Bテクノロジー	7,700	2,002.00	15,415,400
トーセ	4,900	770.00	3,773,000
オービックビジネスコンサルタント	35,100	4,275.00	150,052,500
伊藤忠テクノソリューションズ	95,700	3,285.00	314,374,500
アイティフォー	23,800	781.00	18,587,800
東計電算	2,500	5,860.00	14,650,000
エクスネット	2,700	1,010.00	2,727,000
大塚商会	101,000	4,675.00	472,175,000
サイボウズ	24,600	2,126.00	52,299,600
電通国際情報サービス	21,700	4,700.00	101,990,000
A C C E S S	21,400	801.00	17,141,400
デジタルガレージ	31,700	4,105.00	130,128,500
E Mシステムズ	30,000	961.00	28,830,000
ウェザーニューズ	6,300	7,800.00	49,140,000
C I J	16,600	930.00	15,438,000
ビジネスエンジニアリング	3,900	2,154.00	8,400,600
日本エンタープライズ	20,100	144.00	2,894,400
WOWOW	10,300	1,262.00	12,998,600
スカラ	18,000	748.00	13,464,000
インテリジェント ウェイブ	9,700	736.00	7,139,200
WOW WORLD GROUP	3,000	1,058.00	3,174,000

IMAGICA GROUP	15,100	767.00	11,581,700
ネットワンシステムズ	66,400	3,575.00	237,380,000
システムソフト	64,400	102.00	6,568,800
アルゴグラフィックス	16,400	3,645.00	59,778,000
マーベラス	29,300	684.00	20,041,200
エイベックス	30,400	1,545.00	46,968,000
BIPROGY	65,600	3,185.00	208,936,000
兼松エレクトロニクス	11,500	4,520.00	51,980,000
都築電気	9,600	1,323.00	12,700,800
TBSホールディングス	91,300	1,523.00	139,049,900
日本テレビホールディングス	157,900	1,059.00	167,216,100
朝日放送グループホールディングス	17,100	621.00	10,619,100
テレビ朝日ホールディングス	43,400	1,345.00	58,373,000
スカパーJ SATホールディングス	158,500	496.00	78,616,000
テレビ東京ホールディングス	13,000	1,829.00	23,777,000
日本BS放送	6,600	920.00	6,072,000
ビジョン	23,600	1,408.00	33,228,800
スマートバリュー	4,800	469.00	2,251,200
USEN-NEXT HOLDINGS	16,100	2,306.00	37,126,600
ワイヤレスゲート	8,600	291.00	2,502,600
コネクシオ	12,100	1,169.00	14,144,900
クロップス	3,100	1,087.00	3,369,700
日本電信電話	2,282,200	3,843.00	8,770,494,600
KDDI	1,376,300	4,098.00	5,640,077,400
ソフトバンク	2,861,300	1,477.00	4,226,140,100
光通信	21,000	20,010.00	420,210,000
エムティーアイ	16,700	509.00	8,500,300
GMOインターネットグループ	66,300	2,571.00	170,457,300
ファイバーゲート	9,800	1,007.00	9,868,600
アйдママーケティングコミュニケーション	4,900	283.00	1,386,700
KADOKAWA	94,300	2,538.00	239,333,400
学研ホールディングス	29,900	972.00	29,062,800
ゼンリン	30,700	875.00	26,862,500
昭文社ホールディングス	8,400	291.00	2,444,400
インプレスホールディングス	16,700	212.00	3,540,400
アイネット	11,000	1,314.00	14,454,000
松竹	10,200	11,900.00	121,380,000
東宝	111,500	5,300.00	590,950,000
東映	4,900	17,930.00	87,857,000
エヌ・ティ・ティ・データ	559,000	2,092.00	1,169,428,000
ピー・シー・エー	11,000	1,265.00	13,915,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,700	1,965.00	15,130,500

D T S	39,200	3,435.00	134,652,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,500	6,370.00	570,115,000	
シーイーシー	25,100	1,492.00	37,449,200	
カプコン	177,000	4,400.00	778,800,000	
アイ・エス・ビー	9,300	1,326.00	12,331,800	
ジャステック	11,100	1,267.00	14,063,700	
S C S K	145,500	2,156.00	313,698,000	
N S W	7,000	2,193.00	15,351,000	
アイネス	12,700	1,442.00	18,313,400	
T K C	32,000	3,700.00	118,400,000	
富士ソフト	20,200	8,250.00	166,650,000	
N S D	63,600	2,545.00	161,862,000	
コナミグループ	76,300	6,770.00	516,551,000	
福井コンピュータホールディングス	12,400	2,982.00	36,976,800	
J B C Cホールディングス	13,100	1,864.00	24,418,400	
ミロク情報サービス	16,400	1,435.00	23,534,000	
ソフトバンクグループ	1,029,800	6,077.00	6,258,094,600	
高千穂交易	6,700	2,232.00	14,954,400	
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,495.00	4,634,500	
伊藤忠食品	4,200	5,130.00	21,546,000	
エレマテック	16,900	1,521.00	25,704,900	
あらた	14,400	4,010.00	57,744,000	
トーメンデバイス	2,700	5,670.00	15,309,000	
東京エレクトロン デバイス	6,900	6,880.00	47,472,000	
円谷フィールズホールディングス	16,200	2,084.00	33,760,800	
双日	199,500	2,417.00	482,191,500	
アルフレッサ ホールディングス	188,600	1,667.00	314,396,200	
横浜冷凍	51,200	970.00	49,664,000	
ラサ商事	8,600	1,003.00	8,625,800	
アルコニックス	24,700	1,322.00	32,653,400	
神戸物産	145,400	3,470.00	504,538,000	
ハイパー	3,600	480.00	1,728,000	
あい ホールディングス	30,100	2,190.00	65,919,000	
ディーブイエックス	5,200	989.00	5,142,800	
ダイワボウホールディングス	76,800	2,216.00	170,188,800	
マクニカホールディングス	46,100	3,430.00	158,123,000	
ラクト・ジャパン	7,300	2,061.00	15,045,300	
グリムス	7,800	1,863.00	14,531,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,500	795.00	21,862,500	
八洲電機	15,200	1,024.00	15,564,800	
メディアスホールディングス	12,100	744.00	9,002,400	
レスターホールディングス	18,000	2,195.00	39,510,000	

ジューテックホールディングス	3,900	1,182.00	4,609,800
大光	8,100	697.00	5,645,700
OCHIホールディングス	4,300	1,247.00	5,362,100
TOKAIホールディングス	92,800	889.00	82,499,200
黒谷	5,200	584.00	3,036,800
Cominix	3,500	733.00	2,565,500
三洋貿易	19,300	1,114.00	21,500,200
ビューティガレージ	3,400	2,930.00	9,962,000
ウイン・パートナーズ	13,700	982.00	13,453,400
ミタチ産業	4,800	1,156.00	5,548,800
シップヘルスケアホールディングス	67,500	2,784.00	187,920,000
明治電機工業	7,000	1,032.00	7,224,000
デリカフーズホールディングス	7,400	478.00	3,537,200
スターティアホールディングス	3,700	1,234.00	4,565,800
コメダホールディングス	46,000	2,424.00	111,504,000
ピーバンドットコム	2,700	522.00	1,409,400
アセンテック	6,400	538.00	3,443,200
富士興産	4,200	1,180.00	4,956,000
協栄産業	1,700	1,884.00	3,202,800
フルサト・マルカホールディングス	18,700	3,575.00	66,852,500
ヤマエグループホールディングス	10,600	1,444.00	15,306,400
小野建	17,300	1,459.00	25,240,700
南陽	3,600	1,806.00	6,501,600
佐島電機	11,800	1,392.00	16,425,600
エコートレーディング	3,700	583.00	2,157,100
伯東	10,800	3,685.00	39,798,000
コンドーテック	14,500	991.00	14,369,500
中山福	10,100	329.00	3,322,900
ナガイレーベン	23,800	2,048.00	48,742,400
三菱食品	17,400	3,305.00	57,507,000
松田産業	14,300	2,286.00	32,689,800
第一興商	36,400	4,010.00	145,964,000
メディバルホールディングス	194,900	1,792.00	349,260,800
SPK	8,400	1,403.00	11,785,200
萩原電気ホールディングス	7,200	2,583.00	18,597,600
アズワン	27,500	6,320.00	173,800,000
スズデン	6,600	2,373.00	15,661,800
尾家産業	4,500	865.00	3,892,500
シモジマ	12,900	990.00	12,771,000
ドウシシャ	19,900	1,529.00	30,427,100
小津産業	4,200	1,459.00	6,127,800
高速	9,800	1,760.00	17,248,000

たけびし	7,200	1,545.00	11,124,000
リックス	3,900	2,105.00	8,209,500
丸文	16,800	919.00	15,439,200
ハビネット	16,000	1,833.00	29,328,000
橋本総業ホールディングス	7,500	994.00	7,455,000
日本ライフライン	55,100	954.00	52,565,400
タカショー	16,400	707.00	11,594,800
I D O M	56,800	735.00	41,748,000
進和	12,500	2,015.00	25,187,500
エスケイジャパン	4,600	537.00	2,470,200
ダイトロン	7,400	2,424.00	17,937,600
シークス	26,800	1,329.00	35,617,200
田中商事	5,400	549.00	2,964,600
オーハシテクニカ	9,400	1,436.00	13,498,400
白銅	6,800	2,494.00	16,959,200
ダイコー通産	2,300	1,079.00	2,481,700
伊藤忠商事	1,157,800	4,210.00	4,874,338,000
丸紅	1,483,400	1,494.50	2,216,941,300
高島	2,800	2,868.00	8,030,400
長瀬産業	88,300	2,013.00	177,747,900
蝶理	10,100	1,955.00	19,745,500
豊田通商	164,600	5,120.00	842,752,000
三共生興	27,000	498.00	13,446,000
兼松	73,000	1,520.00	110,960,000
ツカモトコーポレーション	2,700	1,276.00	3,445,200
三井物産	1,374,800	3,843.00	5,283,356,400
日本紙パルプ商事	10,000	5,020.00	50,200,000
カメイ	20,000	1,169.00	23,380,000
東都水産	1,000	4,930.00	4,930,000
O U Gホールディングス	2,800	2,425.00	6,790,000
スターゼン	14,300	2,044.00	29,229,200
山善	50,700	1,040.00	52,728,000
椿本興業	3,000	3,800.00	11,400,000
住友商事	1,163,600	2,197.00	2,556,429,200
内田洋行	8,300	4,625.00	38,387,500
三菱商事	1,174,800	4,445.00	5,221,986,000
第一実業	6,600	4,265.00	28,149,000
キャノンマーケティングジャパン	43,500	3,180.00	138,330,000
西華産業	7,400	1,545.00	11,433,000
佐藤商事	13,100	1,179.00	15,444,900
菱洋エレクトロ	16,000	2,361.00	37,776,000
東京産業	17,200	787.00	13,536,400



ユアサ商事	16,900	3,630.00	61,347,000
神鋼商事	4,700	4,340.00	20,398,000
トルク	10,200	230.00	2,346,000
阪和興業	33,700	3,650.00	123,005,000
正栄食品工業	12,500	4,345.00	54,312,500
カナデン	15,200	1,105.00	16,796,000
菱電商事	15,200	1,712.00	26,022,400
岩谷産業	42,800	5,650.00	241,820,000
ナイス	5,100	1,354.00	6,905,400
ニチモウ	2,100	2,610.00	5,481,000
極東貿易	11,200	1,334.00	14,940,800
アステナホールディングス	32,600	424.00	13,822,400
三愛オブリ	51,900	1,227.00	63,681,300
稲畑産業	38,300	2,389.00	91,498,700
G S I クレオス	10,900	1,465.00	15,968,500
明和産業	25,000	715.00	17,875,000
クワザワホールディングス	6,100	420.00	2,562,000
ワキタ	34,600	1,198.00	41,450,800
東邦ホールディングス	46,800	2,068.00	96,782,400
サンゲツ	47,200	2,022.00	95,438,400
ミツウロコグループホールディングス	24,200	1,040.00	25,168,000
シナネンホールディングス	6,100	3,840.00	23,424,000
伊藤忠エネクス	46,600	1,028.00	47,904,800
サンリオ	53,200	4,345.00	231,154,000
サンワテクノス	9,600	1,498.00	14,380,800
リョーサン	19,900	2,909.00	57,889,100
新光商事	25,300	1,132.00	28,639,600
トーホー	8,100	1,697.00	13,745,700
三信電気	7,600	2,208.00	16,780,800
東陽テクニカ	20,800	1,357.00	28,225,600
モスフードサービス	27,600	3,145.00	86,802,000
加賀電子	15,300	4,280.00	65,484,000
ソーダニッカ	13,800	615.00	8,487,000
立花エレテック	13,700	1,763.00	24,153,100
フォーバル	7,400	974.00	7,207,600
P A L T A C	29,600	4,400.00	130,240,000
三谷産業	33,000	310.00	10,230,000
西本Wismettacホールディングス	4,800	3,695.00	17,736,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,510.00	2,567,000
コア商事ホールディングス	13,200	584.00	7,708,800
K P P グループホールディングス	43,800	1,017.00	44,544,600
ヤマタネ	8,300	1,667.00	13,836,100

丸紅建材リース	1,700	1,747.00	2,969,900
日鉄物産	12,900	5,150.00	66,435,000
泉州電業	9,400	2,665.00	25,051,000
トラスコ中山	39,500	2,058.00	81,291,000
オートバックスセブン	65,400	1,435.00	93,849,000
モリト	13,500	766.00	10,341,000
加藤産業	22,800	3,520.00	80,256,000
北恵	4,200	704.00	2,956,800
イエローハット	33,200	1,714.00	56,904,800
J Kホールディングス	14,800	1,018.00	15,066,400
日伝	11,100	1,712.00	19,003,200
北沢産業	10,200	196.00	1,999,200
杉本商事	8,300	2,062.00	17,114,600
因幡電機産業	48,700	2,717.00	132,317,900
東テク	6,300	3,355.00	21,136,500
ミスミグループ本社	283,400	3,480.00	986,232,000
アルテック	10,500	328.00	3,444,000
タキヒヨー	4,600	892.00	4,103,200
蔵王産業	3,100	1,746.00	5,412,600
スズケン	68,600	3,695.00	253,477,000
ジェコス	12,100	797.00	9,643,700
グローセル	20,600	439.00	9,043,400
ローソン	46,700	5,020.00	234,434,000
サンエー	14,400	4,255.00	61,272,000
カワチ薬品	14,900	2,153.00	32,079,700
エービーシー・マート	27,500	7,050.00	193,875,000
ハードオフコーポレーション	7,800	1,324.00	10,327,200
アスクル	45,500	1,636.00	74,438,000
ゲオホールディングス	19,900	1,822.00	36,257,800
アダストリア	22,800	2,011.00	45,850,800
くら寿司	22,100	3,445.00	76,134,500
キャンドゥ	6,800	2,217.00	15,075,600
アイケイ	6,800	418.00	2,842,400
パルグループホールディングス	18,600	2,282.00	42,445,200
エディオン	74,700	1,252.00	93,524,400
サーラコーポレーション	39,900	746.00	29,765,400
ワッツ	9,600	685.00	6,576,000
ハローズ	8,600	2,919.00	25,103,400
フジオフードグループ本社	15,600	1,411.00	22,011,600
あみやき亭	4,700	2,908.00	13,667,600
大黒天物産	6,800	5,090.00	34,612,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,233.00	20,837,700

ファーマライズホールディングス	4,600	652.00	2,999,200
アルペン	15,700	2,015.00	31,635,500
ハブ	6,700	641.00	4,294,700
クオールホールディングス	26,100	1,163.00	30,354,300
ジーンズホールディングス	11,200	4,245.00	47,544,000
ビックカメラ	125,200	1,192.00	149,238,400
D C Mホールディングス	115,000	1,201.00	138,115,000
M o n o t a R O	266,500	2,404.00	640,666,000
東京一番フーズ	4,900	579.00	2,837,100
きちりホールディングス	5,000	495.00	2,475,000
アークランドサービスホールディングス	15,500	2,216.00	34,348,000
J . フロント リテイリング	233,900	1,123.00	262,669,700
ドトール・日レスホールディングス	33,500	1,675.00	56,112,500
マツキヨココカラ&カンパニー	114,000	5,790.00	660,060,000
ブロンコピリー	10,100	2,534.00	25,593,400
Z O Z O	124,300	3,125.00	388,437,500
トレジャー・ファクトリー	5,700	2,239.00	12,762,300
物語コーポレーション	10,500	7,080.00	74,340,000
三越伊勢丹ホールディングス	316,500	1,233.00	390,244,500
H a m e e	7,900	885.00	6,991,500
マーケットエンタープライズ	2,200	1,031.00	2,268,200
ウエルシアホールディングス	97,600	3,130.00	305,488,000
クリエイティブSDホールディングス	31,200	3,310.00	103,272,000
丸善C H Iホールディングス	23,100	337.00	7,784,700
ミサワ	4,000	601.00	2,404,000
ティーライフ	2,800	1,298.00	3,634,400
チムニー	5,800	1,124.00	6,519,200
シュッピン	14,200	1,354.00	19,226,800
オイシックス・ラ・大地	25,400	1,936.00	49,174,400
ネクステージ	43,000	2,927.00	125,861,000
ジョイフル本田	60,600	1,905.00	115,443,000
鳥貴族ホールディングス	7,100	2,306.00	16,372,600
ホットランド	14,600	1,503.00	21,943,800
すかいらーくホールディングス	257,100	1,622.00	417,016,200
S F Pホールディングス	10,300	1,686.00	17,365,800
綿半ホールディングス	14,800	1,341.00	19,846,800
ヨシックスホールディングス	3,900	2,105.00	8,209,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	61,500	1,115.00	68,572,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	1,683.00	14,642,100
B E E N O S	10,700	3,200.00	34,240,000
あさひ	15,900	1,328.00	21,115,200
日本調剤	13,000	1,230.00	15,990,000

コスモス薬品	21,300	14,710.00	313,323,000	
トーエル	8,700	706.00	6,142,200	
セブン&アイ・ホールディングス	647,600	5,578.00	3,612,312,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	141,300	955.00	134,941,500	
ツルハホールディングス	46,000	9,410.00	432,860,000	
サンマルクホールディングス	15,300	1,694.00	25,918,200	
フェリシモ	4,500	1,002.00	4,509,000	
トリドールホールディングス	46,800	2,753.00	128,840,400	
TOKYO BASE	20,300	314.00	6,374,200	
ウイルプラスホールディングス	3,900	1,100.00	4,290,000	
JMホールディングス	16,100	1,733.00	27,901,300	
サツドラホールディングス	9,000	680.00	6,120,000	
アレンザホールディングス	14,400	976.00	14,054,400	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,866.00	9,703,200	
バロックジャパンリミテッド	12,600	793.00	9,991,800	
クスリのアオキホールディングス	18,900	7,710.00	145,719,000	
力の源ホールディングス	10,300	985.00	10,145,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	108,000	2,590.00	279,720,000	
メディカルシステムネットワーク	17,100	399.00	6,822,900	
はるやまホールディングス	8,600	438.00	3,766,800	
ノジマ	61,600	1,313.00	80,880,800	
カップ・クリエイト	29,500	1,406.00	41,477,000	
ライトオン	14,200	635.00	9,017,000	
良品計画	242,600	1,451.00	352,012,600	
パリミキホールディングス	24,700	262.00	6,471,400	
アドヴァングループ	18,200	895.00	16,289,000	
アルビス	6,300	2,315.00	14,584,500	
コナカ	20,500	335.00	6,867,500	
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,603.00	4,007,500	
G - 7ホールディングス	23,600	1,541.00	36,367,600	
イオン北海道	28,000	1,208.00	33,824,000	
コジマ	36,800	615.00	22,632,000	
ヒマラヤ	6,300	929.00	5,852,700	
コーナン商事	25,400	3,305.00	83,947,000	
エコス	7,100	1,835.00	13,028,500	
ワタミ	22,700	1,053.00	23,903,100	
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	421,400	2,417.00	1,018,523,800	
西松屋チェーン	41,800	1,378.00	57,600,400	
ゼンショーホールディングス	102,900	3,565.00	366,838,500	
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,061.00	13,050,300	

ハークスレイ	7,200	668.00	4,809,600
サイゼリヤ	31,400	2,920.00	91,688,000
V Tホールディングス	72,000	496.00	35,712,000
魚力	6,000	2,155.00	12,930,000
フジ・コーポレーション	10,900	1,269.00	13,832,100
ユナイテッドアローズ	20,200	1,905.00	38,481,000
ハイデイ日高	28,000	1,959.00	54,852,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,700	208.00	2,641,600
コロワイド	86,600	1,841.00	159,430,600
ピーシーデボコーポレーション	22,100	297.00	6,563,700
巻番屋	14,900	4,615.00	68,763,500
P L A N T	4,900	634.00	3,106,600
スギホールディングス	37,900	6,320.00	239,528,000
薬王堂ホールディングス	10,600	2,566.00	27,199,600
スクロール	28,300	719.00	20,347,700
ヨンドシーホールディングス	16,400	1,744.00	28,601,600
木曽路	28,600	2,155.00	61,633,000
S R S ホールディングス	31,400	853.00	26,784,200
千趣会	35,400	402.00	14,230,800
リテールパートナーズ	28,100	1,252.00	35,181,200
ケーヨー	30,500	910.00	27,755,000
上新電機	16,900	1,925.00	32,532,500
日本瓦斯	100,800	2,151.00	216,820,800
ロイヤルホールディングス	36,200	2,400.00	86,880,000
いなげや	18,500	1,214.00	22,459,000
チヨダ	18,400	773.00	14,223,200
ライフコーポレーション	16,500	2,460.00	40,590,000
リンガーハット	24,200	2,235.00	54,087,000
M r M a x H D	26,800	670.00	17,956,000
A O K I ホールディングス	35,400	670.00	23,718,000
オークワ	30,300	922.00	27,936,600
コメリ	29,000	2,637.00	76,473,000
青山商事	40,500	977.00	39,568,500
しまむら	22,100	12,330.00	272,493,000
はせがわ	9,700	358.00	3,472,600
高島屋	141,800	1,702.00	241,343,600
松屋	32,100	971.00	31,169,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	91,600	1,196.00	109,553,600
近鉄百貨店	6,200	2,438.00	15,115,600
丸井グループ	138,700	2,311.00	320,535,700
アクシアル リテイリング	12,900	3,455.00	44,569,500
イオン	637,000	2,787.50	1,775,637,500

イズミ	28,600	3,110.00	88,946,000
平和堂	31,500	1,988.00	62,622,000
フジ	29,000	1,901.00	55,129,000
ヤオコー	21,300	6,800.00	144,840,000
ゼビオホールディングス	25,800	967.00	24,948,600
ケーズホールディングス	149,700	1,120.00	167,664,000
Olympicグループ	7,600	515.00	3,914,000
日産東京販売ホールディングス	25,100	281.00	7,053,100
シルバーライフ	4,500	1,638.00	7,371,000
Genky DrugStores	9,300	3,625.00	33,712,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	839.00	2,852,600
ブックオフグループホールディングス	11,300	1,322.00	14,938,600
ギフトホールディングス	4,100	3,750.00	15,375,000
アインホールディングス	25,900	7,050.00	182,595,000
元気寿司	6,000	3,150.00	18,900,000
ヤマダホールディングス	771,100	468.00	360,874,800
アークランズ	27,700	1,492.00	41,328,400
ニトリホールディングス	76,000	15,545.00	1,181,420,000
グルメ杵屋	15,500	1,016.00	15,748,000
愛眼	13,900	175.00	2,432,500
ケーユーホールディングス	11,300	1,243.00	14,045,900
吉野家ホールディングス	73,700	2,359.00	173,858,300
松屋フーズホールディングス	8,900	4,050.00	36,045,000
サガミホールディングス	30,500	1,231.00	37,545,500
関西フードマーケット	17,200	1,376.00	23,667,200
王将フードサービス	12,400	6,070.00	75,268,000
プレナス	20,800	2,638.00	54,870,400
ミニストップ	13,800	1,436.00	19,816,800
アークス	34,600	2,104.00	72,798,400
パローホールディングス	36,000	1,808.00	65,088,000
ベルク	9,400	5,680.00	53,392,000
大庄	10,500	1,053.00	11,056,500
ファーストリテイリング	28,200	82,160.00	2,316,912,000
サンドラッグ	71,400	3,720.00	265,608,000
サックスパーホールディングス	18,300	734.00	13,432,200
ヤマザワ	3,700	1,210.00	4,477,000
やまや	4,000	2,490.00	9,960,000
ベルーナ	45,700	703.00	32,127,100
いよぎんホールディングス	208,100	654.00	136,097,400
しずおかフィナンシャルグループ	395,200	941.00	371,883,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,200	913.00	134,393,600
島根銀行	6,000	418.00	2,508,000

じもとホールディングス	11,600	399.00	4,628,400
めぶきフィナンシャルグループ	867,900	297.00	257,766,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	2,204.00	49,369,600
九州フィナンシャルグループ	307,700	380.00	116,926,000
ゆうちょ銀行	498,000	1,026.00	510,948,000
富山第一銀行	43,600	404.00	17,614,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	963,900	466.00	449,177,400
西日本フィナンシャルホールディングス	110,700	828.00	91,659,600
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,440.00	22,464,000
第四北越フィナンシャルグループ	27,500	2,542.00	69,905,000
ひろぎんホールディングス	228,200	614.00	140,114,800
おきなわフィナンシャルグループ	16,600	2,043.00	33,913,800
十六フィナンシャルグループ	22,700	2,460.00	55,842,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,700	4,220.00	62,034,000
プロクレアホールディングス	21,400	2,073.00	44,362,200
あいちフィナンシャルグループ	24,500	2,095.00	51,327,500
新生銀行	51,600	2,183.00	112,642,800
あおぞら銀行	110,000	2,573.00	283,030,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,466,500	719.70	8,252,440,050
りそなホールディングス	2,232,200	629.40	1,404,946,680
三井住友トラスト・ホールディングス	324,000	4,251.00	1,377,324,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,278,100	4,579.00	5,852,419,900
千葉銀行	487,400	810.00	394,794,000
群馬銀行	339,400	423.00	143,566,200
武蔵野銀行	22,400	1,772.00	39,692,800
千葉興業銀行	40,900	347.00	14,192,300
筑波銀行	76,800	187.00	14,361,600
七十七銀行	56,000	1,805.00	101,080,000
秋田銀行	11,700	1,556.00	18,205,200
山形銀行	19,400	1,086.00	21,068,400
岩手銀行	12,000	1,841.00	22,092,000
東邦銀行	138,300	203.00	28,074,900
東北銀行	8,500	951.00	8,083,500
ふくおかフィナンシャルグループ	139,600	2,530.00	353,188,000
スルガ銀行	154,200	416.00	64,147,200
八十二銀行	358,700	498.00	178,632,600
山梨中央銀行	18,000	987.00	17,766,000
大垣共立銀行	33,300	1,748.00	58,208,400
福井銀行	15,600	1,387.00	21,637,200
清水銀行	7,000	1,498.00	10,486,000
富山銀行	2,700	1,640.00	4,428,000
滋賀銀行	29,100	2,518.00	73,273,800

南都銀行	26,300	2,149.00	56,518,700
百五銀行	164,500	329.00	54,120,500
京都銀行	55,400	5,600.00	310,240,000
紀陽銀行	62,600	1,427.00	89,330,200
ほくほくフィナンシャルグループ	111,200	878.00	97,633,600
山陰合同銀行	109,500	696.00	76,212,000
鳥取銀行	5,600	1,058.00	5,924,800
百十四銀行	15,900	1,694.00	26,934,600
四国銀行	27,800	857.00	23,824,600
阿波銀行	25,800	1,926.00	49,690,800
大分銀行	10,500	1,856.00	19,488,000
宮崎銀行	11,400	2,212.00	25,216,800
佐賀銀行	10,200	1,517.00	15,473,400
琉球銀行	40,100	778.00	31,197,800
セブン銀行	626,500	258.00	161,637,000
みずほフィナンシャルグループ	2,529,400	1,630.00	4,122,922,000
高知銀行	6,000	633.00	3,798,000
山口フィナンシャルグループ	193,100	776.00	149,845,600
長野銀行	5,400	1,188.00	6,415,200
名古屋銀行	11,500	3,010.00	34,615,000
北洋銀行	265,000	229.00	60,685,000
大光銀行	5,200	1,154.00	6,000,800
愛媛銀行	23,600	822.00	19,399,200
トマト銀行	5,800	972.00	5,637,600
京葉銀行	81,200	509.00	41,330,800
栃木銀行	80,100	292.00	23,389,200
北日本銀行	6,100	1,872.00	11,419,200
東和銀行	32,100	525.00	16,852,500
福島銀行	18,400	209.00	3,845,600
大東銀行	6,800	607.00	4,127,600
トモニホールディングス	141,300	325.00	45,922,500
フィデアホールディングス	18,100	1,302.00	23,566,200
池田泉州ホールディングス	223,900	216.00	48,362,400
F P G	71,200	1,076.00	76,611,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,500	1,268.00	18,386,000
マーキュリアホールディングス	10,700	621.00	6,644,700
S B I ホールディングス	253,200	2,619.00	663,130,800
ジャフコ グループ	58,500	2,288.00	133,848,000
大和証券グループ本社	1,251,100	598.00	748,157,800
野村ホールディングス	3,221,500	490.00	1,578,535,000
岡三証券グループ	154,200	373.00	57,516,600
丸三証券	58,800	410.00	24,108,000



東洋証券	59,000	270.00	15,930,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191,100	350.00	66,885,000
光世証券	4,600	368.00	1,692,800
水戸証券	48,100	222.00	10,678,200
いちよし証券	32,600	613.00	19,983,800
松井証券	103,600	777.00	80,497,200
マネックスグループ	195,900	447.00	87,567,300
極東証券	22,200	613.00	13,608,600
岩井コスモホールディングス	20,100	1,257.00	25,265,700
アイザワ証券グループ	25,600	658.00	16,844,800
マネーパートナーズグループ	19,000	267.00	5,073,000
スパークス・グループ	19,600	1,645.00	32,242,000
かんぽ生命保険	212,300	2,197.00	466,423,100
S O M P Oホールディングス	300,200	5,631.00	1,690,426,200
アニコム ホールディングス	59,400	684.00	40,629,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	394,300	3,963.00	1,562,610,900
第一生命ホールディングス	890,400	2,369.00	2,109,357,600
東京海上ホールディングス	1,761,200	2,791.00	4,915,509,200
T & Dホールディングス	469,400	1,520.00	713,488,000
アドバンスクリエイト	10,100	1,073.00	10,837,300
全国保証	45,900	5,060.00	232,254,000
あんしん保証	10,300	253.00	2,605,900
イントラスト	7,600	755.00	5,738,000
日本モーゲージサービス	10,400	859.00	8,933,600
C a s a	7,400	866.00	6,408,400
アルヒ	36,400	1,060.00	38,584,000
プレミアグループ	29,700	1,789.00	53,133,300
ネットプロテクションズホールディングス	59,100	502.00	29,668,200
クレディセゾン	111,200	1,712.00	190,374,400
芙蓉総合リース	16,200	8,550.00	138,510,000
みずほリース	26,200	3,245.00	85,019,000
東京センチュリー	32,800	4,830.00	158,424,000
日本証券金融	70,800	994.00	70,375,200
アイフル	291,200	396.00	115,315,200
リコーリース	16,800	3,605.00	60,564,000
イオンフィナンシャルサービス	100,900	1,445.00	145,800,500
アコム	314,200	316.00	99,287,200
ジャックス	18,800	3,740.00	70,312,000
オリエントコーポレーション	46,200	1,190.00	54,978,000
オリックス	1,170,200	2,162.00	2,529,972,400
三菱HCキャピタル	683,000	636.00	434,388,000
九州リースサービス	9,100	653.00	5,942,300

日本取引所グループ	491,800	1,957.00	962,452,600
イー・ギャランティ	28,500	2,459.00	70,081,500
アサックス	8,900	598.00	5,322,200
NECキャピタルソリューション	8,900	2,070.00	18,423,000
大東建託	64,200	15,340.00	984,828,000
いちご	207,100	317.00	65,650,700
日本駐車場開発	215,600	251.00	54,115,600
スター・マイカ・ホールディングス	9,200	1,497.00	13,772,400
SREホールディングス	9,000	4,565.00	41,085,000
ADワークスグループ	44,000	167.00	7,348,000
ヒューリック	409,600	1,143.00	468,172,800
三栄建築設計	9,600	1,525.00	14,640,000
野村不動産ホールディングス	109,900	3,225.00	354,427,500
三重交通グループホールディングス	41,200	496.00	20,435,200
サムティ	28,600	2,404.00	68,754,400
ディア・ライフ	29,300	610.00	17,873,000
地主	14,300	2,015.00	28,814,500
プレサンスコーポレーション	24,200	1,588.00	38,429,600
ハウスコム	4,500	1,119.00	5,035,500
JPMC	10,600	1,042.00	11,045,200
サンセイランディック	7,200	854.00	6,148,800
フージャースホールディングス	27,000	757.00	20,439,000
オープンハウスグループ	64,300	5,870.00	377,441,000
東急不動産ホールディングス	528,300	723.00	381,960,900
飯田グループホールディングス	154,000	2,209.00	340,186,000
イーランド	3,800	1,574.00	5,981,200
ムゲンエステート	15,500	486.00	7,533,000
And Doホールディングス	10,400	852.00	8,860,800
シーアールイー	9,200	1,479.00	13,606,800
ケイアイスター不動産	8,800	4,845.00	42,636,000
グッドコムアセット	18,700	726.00	13,576,200
ジェイ・エス・ビー	4,700	4,270.00	20,069,000
ロードスターキャピタル	8,600	1,730.00	14,878,000
テンポイノベーション	7,200	950.00	6,840,000
フェイスネットワーク	3,700	1,351.00	4,998,700
パーク24	137,300	2,005.00	275,286,500
パラカ	7,100	1,871.00	13,284,100
三井不動産	760,800	2,671.00	2,032,096,800
三菱地所	1,109,800	1,908.00	2,117,498,400
平和不動産	28,900	4,030.00	116,467,000
東京建物	167,700	1,924.00	322,654,800
京阪神ビルディング	23,900	1,317.00	31,476,300

住友不動産	316,700	3,659.00	1,158,805,300
テオオーシー	34,100	709.00	24,176,900
東京楽天地	3,500	4,240.00	14,840,000
スターツコーポレーション	25,800	2,881.00	74,329,800
フジ住宅	27,400	619.00	16,960,600
空港施設	24,400	539.00	13,151,600
明和地所	11,900	627.00	7,461,300
ゴールドクレスト	17,700	1,780.00	31,506,000
エスリード	9,200	1,860.00	17,112,000
日神グループホールディングス	32,400	425.00	13,770,000
日本エスコン	39,300	836.00	32,854,800
MIRARTHホールディングス	88,400	390.00	34,476,000
AVANTIA	11,200	794.00	8,892,800
イオンモール	91,800	1,693.00	155,417,400
毎日コムネット	9,000	676.00	6,084,000
ファースト住建	8,700	1,017.00	8,847,900
カチタス	47,600	3,280.00	156,128,000
トーセイ	30,400	1,481.00	45,022,400
穴吹興産	5,100	1,988.00	10,138,800
サンフロンティア不動産	30,800	1,138.00	35,050,400
FJネクストホールディングス	20,200	959.00	19,371,800
インテリックス	4,300	562.00	2,416,600
ランドビジネス	6,400	232.00	1,484,800
サンネクスタグループ	7,600	965.00	7,334,000
グランディハウス	17,100	543.00	9,285,300
日本空港ビルデング	62,200	6,180.00	384,396,000
明豊ファシリティワークス	9,300	700.00	6,510,000
日本工営	13,100	3,345.00	43,819,500
LIFULL	63,800	249.00	15,886,200
MIXI	41,700	2,450.00	102,165,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,600	2,488.00	41,300,800
日本M&Aセンターホールディングス	313,300	1,854.00	580,858,200
メンバーズ	5,500	2,141.00	11,775,500
中広	3,300	378.00	1,247,400
UTグループ	26,900	2,827.00	76,046,300
アイティメディア	7,100	1,804.00	12,808,400
E・Jホールディングス	12,000	1,343.00	16,116,000
夢真ビーネックスグループ	66,900	1,903.00	127,310,700
コシダカホールディングス	55,000	1,078.00	59,290,000
アルトナー	4,800	1,000.00	4,800,000
パソナグループ	22,300	2,042.00	45,536,600
CDS	4,700	1,849.00	8,690,300

リンクアンドモチベーション	52,600	736.00	38,713,600
エス・エム・エス	69,500	3,710.00	257,845,000
サニーサイドアップグループ	7,000	589.00	4,123,000
パーソルホールディングス	204,500	3,015.00	616,567,500
リニカル	10,800	723.00	7,808,400
クックパッド	51,700	207.00	10,701,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,500	625.00	5,937,500
学情	8,500	1,514.00	12,869,000
スタジオアリス	9,300	2,096.00	19,492,800
シミックホールディングス	10,300	1,727.00	17,788,100
エプコ	4,400	686.00	3,018,400
N J S	4,200	2,041.00	8,572,200
総合警備保障	67,900	3,730.00	253,267,000
カカクコム	136,500	2,295.00	313,267,500
アイロムグループ	6,700	2,204.00	14,766,800
セントケア・ホールディング	12,000	838.00	10,056,000
サイネックス	3,700	537.00	1,986,900
ルネサンス	13,100	908.00	11,894,800
ディップ	32,000	3,935.00	125,920,000
デジタルホールディングス	14,500	1,170.00	16,965,000
新日本科学	19,500	2,552.00	49,764,000
キャリアデザインセンター	4,000	1,592.00	6,368,000
ベネフィット・ワン	84,700	2,105.00	178,293,500
エムスリー	360,800	4,416.00	1,593,292,800
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	382.00	4,469,400
アウトソーシング	109,000	1,023.00	111,507,000
ウェルネット	16,700	638.00	10,654,600
ワールドホールディングス	8,300	2,894.00	24,020,200
ディー・エヌ・エー	78,000	1,898.00	148,044,000
博報堂D Yホールディングス	233,100	1,331.00	310,256,100
ぐるなび	34,400	395.00	13,588,000
タカミヤ	25,600	375.00	9,600,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	843.00	9,525,900
ファンコミュニケーションズ	36,500	441.00	16,096,500
ライク	7,000	2,046.00	14,322,000
ビジネス・ブレークスルー	7,700	396.00	3,049,200
エスプール	52,800	909.00	47,995,200
W D Bホールディングス	9,500	2,521.00	23,949,500
ティア	11,500	426.00	4,899,000
C D G	2,200	1,176.00	2,587,200
アドウェイズ	25,600	564.00	14,438,400
バリューコマース	13,900	2,111.00	29,342,900

インフォマート	190,200	444.00	84,448,800
J Pホールディングス	53,700	272.00	14,606,400
エコナックホールディングス	35,400	95.00	3,363,000
C Lホールディングス	5,400	838.00	4,525,200
プレステージ・インターナショナル	77,200	722.00	55,738,400
アミューズ	10,100	1,710.00	17,271,000
ドリームインキュベータ	5,700	2,789.00	15,897,300
クイック	14,100	2,035.00	28,693,500
T A C	10,500	203.00	2,131,500
電通グループ	191,600	4,435.00	849,746,000
イオンファンタジー	8,000	2,885.00	23,080,000
シーティーエス	20,600	833.00	17,159,800
ネクシィーズグループ	6,100	628.00	3,830,800
H . U . グループホールディングス	53,600	2,790.00	149,544,000
アルプス技研	16,000	2,120.00	33,920,000
日本空調サービス	20,100	699.00	14,049,900
オリエンタルランド	193,200	19,640.00	3,794,448,000
ダスキン	40,800	2,968.00	121,094,400
明光ネットワークジャパン	24,600	615.00	15,129,000
ファルコホールディングス	8,400	1,784.00	14,985,600
ラウンドワン	153,200	567.00	86,864,400
リゾートトラスト	72,200	2,335.00	168,587,000
ビー・エム・エル	22,700	3,480.00	78,996,000
りらいあコミュニケーションズ	30,500	1,017.00	31,018,500
リソー教育	84,000	323.00	27,132,000
早稲田アカデミー	10,400	1,121.00	11,658,400
ユー・エス・エス	187,900	2,160.00	405,864,000
東京個別指導学院	22,300	536.00	11,952,800
サイバーエージェント	437,100	1,227.00	536,321,700
楽天グループ	844,700	657.00	554,967,900
クリーク・アンド・リバー社	10,900	2,047.00	22,312,300
モーニングスター	30,500	442.00	13,481,000
テー・オー・ダブリュー	40,100	297.00	11,909,700
山田コンサルティンググループ	9,500	1,153.00	10,953,500
セントラルスポーツ	7,000	2,429.00	17,003,000
フルキャストホールディングス	17,500	2,901.00	50,767,500
エン・ジャパン	33,200	2,328.00	77,289,600
リソルホールディングス	1,700	4,665.00	7,930,500
テクノプロ・ホールディングス	122,500	3,830.00	469,175,000
アトラグループ	4,100	192.00	787,200
インターワークス	5,600	371.00	2,077,600
アイ・アールジャパンホールディングス	9,600	1,834.00	17,606,400

KeepEr 技研	13,200	4,055.00	53,526,000
ファーストロジック	3,300	840.00	2,772,000
三機サービス	3,600	927.00	3,337,200
Gunosy	11,800	700.00	8,260,000
デザインワン・ジャパン	7,100	191.00	1,356,100
イー・ガーディアン	7,000	2,823.00	19,761,000
リブセンス	9,600	299.00	2,870,400
ジャパンマテリアル	56,000	2,507.00	140,392,000
ベクトル	29,000	1,191.00	34,539,000
ウチヤマホールディングス	8,900	274.00	2,438,600
チャーム・ケア・コーポレーション	15,500	1,105.00	17,127,500
キャリアリンク	6,800	3,055.00	20,774,000
I B J	11,500	985.00	11,327,500
アサンテ	9,200	1,594.00	14,664,800
バリューHR	16,100	1,520.00	24,472,000
M&Aキャピタルパートナーズ	16,900	4,915.00	83,063,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,087.00	7,391,600
E R Iホールディングス	5,500	1,112.00	6,116,000
アビスト	3,000	2,934.00	8,802,000
シグマクシス・ホールディングス	27,900	1,297.00	36,186,300
ウィルグループ	15,400	1,340.00	20,636,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	21,500	162.00	3,483,000
メドピア	14,600	1,717.00	25,068,200
レアジョブ	3,800	904.00	3,435,200
リクルートホールディングス	1,351,600	4,430.00	5,987,588,000
エラン	24,500	1,011.00	24,769,500
土木管理総合試験所	8,800	305.00	2,684,000
日本郵政	2,392,900	1,058.00	2,531,688,200
ベルシステム24ホールディングス	24,700	1,308.00	32,307,600
鎌倉新書	21,100	769.00	16,225,900
S MN	5,100	458.00	2,335,800
グローバルキッズCOMPANY	3,400	588.00	1,999,200
エアトリ	11,900	2,573.00	30,618,700
アトラエ	14,500	1,485.00	21,532,500
ストライク	9,100	4,265.00	38,811,500
ソラスト	50,700	815.00	41,320,500
セラク	6,800	1,268.00	8,622,400
インソース	22,700	3,255.00	73,888,500
ベイカレント・コンサルティング	144,600	4,360.00	630,456,000
Orchestra Holdings	4,000	2,326.00	9,304,000
アイモバイル	9,800	1,272.00	12,465,600
キャリアインデックス	7,100	365.00	2,591,500

MS - J a p a n	6,300	1,070.00	6,741,000
船場	3,500	777.00	2,719,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,000	1,677.00	109,005,000
フルテック	2,900	1,116.00	3,236,400
GameWith	6,400	377.00	2,412,800
MS&Consulting	2,700	608.00	1,641,600
ウェルビー	13,800	909.00	12,544,200
エル・ティー・エス	2,400	3,125.00	7,500,000
ミダックホールディングス	11,200	3,190.00	35,728,000
日総工産	14,200	594.00	8,434,800
キュービーネットホールディングス	9,700	1,418.00	13,754,600
RPAホールディングス	25,900	290.00	7,511,000
スプリックス	6,600	992.00	6,547,200
マネジメントソリューションズ	10,100	3,855.00	38,935,500
プロレド・パートナーズ	5,100	528.00	2,692,800
テノ・ホールディングス	2,800	556.00	1,556,800
フロンティア・マネジメント	6,400	1,333.00	8,531,200
ピアラ	3,500	720.00	2,520,000
コプロ・ホールディングス	3,400	962.00	3,270,800
ギークス	2,900	893.00	2,589,700
カーブスホールディングス	56,500	900.00	50,850,000
フォーラムエンジニアリング	11,100	852.00	9,457,200
Fast Fitness Japan	6,400	1,377.00	8,812,800
ダイレクトマーケティングミックス	21,000	1,500.00	31,500,000
ポピンズ	2,900	1,662.00	4,819,800
LITALICO	14,300	2,418.00	34,577,400
アドバンテッジリスクマネジメント	9,100	420.00	3,822,000
リログループ	101,800	2,277.00	231,798,600
東祥	13,000	1,195.00	15,535,000
ビーウィズ	5,700	1,217.00	6,936,900
TREホールディングス	38,700	1,537.00	59,481,900
人・夢・技術グループ	8,300	2,064.00	17,131,200
エイチ・アイ・エス	47,900	1,966.00	94,171,400
ラックランド	5,800	2,955.00	17,139,000
共立メンテナンス	31,300	5,620.00	175,906,000
イチネンホールディングス	19,600	1,234.00	24,186,400
建設技術研究所	9,500	3,135.00	29,782,500
スペース	13,600	895.00	12,172,000
燦ホールディングス	8,300	1,753.00	14,549,900
スバル興業	1,200	9,060.00	10,872,000
東京テアトル	6,700	1,128.00	7,557,600
タナベコンサルティンググループ	7,600	650.00	4,940,000

ナガワ	4,900	7,420.00	36,358,000	
東京都競馬	15,400	3,910.00	60,214,000	
カナモト	33,600	2,237.00	75,163,200	
西尾レントオール	17,100	3,010.00	51,471,000	
トランス・コスモス	22,800	3,330.00	75,924,000	
乃村工藝社	79,900	1,028.00	82,137,200	
藤田観光	8,100	2,889.00	23,400,900	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,615.00	17,603,500	
日本管財	19,300	2,551.00	49,234,300	
トーカイ	16,300	1,876.00	30,578,800	
セコム	186,000	8,259.00	1,536,174,000	
セントラル警備保障	10,000	2,407.00	24,070,000	
丹青社	35,800	791.00	28,317,800	
メイテック	72,900	2,505.00	182,614,500	
応用地質	17,900	2,083.00	37,285,700	
船井総研ホールディングス	38,500	2,773.00	106,760,500	
進学会ホールディングス	7,100	306.00	2,172,600	
オオバ	12,000	679.00	8,148,000	
いであ	4,200	1,723.00	7,236,600	
学究社	7,500	1,780.00	13,350,000	
ベネッセホールディングス	68,300	1,990.00	135,917,000	
イオンディライト	20,300	2,965.00	60,189,500	
ナック	8,400	930.00	7,812,000	
ダイセキ	37,300	4,690.00	174,937,000	
ステップ	7,700	1,831.00	14,098,700	
合計	206,282,900		505,863,987,550	

## (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12月30日現在）

資産総額	2,400,896,541円
負債総額	16,019,659円
純資産総額（ - ）	2,384,876,882円
発行済口数	2,537,539,537口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9398円
（1万口当たり純資産額）	（9,398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12月30日現在）

資産総額	290,749,252,837円
負債総額	241,221,076円
純資産総額（ - ）	290,508,031,761円
発行済口数	97,853,441,964口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9688円
（1万口当たり純資産額）	（29,688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12月30日現在）

資産総額	495,521,517,318円
負債総額	195,006,598円
純資産総額（ - ）	495,326,510,720円
発行済口数	261,367,620,775口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8951円
（1万口当たり純資産額）	（18,951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12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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。

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 2月21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12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	13,524,246
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	207,324
単位型公社債投資信託	52	185,394
合計	652	13,916,964

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（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。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (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】

（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	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					

当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 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と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44-21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、

（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、それら的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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

##### 固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90



法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

## その他有価証券

## 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

時価法によっております。

## (3) 金銭の信託

時価法によっております。

## 2．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。

## 3．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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間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、退職給付に係る当中間会計期間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。

## 4．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。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

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の適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下、「実務対応報告第42号」）という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## （表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。	

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	777百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

## （中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	95百万円
無形固定資産	608百万円
2 営業外収益の主要項目	
デリバティブ利益	2,027百万円
投資有価証券売却益	317百万円
3 営業外費用の主要項目	
為替差損	1,011百万円
金銭の信託運用損	904百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

#### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

#### (金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

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

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

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

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

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

#### (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

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

（2）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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中間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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額223百万円)は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第37期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計	8,141	-	0	0	

(注) 上記取引の評価損益は中間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	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

(注) 上記取引の評価損益は中間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	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	------------------	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ	投資有価証券 関係会社株式	82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
	合計		6,898	-	22

## （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）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 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4．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中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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

## 〔関連情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円



## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1)自己又はその役員との取引

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

## (2)運用財産相互間の取引

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

## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年2月21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
2022年 6月15日	臨時報告書
2022年 8月19日	有価証券届出書
2022年 8月19日	有価証券報告書
2022年 9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

2023年2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

## 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2022年5月20日から2022年11月21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11月21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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。