

【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】	2024年2月20日提出
【計算期間】	第38特定期間(自 2023年5月20日至 2023年11月20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】	上坪 直樹
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

(1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

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

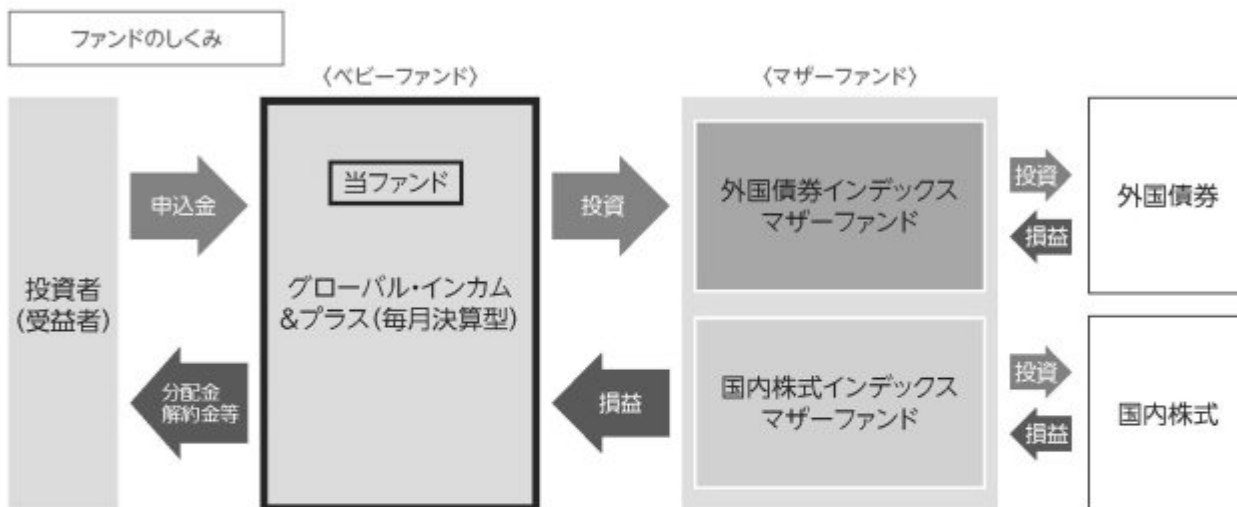
(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
外国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース） 1
国内株式	TOPIX（東証株価指数）（配当込み） 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」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。

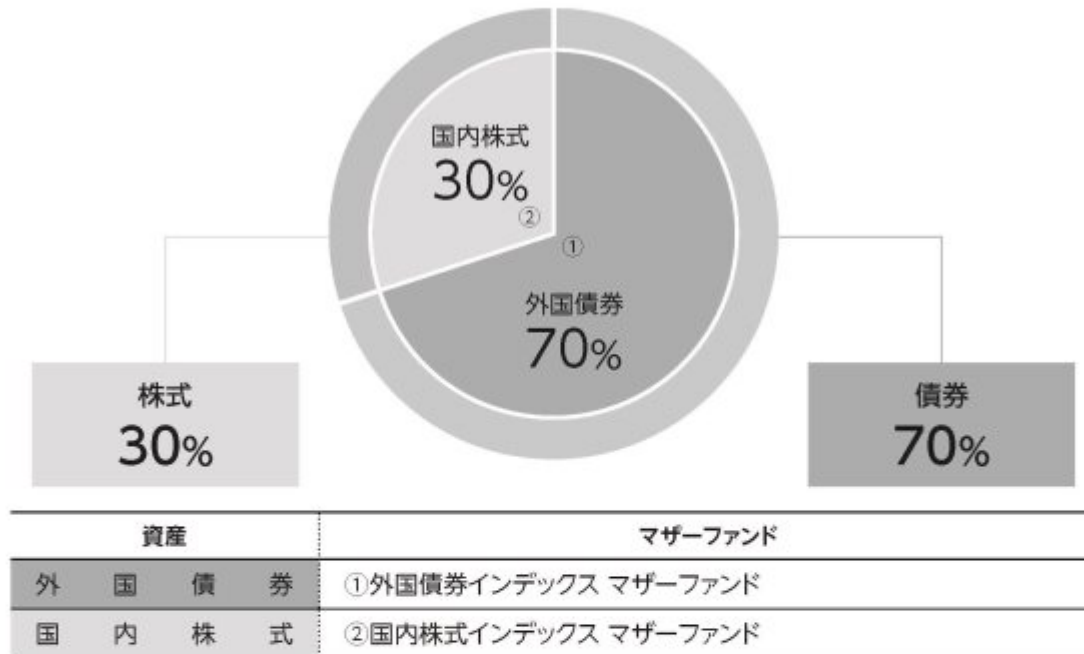
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX(東証株価指数) (配当込み) (以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIX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、配当込みTOPIX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。

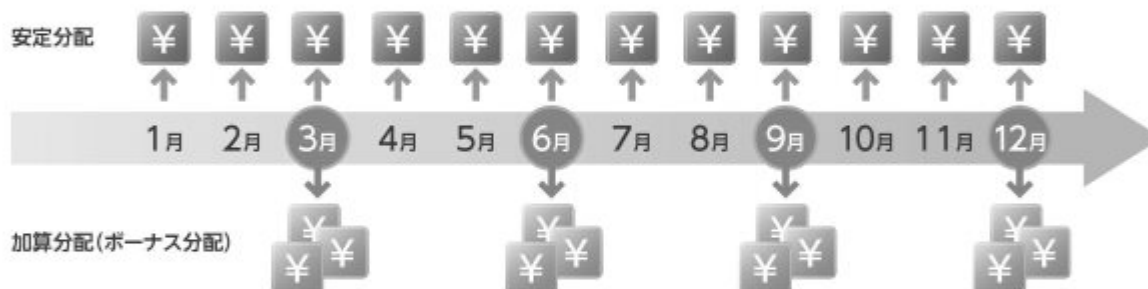
4.

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

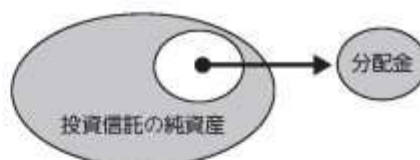
- 株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

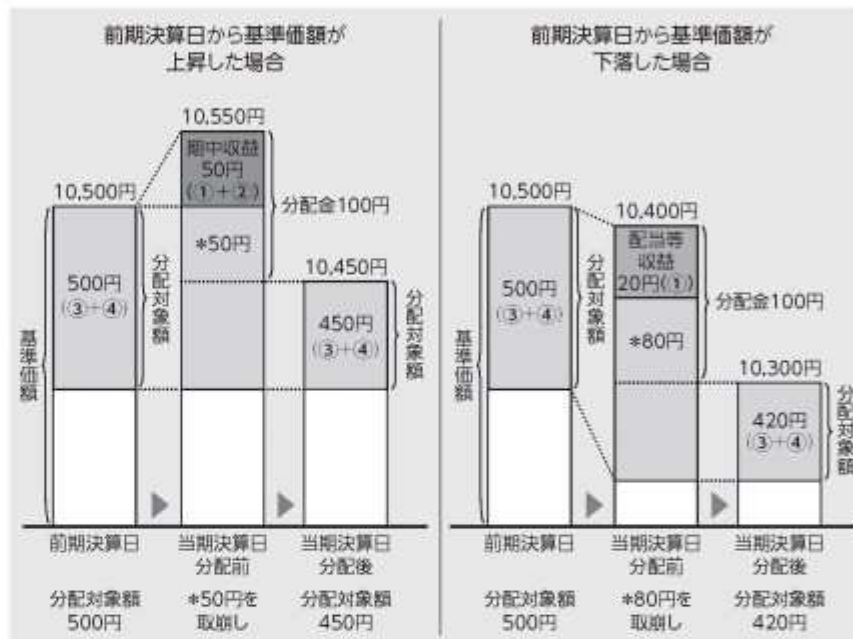


分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超過して支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

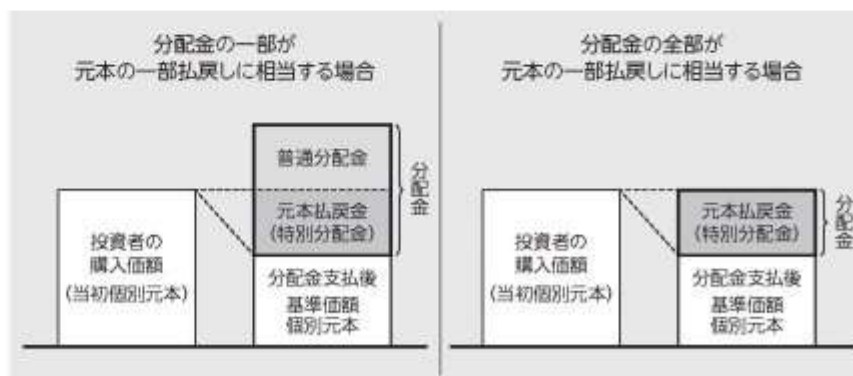
※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。分配対象額とは、
① 経費控除後の配当等収益
② 経費控除後の評価益を含む売買益
③ 分配準備積立金
④ 収益調整金
です。

※右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。

計算期間中に発生した収益を超過して支払われる場合



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小さかった場合も同様です。



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。
※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。

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。元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、分配後はその金額だけ個別元本が減少します。
※元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

(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

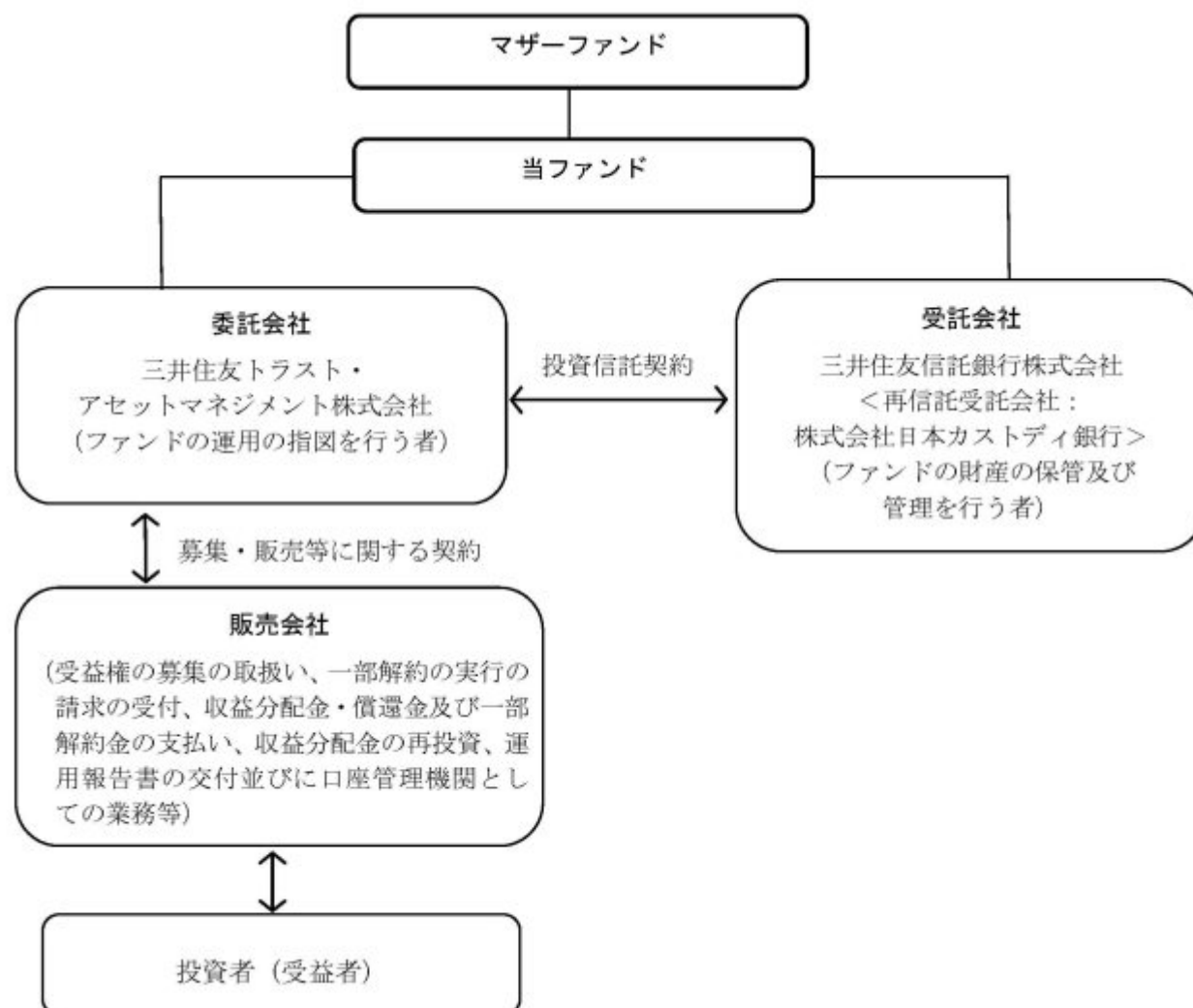
2012年4月1日

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（2023年12月29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す。)

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す。)

17. 預託証書(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書

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、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、T O P I X（東証株価指数）（配当込み）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、T O P I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

・分配対象額の範囲

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

・分配対象額についての分配方針

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

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

・留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

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

（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

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

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

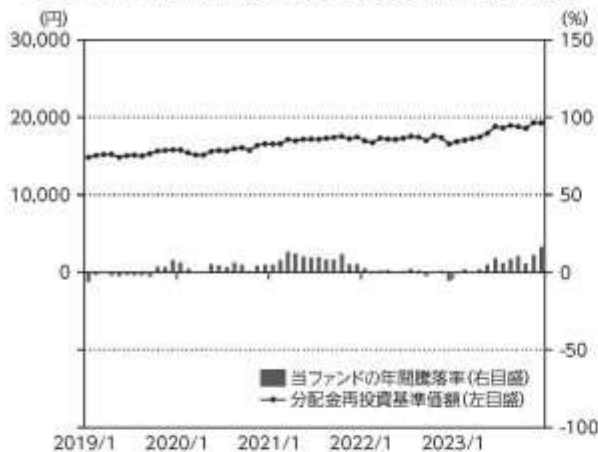
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

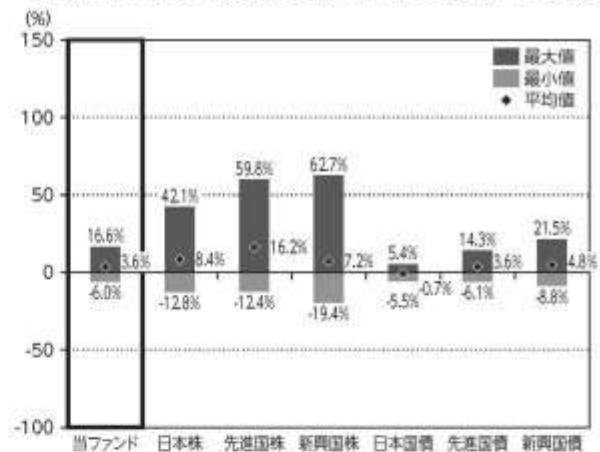
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年1月～2023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JPMリサーチが算出、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、浮動性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商標は、株式会社JPMリサーチ又は株式会社JPMリサーチの関連会社（以下「JPM」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商標に関するすべての権利）はJPMが有します。JPMは、同指数の指数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPM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JPMは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が算出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。同指数に關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.が算出した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に關する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は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定期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・サービスに關し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドの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、またデータの誤差、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その他の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEモガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ボンド・インデックス (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。本指数は特許を授けられていません。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

じ。)。

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

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

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ: <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル: 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2) 【換金(解約) 手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額 () の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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、2024年1月1日現在のもので、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。

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.35%	1.32%	0.03%

※対象期間は2023年5月20日～2023年11月20日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2023年12月29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	2,486,338,647	97.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		51,586,333	2.03
合計(純資産総額)		2,537,924,980	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	512,372,069	3.3600	1,721,570,152	3.3905	1,737,197,499	68.45
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	308,161,723	2.3942	737,800,798	2.4310	749,141,148	29.52

(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	97.97
合計	97.97

(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
第37特定期間末	(2023年 5月19日)	2,536,440,309	2,538,941,288	10,142	10,152
第38特定期間末	(2023年11月20日)	2,592,843,640	2,595,259,115	10,734	10,744
	2022年12月末日	2,384,876,882		9,398	
	2023年 1月末日	2,417,825,682		9,578	
	2月末日	2,434,000,122		9,665	
	3月末日	2,458,310,856		9,776	
	4月末日	2,480,800,587		9,884	
	5月末日	2,528,174,559		10,144	
	6月末日	2,628,982,993		10,636	
	7月末日	2,586,868,876		10,504	
	8月末日	2,618,402,606		10,690	
	9月末日	2,546,094,406		10,433	
	10月末日	2,502,601,044		10,310	
	11月末日	2,566,198,801		10,699	
	12月末日	2,537,924,980		10,629	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第37特定期間	2022年11月22日～2023年 5月19日	60
第38特定期間	2023年 5月20日～2023年11月20日	210

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第37特定期間	2022年11月22日～2023年 5月19日	3.2
第38特定期間	2023年 5月20日～2023年11月20日	7.9

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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
第37特定期間	2022年11月22日～2023年5月19日	5,081,944	78,097,694	2,500,979,723
第38特定期間	2023年5月20日～2023年11月20日	13,193,122	98,697,457	2,415,475,388

(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	138,828,155,278	45.99
	フランス	25,137,414,172	8.33
	イタリア	22,555,698,209	7.47
	中国	22,192,630,962	7.35
	ドイツ	19,616,876,170	6.50
	イギリス	15,617,157,420	5.17
	スペイン	14,722,033,558	4.88
	カナダ	5,945,031,157	1.97
	ベルギー	5,358,708,128	1.78
	オランダ	4,549,218,529	1.51
	オーストラリア	4,245,766,262	1.41
	オーストリア	3,582,221,297	1.19
	メキシコ	2,700,465,553	0.89
	アイルランド	1,759,172,154	0.58
	フィンランド	1,583,609,641	0.52
	ポーランド	1,522,256,383	0.50
	マレーシア	1,491,873,985	0.49
	シンガポール	1,266,874,133	0.42
	イスラエル	888,889,820	0.29
	デンマーク	844,917,398	0.28
ニュージーランド	730,448,334	0.24	
スウェーデン	637,896,631	0.21	
ノルウェー	539,822,201	0.18	
	小計	296,317,137,375	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,551,829,720	1.84

合計(純資産総額)	301,868,967,095	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,057,010,248	0.35
	買建	ドイツ	1,031,283,830	0.34

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		2,273,903,860	0.75

(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 4.125% 11/15/32	14,000,000	14,370.29	2,011,841,580	14,462.78	2,024,789,452	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,524.72	1,843,419,967	13,657.78	1,861,556,202	3.375	2033/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,024.24	1,680,128,108	13,029.52	1,680,808,502	2.750	2032/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,309.58	1,555,890,143	13,470.80	1,574,736,862	2.375	2027/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,457.94	1,507,289,389	13,799.33	1,545,525,943	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,722.99	1,474,752,411	11,810.39	1,485,747,637	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,091.00	1,409,900,981	13,375.78	1,440,572,355	1.625	2026/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,174.94	1,426,903,209	12,229.51	1,433,298,956	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,176.54	1,417,654,589	14,313.47	1,431,347,254	4.500	2026/7/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	13,706.58	1,398,071,810	13,894.63	1,417,252,343	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,348.89	1,356,192,724	11,521.74	1,376,848,933	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,491.33	1,357,228,616	13,600.72	1,368,232,565	2.875	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,181.32	1,331,313,889	13,182.71	1,331,453,784	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,531.43	1,244,892,265	14,388.81	1,323,771,414	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,528.95	1,285,477,999	11,675.21	1,301,786,232	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,832.84	1,219,120,267	13,107.64	1,245,225,851	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	13,583.85	1,222,547,120	13,811.25	1,243,012,521	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,087.07	1,197,403,879	11,400.69	1,231,274,976	2.875	2052/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,493.24	1,187,405,195	13,747.59	1,209,788,742	1.500	2024/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,187.68	1,170,017,725	12,467.46	1,196,876,778	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,348.35	1,173,093,379	12,568.02	1,193,962,055	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,548.08	1,146,168,347	13,760.83	1,164,166,574	2.000	2025/2/15	0.39

アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,332.29	1,133,245,244	13,620.11	1,157,709,536	1.125	2025/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,060.15	1,143,090,457	14,175.24	1,152,447,304	3.875	2029/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,607.64	1,143,042,314	13,702.93	1,151,046,845	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,379.87	1,114,189,028	12,645.86	1,138,127,573	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,270.89	1,090,867,305	13,570.80	1,115,520,099	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	8,350,000	13,545.82	1,131,076,740	13,226.20	1,104,387,824	3.625	2053/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	11,662.47	1,076,446,019	11,768.56	1,086,238,622	1.250	2031/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000	17,871.22	1,057,976,319	18,272.36	1,081,723,989	5.500	2029/4/25	0.36

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.16
合計	98.16

(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	28	アメリカドル	3,019,726.92	428,287,869	3,043,250	431,624,147	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	18	アメリカドル	2,005,495.72	284,439,458	2,032,031.34	288,203,005	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカドル	2,297,490.69	325,853,104	2,377,375	337,183,096	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,169,788.1	183,797,106	1,172,710	184,256,195	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,782,261.5	280,028,927	1,794,900	282,014,688	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	26	ユーロ	3,549,464.6	557,691,878	3,596,060	565,012,947	0.19

(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	7,820,000.00	1,120,056,741	1,105,931,770	0.37
	カナダドル	買建	860,000.00	91,810,503	91,986,718	0.03
	ユーロ	買建	4,800,000.00	751,781,098	752,531,520	0.25
	イギリスポンド	買建	740,000.00	134,213,963	133,329,352	0.04
	オフショア人民元	買建	9,560,000.00	191,600,350	190,124,500	0.06

(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	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	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	7,168,980,000	1.21

(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	9,585,900	1,944.31	18,637,971,918	2,590.50	24,832,273,950	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,234,900	13,262.64	16,378,034,785	13,410.00	16,560,009,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,476,900	935.07	9,796,634,883	1,211.50	12,692,764,350	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,700	68,435.49	11,955,681,814	62,120.00	10,852,364,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1,585,700	4,415.41	7,001,522,280	5,917.00	9,382,586,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,500	19,749.13	7,297,307,208	25,255.00	9,331,722,500	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,081,600	162.92	8,485,138,853	172.30	8,973,659,680	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,400	8,161.66	6,916,194,878	10,170.00	8,618,058,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,222,500	5,682.91	6,947,368,917	6,880.00	8,410,800,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,660,000	2,002.89	7,330,597,902	2,253.50	8,247,810,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,200	5,922.79	6,528,102,549	7,359.00	8,111,089,800	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,328,700	4,450.16	5,912,928,191	5,963.00	7,923,038,100	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,700	4,702.71	6,544,769,731	5,298.00	7,373,226,600	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,241,600	4,993.91	6,200,440,714	5,767.00	7,160,307,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,549,600	4,531.81	7,022,503,107	4,054.00	6,282,078,400	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,257,300	1,346.23	5,731,320,672	1,466.00	6,241,201,800	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,000	4,358.82	5,897,485,430	4,486.00	6,069,558,000	1.02

日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,130.60	5,891,213,340	17,625.00	6,061,237,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,699,500	3,118.90	5,300,580,579	3,529.00	5,997,535,500	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,525,300	4,533.12	6,914,370,121	3,872.00	5,905,961,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,320,800	2,084.61	4,837,983,290	2,412.50	5,598,930,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	863,700	5,563.87	4,805,515,260	6,293.00	5,435,264,100	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	949,800	5,369.03	5,099,512,290	5,251.00	4,987,399,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,817,100	1,514.97	4,267,827,507	1,759.50	4,956,687,450	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,500	26,686.15	5,617,435,672	22,985.00	4,838,342,500	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,588,400	2,751.28	4,370,145,617	2,993.00	4,754,081,200	0.80
日本	株式	S M C	機械	52,800	74,470.94	3,932,065,937	75,760.00	4,000,128,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,962,500	1,824.24	3,580,089,531	1,999.00	3,923,037,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,044,500	3,091.13	3,228,692,742	3,645.00	3,807,202,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	636,600	6,139.85	3,908,633,900	5,595.00	3,561,777,000	0.60

(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	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.33
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.12
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.27
		電気機器	17.33
		輸送用機器	8.09
		精密機器	2.34
		その他製品	2.35
		電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81		
海運業	0.83		
空運業	0.45		
倉庫・運輸関連業	0.15		

	情報・通信業	7.63
	卸売業	6.92
	小売業	4.25
	銀行業	6.79
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.35
	その他金融業	1.14
	不動産業	1.93
	サービス業	4.94
	小計	98.78
合計		98.78

(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	東証株価指数先物	買建	303円		7,109,275,050	7,168,980,000	1.21

(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：2023年12月29日

基準価額・純資産の推移



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

基準価額	10,629円
純資産総額	25.38億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2023年8月	10円
2023年9月	160円
2023年10月	10円
2023年11月	10円
2023年12月	60円
直近1年間 分配金合計額	320円
設定来 分配金合計額	5,586円

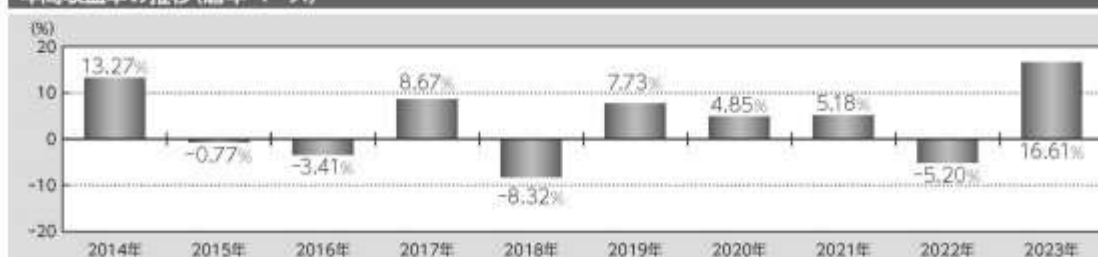
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	68.4%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.5%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.4%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.4%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.4%
		T 3.5% 02/15/33	アメリカ	国債	-	3.500%	2033/02/15	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	29.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		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	-	-	0.5%
		信越化学工業	日本	株式	化学	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2004年12月1日設定）

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

（4）【計算期間】

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超

えるときは、当該約款変更を行いません。

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経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38特定期間(2023年5月20日から2023年11月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第37特定期間 （2023年 5月19日現在）	第38特定期間 （2023年11月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	49,825,422	53,500,698
親投資信託受益証券	2,486,000,544	2,540,877,894
未収入金	6,070,000	3,830,000
流動資産合計	2,541,895,966	2,598,208,592
資産合計	2,541,895,966	2,598,208,592
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,500,979	2,415,475
未払解約金	236,013	1,215
未払受託者報酬	157,929	171,268
未払委託者報酬	2,549,406	2,764,733
未払利息	59	38
その他未払費用	11,271	12,223
流動負債合計	5,455,657	5,364,952
負債合計	5,455,657	5,364,952
純資産の部		
元本等		
元本	2,500,979,723	2,415,475,388
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	35,460,586	177,368,252
（分配準備積立金）	87,960,148	197,819,460
元本等合計	2,536,440,309	2,592,843,640
純資産合計	2,536,440,309	2,592,843,640
負債純資産合計	2,541,895,966	2,598,208,592

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第37特定期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月19日	第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日
営業収益		
受取利息	115	142
有価証券売買等損益	94,279,523	214,097,350
営業収益合計	94,279,638	214,097,492
営業費用		
支払利息	9,925	15,551
受託者報酬	925,403	1,000,397
委託者報酬	14,938,563	16,149,225
その他費用	66,040	71,393
営業費用合計	15,939,931	17,236,566
営業利益又は営業損失（ ）	78,339,707	196,860,926
経常利益又は経常損失（ ）	78,339,707	196,860,926
当期純利益又は当期純損失（ ）	78,339,707	196,860,926
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（ ）	382,626	694,575
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	29,976,791	35,460,586
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,984,715	642,831
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,984,715	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	642,831
剰余金減少額又は欠損金増加額	145,740	3,622,773
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	3,622,773
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	145,740	-
分配金	15,123,931	51,278,743
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	35,460,586	177,368,252

(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38特定期間は当特定期間末日が休業日のため、2023年 5月20日から2023年11月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第37特定期間 (2023年 5月19日現在)	第38特定期間 (2023年11月20日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,500,979,723口	2,415,475,388口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0142円 (10,142円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0734円 (10,734円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第37特定期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月19日	第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日																																																												
分配金の計算過程 第215期 自 2022年11月22日 至 2022年12月19日	分配金の計算過程 第221期 自 2023年 5月20日 至 2023年 6月19日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>116,927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>9,342,919円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>85,504,902円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>94,964,748円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,552,773,086口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>372円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,552,773円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	116,927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	9,342,919円	分配準備積立金額	D	85,504,902円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,964,748円	当ファンドの期末残存口数	F	2,552,773,086口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	372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	2,552,773円	<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>3,248,540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>65,194,932円</td></tr> <tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>9,247,515円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>87,027,019円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>164,718,006円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,475,647,157口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>665円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,475,647円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,248,540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	65,194,932円	収益調整金額	C	9,247,515円	分配準備積立金額	D	87,027,019円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,718,006円	当ファンドの期末残存口数	F	2,475,647,157口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	665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	2,475,647円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	116,927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	9,342,919円																																																											
分配準備積立金額	D	85,504,902円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,964,748円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,552,773,086口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	372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	2,552,773円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	3,248,540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	65,194,932円																																																											
収益調整金額	C	9,247,515円																																																											
分配準備積立金額	D	87,027,019円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,718,006円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,475,647,157口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	665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	2,475,647円																																																											
第216期 自 2022年12月20日 至 2023年 1月19日	第222期 自 2023年 6月20日 至 2023年 7月19日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,337,274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>9,278,727円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>82,212,601円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>92,828,602円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,527,332,192口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>367円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,527,332円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,337,274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	9,278,727円	分配準備積立金額	D	82,212,601円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,828,602円	当ファンドの期末残存口数	F	2,527,332,192口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	367円	1万口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,527,332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>1,487,928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>9,278,715円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>152,341,305円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>163,107,948円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,466,143,436口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>661円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,466,143円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,487,928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	9,278,715円	分配準備積立金額	D	152,341,305円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	163,107,948円	当ファンドの期末残存口数	F	2,466,143,436口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	661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	2,466,143円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,337,274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	9,278,727円																																																											
分配準備積立金額	D	82,212,601円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,828,602円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,527,332,192口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	367円																																																											
1万口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,527,332円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,487,928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	9,278,715円																																																											
分配準備積立金額	D	152,341,305円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	163,107,948円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,466,143,436口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	661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	2,466,143円																																																											
第217期 自 2023年 1月20日 至 2023年 2月20日	第223期 自 2023年 7月20日 至 2023年 8月21日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>2,922,696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>9,268,067円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>80,731,097円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>92,921,860円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,518,874,943口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>368円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,518,874円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,922,696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	9,268,067円	分配準備積立金額	D	80,731,097円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,921,860円	当ファンドの期末残存口数	F	2,518,874,943口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	368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	2,518,874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>2,164,422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>9,287,261円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>150,738,400円</td></tr> <tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>162,190,083円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,456,679,525口</td></tr> <tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F × 10,000</td><td>660円</td></tr> <tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F × H/10,000</td><td>2,456,679円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,164,422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	9,287,261円	分配準備積立金額	D	150,738,400円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	162,190,083円	当ファンドの期末残存口数	F	2,456,679,525口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	660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	2,456,679円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,922,696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	9,268,067円																																																											
分配準備積立金額	D	80,731,097円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,921,860円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,518,874,943口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	368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	2,518,874円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,164,422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	9,287,261円																																																											
分配準備積立金額	D	150,738,400円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	162,190,083円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,456,679,525口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	660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	2,456,679円																																																											
第218期 自 2023年 2月21日 至 2023年 3月20日	第224期 自 2023年 8月22日 至 2023年 9月19日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>516,600円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	516,600円	<table border="1"> <thead> <tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr> </thead> <tbody> <tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>3,415,051円</td></tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,415,051円																																																
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	516,600円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	3,415,051円																																																											

第37特定期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月19日			第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日		
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	52,608,872円
収益調整金額	C	9,277,250円	収益調整金額	C	9,292,438円
分配準備積立金額	D	80,951,814円	分配準備積立金額	D	149,321,537円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	90,745,664円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	214,637,898円
当ファンドの期末残存口数	F	2,514,022,011口	当ファンドの期末残存口数	F	2,439,458,858口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	360円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	879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	160円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,514,022円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	39,031,341円
第219期 自 2023年 3月21日 至 2023年 4月19日			第225期 自 2023年 9月20日 至 2023年10月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,132,012円	費用控除後の配当等収益額	A	7,429,489円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,294,166円	収益調整金額	C	9,859,784円
分配準備積立金額	D	78,797,366円	分配準備積立金額	D	165,335,157円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,223,544円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	182,624,430円
当ファンドの期末残存口数	F	2,509,951,195口	当ファンドの期末残存口数	F	2,433,458,342口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	395円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	750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	2,509,951円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,433,458円
第220期 自 2023年 4月20日 至 2023年 5月19日			第226期 自 2023年10月20日 至 2023年11月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,392,321円	費用控除後の配当等収益額	A	3,903,756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	27,303,723円
収益調整金額	C	9,299,275円	収益調整金額	C	9,831,990円
分配準備積立金額	D	87,068,806円	分配準備積立金額	D	169,027,456円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,760,402円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	210,066,925円
当ファンドの期末残存口数	F	2,500,979,723口	当ファンドの期末残存口数	F	2,415,475,388口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	398円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	869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	2,500,979円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,415,475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38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20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38特定期間 (2023年11月20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

	第38特定期間 (2023年11月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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>

（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37特定期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月19日	第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,573,995,473円	2,500,979,723円
期中追加設定元本額	5,081,944円	13,193,122円
期中一部解約元本額	78,097,694円	98,697,457円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第37特定期間 (2023年 5月19日現在)	第38特定期間 (2023年11月20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	80,593,012	112,692,510
合計	80,593,012	112,692,510

（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	312,133,505	759,639,311	
	外国債券インデックス マザーファンド	523,477,998	1,781,238,583	
合計		835,611,503	2,540,877,894	

(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

	2023年11月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,056,853,181
コール・ローン	1,661,302,150
国債証券	297,342,136,793
派生商品評価勘定	7,865,174
未収入金	750,887,927
未収利息	1,928,235,868
前払費用	158,997,851
差入委託証拠金	212,279,289
流動資産合計	303,118,558,233
資産合計	303,118,558,233
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,540,463
前受金	7,065,250
未払金	1,266,790
未払解約金	1,248,560,491
未払利息	1,181
流動負債合計	1,258,434,175
負債合計	1,258,434,175
純資産の部	
元本等	
元本	88,713,199,804
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	213,146,924,254
元本等合計	301,860,124,058
純資産合計	301,860,124,058
負債純資産合計	303,118,558,233

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。 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 債券先物取引 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、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 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>

2023年11月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。 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。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年11月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,713,199,804口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3,4027円 (34,027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

2023年11月20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、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、並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

2023年11月20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。
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	2023年11月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月20日
期首元本額	88,603,428,553円
期中追加設定元本額	7,443,506,872円
期中一部解約元本額	7,333,735,621円
期末元本額	88,713,199,804円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,154,181,349円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	523,477,998円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,473,867,702円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,224,653円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,556,473,270円
世界経済インデックスファンド	18,888,613,837円
DCマイセレクション25	1,971,950,768円
DCマイセレクション50	1,772,032,620円
DCマイセレクション75	1,361,809,610円
DC外国債券インデックス・オープン	2,249,932,928円
DCマイセレクションS25	1,059,352,606円
DCマイセレクションS50	965,293,822円
DCマイセレクションS75	533,410,849円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,278,397円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	99,598,939円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,645,237円
DC世界経済インデックスファンド	13,757,438,586円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	645,157,684円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	913,708円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,011,151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）	15,969,072円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	29,577,182円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	51,554,161円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	54,953,177円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,048,914円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	854,525,624円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	382,867,468円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,560,437,846円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,388,370円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,095,201円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	365,159,019円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	132,919,969円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	180,852,899円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	641,969,049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）	1,501,552,460円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705円
外国債券ファンド・シリーズ1	781,076,246円
分散投資コア戦略ファンドA	502,636,014円
分散投資コア戦略ファンドS	1,323,423,963円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	693,068,215円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,384,054,415円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,164,889円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,733,809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）	1,298,039,218円
SMT インデックスバランス・オープン	174,786,219円
SMT 世界経済インデックス・オープン	367,654,965円

区分	2023年11月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	485,452,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	774,450,708円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,704,630円
グローバル経済コア	793,386,734円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,525,711円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,595,310円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	53,215,137円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	71,480,505円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	35,254,649円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	43,178,033円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	387,549,423円
10資産分散投資ファンド	26,122,257円
グローバル10資産バランスファンド	2,037,588円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,245,769,215円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	183,039,272円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	488,925,566円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	125,551,870円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	128,036,027円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年11月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,221,570,996
合計		3,221,570,996

(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

（2023年11月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,493,810,476	-	1,500,875,726	7,065,250
合計		1,493,810,476	-	1,500,875,726	7,065,250

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2023年11月20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	1,631,771,343	-	1,631,074,110	697,233
	アメリカドル	812,409,367	-	811,061,181	1,348,186
	カナダドル	66,484,120	-	66,408,687	75,433

	ユーロ	527,695,632	-	528,276,492	580,860
	イギリスポンド	92,820,416	-	92,990,850	170,434
	オフショア人民元	132,361,808	-	132,336,900	24,908
	売建	994,308,660	-	994,351,966	43,306
	アメリカドル	494,670,000	-	494,680,890	10,890
	カナダドル	19,660,860	-	19,659,474	1,386
	ユーロ	341,675,290	-	341,716,463	41,173
	イギリスポンド	52,255,280	-	52,257,324	2,044
	オーストラリアドル	16,584,180	-	16,582,820	1,360
	イスラエルシェケル	2,014,500	-	2,015,870	1,370
	オフショア人民元	67,448,550	-	67,439,125	9,425
	合計	2,626,080,003	-	2,625,426,076	740,539

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,626,923.83	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,522,050.78	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,802,789.05	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,832,563.47	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,753,906.25	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,292,804.69	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,268,593.76	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,479,843.76	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,727,744.12	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,619,859.75	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,742,597.66	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,648,359.36	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,088,671.87	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,785,248.85	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,562,738.28	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,041,376.94	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,030,187.50	

T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,012,969.90
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,419,091.82
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,585,937.50
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,142,433.57
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,187,812.48
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,301,861.35
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,144,726.55
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,212,312.51
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,291,406.25
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,473,945.32
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,637,949.19
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,625,468.76
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,645,355.85
T 0.75% 11/15/24	2,750,000.00	2,631,425.00
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,263,906.24
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,612,888.66
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,793,691.46
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,492,007.80
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,262,007.81
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,079,150.38
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,958,750.00
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,001,351.95
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,018,640.61
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,348,720.08
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,397,475.00
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,963,750.00
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,675,381.82
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,209,921.86
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,795,898.46
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,316,217.18
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,169,072.23
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,341,289.08
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,450,282.62
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,824,375.00
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,842,318.33
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,039,162.50
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,001,100.00
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,630,703.14
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,210,267.57
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,455,546.86
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,433,789.06
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,893,261.70

T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,469,047.13
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,503,173.80
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,228,453.10
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	9,994,433.77
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,901,517.94
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,799,990.21
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,569,875.00
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,692,712.88
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,379,394.93
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,245,312.50
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	2,010,093.75
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	2,978,198.44
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,583,046.86
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,645,422.64
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,205,667.94
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,773,859.40
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,674,218.76
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,824,469.90
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,877,519.52
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,975,019.54
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,647,584.40
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,053,199.19
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,379,640.61
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,163,993.17
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,691,699.20
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,085,156.25
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,522,252.32
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,943,336.49
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,058,344.52
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,476,601.59
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,124,815.77
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,856,676.06
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,182,578.13
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,021,265.62
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,227,031.25
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,877,392.58
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,409,808.60
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,460,148.44
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,871,471.69
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,397,496.49
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,268,370.10
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,666,361.32
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,844,824.20

T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,944,058.99	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,673,608.40	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,650,287.13	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	987,585.93	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,478,766.80	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,051,598.81	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,013,525.37	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,250,000.00	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,563,783.57	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,110,305.63	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,217,949.23	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,310,185.54	
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,303,876.93	
T 2.75% 08/15/42	7,600,000.00	5,679,218.71	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,870,041.97	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,641,250.00	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,484,076.94	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,160,198.24	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,877,421.88	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,044,572.27	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,402,563.30	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	8,968,089.86	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,076,303.70	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,397,550.00	
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,803,000.00	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,700,177.33	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,274,232.01	
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,658,085.89	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,696,115.24	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	686,420.31	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,656,875.00	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,140,601.92	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,634,047.85	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,280,734.37	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,620,614.24	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,985,417.97	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,111,253.91	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	839,323.24	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	2,996,359.35	
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,238,620.34	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,888,421.82	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,430,492.19	

T 3.125% 08/31/27	8,850,000.00	8,419,081.02
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,654,806.65
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,894,687.50
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,359,068.34
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,815,605.48
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,152,843.75
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,443,097.08
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,892,738.28
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,213,810.52
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,785,625.00
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,388,000.00
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	675,283.98
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,827,330.08
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,029,781.25
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,020,686.51
T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,093,828.12
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	3,988,757.83
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,737,328.13
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,589,726.57
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,374,443.33
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,677,492.17
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,306,727.54
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,426,194.52
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,862,599.25
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,193,000.00
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	742,207.03
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	740,878.91
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,912,483.40
T 3% 05/15/45	700,000.00	529,238.28
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,391,387.30
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,683,431.63
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,408,935.55
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,858,359.38
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,056,855.47
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,825,000.00
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,126,304.68
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,731,333.99
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,005,937.50
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,055,437.50
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,640,703.16
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	860,308.59
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,816,714.86
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	698,403.90

	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	982,265.62
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,827,859.37
	T 4.375% 05/15/41	650,000.00	621,714.84
	T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,952,187.50
	T 4.375% 11/15/39	960,000.00	927,562.50
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,099,282.02
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	545,703.12
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,669,054.69
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,370,701.17
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	752,182.62
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,391,201.18
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,031,921.84
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,380,621.06
	T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,024,265.66
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	420,750.00
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,343,417.97
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,063,115.22
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,741,769.52
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,533,714.85
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,152,251.95
	アメリカドル 小計	1,091,200,000.00	946,716,978.28 (141,960,210,893)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,082,034.66
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,806,539.68
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,530,398.21
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,378,950.76
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,720,594.40
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,101,397.27
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,398,648.68
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	851,887.57
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,222,068.65
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,067,076.41
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,959,102.90
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	733,234.01
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,404,940.20
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,236,314.07
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	222,656.70
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,087,889.58
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	295,984.74
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,533,099.85
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	913,529.35
	CAN 2.75% 12/01/55	620,000.00	528,793.64

	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	522,291.86
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	380,027.05
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,330,800.61
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,666,410.98
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,018,851.02
	CAN 3.25% 12/01/33	760,000.00	733,079.36
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,142,592.69
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,036,061.14
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,005,465.84
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,301,159.09
	CAN 3% 10/01/25	960,000.00	934,412.13
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,122,973.15
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	774,091.96
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,638,697.72
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,883,579.46
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	714,595.16
	カナダドル 小計	58,750,000.00	53,280,230.55 (5,820,865,187)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,920,044.00
	MBONO 10% 12/05/24	21,760,000.00	21,587,281.52
	MBONO 5.5% 03/04/27	30,850,000.00	27,397,885.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,034,201.95
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,423,508.80
	MBONO 7.5% 05/26/33	20,330,000.00	17,920,285.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,603,014.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	39,030,000.00	35,650,392.30
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,157,711.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,861,543.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	26,700,000.00	25,774,845.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,687,526.70
	MBONO 8% 07/31/53	16,550,000.00	14,110,364.50
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,094,254.00
	メキシコペソ 小計	343,100,000.00	313,222,858.97 (2,726,417,053)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,048,610.29
	BGB 0.35% 06/22/32	1,370,000.00	1,087,436.13
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	309,633.91
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	168,047.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,060,000.00	1,985,397.10
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,405,846.24
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,463,119.04
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,467,114.10
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	698,596.86

BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,314,970.52
BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	738,569.97
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	621,650.40
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	629,568.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	731,207.52
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	732,847.87
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	532,829.05
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,390,289.74
BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,348,055.28
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	613,959.28
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	489,992.44
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	363,717.52
BGB 3.3% 06/22/54	810,000.00	743,884.87
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	427,430.96
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	943,326.99
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,102,851.00
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	929,231.10
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,010,043.50
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,178,734.92
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,153,005.84
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,262,782.28
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,093,931.08
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,372,909.95
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,614,633.99
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	795,548.00
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,361,006.94
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,457,060.64
BTPS 0.35% 02/01/25	1,260,000.00	1,212,701.24
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,751,427.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,790,237.27
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,127,785.10
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,456,426.00
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,170,651.71
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,354,670.48
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	663,963.90
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,802,988.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,845,715.60
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,353,404.35
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,692,410.22
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,064,697.60
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,943,240.60
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	722,153.25
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,357,151.40

BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	816,850.28
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,563,719.53
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,591,148.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	848,641.84
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,232,118.03
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,929,011.05
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	726,325.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,337,032.93
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,031,373.00
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,591,608.73
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,184,984.20
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	752,328.00
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	439,610.82
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,629,130.40
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,601,038.16
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,389,872.16
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	321,915.80
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	619,211.40
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,181,319.32
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,611,953.95
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,894,039.40
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	674,488.75
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,630,232.26
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,917,729.95
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,679,573.53
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,699,397.92
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	807,168.69
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	547,413.22
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,483,526.76
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,364,358.72
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	976,514.74
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,121,995.36
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,128,159.16
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,172,332.12
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,601,766.90
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,822,646.56
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,016,001.28
BTPS 3.4% 04/01/28	1,200,000.00	1,189,776.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,500,728.32
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	910,606.06
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,318,310.60
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	296,413.39

BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,359,865.26
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,282,613.22
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,861,251.24
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,106,012.50
BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	238,029.60
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	473,811.23
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	406,709.60
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	818,808.40
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,124,404.04
BTPS 4.5% 10/01/53	860,000.00	820,214.68
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,756,634.50
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,505,202.00
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,715,322.56
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	851,053.47
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,248,933.72
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,787,602.00
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,920,745.86
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,554,890.02
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,184,305.50
BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	3,982,586.53
BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,347,064.24
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,989,210.50
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,291,081.92
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,544,926.60
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,798,639.96
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,705,238.54
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,884,166.35
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,979,022.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,849,010.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,251,384.96
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	324,766.40
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	834,018.61
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	947,115.15
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,986,468.50
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,756,854.12
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,594,592.72
DBR 0% 08/15/26	1,550,000.00	1,440,566.90
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,566,786.15
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,996,362.60
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,258,932.94
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,755,975.92
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,124,006.54
DBR 0% 08/15/52	3,100,000.00	1,422,419.50

DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,190,547.70
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,762,027.59
DBR 1.25% 08/15/48	3,330,000.00	2,428,485.75
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,958,916.56
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,905,066.24
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,505,483.01
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,347,170.19
DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,766,449.61
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,537,668.54
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,637,803.00
DBR 2.5% 08/15/46	2,820,000.00	2,672,176.30
DBR 2.6% 08/15/33	1,440,000.00	1,441,957.52
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,936,566.75
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,772,520.76
DBR 4.25% 07/04/39	1,590,000.00	1,876,048.95
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,568,016.45
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,544,527.82
DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,484,595.08
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,701,015.60
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,641,433.54
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,515,427.62
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,042,189.85
FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	3,965,839.02
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,450,794.12
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,235,053.50
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,480,325.25
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,695,224.55
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	345,180.92
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	829,642.71
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,304,878.52
FRTR 0.75% 05/25/28	6,010,000.00	5,479,930.02
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,467,148.20
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,540,885.52
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,911,343.52
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,150,068.03
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,761,232.94
FRTR 0% 02/25/27	3,040,000.00	2,770,093.60
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,589,283.80
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,545,404.64
FRTR 0% 11/25/29	4,450,000.00	3,752,373.50
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,308,108.00
FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,861,667.23

FRTR 1.25% 05/25/34	3,860,000.00	3,201,875.89
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,518,218.95
FRTR 1.25% 05/25/38	1,800,000.00	1,355,794.92
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,675,199.98
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,854,123.32
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	921,715.88
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,343,679.60
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,088,448.00
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,662,083.65
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,487,024.73
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,439,641.49
FRTR 2.5% 05/25/43	1,020,000.00	868,532.04
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,101,110.47
FRTR 2.75% 02/25/29	970,000.00	962,948.10
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,315,864.15
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,128,383.40
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,660,950.68
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,939,207.04
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,787,824.25
FRTR 3% 05/25/33	3,690,000.00	3,659,764.14
FRTR 3% 05/25/54	1,650,000.00	1,452,543.16
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,894,117.84
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,786,843.56
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,068,278.81
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,911,194.18
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,940,313.75
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,681,803.36
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,335,039.88
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,003,403.70
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	611,862.09
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	649,662.78
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	375,151.55
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	511,588.08
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	227,969.28
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	708,916.97
IRISH 0% 10/18/31	950,000.00	757,423.60
IRISH 1.1% 05/15/29	940,000.00	857,893.82
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	370,426.94
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	422,884.00
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	528,221.60
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	480,798.54
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	954,175.40
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	767,058.40

IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	765,478.00	
IRISH 3% 10/18/43	420,000.00	403,161.25	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,193,274.83	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,823,694.74	
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	827,893.65	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,560,000.00	1,058,268.12	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,830,000.00	1,720,763.26	
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	838,911.91	
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	837,972.54	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,554,419.14	
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,117,415.95	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,687,250.56	
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,400,654.92	
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	625,569.60	
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	770,920.92	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,126,833.38	
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,271,623.50	
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	393,818.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,506,523.11	
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	714,884.69	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,757,071.20	
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	576,014.40	
NETHER 3.25% 01/15/44	510,000.00	525,313.77	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,859,584.10	
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,832,132.04	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,691,646.03	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,874,622.13	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,196,767.81	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,335,501.65	
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,378,998.45	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,784,030.99	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,388,965.61	
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,366,079.60	
OBL 2.4% 10/19/28	2,970,000.00	2,952,978.93	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	491,127.12	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,245,199.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,125,801.36	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	115,115.37	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	805,639.12	
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	398,036.38	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,324,389.49	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	95,651.25	

RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,035,348.81
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,064,115.20
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,343,329.63
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	984,552.52
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	633,247.99
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	331,906.74
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,149,372.21
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	753,588.36
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	148,527.75
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	339,599.60
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	444,288.00
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	679,235.80
RAGB 2.9% 02/20/33	1,000,000.00	980,623.00
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	219,989.00
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	676,325.30
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	417,058.84
RAGB 3.45% 10/20/30	120,000.00	123,066.12
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	454,942.74
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,706,833.35
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,113,020.42
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,314,901.14
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	299,708.20
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	198,018.04
RFGB 0.125% 09/15/31	460,000.00	368,200.56
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	181,914.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	585,963.39
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	291,711.70
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	494,484.48
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	651,798.75
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	462,856.42
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	486,651.75
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	423,041.74
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	424,013.74
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	524,272.64
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	304,285.33
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	332,907.40
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	352,715.42
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	501,556.96
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	469,024.92
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	372,029.60
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	547,438.65
RFGB 2.875% 04/15/29	210,000.00	209,636.70
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	455,009.92

RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	587,119.32
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,737,736.88
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,703,818.31
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,060,872.72
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,048,966.98
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,766,428.40
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,242,286.80
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,407,561.75
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	996,158.00
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,189,376.47
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,481,194.80
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,633,929.09
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,133,401.49
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,907,985.32
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,386,658.24
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,741,009.09
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,963,535.76
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,014,465.25
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,895,553.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,459,623.02
SPGB 1.45% 10/31/27	3,160,000.00	2,963,776.64
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	290,493.72
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,420,194.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,413,597.75
SPGB 1.85% 07/30/35	1,850,000.00	1,527,694.42
SPGB 1.9% 10/31/52	1,610,000.00	995,496.81
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,233,728.51
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,861,714.82
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	538,895.00
SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	935,920.40
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,539,503.75
SPGB 2.35% 07/30/33	1,550,000.00	1,400,702.00
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,841,063.40
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,332,443.67
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,339,166.25
SPGB 2.8% 05/31/26	1,270,000.00	1,257,233.96
SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,611,594.32
SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,647,992.96
SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	665,856.36
SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,159,353.18
SPGB 3.55% 10/31/33	2,090,000.00	2,083,614.21
SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,018,510.58

	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,029,530.75
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,901,038.70
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,043,278.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,914,841.85
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,421,598.34
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,632,077.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,354,894.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,467,412.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,031,698.85
	ユーロ 小計	659,150,000.00	599,491,686.16 (98,040,870,354)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,153,969.99
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,284,967.11
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,809,812.56
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,041,172.00
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,312,584.03
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,514,664.00
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,824,276.32
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	524,001.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,321,011.72
	UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	1,636,257.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	428,160.50
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	795,637.72
	UKT 0.875% 07/31/33	2,190,000.00	1,625,702.70
	UKT 0.875% 10/22/29	1,110,000.00	931,557.73
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,304,311.68
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	390,625.62
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	860,369.40
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,182,170.00
	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,225,714.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,493,072.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	955,825.00
	UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	582,882.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	959,446.74
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	702,843.40
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	556,719.28
	UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	632,691.21
	UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	835,848.00
	UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,380,456.00
	UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,110,937.32
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	915,320.64
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,279,578.28
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,584,161.64

	UKT 3.25% 01/31/33	3,260,000.00	3,049,606.12
	UKT 3.5% 01/22/45	1,660,000.00	1,422,288.99
	UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,275,195.63
	UKT 3.5% 10/22/25	1,520,000.00	1,491,348.00
	UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,310,205.84
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,156,280.40
	UKT 3.75% 10/22/53	2,070,000.00	1,804,212.00
	UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,330,481.00
	UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,886,598.00
	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,526,145.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,240,549.20
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,194,882.42
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,409,484.68
	UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,692,219.12
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,536,146.08
	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,628,069.60
	UKT 4.5% 06/07/28	660,000.00	670,717.34
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,425,726.33
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,795,826.88
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,529,495.70
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,451,358.44
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,153,356.50
	UKT 4% 10/22/63	1,000,000.00	919,700.00
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,185,428.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,471,243.50
	イギリスポンド 小計	98,390,000.00	80,713,311.36 (15,068,368,097)
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,723,693.27
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,911,110.50
	SGB 0.75% 11/12/29	5,540,000.00	4,974,139.19
	SGB 1.75% 11/11/33	3,260,000.00	3,007,168.22
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,557,874.43
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,346,554.44
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,635,776.40
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,681,883.00
	スウェーデンクローナ 小計	45,220,000.00	42,838,199.45 (610,444,342)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,091,200.00
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,505,373.60
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,882,964.20
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,969,795.78
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,076,425.50

	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,836,900.00
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,222,788.26
	NGB 2% 04/26/28	3,070,000.00	2,860,779.50
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,888,863.48
	NGB 3% 08/15/33	4,460,000.00	4,222,505.00
ノルウェークローネ 小計		40,720,000.00	37,557,595.32 (520,923,847)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,526,589.34
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,299,809.37
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,379,065.40
	DGB 0% 11/15/24	4,050,000.00	3,920,169.15
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,279,415.00
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,408,142.56
	DGB 2.25% 11/15/33	1,810,000.00	1,720,405.00
	DGB 4.5% 11/15/39	9,900,000.00	11,804,342.22
デンマーククローネ 小計		46,980,000.00	43,337,938.04 (950,400,981)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,964,166.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,344,979.56
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,210,855.00
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,350,690.39
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,576,737.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,042,159.99
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,899,471.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,261,292.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,901,926.60
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,348,783.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	611,866.80
	POLGB 6% 10/25/33	2,380,000.00	2,474,467.91
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,932,829.66
	ポーランドズロチ 小計		44,690,000.00
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,689,860.46
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,943,963.80
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,094,900.50
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,897,264.50
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,961,110.27
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	914,932.19
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,459,355.98
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,150,186.60
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,366,948.58
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,367,640.90
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,107,303.72

	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,014,268.83
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,010,098.59
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,834,899.53
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,556,575.40
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,347,235.10
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,041,970.19
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,605,127.84
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	942,871.09
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,325,075.74
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,062,231.39
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,800,000.00	1,691,520.45
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,007,005.05
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,624,258.34
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,660,000.00	1,666,003.55
	ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,021,673.38
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,052,187.08
	ACGB 4.75% 06/21/54	670,000.00	665,672.53
	オーストラリアドル 小計	50,190,000.00	44,422,141.58 (4,334,268,353)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	533,967.02
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	603,031.55
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	793,525.84
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	281,442.49
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	822,970.39
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	489,168.71
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	393,451.82
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	426,150.85
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,040,496.89
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	597,038.01
	NZGB 4.25% 05/15/34	380,000.00	359,424.71
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	834,027.03
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	482,609.31
		ニュージーランドドル 小計	8,910,000.00
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	748,240.60
	SIGB 1.25% 11/01/26	760,000.00	720,100.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	509,040.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	616,000.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	338,979.90
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	613,620.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	600,600.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	884,970.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	435,396.25

	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	710,280.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	350,640.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	615,040.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	611,789.85
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	647,595.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	419,160.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	626,094.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	858,863.25
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	749,842.00
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	509,600.00
	シンガポールドル 小計	12,060,000.00	11,565,850.85 (1,290,401,979)
マレーシアリングgit	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,515,073.31
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,503,832.82
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	690,211.26
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,931,154.71
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,219,591.54
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,739,150.98
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,871,229.02
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,379,411.48
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,163,440.66
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,140,175.65
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,989,216.16
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,490,394.29
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	605,947.44
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,703,741.05
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,916,822.13
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,537,818.95
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,784,646.32
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,567,345.25
	MGS 4.457% 03/31/53	490,000.00	499,030.50
	MGS 4.498% 04/15/30	1,610,000.00	1,667,724.61
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	360,994.09
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	925,820.15
	MGS 4.696% 10/15/42	1,750,000.00	1,855,334.60
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,030,294.18
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,972,659.28
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,009,228.29
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,816,310.66
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,118,123.40
	マレーシアリングgit 小計	47,410,000.00	48,004,722.78 (1,536,904,803)

イスラエルシェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,992,605.67
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,399,120.54
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,306,394.31
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,228,815.65
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,218,185.50
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,194,636.33
	ILGOV 1% 03/31/30	2,720,000.00	2,251,722.08
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,496,135.15
	ILGOV 2.8% 11/29/52	740,000.00	496,552.65
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,507,964.96
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,630,000.00	2,219,743.40
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,056,342.68
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,426,396.90
	イスラエルシェケル 小計		25,190,000.00
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	52,570,000.00	52,298,282.49
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,059,670.84
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,060,610.94
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	31,968,362.88
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,168,048.49
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,351,669.90
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,066,485.52
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,901,798.29
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,443,733.64
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,288,590.29
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,553,766.75
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,011,520.00
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,466,762.64
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,095,484.72
	CGB 2.52% 08/25/33	11,500,000.00	11,381,698.12
	CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	31,846,491.79
	CGB 2.6% 09/15/30	10,500,000.00	10,473,554.28
	CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,140,631.10
	CGB 2.62% 06/25/30	21,400,000.00	21,382,842.97
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,008,536.00
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,598,574.93
	CGB 2.67% 05/25/33	13,000,000.00	12,999,524.46
	CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,594,327.30
	CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,179,873.72
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,254,297.16
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,577,624.30
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,693,830.78
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,779,848.75	

	CGB 2.79% 12/15/29	15,000,000.00	15,139,369.50	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,375,230.12	
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,192,466.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,651,333.24	
	CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,448,014.43	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,539,589.38	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,604,911.09	
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,731,136.32	
	CGB 2% 06/15/25	16,600,000.00	16,514,593.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	12,888,952.06	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,313,474.71	
	CGB 3.02% 10/22/25	4,270,000.00	4,335,652.53	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,135,061.12	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,526,366.24	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,600,000.00	6,903,180.24	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,174,535.19	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,615,128.12	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,506,988.90	
	CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	17,911,450.35	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,165,025.96	
	CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	15,256,023.04	
	CGB 3.81% 09/14/50	18,020,000.00	20,607,724.25	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,752,880.66	
	CGB 4.08% 10/22/48	13,110,000.00	15,528,464.62	
	オフショア人民元 小計	1,012,830,000.00	1,028,463,994.12 (21,349,061,282)	
	合計		297,342,136,793 (297,342,136,793)	

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 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 207銘柄	100.0%	47.7%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 358銘柄	100.0%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	5.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%

ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券	28銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	52銘柄	100.0%	7.2%

(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

	2023年11月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,058,417,561
株式	584,817,153,820
派生商品評価勘定	287,563,400
未収入金	30,983,700
未収配当金	5,362,457,280
差入委託証拠金	282,802,589
流動資産合計	593,839,378,350
資産合計	593,839,378,350
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,182,650
前受金	282,485,800
未払解約金	285,994,908
未払利息	2,175
流動負債合計	573,665,533
負債合計	573,665,533
純資産の部	
元本等	
元本	243,768,698,223
剰余金	
剰余金又は欠損金()	349,497,014,594
元本等合計	593,265,712,817
純資産合計	593,265,712,817
負債純資産合計	593,839,378,350

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月20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。

2023年11月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年11月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,768,698,223口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,4337円 (24,337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

2023年11月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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、並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、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年11月20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。
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	2023年11月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月20日
期首元本額	256,468,923,145円
期中追加設定元本額	12,668,766,628円
期中一部解約元本額	25,368,991,550円
期末元本額	243,768,698,223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）	312,133,505円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,456,696,446円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,123,646円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,088,619,178円
世界経済インデックスファンド	5,146,222,596円
日本株式インデックス・オープン	2,984,006,539円
DCマイセクション25	5,386,708,253円
DCマイセクション50	17,343,403,847円
DCマイセクション75	18,592,025,022円
DC日本株式インデックス・オープン	6,031,056,838円
DCマイセクションS25	3,178,764,225円
DCマイセクションS50	9,557,201,654円
DCマイセクションS75	8,198,780,347円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,136,958,910円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,985,592円
DCターゲット・イヤーフンド2035	618,818,399円
DCターゲット・イヤーフンド2045	484,939,876円
DC世界経済インデックスファンド	3,771,500,616円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	878,224,281円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,789,509円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,000,727円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,704,323円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	146,079,341円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,043,492円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,358,838円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	70,516,841円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,387,263円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	46,566,578円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	515,425,735円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	322,306,695円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,165,707,850円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	29,983,810円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,709,949円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	336,923,061円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	184,132,069円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	250,767,907円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	20,204,568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）	420,084,939円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,922,601,704円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	591,424,139円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	406,077,221円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,225,158,969円

区分	2023年11月20日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	200,832,770円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,778,514円
SMT インデックスバランス・オープン	49,352,178円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,637,402,945円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,063,098円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	214,549,267円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,996,916円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,089,128円
グローバル経済コア	217,494,160円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,720,100円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,229,953,422円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,773,557円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	964,175,269円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	240,247,924円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	52,466,000円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	49,982,774円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,517,346円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	24,205,054円
10資産分散投資ファンド	92,848,595円
グローバル10資産バランスファンド	2,856,307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）	42,174,446,024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）	496,310,076円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,088,835円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,124,196円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	437,099,410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）	47,038,358,652円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,860,409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）	210,824,141円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年11月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		51,655,360,419
合計		51,655,360,419

(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

（2023年11月20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	6,658,684,200	-	6,941,170,000	282,485,800
	合計	6,658,684,200	-	6,941,170,000	282,485,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,200	3,730.00	34,316,000	
ニッスイ	243,200	705.80	171,650,560	
マルハニチロ	36,100	2,733.50	98,679,350	
雪国まいたけ	20,700	934.00	19,333,800	
カネコ種苗	7,400	1,415.00	10,471,000	
サカタのタネ	27,700	4,015.00	111,215,500	
ホクト	19,500	1,736.00	33,852,000	
ホクリヨウ	2,300	1,116.00	2,566,800	
住石ホールディングス	25,100	632.00	15,863,200	
日鉄鉱業	9,800	5,370.00	52,626,000	
三井松島ホールディングス	14,400	2,760.00	39,744,000	
I N P E X	899,300	2,097.00	1,885,832,100	
石油資源開発	28,200	5,590.00	157,638,000	
K & O エナジーグループ	11,000	2,177.00	23,947,000	
ショーボンドホールディングス	33,100	5,974.00	197,739,400	
ミライト・ワン	80,400	1,830.00	147,132,000	
タマホーム	15,300	3,630.00	55,539,000	
サンヨーホームズ	2,000	717.00	1,434,000	
日本アクア	6,700	905.00	6,063,500	
ファーストコーポレーション	4,100	753.00	3,087,300	
ベステラ	3,500	1,039.00	3,636,500	
キャンディル	2,900	579.00	1,679,100	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	999.00	3,296,700	
第一カッター興業	6,200	1,290.00	7,998,000	
安藤・間	140,900	1,084.00	152,735,600	
東急建設	76,200	785.00	59,817,000	
コムシスホールディングス	77,600	3,184.00	247,078,400	
ピーアールホールディングス	38,500	352.00	13,552,000	
高松コンストラクショングループ	18,100	2,666.00	48,254,600	
東建コーポレーション	7,000	8,040.00	56,280,000	
ソネック	1,700	953.00	1,620,100	
ヤマウラ	12,300	1,424.00	17,515,200	
オリエンタル白石	90,000	327.00	29,430,000	
大成建設	159,200	5,375.00	855,700,000	
大林組	608,300	1,276.00	776,190,800	
清水建設	482,300	977.50	471,448,250	
飛鳥建設	18,700	1,288.00	24,085,600	
長谷工コーポレーション	156,100	1,811.50	282,775,150	
松井建設	15,900	768.00	12,211,200	

銭高組	1,400	3,525.00	4,935,000
鹿島建設	377,200	2,284.50	861,713,400
不動テトラ	11,800	2,063.00	24,343,400
大末建設	4,100	1,304.00	5,346,400
鉄建建設	12,200	1,981.00	24,168,200
西松建設	32,400	3,686.00	119,426,400
三井住友建設	126,600	399.00	50,513,400
大豊建設	5,900	3,695.00	21,800,500
佐田建設	7,200	615.00	4,428,000
ナカノフドー建設	8,000	391.00	3,128,000
奥村組	27,600	4,495.00	124,062,000
東鉄工業	21,100	2,864.00	60,430,400
イチケン	2,500	2,259.00	5,647,500
富士ピー・エス	5,100	445.00	2,269,500
浅沼組	12,600	3,650.00	45,990,000
戸田建設	230,200	872.00	200,734,400
熊谷組	28,500	3,460.00	98,610,000
北野建設	2,100	3,110.00	6,531,000
植木組	3,200	1,430.00	4,576,000
矢作建設工業	23,100	1,268.00	29,290,800
ピーエス三菱	21,600	932.00	20,131,200
日本ハウスホールディングス	36,300	334.00	12,124,200
新日本建設	23,900	1,102.00	26,337,800
東亜道路工業	6,800	6,610.00	44,948,000
日本道路	20,000	1,884.00	37,680,000
東亜建設工業	13,100	3,690.00	48,339,000
日本国土開発	48,400	600.00	29,040,000
若築建設	5,900	2,929.00	17,281,100
東洋建設	42,800	1,246.00	53,328,800
五洋建設	241,100	798.70	192,566,570
世紀東急工業	21,800	1,587.00	34,596,600
福田組	6,400	5,150.00	32,960,000
住友林業	147,000	3,804.00	559,188,000
日本基礎技術	6,800	449.00	3,053,200
巴コーポレーション	12,700	560.00	7,112,000
大和ハウス工業	470,400	4,244.00	1,996,377,600
ライト工業	35,000	1,961.00	68,635,000
積水ハウス	515,900	3,021.00	1,558,533,900
日特建設	16,200	1,025.00	16,605,000
北陸電気工事	11,700	945.00	11,056,500
ユアテック	37,500	965.00	36,187,500
日本リーテック	14,900	1,259.00	18,759,100

四電工	7,100	2,839.00	20,156,900
中電工	26,400	2,397.00	63,280,800
関電工	106,500	1,314.00	139,941,000
きんでん	119,700	2,217.00	265,374,900
東京エネシス	16,900	953.00	16,105,700
トーエネック	5,600	4,035.00	22,596,000
住友電設	16,200	2,527.00	40,937,400
日本電設工業	31,900	1,979.00	63,130,100
エクシオグループ	85,500	3,143.00	268,726,500
新日本空調	11,000	2,175.00	23,925,000
九電工	36,800	4,401.00	161,956,800
三機工業	37,500	1,735.00	65,062,500
日揮ホールディングス	168,300	1,660.50	279,462,150
中外炉工業	5,600	2,150.00	12,040,000
ヤマト	9,400	924.00	8,685,600
太平電業	10,600	3,835.00	40,651,000
高砂熱学工業	45,600	2,975.00	135,660,000
三晃金属工業	1,400	4,675.00	6,545,000
朝日工業社	7,900	2,719.00	21,480,100
明星工業	32,900	1,113.00	36,617,700
大気社	19,600	4,240.00	83,104,000
ダイダン	22,400	1,441.00	32,278,400
日比谷総合設備	12,300	2,246.00	27,625,800
フィル・カンパニー	2,600	530.00	1,378,000
テスホールディングス	36,600	445.00	16,287,000
インフロニア・ホールディングス	196,100	1,612.00	316,113,200
東洋エンジニアリング	25,000	674.00	16,850,000
レイズネクスト	24,600	1,356.00	33,357,600
ニッポン	51,100	2,208.00	112,828,800
日清製粉グループ本社	157,900	2,098.50	331,353,150
日東富士製粉	3,000	4,690.00	14,070,000
昭和産業	16,500	3,040.00	50,160,000
鳥越製粉	10,100	698.00	7,049,800
中部飼料	23,600	1,054.00	24,874,400
フィード・ワン	25,000	773.00	19,325,000
東洋精糖	2,100	1,997.00	4,193,700
日本甜菜製糖	9,900	1,972.00	19,522,800
D M三井製糖ホールディングス	16,900	3,005.00	50,784,500
塩水港精糖	13,600	235.00	3,196,000
ウェルネオシュガー	8,800	2,044.00	17,987,200
森永製菓	36,500	5,373.00	196,114,500
中村屋	4,300	3,065.00	13,179,500

江崎グリコ	48,800	4,080.00	199,104,000
名糖産業	6,700	1,613.00	10,807,100
井村屋グループ	10,200	2,291.00	23,368,200
不二家	11,700	2,538.00	29,694,600
山崎製パン	114,300	3,153.00	360,387,900
第一屋製パン	2,200	682.00	1,500,400
モロゾフ	5,500	3,820.00	21,010,000
亀田製菓	9,800	3,845.00	37,681,000
寿スピリッツ	80,700	2,372.00	191,420,400
カルビー	78,200	2,717.50	212,508,500
森永乳業	31,000	5,456.00	169,136,000
六甲バター	12,500	1,391.00	17,387,500
ヤクルト本社	244,100	3,385.00	826,278,500
明治ホールディングス	209,400	3,417.00	715,519,800
雪印メグミルク	41,300	2,203.00	90,983,900
プリマハム	22,900	2,214.00	50,700,600
日本ハム	73,500	4,322.00	317,667,000
林兼産業	3,500	586.00	2,051,000
丸大食品	17,200	1,591.00	27,365,200
S Foods	18,800	3,185.00	59,878,000
柿安本店	6,700	2,457.00	16,461,900
伊藤ハム米久ホールディングス	26,100	3,895.00	101,659,500
サッポロホールディングス	56,200	5,673.00	318,822,600
アサヒグループホールディングス	394,600	5,525.00	2,180,165,000
キリンホールディングス	711,300	2,167.00	1,541,387,100
宝ホールディングス	116,600	1,163.00	135,605,800
オエノンホールディングス	51,000	386.00	19,686,000
養命酒製造	5,600	1,830.00	10,248,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,800	1,919.50	256,829,100
ライフドリンク カンパニー	2,500	3,925.00	9,812,500
サントリー食品インターナショナル	120,200	4,728.00	568,305,600
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,940.00	57,618,000
伊藤園	57,900	4,830.00	279,657,000
キーコーヒー	19,100	2,064.00	39,422,400
ユニカフェ	3,800	961.00	3,651,800
ジャパンフーズ	1,800	1,156.00	2,080,800
日清オイリオグループ	24,100	4,285.00	103,268,500
不二製油グループ本社	39,800	2,426.00	96,554,800
かどや製油	1,400	3,570.00	4,998,000
J - オイルミルズ	19,600	1,931.00	37,847,600
キッコーマン	113,200	9,438.00	1,068,381,600
味の素	405,800	5,633.00	2,285,871,400

ブルドックソース	9,100	2,069.00	18,827,900
キューピー	91,800	2,522.00	231,519,600
ハウス食品グループ本社	58,800	3,350.00	196,980,000
カゴメ	73,400	3,181.00	233,485,400
焼津水産化学工業	4,400	1,177.00	5,178,800
アリアケジャパン	17,000	4,735.00	80,495,000
ピエトロ	1,600	1,826.00	2,921,600
エバラ食品工業	4,600	2,851.00	13,114,600
やまみ	1,100	2,889.00	3,177,900
ニチレイ	78,300	3,207.00	251,108,100
東洋水産	86,300	7,932.00	684,531,600
イトアンドホールディングス	7,800	1,988.00	15,506,400
大冷	1,400	1,920.00	2,688,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,700	1,131.00	8,708,700
日清食品ホールディングス	60,000	14,505.00	870,300,000
永谷園ホールディングス	8,400	2,165.00	18,186,000
一正蒲鉾	4,900	731.00	3,581,900
フジッコ	17,500	1,944.00	34,020,000
ロック・フィールド	19,100	1,619.00	30,922,900
日本たばこ産業	1,037,700	3,758.00	3,899,676,600
ケンコーマヨネーズ	11,800	1,577.00	18,608,600
わらべや日洋ホールディングス	11,400	3,370.00	38,418,000
なとり	10,700	2,012.00	21,528,400
イフジ産業	1,900	1,324.00	2,515,600
ファーマフーズ	24,500	1,409.00	34,520,500
ユーグレナ	106,300	783.00	83,232,900
紀文食品	14,800	1,157.00	17,123,600
ピックルスホールディングス	10,000	1,201.00	12,010,000
ミヨシ油脂	4,400	1,419.00	6,243,600
理研ビタミン	14,800	2,293.00	33,936,400
片倉工業	16,300	1,705.00	27,791,500
ゲンゼ	12,400	4,770.00	59,148,000
東洋紡	75,600	1,040.00	78,624,000
ユニチカ	58,700	189.00	11,094,300
富士紡ホールディングス	7,700	3,585.00	27,604,500
倉敷紡績	13,200	2,485.00	32,802,000
シキボウ	8,000	1,072.00	8,576,000
日本毛織	46,200	1,354.00	62,554,800
トーア紡コーポレーション	4,500	457.00	2,056,500
帝国繊維	19,800	2,001.00	39,619,800
帝人	167,300	1,341.50	224,432,950
東レ	1,164,600	785.00	914,211,000

住江織物	2,500	2,203.00	5,507,500
日本フェルト	7,600	416.00	3,161,600
イチカワ	1,800	1,661.00	2,989,800
日東製網	1,200	1,432.00	1,718,400
アツギ	7,100	447.00	3,173,700
ダイニック	3,000	750.00	2,250,000
セーレン	33,800	2,271.00	76,759,800
ソトー	3,800	693.00	2,633,400
東海染工	1,300	941.00	1,223,300
小松マテーレ	25,400	808.00	20,523,200
ワコールホールディングス	35,600	3,296.00	117,337,600
ホギメディカル	23,300	3,400.00	79,220,000
T S Iホールディングス	58,600	842.00	49,341,200
マツオカコーポレーション	3,200	1,554.00	4,972,800
ワールド	24,600	1,568.00	38,572,800
三陽商会	5,700	2,653.00	15,122,100
ナイガイ	4,400	268.00	1,179,200
オンワードホールディングス	102,700	491.00	50,425,700
ルックホールディングス	4,300	2,382.00	10,242,600
ゴールドウイン	30,800	10,885.00	335,258,000
デサント	30,000	4,450.00	133,500,000
キング	5,300	664.00	3,519,200
ヤマトインターナショナル	9,600	297.00	2,851,200
特種東海製紙	9,500	3,555.00	33,772,500
王子ホールディングス	723,700	573.30	414,897,210
日本製紙	98,000	1,291.00	126,518,000
三菱製紙	13,900	528.00	7,339,200
北越コーポレーション	85,400	1,319.00	112,642,600
中越パルプ工業	4,700	1,535.00	7,214,500
大王製紙	76,700	1,057.50	81,110,250
阿波製紙	2,800	403.00	1,128,400
レンゴー	158,200	946.70	149,767,940
トーモク	10,000	2,141.00	21,410,000
ザ・パック	12,900	3,160.00	40,764,000
北の達人コーポレーション	73,200	194.00	14,200,800
クラレ	253,200	1,550.50	392,586,600
旭化成	1,175,300	1,007.00	1,183,527,100
共和レザー	6,700	750.00	5,025,000
巴川製紙所	3,600	656.00	2,361,600
レゾナック・ホールディングス	167,900	2,693.50	452,238,650
住友化学	1,289,200	387.20	499,178,240
住友精化	8,200	4,990.00	40,918,000

日産化学	81,600	5,600.00	456,960,000
ラサ工業	6,700	2,086.00	13,976,200
クレハ	12,700	8,170.00	103,759,000
多木化学	6,700	3,130.00	20,971,000
テイカ	15,000	1,329.00	19,935,000
石原産業	28,800	1,357.00	39,081,600
片倉コープアグリ	2,400	1,140.00	2,736,000
日本曹達	20,500	5,250.00	107,625,000
東ソー	231,900	1,913.00	443,624,700
トクヤマ	56,100	2,356.50	132,199,650
セントラル硝子	18,500	2,670.00	49,395,000
東亜合成	87,100	1,347.00	117,323,700
大阪ソーダ	12,100	9,080.00	109,868,000
関東電化工業	33,600	792.00	26,611,200
デンカ	63,200	2,597.00	164,130,400
信越化学工業	1,575,300	5,160.00	8,128,548,000
日本カーバイド工業	6,400	1,491.00	9,542,400
堺化学工業	13,200	1,835.00	24,222,000
第一稀元素化学工業	19,000	968.00	18,392,000
エア・ウォーター	163,900	1,953.50	320,178,650
日本酸素ホールディングス	168,500	4,059.00	683,941,500
日本化学工業	6,400	1,978.00	12,659,200
東邦アセチレン	2,400	1,784.00	4,281,600
日本パーカライズン	77,400	1,126.00	87,152,400
高压ガス工業	25,200	798.00	20,109,600
チタン工業	1,400	1,302.00	1,822,800
四国化成ホールディングス	22,300	1,791.00	39,939,300
戸田工業	4,000	1,652.00	6,608,000
ステラ ケミファ	9,400	3,110.00	29,234,000
保土谷化学工業	5,500	3,230.00	17,765,000
日本触媒	26,500	5,305.00	140,582,500
大日精化工業	12,100	2,153.00	26,051,300
カネカ	44,100	3,758.00	165,727,800
三菱瓦斯化学	129,700	2,284.00	296,234,800
三井化学	143,300	4,090.00	586,097,000
J S R	189,200	3,946.00	746,583,200
東京応化工業	27,600	9,137.00	252,181,200
大阪有機化学工業	14,500	2,685.00	38,932,500
三菱ケミカルグループ	1,270,000	957.00	1,215,390,000
K Hネオケム	26,500	2,295.00	60,817,500
ダイセル	223,300	1,422.50	317,644,250
住友ベークライト	25,700	6,858.00	176,250,600

積水化学工業	352,200	2,120.00	746,664,000
日本ゼオン	119,100	1,355.50	161,440,050
アイカ工業	43,800	3,410.00	149,358,000
UBE	82,700	2,317.00	191,615,900
積水樹脂	25,900	2,475.00	64,102,500
タキロンシーアイ	44,300	585.00	25,915,500
旭有機材	11,600	4,125.00	47,850,000
ニチバン	9,400	1,745.00	16,403,000
リケンテクノス	37,300	826.00	30,809,800
大倉工業	8,100	2,730.00	22,113,000
積水化成成品工業	24,400	467.00	11,394,800
群栄化学工業	4,100	3,090.00	12,669,000
タイガースポリマー	5,300	864.00	4,579,200
ミライアル	3,500	1,477.00	5,169,500
ダイキアクシス	4,800	755.00	3,624,000
ダイキョーニシカワ	38,300	745.00	28,533,500
竹本容器	4,400	780.00	3,432,000
森六ホールディングス	9,900	2,672.00	26,452,800
恵和	12,500	1,317.00	16,462,500
日本化薬	132,700	1,339.00	177,685,300
カーリットホールディングス	18,700	940.00	17,578,000
日本精化	11,500	2,654.00	30,521,000
扶桑化学工業	18,400	4,090.00	75,256,000
トリケミカル研究所	21,100	3,440.00	72,584,000
ADEKA	60,600	2,823.00	171,073,800
日油	53,700	6,813.00	365,858,100
新日本理化	15,900	190.00	3,021,000
ハリマ化成グループ	9,500	795.00	7,552,500
花王	392,800	5,519.00	2,167,863,200
第一工業製薬	6,900	1,784.00	12,309,600
石原ケミカル	7,900	1,859.00	14,686,100
日華化学	4,600	959.00	4,411,400
ニイタカ	2,100	2,078.00	4,363,800
三洋化成工業	10,700	4,285.00	45,849,500
有機合成薬品工業	8,500	282.00	2,397,000
大日本塗料	21,100	941.00	19,855,100
日本ペイントホールディングス	922,500	1,141.00	1,052,572,500
関西ペイント	170,200	2,361.50	401,927,300
神東塗料	9,600	125.00	1,200,000
中国塗料	35,700	1,427.00	50,943,900
日本特殊塗料	7,300	1,187.00	8,665,100
藤倉化成	23,300	445.00	10,368,500

太陽ホールディングス	30,200	2,955.00	89,241,000
D I C	67,900	2,395.50	162,654,450
サカティンクス	38,600	1,316.00	50,797,600
東洋インキSCホールディングス	37,800	2,575.00	97,335,000
T & K T O K A	16,600	1,419.00	23,555,400
富士フィルムホールディングス	322,700	8,698.00	2,806,844,600
資生堂	363,200	4,320.00	1,569,024,000
ライオン	227,700	1,341.00	305,345,700
高砂香料工業	13,100	3,400.00	44,540,000
マンダム	37,600	1,271.00	47,789,600
ミルボン	23,600	3,919.00	92,488,400
ファンケル	76,100	2,312.50	175,981,250
コーセー	35,400	10,570.00	374,178,000
コタ	16,000	1,570.00	25,120,000
シーボン	1,500	1,493.00	2,239,500
ポーラ・オルビスホールディングス	89,200	1,539.50	137,323,400
ノエビアホールディングス	15,500	5,120.00	79,360,000
アジュバンホールディングス	2,800	922.00	2,581,600
新日本製薬	9,900	1,559.00	15,434,100
I - n e	3,400	2,734.00	9,295,600
アクシージア	8,800	977.00	8,597,600
エステー	13,400	1,491.00	19,979,400
アグロ カネショウ	7,000	1,325.00	9,275,000
コニシ	29,000	2,479.00	71,891,000
長谷川香料	33,200	3,270.00	108,564,000
小林製薬	50,600	6,787.00	343,422,200
荒川化学工業	14,700	1,010.00	14,847,000
メック	14,300	4,050.00	57,915,000
日本高純度化学	4,300	2,532.00	10,887,600
タカラバイオ	46,900	1,201.00	56,326,900
J C U	19,400	3,720.00	72,168,000
新田ゼラチン	7,100	795.00	5,644,500
O A T アグリオ	5,000	1,929.00	9,645,000
デクセリアルズ	43,600	4,342.00	189,311,200
アース製薬	15,800	4,785.00	75,603,000
北興化学工業	17,500	932.00	16,310,000
大成ラミック	5,500	2,943.00	16,186,500
クミアイ化学工業	69,100	1,102.00	76,148,200
日本農薬	31,900	594.00	18,948,600
アキレス	11,000	1,574.00	17,314,000
有沢製作所	30,500	1,048.00	31,964,000
日東電工	111,700	10,615.00	1,185,695,500

レック	22,300	908.00	20,248,400
三光合成	21,900	556.00	12,176,400
きもと	17,000	187.00	3,179,000
藤森工業	13,700	3,805.00	52,128,500
前澤化成工業	11,200	1,560.00	17,472,000
未来工業	6,200	3,325.00	20,615,000
ウェーブロックホールディングス	3,600	619.00	2,228,400
J S P	12,200	1,769.00	21,581,800
エフピコ	32,900	2,819.50	92,761,550
天馬	12,600	2,376.00	29,937,600
信越ポリマー	37,500	1,418.00	53,175,000
東リ	25,900	362.00	9,375,800
ニフコ	52,000	3,845.00	199,940,000
バルカー	14,500	3,775.00	54,737,500
ユニ・チャーム	362,400	4,733.00	1,715,239,200
ショーエイコーポレーション	3,400	585.00	1,989,000
協和キリン	210,100	2,441.00	512,854,100
武田薬品工業	1,539,400	4,190.00	6,450,086,000
アステラス製薬	1,525,800	1,808.50	2,759,409,300
住友ファーマ	129,000	480.00	61,920,000
塩野義製薬	219,300	7,097.00	1,556,372,100
わかもと製薬	10,800	200.00	2,160,000
日本新薬	45,600	5,367.00	244,735,200
中外製薬	544,500	4,880.00	2,657,160,000
科研製薬	29,800	3,225.00	96,105,000
エーザイ	211,600	7,721.00	1,633,763,600
ロート製薬	168,500	3,123.00	526,225,500
小野薬品工業	369,100	2,751.50	1,015,578,650
久光製薬	38,700	4,540.00	175,698,000
持田製薬	20,000	3,195.00	63,900,000
参天製薬	317,000	1,332.50	422,402,500
扶桑薬品工業	6,100	1,893.00	11,547,300
日本ケミファ	1,200	1,617.00	1,940,400
ツムラ	54,800	2,695.50	147,713,400
キッセイ薬品工業	28,800	3,005.00	86,544,000
生化学工業	29,500	757.00	22,331,500
栄研化学	33,900	1,584.00	53,697,600
鳥居薬品	9,300	3,615.00	33,619,500
J C R ファーマ	58,900	1,270.00	74,803,000
東和薬品	26,700	2,444.00	65,254,800
富士製薬工業	12,800	1,414.00	18,099,200
ゼリア新薬工業	24,100	1,921.00	46,296,100

そーせいグループ	56,100	1,403.00	78,708,300
第一三共	1,515,300	3,947.00	5,980,889,100
杏林製薬	37,700	1,789.00	67,445,300
大幸薬品	35,700	317.00	11,316,900
ダイト	13,400	1,925.00	25,795,000
大塚ホールディングス	361,800	5,475.00	1,980,855,000
大正製薬ホールディングス	38,700	5,547.00	214,668,900
ペプチドリーム	84,300	1,261.00	106,302,300
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,785.00	31,773,000
サワイグループホールディングス	39,800	4,931.00	196,253,800
日本コークス工業	176,500	121.00	21,356,500
ニチレキ	22,600	2,300.00	51,980,000
ユシロ化学工業	9,000	1,653.00	14,877,000
ビーピー・カストロール	4,500	890.00	4,005,000
富士石油	50,700	350.00	17,745,000
MORESCO	3,800	1,299.00	4,936,200
出光興産	193,200	4,120.00	795,984,000
E N E O Sホールディングス	2,753,800	596.50	1,642,641,700
コスモエネルギーホールディングス	51,600	5,785.00	298,506,000
横浜ゴム	88,000	3,113.00	273,944,000
TOYO TIRE	100,000	2,418.50	241,850,000
ブリヂストン	509,200	5,925.00	3,017,010,000
住友ゴム工業	170,600	1,655.00	282,343,000
藤倉コンポジット	11,700	1,328.00	15,537,600
オカモト	8,200	5,360.00	43,952,000
フコク	9,100	1,315.00	11,966,500
ニッタ	17,700	3,605.00	63,808,500
住友理工	27,000	1,009.00	27,243,000
三ツ星ベルト	21,100	4,375.00	92,312,500
バンドー化学	25,800	1,535.00	39,603,000
日東紡績	22,100	4,020.00	88,842,000
A G C	162,300	5,387.00	874,310,100
日本板硝子	82,900	637.00	52,807,300
石塚硝子	1,900	3,100.00	5,890,000
日本山村硝子	4,500	1,359.00	6,115,500
日本電気硝子	71,100	3,051.00	216,926,100
オハラ	8,400	1,290.00	10,836,000
住友大阪セメント	29,000	3,562.00	103,298,000
太平洋セメント	102,900	2,750.00	282,975,000
日本ヒューム	15,400	906.00	13,952,400
日本コンクリート工業	34,300	328.00	11,250,400
三谷セキサン	7,300	4,325.00	31,572,500

アジアパイルホールディングス	27,400	682.00	18,686,800
東海カーボン	160,600	1,087.50	174,652,500
日本カーボン	9,200	4,585.00	42,182,000
東洋炭素	12,300	4,410.00	54,243,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	6,580.00	63,826,000
TOTO	114,800	3,910.00	448,868,000
日本碍子	202,400	1,789.50	362,194,800
日本特殊陶業	145,700	3,357.00	489,114,900
MARUWA	6,400	28,200.00	180,480,000
品川リフラクトリーズ	21,500	1,647.00	35,410,500
黒崎播磨	3,600	9,940.00	35,784,000
ヨータイ	10,800	1,424.00	15,379,200
東京窯業	11,200	399.00	4,468,800
ニッカトー	5,500	560.00	3,080,000
フジインコーポレーテッド	46,800	3,015.00	141,102,000
クニミネ工業	3,600	993.00	3,574,800
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,211.00	2,785,300
ニチアス	44,000	3,045.00	133,980,000
ニチハ	21,800	2,774.00	60,473,200
日本製鉄	801,300	3,401.00	2,725,221,300
神戸製鋼所	359,900	1,740.50	626,405,950
中山製鋼所	41,000	818.00	33,538,000
合同製鐵	10,000	4,320.00	43,200,000
JFEホールディングス	497,700	2,228.00	1,108,875,600
東京製鐵	50,300	1,794.00	90,238,200
共英製鋼	20,400	2,038.00	41,575,200
大和工業	33,700	7,314.00	246,481,800
東京鐵鋼	8,500	3,775.00	32,087,500
大阪製鐵	8,200	1,896.00	15,547,200
淀川製鋼所	20,300	3,740.00	75,922,000
中部鋼鈹	11,800	1,947.00	22,974,600
丸一鋼管	54,500	3,796.00	206,882,000
モリ工業	3,200	4,240.00	13,568,000
大同特殊鋼	22,600	6,337.00	143,216,200
日本高周波鋼業	4,100	523.00	2,144,300
日本冶金工業	13,100	4,125.00	54,037,500
山陽特殊製鋼	17,700	2,562.00	45,347,400
愛知製鋼	10,300	3,395.00	34,968,500
日本金属	2,600	797.00	2,072,200
大平洋金属	15,300	1,333.00	20,394,900
新日本電工	89,100	296.00	26,373,600
栗本鐵工所	8,500	3,195.00	27,157,500

虹技	1,500	1,149.00	1,723,500
三菱製鋼	13,300	1,470.00	19,551,000
日亜鋼業	12,200	305.00	3,721,000
日本精線	2,800	4,700.00	13,160,000
エンビプロ・ホールディングス	9,600	650.00	6,240,000
シンニッタン	13,000	246.00	3,198,000
新家工業	2,600	2,915.00	7,579,000
大紀アルミニウム工業所	22,700	1,196.00	27,149,200
日本軽金属ホールディングス	52,300	1,673.00	87,497,900
三井金属鉱業	52,100	4,282.00	223,092,200
東邦亜鉛	11,500	1,193.00	13,719,500
三菱マテリアル	127,900	2,431.50	310,988,850
住友金属鉱山	207,500	4,365.00	905,737,500
D O W Aホールディングス	44,200	5,121.00	226,348,200
古河機械金属	23,600	1,945.00	45,902,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,000	3,005.00	93,155,000
東邦チタニウム	37,000	1,916.00	70,892,000
U A C J	25,100	3,160.00	79,316,000
C Kサンエツ	4,300	3,615.00	15,544,500
古河電気工業	59,600	2,391.50	142,533,400
住友電気工業	669,400	1,828.00	1,223,663,200
フジクラ	211,100	1,126.00	237,698,600
S W C C	20,000	2,614.00	52,280,000
タツタ電線	31,900	685.00	21,851,500
カナレ電気	2,100	1,507.00	3,164,700
平河ヒューテック	11,500	1,382.00	15,893,000
リョービ	19,100	3,125.00	59,687,500
アーレスティ	13,200	823.00	10,863,600
A R Eホールディングス	67,200	1,929.00	129,628,800
稲葉製作所	9,300	1,514.00	14,080,200
宮地エンジニアリンググループ	9,000	3,135.00	28,215,000
トーカロ	51,600	1,436.00	74,097,600
アルファC o	4,400	1,423.00	6,261,200
S U M C O	318,000	2,137.00	679,566,000
川田テクノロジーズ	4,200	6,560.00	27,552,000
R S Technologies	12,000	2,448.00	29,376,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,088.00	3,340,800
信和	6,600	734.00	4,844,400
東洋製罐グループホールディングス	106,700	2,373.50	253,252,450
ホッカンホールディングス	9,600	1,592.00	15,283,200
コロナ	10,000	897.00	8,970,000
横河ブリッジホールディングス	28,000	2,617.00	73,276,000

駒井ハルテック	1,900	2,203.00	4,185,700	
高田機工	1,000	3,255.00	3,255,000	
三和ホールディングス	179,800	2,064.00	371,107,200	
文化シャッター	46,800	1,358.00	63,554,400	
三協立山	20,500	830.00	17,015,000	
アルインコ	13,600	1,005.00	13,668,000	
東洋シャッター	2,700	706.00	1,906,200	
L I X I L	279,400	1,782.00	497,890,800	
日本フィルコン	7,700	484.00	3,726,800	
ノーリツ	29,700	1,520.00	45,144,000	
長府製作所	17,800	2,062.00	36,703,600	
リンナイ	87,600	2,984.50	261,442,200	
ダイニチ工業	5,900	713.00	4,206,700	
日東精工	25,900	559.00	14,478,100	
三洋工業	1,400	2,215.00	3,101,000	
岡部	32,000	695.00	22,240,000	
ジーテクト	22,800	1,723.00	39,284,400	
東プレ	31,500	1,893.00	59,629,500	
高周波熱錬	27,600	984.00	27,158,400	
東京製綱	11,600	1,373.00	15,926,800	
サンコール	13,900	469.00	6,519,100	
モリテック スチール	8,800	301.00	2,648,800	
パイオラックス	22,200	2,281.00	50,638,200	
エイチワン	18,400	750.00	13,800,000	
日本発條	158,300	1,116.50	176,741,950	
中央発條	13,300	711.00	9,456,300	
アドバネクス	1,500	909.00	1,363,500	
立川ブラインド工業	8,100	1,465.00	11,866,500	
三益半導体工業	13,800	2,696.00	37,204,800	
日本ドライケミカル	2,800	2,331.00	6,526,800	
日本製鋼所	48,300	2,576.00	124,420,800	
三浦工業	73,200	2,843.50	208,144,200	
タクマ	59,300	1,562.00	92,626,600	
ツガミ	39,000	1,205.00	46,995,000	
オークマ	15,300	6,291.00	96,252,300	
芝浦機械	17,500	3,525.00	61,687,500	
アマダ	279,600	1,457.50	407,517,000	
アイダエンジニアリング	40,600	887.00	36,012,200	
F U J I	82,500	2,418.00	199,485,000	
牧野フライス製作所	19,400	5,770.00	111,938,000	
オーエスジー	77,200	1,792.50	138,381,000	
ダイジェット工業	1,300	884.00	1,149,200	

旭ダイヤモンド工業	42,100	897.00	37,763,700
D M G 森精機	106,200	2,663.50	282,863,700
ソディック	42,700	776.00	33,135,200
ディスコ	84,300	31,730.00	2,674,839,000
日東工器	8,500	1,802.00	15,317,000
日進工具	16,300	1,019.00	16,609,700
パンチ工業	10,700	422.00	4,515,400
富士ダイス	9,200	641.00	5,897,200
豊和工業	6,500	750.00	4,875,000
リケンN P R	19,000	2,033.00	38,627,000
東洋機械金属	8,100	644.00	5,216,400
エンシュウ	2,600	672.00	1,747,200
島精機製作所	27,900	1,639.00	45,728,100
オプトラン	28,800	1,625.00	46,800,000
N C ホールディングス	2,400	1,830.00	4,392,000
イワキポンプ	11,700	1,975.00	23,107,500
フリュー	16,600	1,275.00	21,165,000
ヤマシンフィルタ	42,200	322.00	13,588,400
日阪製作所	19,200	926.00	17,779,200
やまびこ	28,600	1,433.00	40,983,800
野村マイクロ・サイエンス	5,900	10,300.00	60,770,000
平田機工	8,400	6,310.00	53,004,000
P E G A S U S	19,400	484.00	9,389,600
マルマエ	7,700	1,577.00	12,142,900
タツモ	10,600	3,820.00	40,492,000
ナプテスコ	110,000	2,708.50	297,935,000
三井海洋開発	22,200	2,004.00	44,488,800
レオン自動機	20,300	1,491.00	30,267,300
S M C	52,400	75,570.00	3,959,868,000
ホソカワミクロン	11,200	4,250.00	47,600,000
ユニオンツール	7,700	3,510.00	27,027,000
瑞光	12,600	1,360.00	17,136,000
オイレス工業	24,400	1,936.00	47,238,400
日精エー・エス・ビー機械	7,000	5,040.00	35,280,000
サトーホールディングス	24,900	2,000.00	49,800,000
技研製作所	16,500	1,809.00	29,848,500
日本エアーテック	8,200	1,394.00	11,430,800
カワタ	3,400	1,085.00	3,689,000
日精樹脂工業	13,100	1,064.00	13,938,400
オカダアイヨン	3,600	2,166.00	7,797,600
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,593.00	15,039,400
小松製作所	821,100	3,829.00	3,143,991,900

住友重機械工業	103,700	3,444.00	357,142,800
日立建機	69,800	4,025.00	280,945,000
日工	26,100	665.00	17,356,500
巴工業	6,900	2,835.00	19,561,500
井関農機	16,500	1,097.00	18,100,500
TOWA	19,500	6,660.00	129,870,000
丸山製作所	2,000	2,311.00	4,622,000
北川鉄工所	7,000	1,281.00	8,967,000
ローツェ	9,200	13,880.00	127,696,000
タカキタ	3,400	471.00	1,601,400
クボタ	919,300	2,129.50	1,957,649,350
荏原実業	9,300	2,817.00	26,198,100
三菱化工機	6,200	3,050.00	18,910,000
月島ホールディングス	23,800	1,294.00	30,797,200
帝国電機製作所	12,300	2,734.00	33,628,200
新東工業	35,500	1,099.00	39,014,500
澁谷工業	16,500	2,500.00	41,250,000
アイチ コーポレーション	24,500	898.00	22,001,000
小森コーポレーション	44,400	1,167.00	51,814,800
鶴見製作所	13,400	3,790.00	50,786,000
日本ギア工業	4,100	475.00	1,947,500
酒井重工業	2,400	5,980.00	14,352,000
荏原製作所	71,900	8,253.00	593,390,700
石井鐵工所	1,400	2,713.00	3,798,200
西島製作所	15,100	2,030.00	30,653,000
北越工業	17,600	2,046.00	36,009,600
ダイキン工業	209,100	23,850.00	4,987,035,000
オルガノ	21,100	5,630.00	118,793,000
トーヨーカネツ	6,700	3,485.00	23,349,500
栗田工業	98,000	4,960.00	486,080,000
椿本チエイン	24,900	3,640.00	90,636,000
大同工業	4,800	723.00	3,470,400
木村化工機	13,500	724.00	9,774,000
アネスト岩田	27,100	1,085.00	29,403,500
ダイフク	295,700	2,728.00	806,669,600
サムコ	4,700	4,960.00	23,312,000
加藤製作所	5,600	1,151.00	6,445,600
油研工業	1,800	2,107.00	3,792,600
タダノ	100,900	1,190.00	120,071,000
フジテック	41,000	3,432.00	140,712,000
C K D	48,500	2,188.00	106,118,000
平和	51,800	2,019.00	104,584,200

理想科学工業	14,000	2,650.00	37,100,000
SANKYO	43,000	6,068.00	260,924,000
日本金銭機械	21,200	1,154.00	24,464,800
マースグループホールディングス	8,900	2,360.00	21,004,000
フクシマガリレイ	11,500	5,000.00	57,500,000
オーイズミ	4,500	385.00	1,732,500
ダイコク電機	8,600	3,550.00	30,530,000
竹内製作所	31,800	4,350.00	138,330,000
アマノ	49,700	3,126.00	155,362,200
JUKI	27,200	521.00	14,171,200
ジャノメ	17,800	675.00	12,015,000
マックス	24,700	2,856.00	70,543,200
グローリー	42,100	2,711.00	114,133,100
新晃工業	17,700	2,395.00	42,391,500
大和冷機工業	26,900	1,383.00	37,202,700
セガサミーホールディングス	156,500	2,222.00	347,743,000
TPR	22,300	1,736.00	38,712,800
ツバキ・ナカシマ	35,100	752.00	26,395,200
ホシザキ	103,400	4,719.00	487,944,600
大豊工業	15,200	834.00	12,676,800
日本精工	324,300	791.80	256,780,740
NTN	379,900	283.20	107,587,680
ジェイテクト	155,900	1,342.00	209,217,800
不二越	12,900	3,860.00	49,794,000
日本トムソン	47,800	552.00	26,385,600
THK	101,100	2,958.00	299,053,800
ユーシン精機	13,900	664.00	9,229,600
前澤給装工業	13,500	1,285.00	17,347,500
イーグル工業	19,400	1,639.00	31,796,600
前澤工業	6,700	959.00	6,425,300
日本ピラー工業	16,300	4,395.00	71,638,500
キッツ	58,700	1,114.00	65,391,800
マキタ	199,800	3,922.00	783,615,600
三井E&S	86,500	511.00	44,201,500
日立造船	154,700	861.00	133,196,700
三菱重工業	306,300	8,488.00	2,599,874,400
IHI	130,500	2,865.50	373,947,750
スター精密	32,900	1,800.00	59,220,000
日清紡ホールディングス	131,700	1,100.50	144,935,850
イビデン	91,400	7,198.00	657,897,200
コニカミノルタ	392,100	470.40	184,443,840
ブラザー工業	234,200	2,439.50	571,330,900

ミネベアミツミ	304,900	2,826.00	861,647,400
日立製作所	851,900	10,215.00	8,702,158,500
三菱電機	1,949,600	2,052.50	4,001,554,000
富士電機	106,500	6,049.00	644,218,500
東洋電機製造	3,800	953.00	3,621,400
安川電機	190,300	5,612.00	1,067,963,600
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,948.00	37,596,400
明電舎	32,500	2,395.00	77,837,500
オリジン	2,600	1,175.00	3,055,000
山洋電気	7,600	5,760.00	43,776,000
デンヨー	13,300	2,245.00	29,858,500
PHCホールディングス	33,000	1,405.00	46,365,000
ソシオネクスト	25,400	14,590.00	370,586,000
東芝テック	22,400	2,950.00	66,080,000
芝浦メカトロニクス	10,000	7,250.00	72,500,000
マブチモーター	43,600	4,520.00	197,072,000
ニデック	386,800	5,789.00	2,239,185,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	395.00	5,372,000
トレックス・セミコンダクター	9,200	1,771.00	16,293,200
東光高岳	10,800	2,001.00	21,610,800
ダブル・スコープ	50,100	970.00	48,597,000
ダイヘン	17,600	5,500.00	96,800,000
ヤーマン	30,600	1,053.00	32,221,800
JVCケンウッド	138,900	686.00	95,285,400
ミマキエンジニアリング	17,100	926.00	15,834,600
I-PEX	12,400	1,660.00	20,584,000
大崎電気工業	41,400	621.00	25,709,400
オムロン	133,800	6,140.00	821,532,000
日東工業	23,600	3,400.00	80,240,000
I D E C	25,900	2,824.00	73,141,600
正興電機製作所	4,200	1,098.00	4,611,600
不二電機工業	2,600	1,121.00	2,914,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,700	2,490.00	143,673,000
サクサホールディングス	2,400	2,283.00	5,479,200
メルコホールディングス	5,600	3,305.00	18,508,000
テクノメディカ	4,400	2,525.00	11,110,000
日本電気	230,000	8,263.00	1,900,490,000
富士通	161,200	20,600.00	3,320,720,000
沖電気工業	79,200	977.00	77,378,400
岩崎通信機	5,100	750.00	3,825,000
電気興業	7,800	2,287.00	17,838,600
サンケン電気	16,300	7,252.00	118,207,600

ナカヨ	1,900	1,224.00	2,325,600
アイホン	9,500	2,769.00	26,305,500
ルネサスエレクトロニクス	1,143,300	2,418.00	2,764,499,400
セイコーエプソン	224,700	2,152.50	483,666,750
ワコム	133,900	706.00	94,533,400
アルバック	41,600	6,368.00	264,908,800
アクセル	6,300	1,808.00	11,390,400
E I Z O	12,800	4,645.00	59,456,000
日本信号	39,900	948.00	37,825,200
京三製作所	36,700	477.00	17,505,900
能美防災	23,900	1,852.00	44,262,800
ホーチキ	13,300	1,680.00	22,344,000
星和電機	5,900	479.00	2,826,100
エレコム	42,100	1,628.00	68,538,800
パナソニック ホールディングス	2,069,300	1,571.50	3,251,904,950
シャープ	295,300	1,029.50	304,011,350
アンリツ	123,000	1,233.00	151,659,000
富士通ゼネラル	49,700	2,796.50	138,986,050
ソニーグループ	1,226,800	12,930.00	15,862,524,000
T D K	277,400	6,505.00	1,804,487,000
帝国通信工業	8,000	1,948.00	15,584,000
タムラ製作所	69,800	564.00	39,367,200
アルプスアルパイン	156,800	1,212.00	190,041,600
池上通信機	3,700	884.00	3,270,800
日本電波工業	21,300	1,214.00	25,858,200
鈴木	9,700	1,122.00	10,883,400
メイコー	17,500	4,195.00	73,412,500
日本トリム	4,100	3,025.00	12,402,500
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,490.00	33,853,000
フォスター電機	13,000	1,145.00	14,885,000
S M K	4,700	2,421.00	11,378,700
ヨコオ	15,800	1,505.00	23,779,000
ホシデン	40,800	1,722.00	70,257,600
ヒロセ電機	25,900	16,135.00	417,896,500
日本航空電子工業	41,900	2,761.00	115,685,900
T O A	19,900	1,012.00	20,138,800
マクセル	38,900	1,641.00	63,834,900
古野電気	23,000	1,687.00	38,801,000
スミダコーポレーション	23,700	1,180.00	27,966,000
アイコム	6,700	3,195.00	21,406,500
リオン	7,400	2,171.00	16,065,400
横河電機	191,600	2,799.00	536,288,400

新電元工業	6,700	2,963.00	19,852,100
アズビル	121,200	4,927.00	597,152,400
東亜ディーケーケー	5,800	878.00	5,092,400
日本光電工業	74,500	3,687.00	274,681,500
チノー	7,200	2,115.00	15,228,000
共和電業	10,800	402.00	4,341,600
日本電子材料	11,400	1,477.00	16,837,800
堀場製作所	33,100	9,237.00	305,744,700
アドバンテクト	496,900	4,644.00	2,307,603,600
小野測器	5,500	437.00	2,403,500
エスベック	14,100	2,274.00	32,063,400
キーエンス	173,500	62,280.00	10,805,580,000
日置電機	8,200	6,560.00	53,792,000
シスメックス	149,700	7,786.00	1,165,564,200
日本マイクロニクス	31,300	3,695.00	115,653,500
メガチップス	14,200	3,740.00	53,108,000
O B A R A G R O U P	9,600	3,660.00	35,136,000
澤藤電機	1,600	1,238.00	1,980,800
原田工業	5,500	779.00	4,284,500
コーセル	21,200	1,181.00	25,037,200
イリソ電子工業	16,100	3,880.00	62,468,000
オブテックスグループ	32,000	1,761.00	56,352,000
千代田インテグレ	6,900	2,922.00	20,161,800
レーザーテック	79,500	31,060.00	2,469,270,000
スタンレー電気	111,200	2,707.00	301,018,400
ウシオ電機	88,300	1,915.50	169,138,650
岡谷電機産業	10,100	275.00	2,777,500
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	513.00	5,899,500
エノモト	3,100	1,506.00	4,668,600
日本セラミック	15,200	2,756.00	41,891,200
遠藤照明	5,400	1,197.00	6,463,800
古河電池	13,200	910.00	12,012,000
双信電機	5,700	327.00	1,863,900
山一電機	15,800	1,843.00	29,119,400
図研	15,200	4,005.00	60,876,000
日本電子	43,500	5,655.00	245,992,500
カシオ計算機	125,300	1,252.50	156,938,250
ファナック	845,700	4,044.00	3,420,010,800
日本シイエムケイ	37,400	709.00	26,516,600
エンプラス	5,100	11,040.00	56,304,000
大真空	26,400	735.00	19,404,000
ローム	320,800	2,664.00	854,611,200

浜松ホトニクス	139,200	5,868.00	816,825,600
三井ハイテック	15,400	7,145.00	110,033,000
新光電気工業	61,400	5,350.00	328,490,000
京セラ	269,500	8,015.00	2,160,042,500
太陽誘電	84,600	3,807.00	322,072,200
村田製作所	1,578,100	2,870.00	4,529,147,000
双葉電子工業	33,800	520.00	17,576,000
北陸電気工業	4,600	1,342.00	6,173,200
ニチコン	45,800	1,389.00	63,616,200
日本ケミコン	18,700	1,288.00	24,085,600
K O A	26,500	1,532.00	40,598,000
市光工業	32,000	519.00	16,608,000
小糸製作所	187,900	2,303.50	432,827,650
ミツバ	32,500	852.00	27,690,000
S C R E E Nホールディングス	59,300	9,508.00	563,824,400
キャノン電子	19,400	1,913.00	37,112,200
キャノン	865,000	3,693.00	3,194,445,000
リコー	434,800	1,179.00	512,629,200
象印マホービン	48,400	1,523.00	73,713,200
M U T O Hホールディングス	1,700	1,902.00	3,233,400
東京エレクトロン	367,100	23,905.00	8,775,525,500
イノテック	11,800	1,629.00	19,222,200
トヨタ紡織	73,100	2,675.50	195,579,050
芦森工業	2,200	2,178.00	4,791,600
ユニプレス	31,200	951.00	29,671,200
豊田自動織機	147,900	12,015.00	1,777,018,500
モリタホールディングス	30,500	1,511.00	46,085,500
三櫻工業	26,600	906.00	24,099,600
デンソー	1,430,900	2,462.00	3,522,875,800
東海理化電機製作所	48,900	2,389.00	116,822,100
川崎重工業	141,600	3,332.00	471,811,200
名村造船所	37,800	1,133.00	42,827,400
日本車輛製造	6,600	2,091.00	13,800,600
三菱ロジスネクスト	27,700	1,234.00	34,181,800
近畿車輛	1,600	1,846.00	2,953,600
日産自動車	2,463,700	596.20	1,468,857,940
いすゞ自動車	504,200	1,892.50	954,198,500
トヨタ自動車	9,523,200	2,780.00	26,474,496,000
日野自動車	260,900	486.80	127,006,120
三菱自動車工業	676,600	494.80	334,781,680
エフテック	8,100	629.00	5,094,900
レシップホールディングス	4,500	550.00	2,475,000

GMB	2,300	1,446.00	3,325,800
ファルテック	2,000	546.00	1,092,000
武蔵精密工業	42,500	1,602.00	68,085,000
日産車体	20,400	798.00	16,279,200
新明和工業	49,900	1,191.00	59,430,900
極東開発工業	28,600	1,881.00	53,796,600
トピー工業	14,100	2,715.00	38,281,500
ティラド	4,400	3,160.00	13,904,000
曙ブレーキ工業	105,800	121.00	12,801,800
タチエス	32,100	1,657.00	53,189,700
NOK	67,400	1,879.50	126,678,300
フタバ産業	46,600	754.00	35,136,400
カヤバ	16,700	4,460.00	74,482,000
大同メタル工業	34,100	556.00	18,959,600
プレス工業	69,400	610.00	42,334,000
ミクニ	13,400	438.00	5,869,200
太平洋工業	39,800	1,378.00	54,844,400
アイシン	133,800	5,543.00	741,653,400
マツダ	573,700	1,678.00	962,668,600
今仙電機製作所	7,400	583.00	4,314,200
本田技研工業	4,229,400	1,564.50	6,616,896,300
スズキ	318,500	6,124.00	1,950,494,000
SUBARU	548,700	2,673.50	1,466,949,450
安永	5,100	712.00	3,631,200
ヤマハ発動機	249,900	3,662.00	915,133,800
TBK	11,700	380.00	4,446,000
エクセディ	28,400	2,524.00	71,681,600
豊田合成	50,700	2,988.50	151,516,950
愛三工業	28,800	1,261.00	36,316,800
盟和産業	1,700	976.00	1,659,200
日本プラスト	9,300	572.00	5,319,600
ヨロズ	16,400	894.00	14,661,600
エフ・シー・シー	30,800	1,792.00	55,193,600
シマノ	70,400	22,445.00	1,580,128,000
テイ・エス テック	61,800	1,758.00	108,644,400
ジャムコ	7,400	1,469.00	10,870,600
テルモ	484,900	4,772.00	2,313,942,800
クリエートメディック	3,800	890.00	3,382,000
日機装	40,400	962.00	38,864,800
日本エム・ディ・エム	13,800	691.00	9,535,800
島津製作所	230,400	3,785.00	872,064,000
JMS	16,100	516.00	8,307,600

長野計器	12,600	2,074.00	26,132,400
ブイ・テクノロジー	9,100	2,218.00	20,183,800
東京計器	13,300	1,628.00	21,652,400
愛知時計電機	7,500	2,294.00	17,205,000
インターアクション	8,200	996.00	8,167,200
オーバル	10,200	485.00	4,947,000
東京精密	35,500	8,820.00	313,110,000
マニー	69,400	2,154.00	149,487,600
ニコン	250,800	1,442.00	361,653,600
トプコン	84,300	1,535.50	129,442,650
オリンパス	1,067,600	2,178.50	2,325,766,600
理研計器	12,300	6,130.00	75,399,000
タムロン	10,600	4,305.00	45,633,000
HOYA	344,500	16,580.00	5,711,810,000
シード	5,900	819.00	4,832,100
ノーリツ鋼機	16,400	3,085.00	50,594,000
A & Dホロンホールディングス	25,300	1,850.00	46,805,000
朝日インテック	193,800	2,862.50	554,752,500
シチズン時計	159,600	864.00	137,894,400
リズム	3,600	2,574.00	9,266,400
大研医器	8,700	520.00	4,524,000
メニコン	59,600	2,083.50	124,176,600
シンシア	1,400	532.00	744,800
松風	7,800	2,491.00	19,429,800
セイコーグループ	24,200	2,500.00	60,500,000
ニプロ	144,600	1,097.50	158,698,500
KYORITSU	17,200	168.00	2,889,600
中本パックス	3,500	1,621.00	5,673,500
スノーピーク	24,700	1,003.00	24,774,100
パラマウントベッドホールディングス	36,000	2,679.00	96,444,000
トランザクション	11,400	2,054.00	23,415,600
粧美堂	3,100	604.00	1,872,400
ニホンフラッシュ	16,300	911.00	14,849,300
前田工織	14,600	3,090.00	45,114,000
永大産業	12,300	215.00	2,644,500
アートネイチャー	17,800	787.00	14,008,600
バンダイナムコホールディングス	475,100	3,021.00	1,435,277,100
アイフィスジャパン	3,200	614.00	1,964,800
SHOEI	39,200	1,916.00	75,107,200
フランスベッドホールディングス	22,400	1,245.00	27,888,000
パイロットコーポレーション	24,400	4,508.00	109,995,200
萩原工業	11,600	1,611.00	18,687,600

フジシールインターナショナル	35,100	1,681.00	59,003,100
タカラトミー	78,900	2,042.00	161,113,800
広済堂ホールディングス	7,800	3,290.00	25,662,000
エステールホールディングス	2,700	626.00	1,690,200
タカノ	4,300	830.00	3,569,000
プロネクサス	18,000	1,148.00	20,664,000
ホクシン	8,800	116.00	1,020,800
ウッドワン	3,800	974.00	3,701,200
TOPPANホールディングス	213,200	3,296.00	702,707,200
大日本印刷	189,500	4,002.00	758,379,000
共同印刷	4,900	3,665.00	17,958,500
NISSHA	29,700	1,477.00	43,866,900
光村印刷	1,000	1,247.00	1,247,000
TAKARA & COMPANY	11,100	2,391.00	26,540,100
アシックス	147,800	5,428.00	802,258,400
ツツミ	4,100	2,135.00	8,753,500
ローランド	12,800	4,430.00	56,704,000
小松ウオール工業	7,100	2,831.00	20,100,100
ヤマハ	109,300	3,469.00	379,161,700
河合楽器製作所	5,300	3,175.00	16,827,500
クリナップ	19,400	672.00	13,036,800
ピジョン	110,500	1,637.00	180,888,500
キングジム	15,300	870.00	13,311,000
リンテック	34,800	2,445.00	85,086,000
イトーキ	35,500	1,320.00	46,860,000
任天堂	1,095,000	6,800.00	7,446,000,000
三菱鉛筆	24,600	1,915.00	47,109,000
タカラスタANDARD	36,500	1,729.00	63,108,500
コクヨ	74,700	2,354.00	175,843,800
ナカバヤシ	18,700	525.00	9,817,500
グローブライド	15,600	1,987.00	30,997,200
オカムラ	52,200	2,167.00	113,117,400
美津濃	17,200	3,975.00	68,370,000
東京電力ホールディングス	1,563,400	665.90	1,041,068,060
中部電力	639,100	1,807.00	1,154,853,700
関西電力	669,700	1,953.50	1,308,258,950
中国電力	301,300	982.20	295,936,860
北陸電力	177,300	744.60	132,017,580
東北電力	456,600	939.00	428,747,400
四国電力	161,500	1,028.50	166,102,750
九州電力	399,800	1,000.50	399,999,900
北海道電力	167,600	634.70	106,375,720

沖縄電力	44,300	1,046.00	46,337,800
電源開発	142,500	2,292.00	326,610,000
エフオン	11,200	480.00	5,376,000
イーレックス	30,800	681.00	20,974,800
レノバ	46,200	1,134.00	52,390,800
東京瓦斯	366,700	3,285.00	1,204,609,500
大阪瓦斯	351,300	2,876.00	1,010,338,800
東邦瓦斯	75,100	2,614.50	196,348,950
北海道瓦斯	10,400	2,275.00	23,660,000
広島ガス	36,600	373.00	13,651,800
西部ガスホールディングス	18,100	1,879.00	34,009,900
静岡ガス	36,300	1,008.00	36,590,400
メタウォーター	20,800	2,042.00	42,473,600
SBSホールディングス	15,500	2,520.00	39,060,000
東武鉄道	190,500	3,710.00	706,755,000
相鉄ホールディングス	62,100	2,659.00	165,123,900
東急	486,300	1,765.00	858,319,500
京浜急行電鉄	214,600	1,315.50	282,306,300
小田急電鉄	286,800	2,171.00	622,642,800
京王電鉄	83,400	4,105.00	342,357,000
京成電鉄	111,800	6,220.00	695,396,000
富士急行	21,400	4,435.00	94,909,000
東日本旅客鉄道	318,600	7,996.00	2,547,525,600
西日本旅客鉄道	205,700	5,882.00	1,209,927,400
東海旅客鉄道	668,000	3,514.00	2,347,352,000
西武ホールディングス	209,800	1,695.50	355,715,900
鴻池運輸	29,500	1,977.00	58,321,500
西日本鉄道	46,300	2,406.50	111,420,950
ハマキョウレックス	14,800	3,855.00	57,054,000
サカイ引越センター	19,200	2,545.00	48,864,000
近鉄グループホールディングス	173,100	4,136.00	715,941,600
阪急阪神ホールディングス	230,900	4,592.00	1,060,292,800
南海電気鉄道	77,200	2,940.50	227,006,600
京阪ホールディングス	95,400	3,850.00	367,290,000
神戸電鉄	4,700	2,907.00	13,662,900
名古屋鉄道	178,600	2,107.50	376,399,500
山陽電気鉄道	13,000	2,120.00	27,560,000
アルプス物流	13,800	1,612.00	22,245,600
ヤマトホールディングス	221,700	2,589.50	574,092,150
山九	44,100	4,950.00	218,295,000
丸運	5,600	247.00	1,383,200
丸全昭和運輸	10,700	3,825.00	40,927,500

センコーグループホールディングス	91,700	1,047.00	96,009,900
トナミホールディングス	3,800	4,370.00	16,606,000
ニッコンホールディングス	55,400	3,226.00	178,720,400
日本石油輸送	1,200	2,892.00	3,470,400
福山通運	19,800	3,625.00	71,775,000
セイノーホールディングス	97,400	2,037.50	198,452,500
エスライングループ本社	3,200	867.00	2,774,400
神奈川中央交通	4,900	3,055.00	14,969,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,800	1,940.00	81,092,000
C & F ロジホールディングス	16,700	1,430.00	23,881,000
九州旅客鉄道	122,400	3,062.00	374,788,800
S Gホールディングス	290,700	2,139.00	621,807,300
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,800	7,581.00	445,762,800
日本郵船	496,600	3,770.00	1,872,182,000
商船三井	376,000	3,883.00	1,460,008,000
川崎汽船	146,500	4,784.00	700,856,000
N Sユナイテッド海運	9,600	4,565.00	43,824,000
飯野海運	64,600	1,148.00	74,160,800
共栄タンカー	3,600	818.00	2,944,800
乾汽船	23,000	1,103.00	25,369,000
日本航空	425,300	2,886.50	1,227,628,450
A N Aホールディングス	471,100	3,105.00	1,462,765,500
パスコ	2,200	1,576.00	3,467,200
トランコム	5,000	7,500.00	37,500,000
日新	13,100	2,482.00	32,514,200
三菱倉庫	42,500	4,327.00	183,897,500
三井倉庫ホールディングス	16,200	4,630.00	75,006,000
住友倉庫	46,700	2,422.00	113,107,400
澁澤倉庫	7,900	2,746.00	21,693,400
東陽倉庫	3,000	1,495.00	4,485,000
日本トランスシティ	34,800	617.00	21,471,600
ケイヒン	2,000	1,736.00	3,472,000
中央倉庫	9,300	1,086.00	10,099,800
川西倉庫	1,900	1,072.00	2,036,800
安田倉庫	11,800	1,088.00	12,838,400
ファイズホールディングス	2,100	1,022.00	2,146,200
東洋埠頭	3,300	1,360.00	4,488,000
上組	83,000	3,165.00	262,695,000
サンリツ	2,600	729.00	1,895,400
キムラユニティー	5,500	1,350.00	7,425,000
キューソー流通システム	6,900	923.00	6,368,700
東海運	6,700	281.00	1,882,700

エーアイティー	10,900	1,653.00	18,017,700
内外トランスライン	6,900	2,431.00	16,773,900
日本コンセプト	6,300	1,662.00	10,470,600
NEC ネットエスアイ	67,800	2,150.00	145,770,000
クロスキャット	11,100	1,132.00	12,565,200
システナ	263,300	265.00	69,774,500
デジタルアーツ	11,000	4,555.00	50,105,000
日鉄ソリューションズ	29,700	4,625.00	137,362,500
キューブシステム	10,300	1,082.00	11,144,600
コア	7,700	1,726.00	13,290,200
手間いらず	3,000	2,660.00	7,980,000
ラクーンホールディングス	14,500	717.00	10,396,500
ソリトンシステムズ	9,000	1,214.00	10,926,000
ソフトクリエイトホールディングス	14,300	1,710.00	24,453,000
T I S	190,300	3,180.00	605,154,000
テクミラホールディングス	5,400	453.00	2,446,200
グリー	46,700	533.00	24,891,100
GMOペパボ	2,300	1,262.00	2,902,600
コーエーテクモホールディングス	109,000	1,870.00	203,830,000
三菱総合研究所	8,500	4,650.00	39,525,000
電算	1,400	1,501.00	2,101,400
A G S	4,900	711.00	3,483,900
ファインデックス	13,800	900.00	12,420,000
ブレインパッド	13,000	1,022.00	13,286,000
K L a b	32,000	278.00	8,896,000
ポルトゥウィンホールディングス	29,800	512.00	15,257,600
ネクソン	388,500	3,038.00	1,180,263,000
アイスタイル	51,700	478.00	24,712,600
エムアップホールディングス	21,300	1,049.00	22,343,700
エイチーム	10,300	666.00	6,859,800
エニグモ	22,200	372.00	8,258,400
テクノスジャパン	9,500	666.00	6,327,000
コロブラ	67,500	592.00	39,960,000
ブロードリーフ	94,600	574.00	54,300,400
クロス・マーケティンググループ	7,000	580.00	4,060,000
デジタルハーツホールディングス	10,900	901.00	9,820,900
メディアドゥ	7,900	1,470.00	11,613,000
じげん	50,800	514.00	26,111,200
ブイキューブ	20,900	369.00	7,712,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	516.00	1,444,800
サイバーリンクス	4,500	711.00	3,199,500
フィックスターズ	19,700	1,206.00	23,758,200

CARTA HOLDINGS	8,200	1,235.00	10,127,000
オブティム	17,900	844.00	15,107,600
セレス	7,000	919.00	6,433,000
SHIFT	11,600	33,610.00	389,876,000
ティーガイア	18,200	1,779.00	32,377,800
セック	1,900	3,975.00	7,552,500
テクマトリックス	31,800	1,735.00	55,173,000
プロシップ	8,400	1,271.00	10,676,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,300	2,183.50	98,912,550
GMOペイメントゲートウェイ	34,800	8,114.00	282,367,200
ザッパラス	3,300	481.00	1,587,300
システムリサーチ	6,000	3,460.00	20,760,000
インターネットイニシアティブ	83,200	2,564.00	213,324,800
さくらインターネット	19,500	1,196.00	23,322,000
ヴィンクス	2,800	2,015.00	5,642,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,503.00	13,265,900
SRAホールディングス	8,900	3,545.00	31,550,500
システムインテグレータ	3,500	402.00	1,407,000
朝日ネット	18,700	615.00	11,500,500
eBASE	24,500	768.00	18,816,000
アバントグループ	22,000	1,471.00	32,362,000
アドソル日進	7,300	1,650.00	12,045,000
ODKソリューションズ	2,600	553.00	1,437,800
フリービット	9,100	1,139.00	10,364,900
コムチュア	25,100	2,018.00	50,651,800
サイバーコム	1,900	1,900.00	3,610,000
アステリア	13,700	713.00	9,768,100
アイル	8,100	3,960.00	32,076,000
マークライنز	9,400	2,875.00	27,025,000
メディカル・データ・ビジョン	20,800	688.00	14,310,400
gumi	25,700	416.00	10,691,200
ショーケース	2,800	290.00	812,000
モバイルファクトリー	2,500	714.00	1,785,000
テラスカイ	7,500	1,593.00	11,947,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,100	1,609.00	16,250,900
PCIホールディングス	4,400	1,029.00	4,527,600
アイビーシー	1,800	500.00	900,000
ネオジャパン	5,800	1,029.00	5,968,200
PR TIMES	4,400	1,723.00	7,581,200
ラクス	82,300	2,605.00	214,391,500
ランドコンピュータ	5,600	790.00	4,424,000
ダブルスタンダード	5,300	1,467.00	7,775,100

オープンドア	12,200	835.00	10,187,000
アカツキ	8,300	2,144.00	17,795,200
ベネフィットジャパン	700	1,192.00	834,400
U b i c o mホールディングス	5,400	1,701.00	9,185,400
カナミックネットワーク	18,800	405.00	7,614,000
ノムラシステムコーポレーション	12,900	112.00	1,444,800
チェンジホールディングス	37,900	1,558.00	59,048,200
シンクロ・フード	7,400	712.00	5,268,800
オークネット	7,500	1,810.00	13,575,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	735.00	1,690,500
セグエグループ	3,700	917.00	3,392,900
エイトレッド	1,800	1,361.00	2,449,800
マクロミル	34,200	715.00	24,453,000
ビーグリー	2,500	1,200.00	3,000,000
オロ	6,300	2,613.00	16,461,900
ユーザーローカル	6,300	1,822.00	11,478,600
テモナ	2,800	242.00	677,600
ニーズウェル	6,400	720.00	4,608,000
マネーフォワード	38,700	4,576.00	177,091,200
サインポスト	4,500	448.00	2,016,000
S u n A s t e r i s k	12,400	1,035.00	12,834,000
プラスアルファ・コンサルティング	10,300	2,727.00	28,088,100
電算システムホールディングス	7,700	2,781.00	21,413,700
A p p i e r G r o u p	59,400	1,589.00	94,386,600
ソルクシーズ	9,400	409.00	3,844,600
フェイス	3,300	482.00	1,590,600
プロトコーポレーション	19,100	1,361.00	25,995,100
ハイマックス	5,500	1,379.00	7,584,500
野村総合研究所	385,400	4,157.00	1,602,107,800
サイバネットシステム	13,900	1,092.00	15,178,800
C Eホールディングス	6,000	562.00	3,372,000
日本システム技術	5,700	2,332.00	13,292,400
インテージホールディングス	19,700	1,684.00	33,174,800
東邦システムサイエンス	5,700	1,165.00	6,640,500
ソースネクスト	88,400	174.00	15,381,600
インフォコム	22,400	2,506.00	56,134,400
シンプレクス・ホールディングス	26,100	2,582.00	67,390,200
H E R O Z	5,900	1,395.00	8,230,500
ラクスル	41,900	1,381.00	57,863,900
メルカリ	105,500	3,112.00	328,316,000
I P S	5,600	2,089.00	11,698,400
F I G	13,500	354.00	4,779,000

システムサポート	6,700	1,970.00	13,199,000
イーソル	12,600	623.00	7,849,800
東海ソフト	1,700	1,110.00	1,887,000
ウイングアーク1st	18,000	3,015.00	54,270,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,298.00	6,100,600
サーバーワークス	3,600	3,395.00	12,222,000
東名	900	1,805.00	1,624,500
ヴィッツ	1,200	989.00	1,186,800
トピラスシステムズ	3,300	856.00	2,824,800
Sansan	57,000	1,454.00	82,878,000
Link-U	2,800	748.00	2,094,400
ギフトィ	15,200	1,767.00	26,858,400
メドレー	23,400	4,650.00	108,810,000
ベース	6,000	3,570.00	21,420,000
JMDC	29,700	4,600.00	136,620,000
フォーカスシステムズ	12,700	967.00	12,280,900
クレスコ	14,300	1,902.00	27,198,600
フジ・メディア・ホールディングス	167,100	1,466.00	244,968,600
オービック	58,100	22,090.00	1,283,429,000
ジャストシステム	25,000	3,160.00	79,000,000
TDCソフト	16,300	1,931.00	31,475,300
LINEヤフー	2,476,000	428.00	1,059,728,000
トレンドマイクロ	82,200	7,259.00	596,689,800
IDホールディングス	11,700	1,456.00	17,035,200
日本オラクル	33,300	11,185.00	372,460,500
アルファシステムズ	4,600	2,823.00	12,985,800
フューチャー	37,100	1,804.00	66,928,400
CAC Holdings	10,000	1,734.00	17,340,000
SBテクノロジー	7,400	2,377.00	17,589,800
トーセ	3,400	697.00	2,369,800
オービックビジネスコンサルタント	24,500	6,561.00	160,744,500
アイティフォー	22,900	1,056.00	24,182,400
東計電算	2,400	6,600.00	15,840,000
エクスネット	1,600	1,083.00	1,732,800
大塚商会	86,300	5,959.00	514,261,700
サイボウズ	24,000	2,131.00	51,144,000
電通国際情報サービス	21,100	4,625.00	97,587,500
ACCESS	20,600	813.00	16,747,800
デジタルガレージ	27,800	3,120.00	86,736,000
EMシステムズ	29,000	671.00	19,459,000
ウェザーニューズ	5,400	5,880.00	31,752,000
CIJ	28,900	611.00	17,657,900

ビジネスエンジニアリング	2,900	3,945.00	11,440,500
日本エンタープライズ	12,200	120.00	1,464,000
WOWOW	13,100	1,048.00	13,728,800
スカラ	16,100	742.00	11,946,200
インテリジェント ウェイブ	6,200	1,038.00	6,435,600
ANYCOLOR	6,100	3,745.00	22,844,500
IMAGICA GROUP	17,500	649.00	11,357,500
ネットワンシステムズ	70,200	2,065.00	144,963,000
システムソフト	60,900	66.00	4,019,400
アルゴグラフィックス	16,000	3,455.00	55,280,000
マーベラス	28,300	686.00	19,413,800
エイベックス	29,600	1,341.00	39,693,600
BIPROGY	56,900	4,103.00	233,460,700
都築電気	9,200	2,096.00	19,283,200
TBSホールディングス	89,000	2,565.50	228,329,500
日本テレビホールディングス	154,000	1,411.50	217,371,000
朝日放送グループホールディングス	16,300	633.00	10,317,900
テレビ朝日ホールディングス	42,200	1,595.00	67,309,000
スカパーJSAホールディングス	135,100	660.00	89,166,000
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,841.00	35,512,500
日本BS放送	4,200	892.00	3,746,400
ビジョン	26,200	1,212.00	31,754,400
スマートバリュー	2,900	361.00	1,046,900
USEN-NEXT HOLDINGS	19,500	3,555.00	69,322,500
ワイヤレスゲート	5,200	199.00	1,034,800
日本通信	171,400	216.00	37,022,400
クロップス	1,900	996.00	1,892,400
日本電信電話	51,740,600	173.50	8,976,994,100
KDDI	1,344,100	4,616.00	6,204,365,600
ソフトバンク	2,798,400	1,750.50	4,898,599,200
光通信	17,500	22,610.00	395,675,000
エムティーアイ	12,000	576.00	6,912,000
GMOインターネットグループ	64,300	2,337.00	150,269,100
ファイバーゲート	9,400	1,025.00	9,635,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	228.00	638,400
KADOKAWA	92,000	2,724.00	250,608,000
学研ホールディングス	29,000	937.00	27,173,000
ゼンリン	29,800	875.00	26,075,000
昭文社ホールディングス	5,000	360.00	1,800,000
インプレスホールディングス	10,300	183.00	1,884,900
アイネット	10,600	1,789.00	18,963,400
松竹	9,000	9,640.00	86,760,000

東宝	96,800	5,058.00	489,614,400
東映	5,700	17,750.00	101,175,000
N T Tデータグループ	454,800	1,852.00	842,289,600
ピー・シー・エー	10,000	1,170.00	11,700,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,069.00	15,310,600
D T S	37,000	3,285.00	121,545,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	79,500	5,177.00	411,571,500
シーイーシー	22,000	1,709.00	37,598,000
カプコン	155,600	5,047.00	785,313,200
アイ・エス・ピー	8,900	1,484.00	13,207,600
ジャステック	10,700	1,517.00	16,231,900
S C S K	121,700	2,750.50	334,735,850
N S W	7,700	2,886.00	22,222,200
アイネス	13,600	1,539.00	20,930,400
T K C	27,700	3,470.00	96,119,000
富士ソフト	35,000	5,650.00	197,750,000
N S D	62,100	2,617.00	162,515,700
コナミグループ	65,200	7,456.00	486,131,200
福井コンピュータホールディングス	10,800	2,588.00	27,950,400
J B C Cホールディングス	11,500	3,255.00	37,432,500
ミロク情報サービス	15,800	1,574.00	24,869,200
ソフトバンクグループ	858,100	6,160.00	5,285,896,000
高千穂交易	5,100	3,185.00	16,243,500
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,772.00	3,189,600
伊藤忠食品	4,100	7,140.00	29,274,000
エレマテック	16,500	1,669.00	27,538,500
あらた	14,000	6,220.00	87,080,000
トーメンデバイス	2,700	4,870.00	13,149,000
東京エレクトロン デバイス	18,300	4,540.00	83,082,000
円谷フィールズホールディングス	31,500	1,187.00	37,390,500
双日	204,300	3,049.00	622,910,700
アルフレッサ ホールディングス	184,200	2,458.50	452,855,700
横浜冷凍	50,000	1,083.00	54,150,000
ラサ商事	6,500	1,526.00	9,919,000
アルコニックス	24,200	1,310.00	31,702,000
神戸物産	142,000	3,631.00	515,602,000
ハイパー	2,800	349.00	977,200
あい ホールディングス	29,400	2,346.00	68,972,400
ディーブイエックス	3,400	1,022.00	3,474,800
ダイワボウホールディングス	81,200	2,913.00	236,535,600
マクニカホールディングス	43,400	6,815.00	295,771,000
ラクト・ジャパン	7,100	2,010.00	14,271,000

グリムス	7,700	1,897.00	14,606,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,800	1,013.00	28,161,400
八洲電機	14,900	1,270.00	18,923,000
メディアスホールディングス	11,800	749.00	8,838,200
レスターホールディングス	15,600	2,705.00	42,198,000
ジオリーブグループ	2,800	1,220.00	3,416,000
大光	5,200	659.00	3,426,800
OCHIホールディングス	2,800	1,390.00	3,892,000
TOKAIホールディングス	99,700	961.00	95,811,700
黒谷	3,400	580.00	1,972,000
Cominix	2,400	774.00	1,857,600
三洋貿易	20,700	1,272.00	26,330,400
ビューティガレージ	5,800	2,375.00	13,775,000
ウイン・パートナーズ	13,300	1,230.00	16,359,000
ミタチ産業	3,100	1,166.00	3,614,600
シップヘルスケアホールディングス	66,000	2,139.50	141,207,000
明治電機工業	6,800	1,390.00	9,452,000
デリカフーズホールディングス	4,800	575.00	2,760,000
スターティアホールディングス	2,700	1,346.00	3,634,200
コメダホールディングス	45,000	2,805.00	126,225,000
ピーバンドットコム	1,800	386.00	694,800
アセンテック	7,100	532.00	3,777,200
富士興産	2,900	1,809.00	5,246,100
協栄産業	1,100	2,312.00	2,543,200
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,769.00	47,349,900
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,590.00	37,336,000
小野建	18,000	1,658.00	29,844,000
南陽	2,300	2,036.00	4,682,800
佐島電機	9,000	1,893.00	17,037,000
エコートレーディング	2,400	1,316.00	3,158,400
伯東	10,500	5,250.00	55,125,000
コンドーテック	14,100	1,136.00	16,017,600
中山福	6,600	351.00	2,316,600
ナガイレーベン	23,200	2,255.00	52,316,000
三菱食品	17,000	4,545.00	77,265,000
松田産業	14,000	2,455.00	34,370,000
第一興商	71,000	2,192.50	155,667,500
メディバルホールディングス	190,100	2,341.50	445,119,150
SPK	8,200	1,853.00	15,194,600
萩原電気ホールディングス	7,800	4,575.00	35,685,000
アズワン	28,700	5,038.00	144,590,600
スズデン	6,400	2,187.00	13,996,800

尾家産業	2,900	1,782.00	5,167,800
シモジマ	12,600	1,221.00	15,384,600
ドウシシャ	17,000	2,097.00	35,649,000
小津産業	2,700	1,582.00	4,271,400
高速	10,900	1,965.00	21,418,500
たけびし	7,000	1,795.00	12,565,000
リックス	3,200	3,230.00	10,336,000
丸文	16,400	1,347.00	22,090,800
ハピネット	15,600	2,393.00	37,330,800
橋本総業ホールディングス	7,300	1,160.00	8,468,000
日本ライフライン	53,800	1,111.00	59,771,800
タカショー	16,000	597.00	9,552,000
I D O M	48,600	899.00	43,691,400
進和	11,200	2,358.00	26,409,600
エスケイジャパン	3,000	759.00	2,277,000
ダイトロン	7,200	2,850.00	20,520,000
シークス	26,200	1,473.00	38,592,600
田中商事	3,500	702.00	2,457,000
オーハシテクニカ	9,800	1,729.00	16,944,200
白銅	5,200	2,232.00	11,606,400
ダイコー通産	1,300	1,125.00	1,462,500
伊藤忠商事	1,233,500	6,150.00	7,586,025,000
丸紅	1,529,900	2,339.00	3,578,436,100
高島	7,700	974.00	7,499,800
長瀬産業	84,100	2,266.00	190,570,600
蝶理	11,500	2,810.00	32,315,000
豊田通商	160,700	8,497.00	1,365,467,900
三共生興	25,500	720.00	18,360,000
兼松	76,700	2,007.00	153,936,900
ツカモトコーポレーション	1,700	1,180.00	2,006,000
三井物産	1,382,600	5,551.00	7,674,812,600
日本紙パルプ商事	8,800	4,655.00	40,964,000
カメイ	19,500	1,614.00	31,473,000
東都水産	600	7,060.00	4,236,000
O U G ホールディングス	1,800	2,375.00	4,275,000
スターゼン	12,700	2,477.00	31,457,900
山善	55,700	1,198.00	66,728,600
椿本興業	3,800	5,970.00	22,686,000
住友商事	1,110,500	3,199.00	3,552,489,500
内田洋行	7,400	7,210.00	53,354,000
三菱商事	1,212,000	7,059.00	8,555,508,000
第一実業	17,300	1,920.00	33,216,000

キヤノンマーケティングジャパン	42,500	3,630.00	154,275,000
西華産業	7,200	2,499.00	17,992,800
佐藤商事	12,700	1,488.00	18,897,600
菱洋エレクトロ	17,400	3,550.00	61,770,000
東京産業	16,800	824.00	13,843,200
ユアサ商事	14,300	4,315.00	61,704,500
神鋼商事	4,600	5,610.00	25,806,000
トルク	6,600	275.00	1,815,000
阪和興業	33,000	4,345.00	143,385,000
正栄食品工業	12,200	4,415.00	53,863,000
カナデン	13,800	1,439.00	19,858,200
R Y O D E N	14,800	2,521.00	37,310,800
岩谷産業	41,800	7,161.00	299,329,800
ナイス	3,300	1,612.00	5,319,600
ニチモウ	1,600	3,895.00	6,232,000
極東貿易	11,000	1,790.00	19,690,000
アステナホールディングス	34,500	499.00	17,215,500
三愛オブリ	44,100	1,621.00	71,486,100
稲畑産業	36,300	3,125.00	113,437,500
G S I クレオス	10,600	2,002.00	21,221,200
明和産業	24,400	649.00	15,835,600
クワザワホールディングス	4,000	533.00	2,132,000
ワキタ	30,400	1,484.00	45,113,600
東邦ホールディングス	50,800	3,281.00	166,674,800
サンゲツ	42,200	2,765.00	116,683,000
ミツウロコグループホールディングス	23,400	1,302.00	30,466,800
シナネンホールディングス	5,100	3,905.00	19,915,500
伊藤忠エネクス	45,500	1,598.00	72,709,000
サンリオ	52,000	6,622.00	344,344,000
サンワテクノス	9,400	2,137.00	20,087,800
リョーサン	13,000	4,650.00	60,450,000
新光商事	24,700	1,129.00	27,886,300
トーヨー	7,800	3,065.00	23,907,000
三信電気	7,400	2,173.00	16,080,200
東陽テクニカ	18,600	1,308.00	24,328,800
モスフードサービス	27,000	3,205.00	86,535,000
加賀電子	16,800	6,120.00	102,816,000
ソーダニッカ	13,600	980.00	13,328,000
立花エレテック	12,200	2,738.00	33,403,600
フォーバル	7,200	1,193.00	8,589,600
P A L T A C	24,700	4,777.00	117,991,900
三谷産業	32,100	330.00	10,593,000

西本Wismettacホールディングス	4,700	6,290.00	29,563,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,108.00	2,108,000
コア商事ホールディングス	10,300	734.00	7,560,200
KPPグループホールディングス	47,600	694.00	33,034,400
ヤマタネ	8,100	2,160.00	17,496,000
丸紅建材リース	1,100	2,470.00	2,717,000
泉州電業	9,200	3,240.00	29,808,000
トラスコ中山	38,500	2,246.00	86,471,000
オートバックスセブン	63,900	1,510.50	96,520,950
モリト	13,200	1,361.00	17,965,200
加藤産業	22,700	4,595.00	104,306,500
北恵	3,100	886.00	2,746,600
イエローハット	29,200	1,726.00	50,399,200
JKホールディングス	14,100	954.00	13,451,400
日伝	12,400	2,500.00	31,000,000
北沢産業	6,600	287.00	1,894,200
杉本商事	8,900	2,186.00	19,455,400
因幡電機産業	47,600	3,190.00	151,844,000
東テク	6,100	4,785.00	29,188,500
ミスミグループ本社	277,000	2,473.50	685,159,500
アルテック	6,600	233.00	1,537,800
タキヒヨー	3,000	1,009.00	3,027,000
蔵王産業	2,000	2,411.00	4,822,000
スズケン	69,800	5,006.00	349,418,800
ジェコス	11,000	981.00	10,791,000
グローセル	18,800	431.00	8,102,800
ローソン	39,000	7,260.00	283,140,000
サンエー	14,100	4,520.00	63,732,000
カワチ薬品	14,500	2,408.00	34,916,000
エービーシー・マート	80,500	2,426.00	195,293,000
ハードオフコーポレーション	6,000	1,500.00	9,000,000
アスクル	38,200	2,019.00	77,125,800
ゲオホールディングス	20,800	2,313.00	48,110,400
アダストリア	22,300	3,490.00	77,827,000
くら寿司	21,600	3,650.00	78,840,000
キャンドウ	6,700	2,485.00	16,649,500
IKホールディングス	5,200	344.00	1,788,800
パルグループホールディングス	36,200	2,136.00	77,323,200
エディオン	72,900	1,465.00	106,798,500
サーラコーポレーション	39,200	723.00	28,341,600
ワッツ	6,800	555.00	3,774,000
ハローズ	8,400	4,380.00	36,792,000

あみやき亭	4,600	3,640.00	16,744,000
大黒天物産	5,700	6,350.00	36,195,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,605.00	23,754,000
ファーマライズホールディングス	3,400	657.00	2,233,800
アルペン	15,400	1,898.00	29,229,200
ハブ	4,600	749.00	3,445,400
クオールホールディングス	25,500	1,623.00	41,386,500
ジーンズホールディングス	11,000	4,470.00	49,170,000
ビックカメラ	98,000	1,174.00	115,052,000
D C Mホールディングス	97,300	1,200.00	116,760,000
Monotaro	260,500	1,473.00	383,716,500
東京一番フーズ	3,800	508.00	1,930,400
きちりホールディングス	2,900	980.00	2,842,000
J.フロント リテイリング	210,900	1,410.00	297,369,000
ドトール・日レスホールディングス	32,700	2,215.00	72,430,500
マツキヨココカラ&カンパニー	334,000	2,644.00	883,096,000
ブロンコピリー	10,900	3,130.00	34,117,000
Z O Z O	121,400	3,122.00	379,010,800
トレジャー・ファクトリー	9,200	1,202.00	11,058,400
物語コーポレーション	30,800	3,810.00	117,348,000
三越伊勢丹ホールディングス	309,300	1,737.50	537,408,750
Hamee	6,900	1,018.00	7,024,200
マーケットエンタープライズ	1,600	1,234.00	1,974,400
ウエルシアホールディングス	95,400	2,540.00	242,316,000
クリエイティブSDホールディングス	30,500	3,160.00	96,380,000
丸善CHIホールディングス	15,800	328.00	5,182,400
ミサワ	3,000	628.00	1,884,000
ティーライフ	2,000	1,390.00	2,780,000
チムニー	3,800	1,381.00	5,247,800
シュッピン	17,000	1,190.00	20,230,000
オイシックス・ラ・大地	25,000	1,357.00	33,925,000
ネクステージ	42,100	2,228.00	93,798,800
ジョイフル本田	53,600	1,773.00	95,032,800
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,948.00	20,341,200
ホットランド	14,300	2,026.00	28,971,800
すかいらーくホールディングス	251,000	2,238.50	561,863,500
SFPホールディングス	10,000	2,258.00	22,580,000
綿半ホールディングス	14,600	1,335.00	19,491,000
ヨシックスホールディングス	3,500	3,035.00	10,622,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,700	1,026.00	53,044,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	661.00	5,949,000
B E E N O S	8,000	1,504.00	12,032,000

あさひ	17,400	1,300.00	22,620,000
日本調剤	12,800	1,305.00	16,704,000
コスモス薬品	18,200	15,715.00	286,013,000
トーエル	6,100	697.00	4,251,700
セブン&アイ・ホールディングス	632,400	5,663.00	3,581,281,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	124,200	1,057.00	131,279,400
ツルハホールディングス	38,600	12,305.00	474,973,000
サンマルクホールディングス	15,000	2,018.00	30,270,000
フェリシモ	3,200	903.00	2,889,600
トリドールホールディングス	51,500	4,312.00	222,068,000
TOKYO BASE	23,500	291.00	6,838,500
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,129.00	2,709,600
JMホールディングス	14,100	2,004.00	28,256,400
サツドラホールディングス	6,200	766.00	4,749,200
アレンザホールディングス	14,200	1,000.00	14,200,000
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,697.00	8,824,400
バロックジャパンリミテッド	14,800	801.00	11,854,800
クスリのアオキホールディングス	49,200	3,360.00	165,312,000
力の源ホールディングス	8,200	1,739.00	14,259,800
FOOD & LIFE COMPANIES	98,000	2,818.50	276,213,000
メディカルシステムネットワーク	20,900	533.00	11,139,700
はるやまホールディングス	6,100	522.00	3,184,200
ノジマ	53,600	1,401.00	75,093,600
カッパ・クリエイト	28,800	1,626.00	46,828,800
ライトオン	9,200	457.00	4,204,400
良品計画	200,500	2,084.00	417,842,000
パリミキホールディングス	16,500	433.00	7,144,500
アドヴァングループ	17,900	1,016.00	18,186,400
アルビス	6,200	2,521.00	15,630,200
コナカ	13,300	398.00	5,293,400
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,603.00	2,885,400
G - 7ホールディングス	20,400	1,175.00	23,970,000
イオン北海道	54,400	890.00	48,416,000
コジマ	31,000	662.00	20,522,000
ヒマラヤ	4,400	920.00	4,048,000
コーナン商事	22,600	3,720.00	84,072,000
エコス	7,000	2,186.00	15,302,000
ワタミ	19,400	1,008.00	19,555,200
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	370,500	3,394.00	1,257,477,000
西松屋チェーン	36,300	1,903.00	69,078,900

ゼンショーホールディングス	90,500	8,817.00	797,938,500
幸楽苑ホールディングス	13,600	1,096.00	14,905,600
ハークスレイ	5,000	648.00	3,240,000
サイゼリヤ	27,200	5,680.00	154,496,000
V Tホールディングス	70,600	516.00	36,429,600
魚力	6,600	2,182.00	14,401,200
フジ・コーポレーション	9,300	1,656.00	15,400,800
ユナイテッドアローズ	21,800	1,786.00	38,934,800
ハイデイ日高	27,400	2,709.00	74,226,600
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	10,200	155.00	1,581,000
コロワイド	78,900	2,320.50	183,087,450
巻番屋	14,600	5,320.00	77,672,000
P L A N T	3,500	1,362.00	4,767,000
スギホールディングス	37,000	6,358.00	235,246,000
薬王堂ホールディングス	9,100	2,733.00	24,870,300
スクロール	27,800	924.00	25,687,200
ヨンドシーホールディングス	17,600	1,911.00	33,633,600
木曽路	27,900	2,530.00	70,587,000
S R S ホールディングス	30,700	1,042.00	31,989,400
千趣会	34,900	395.00	13,785,500
リテールパートナーズ	27,500	1,794.00	49,335,000
上新電機	18,300	2,260.00	41,358,000
日本瓦斯	97,400	2,360.50	229,912,700
ロイヤルホールディングス	32,300	2,646.00	85,465,800
いなげや	17,900	1,590.00	28,461,000
チヨダ	18,100	828.00	14,986,800
ライフコーポレーション	19,300	3,405.00	65,716,500
リンガーハット	23,700	2,319.00	54,960,300
M r M a x H D	26,400	617.00	16,288,800
A O K I ホールディングス	39,800	1,068.00	42,506,400
オークワ	26,600	831.00	22,104,600
コメリ	28,400	3,215.00	91,306,000
青山商事	39,500	1,477.00	58,341,500
しまむら	21,600	14,885.00	321,516,000
はせがわ	7,300	350.00	2,555,000
高島屋	126,900	2,041.50	259,066,350
松屋	31,200	884.00	27,580,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,300	1,647.00	133,901,100
近鉄百貨店	8,000	2,721.00	21,768,000
丸井グループ	121,800	2,236.50	272,405,700
アクシアル リテイリング	12,600	3,795.00	47,817,000
イオン	622,100	3,080.00	1,916,068,000

イズミ	32,600	3,574.00	116,512,400
平和堂	30,700	2,244.00	68,890,800
フジ	28,200	1,850.00	52,170,000
ヤオコー	20,800	7,871.00	163,716,800
ゼビオホールディングス	25,300	925.00	23,402,500
ケーズホールディングス	130,000	1,280.00	166,400,000
Olympicグループ	5,500	506.00	2,783,000
日産東京販売ホールディングス	16,600	431.00	7,154,600
シルバーライフ	4,000	1,025.00	4,100,000
Genky DrugStores	8,100	5,080.00	41,148,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,121.00	2,690,400
ブックオフグループホールディングス	9,800	1,053.00	10,319,400
ギフトホールディングス	8,000	2,123.00	16,984,000
アインホールディングス	25,400	4,277.00	108,635,800
元気寿司	10,600	3,305.00	35,033,000
ヤマダホールディングス	565,300	428.90	242,457,170
アークランズ	55,100	1,614.00	88,931,400
ニトリホールディングス	66,800	15,615.00	1,043,082,000
グルメ杵屋	15,300	1,066.00	16,309,800
愛眼	9,000	171.00	1,539,000
ケーユーホールディングス	9,000	1,124.00	10,116,000
吉野家ホールディングス	67,700	3,392.00	229,638,400
松屋フーズホールディングス	8,800	4,810.00	42,328,000
サガミホールディングス	27,800	1,375.00	38,225,000
関西フードマーケット	12,800	1,402.00	17,945,600
王将フードサービス	13,700	7,870.00	107,819,000
ミニストップ	13,400	1,524.00	20,421,600
アークス	33,800	2,725.00	92,105,000
パローホールディングス	35,200	2,322.00	81,734,400
ベルク	9,200	6,550.00	60,260,000
大庄	8,100	1,239.00	10,035,900
ファーストリテイリング	82,600	36,820.00	3,041,332,000
サンドラッグ	62,000	4,338.00	268,956,000
サクスパー ホールディングス	17,900	916.00	16,396,400
ヤマザワ	2,600	1,261.00	3,278,600
やまや	2,700	2,921.00	7,886,700
ベルーナ	44,900	616.00	27,658,400
いよぎんホールディングス	203,300	964.70	196,123,510
しずおかフィナンシャルグループ	379,500	1,219.00	462,610,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,800	1,113.50	160,121,300
楽天銀行	59,400	2,613.00	155,212,200
京都フィナンシャルグループ	54,100	8,680.00	469,588,000

島根銀行	3,900	526.00	2,051,400
じもとホールディングス	10,000	577.00	5,770,000
めぶきフィナンシャルグループ	847,600	449.00	380,572,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,900	4,240.00	92,856,000
九州フィナンシャルグループ	330,600	824.20	272,480,520
ゆうちょ銀行	1,877,000	1,472.00	2,762,944,000
富山第一銀行	54,200	894.00	48,454,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	916,500	686.50	629,177,250
西日本フィナンシャルホールディングス	96,400	1,646.00	158,674,400
三十三フィナンシャルグループ	15,300	1,862.00	28,488,600
第四北越フィナンシャルグループ	26,800	3,890.00	104,252,000
ひろぎんホールディングス	243,100	929.60	225,985,760
おきなわフィナンシャルグループ	14,600	2,402.00	35,069,200
十六フィナンシャルグループ	22,100	3,840.00	84,864,000
北國フィナンシャルホールディングス	18,000	4,650.00	83,700,000
プロクレアホールディングス	19,500	1,921.00	37,459,500
あいちフィナンシャルグループ	26,300	2,370.00	62,331,000
あおぞら銀行	122,700	3,047.00	373,866,900
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,697,400	1,276.00	13,649,882,400
りそなホールディングス	1,991,700	783.30	1,560,098,610
三井住友トラスト・ホールディングス	306,600	5,366.00	1,645,215,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,214,500	7,466.00	9,067,457,000
千葉銀行	476,000	1,105.50	526,218,000
群馬銀行	331,500	675.90	224,060,850
武蔵野銀行	23,800	2,740.00	65,212,000
千葉興業銀行	28,200	845.00	23,829,000
筑波銀行	75,000	261.00	19,575,000
七十七銀行	49,700	3,325.00	165,252,500
秋田銀行	11,400	1,988.00	22,663,200
山形銀行	19,000	1,058.00	20,102,000
岩手銀行	10,800	2,535.00	27,378,000
東邦銀行	135,100	285.00	38,503,500
東北銀行	5,500	1,172.00	6,446,000
ふくおかフィナンシャルグループ	148,800	3,531.00	525,412,800
スルガ銀行	150,600	700.00	105,420,000
八十二銀行	366,500	788.40	288,948,600
山梨中央銀行	19,100	1,914.00	36,557,400
大垣共立銀行	32,600	1,879.00	61,255,400
福井銀行	15,300	1,550.00	23,715,000
清水銀行	6,800	1,566.00	10,648,800
富山銀行	1,700	1,704.00	2,896,800
滋賀銀行	28,400	3,765.00	106,926,000

南都銀行	25,700	2,464.00	63,324,800
百五銀行	160,700	535.00	85,974,500
紀陽銀行	61,100	1,595.00	97,454,500
ほくほくフィナンシャルグループ	105,700	1,616.00	170,811,200
山陰合同銀行	106,900	950.00	101,555,000
鳥取銀行	3,600	1,321.00	4,755,600
百十四銀行	16,800	2,613.00	43,898,400
四国銀行	27,100	1,012.00	27,425,200
阿波銀行	24,000	2,514.00	60,336,000
大分銀行	10,300	2,665.00	27,449,500
宮崎銀行	10,300	2,731.00	28,129,300
佐賀銀行	10,000	1,916.00	19,160,000
琉球銀行	36,300	1,145.00	41,563,500
セブン銀行	535,400	301.50	161,423,100
みずほフィナンシャルグループ	2,305,600	2,562.00	5,906,947,200
高知銀行	3,900	985.00	3,841,500
山口フィナンシャルグループ	167,500	1,292.00	216,410,000
名古屋銀行	11,200	5,860.00	65,632,000
北洋銀行	258,800	374.00	96,791,200
大光銀行	3,400	1,325.00	4,505,000
愛媛銀行	23,000	1,040.00	23,920,000
トマト銀行	3,700	1,141.00	4,221,700
京葉銀行	71,700	690.00	49,473,000
栃木銀行	85,300	328.00	27,978,400
北日本銀行	6,000	2,141.00	12,846,000
東和銀行	31,300	619.00	19,374,700
福島銀行	12,000	253.00	3,036,000
大東銀行	4,400	779.00	3,427,600
トモニホールディングス	138,000	479.00	66,102,000
フィデアホールディングス	17,600	1,490.00	26,224,000
池田泉州ホールディングス	236,900	359.00	85,047,100
F P G	57,900	1,511.00	87,486,900
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,583.00	22,162,000
マーキュリアホールディングス	6,000	749.00	4,494,000
S B I ホールディングス	250,000	3,175.00	793,750,000
ジャフコ グループ	51,000	1,676.50	85,501,500
大和証券グループ本社	1,323,300	975.50	1,290,879,150
野村ホールディングス	2,872,700	618.50	1,776,764,950
岡三証券グループ	150,100	721.00	108,222,100
丸三証券	57,000	880.00	50,160,000
東洋証券	45,700	300.00	13,710,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	203,000	545.00	110,635,000

光世証券	2,900	522.00	1,513,800
水戸証券	50,700	439.00	22,257,300
いちよし証券	32,200	719.00	23,151,800
松井証券	84,200	752.00	63,318,400
マネックスグループ	167,500	647.00	108,372,500
極東証券	23,500	1,062.00	24,957,000
岩井コスモホールディングス	19,500	1,750.00	34,125,000
アイザワ証券グループ	24,800	1,178.00	29,214,400
マネーパートナーズグループ	12,400	285.00	3,534,000
スパークス・グループ	19,100	1,438.00	27,465,800
かんぽ生命保険	174,000	2,824.00	491,376,000
F P パートナー	3,400	4,500.00	15,300,000
S O M P O ホールディングス	270,600	6,507.00	1,760,794,200
アニコム ホールディングス	58,000	579.00	33,582,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	382,400	5,383.00	2,058,459,200
第一生命ホールディングス	834,600	3,042.00	2,538,853,200
東京海上ホールディングス	1,688,400	3,697.00	6,242,014,800
T & D ホールディングス	496,600	2,309.50	1,146,897,700
アドバンスクリエイト	9,900	977.00	9,672,300
全国保証	44,700	4,804.00	214,738,800
あんしん保証	6,600	259.00	1,709,400
イントラスト	4,700	803.00	3,774,100
日本モーゲージサービス	6,800	527.00	3,583,600
C a s a	4,700	831.00	3,905,700
アルヒ	16,800	811.00	13,624,800
プレミアグループ	29,000	1,663.00	48,227,000
ネットプロテクションズホールディングス	57,800	276.00	15,952,800
クレディセゾン	108,400	2,352.00	254,956,800
芙蓉総合リース	15,700	11,915.00	187,065,500
みずほリース	28,700	4,855.00	139,338,500
東京センチュリー	32,000	5,660.00	181,120,000
日本証券金融	63,000	1,480.00	93,240,000
アイフル	252,300	380.00	95,874,000
リコーリース	16,300	4,535.00	73,920,500
イオンフィナンシャルサービス	98,300	1,265.50	124,398,650
アコム	305,700	336.90	102,990,330
ジャックス	18,300	5,170.00	94,611,000
オリエントコーポレーション	56,000	1,075.00	60,200,000
オリックス	1,041,300	2,708.50	2,820,361,050
三菱H C キャピタル	761,400	960.20	731,096,280
九州リースサービス	5,600	913.00	5,112,800
日本取引所グループ	445,800	3,078.00	1,372,172,400

イー・ギャランティ	28,000	1,803.00	50,484,000
アサックス	5,600	673.00	3,768,800
NECキャピタルソリューション	8,500	3,255.00	27,667,500
Robot Home	51,000	182.00	9,282,000
大東建託	62,600	16,090.00	1,007,234,000
いちご	198,700	342.00	67,955,400
日本駐車場開発	183,900	205.00	37,699,500
スター・マイカ・ホールディングス	21,000	600.00	12,600,000
SREホールディングス	8,600	2,628.00	22,600,800
ADワークスグループ	28,600	232.00	6,635,200
ヒューリック	398,900	1,427.00	569,230,300
野村不動産ホールディングス	95,200	3,729.00	355,000,800
三重交通グループホールディングス	37,800	561.00	21,205,800
サムティ	27,500	2,414.00	66,385,000
ディア・ライフ	30,000	868.00	26,040,000
地主	13,400	2,173.00	29,118,200
プレサンスコーポレーション	27,500	1,484.00	40,810,000
ハウスコム	2,600	818.00	2,126,800
JPMC	10,500	1,113.00	11,686,500
サンセイランディック	4,100	1,052.00	4,313,200
フージャースホールディングス	26,300	1,050.00	27,615,000
オープンハウスグループ	62,700	4,135.00	259,264,500
東急不動産ホールディングス	514,300	958.50	492,956,550
飯田グループホールディングス	163,900	2,278.50	373,446,150
イーランド	2,200	1,478.00	3,251,600
ムゲンエステート	8,300	1,224.00	10,159,200
And Doホールディングス	10,300	1,053.00	10,845,900
シーアールイー	9,900	1,583.00	15,671,700
ケイアイスター不動産	8,400	3,355.00	28,182,000
グッドコムアセット	16,600	959.00	15,919,400
ジェイ・エス・ビー	8,800	2,497.00	21,973,600
ロードスターキャピタル	11,500	2,030.00	23,345,000
テンポイノベーション	4,100	1,122.00	4,600,200
フェイスネットワーク	3,600	1,366.00	4,917,600
パーク24	111,300	1,753.00	195,108,900
パラカ	6,400	1,965.00	12,576,000
三井不動産	790,100	3,459.00	2,732,955,900
三菱地所	1,116,900	1,942.00	2,169,019,800
平和不動産	27,900	3,840.00	107,136,000
東京建物	149,600	2,095.00	313,412,000
京阪神ビルディング	32,400	1,332.00	43,156,800
住友不動産	247,200	4,166.00	1,029,835,200

テーオーシー	31,900	599.00	19,108,100
東京楽天地	3,000	4,185.00	12,555,000
レオパレス21	170,900	444.00	75,879,600
スターツコーポレーション	24,700	2,774.00	68,517,800
フジ住宅	24,900	689.00	17,156,100
空港施設	25,200	560.00	14,112,000
明和地所	9,100	1,138.00	10,355,800
ゴールドクレスト	14,200	2,006.00	28,485,200
エスリード	8,300	3,055.00	25,356,500
日神グループホールディングス	28,700	490.00	14,063,000
日本エスコン	32,000	897.00	28,704,000
MIRARTHホールディングス	78,500	454.00	35,639,000
AVANTIA	7,200	842.00	6,062,400
イオンモール	88,900	1,714.50	152,419,050
毎日コムネット	5,200	719.00	3,738,800
ファースト住建	5,200	1,106.00	5,751,200
カチタス	46,200	2,183.00	100,854,600
トーセイ	28,800	1,891.00	54,460,800
穴吹興産	2,600	1,983.00	5,155,800
サンフロンティア不動産	25,700	1,553.00	39,912,100
FJネクストホールディングス	18,600	1,159.00	21,557,400
インテリックス	2,800	508.00	1,422,400
ランドビジネス	4,200	269.00	1,129,800
サンネクスタグループ	4,100	938.00	3,845,800
グランディハウス	12,200	576.00	7,027,200
日本空港ビルデング	60,500	6,923.00	418,841,500
明豊ファシリティワークス	6,400	791.00	5,062,400
LIFULL	62,300	199.00	12,397,700
MIXI	38,400	2,321.00	89,126,400
ジェイエシーリクルートメント	16,200	2,587.00	41,909,400
日本M&Aセンターホールディングス	284,500	678.50	193,033,250
メンバーズ	6,300	1,093.00	6,885,900
中広	2,400	415.00	996,000
UTグループ	23,700	2,218.00	52,566,600
アイティメディア	7,000	1,010.00	7,070,000
E・Jホールディングス	10,600	1,617.00	17,140,200
オープンアップグループ	53,600	2,063.00	110,576,800
コシダカホールディングス	53,700	1,070.00	57,459,000
アルトナー	4,300	1,768.00	7,602,400
パソナグループ	21,800	2,266.00	49,398,800
CDS	3,100	1,702.00	5,276,200
リンクアンドモチベーション	51,300	523.00	26,829,900

エス・エム・エス	62,600	2,667.50	166,985,500
サニーサイドアップグループ	3,900	655.00	2,554,500
パーソルホールディングス	1,816,200	245.50	445,877,100
リニカル	7,200	548.00	3,945,600
クックパッド	51,300	132.00	6,771,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	662.00	4,170,600
学情	9,300	1,837.00	17,084,100
スタジオアリス	9,100	2,040.00	18,564,000
シミックホールディングス	8,800	2,643.00	23,258,400
エプロ	3,700	773.00	2,860,100
N J S	4,000	2,675.00	10,700,000
総合警備保障	298,100	845.90	252,162,790
カカクコム	118,000	1,658.50	195,703,000
アイロムグループ	7,400	1,922.00	14,222,800
セントケア・ホールディング	13,300	914.00	12,156,200
サイネックス	2,500	841.00	2,102,500
ルネサンス	14,200	863.00	12,254,600
ディップ	27,400	3,125.00	85,625,000
デジタルホールディングス	12,900	1,130.00	14,577,000
新日本科学	16,400	1,619.00	26,551,600
キャリアデザインセンター	2,600	1,884.00	4,898,400
ベネフィット・ワン	62,200	1,483.50	92,273,700
エムスリー	352,400	2,394.00	843,645,600
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	379.00	2,880,400
アウトソーシング	114,700	1,161.50	133,224,050
ウェルネット	9,600	556.00	5,337,600
ワールドホールディングス	8,100	2,620.00	21,222,000
ディー・エヌ・エー	63,600	1,471.50	93,587,400
博報堂D Yホールディングス	227,600	1,085.50	247,059,800
ぐるなび	34,300	302.00	10,358,600
タカミヤ	24,800	471.00	11,680,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	997.00	8,873,300
ファンコミュニケーションズ	32,300	412.00	13,307,600
ライク	6,800	1,429.00	9,717,200
A o b a - B B T	5,200	416.00	2,163,200
エスプール	52,100	401.00	20,892,100
W D Bホールディングス	9,200	2,217.00	20,396,400
ティア	7,700	465.00	3,580,500
C D G	1,500	1,221.00	1,831,500
アドウェイズ	25,100	547.00	13,729,700
バリューコマース	15,900	1,316.00	20,924,400
インフォマート	185,900	451.00	83,840,900

J Pホールディングス	52,000	388.00	20,176,000
エコナックホールディングス	12,300	146.00	1,795,800
C Lホールディングス	5,100	822.00	4,192,200
プレステージ・インターナショナル	83,900	666.00	55,877,400
アミューズ	11,100	1,476.00	16,383,600
ドリームインキュベータ	6,200	3,020.00	18,724,000
クイック	12,500	2,142.00	26,775,000
T A C	7,300	202.00	1,474,600
電通グループ	175,300	3,942.00	691,032,600
イオンファンタジー	6,500	2,665.00	17,322,500
シーティーエス	23,000	663.00	15,249,000
ネクシィーズグループ	4,000	699.00	2,796,000
H . U . グループホールディングス	52,300	2,569.00	134,358,700
アルプス技研	17,000	2,686.00	45,662,000
日本空調サービス	19,500	785.00	15,307,500
オリエンタルランド	943,600	5,157.00	4,866,145,200
ダスキン	39,800	3,171.00	126,205,800
明光ネットワークジャパン	22,100	709.00	15,668,900
ファルコホールディングス	8,200	2,003.00	16,424,600
ラウンドワン	168,300	571.00	96,099,300
リゾートトラスト	77,600	2,274.00	176,462,400
ビー・エム・エル	22,000	2,934.00	64,548,000
リソー教育	92,300	238.00	21,967,400
早稲田アカデミー	10,100	1,589.00	16,048,900
ユー・エス・エス	200,100	2,872.00	574,687,200
東京個別指導学院	21,700	480.00	10,416,000
サイバーエージェント	394,300	819.70	323,207,710
楽天グループ	1,527,500	562.00	858,455,000
クリーク・アンド・リバー社	9,100	2,075.00	18,882,500
S B I グローバルアセットマネジメント	35,400	552.00	19,540,800
テー・オー・ダブリュー	35,900	317.00	11,380,300
山田コンサルティンググループ	9,200	1,682.00	15,474,400
セントラルスポーツ	6,800	2,417.00	16,435,600
フルキャストホールディングス	17,200	1,985.00	34,142,000
エン・ジャパン	29,200	2,287.00	66,780,400
リソルホールディングス	1,100	5,210.00	5,731,000
テクノプロ・ホールディングス	105,600	3,427.00	361,891,200
アトラグループ	3,600	203.00	730,800
アイ・アールジャパンホールディングス	9,500	1,510.00	14,345,000
K e e P e r 技研	11,100	5,870.00	65,157,000
ファーストロジック	3,400	500.00	1,700,000
三機サービス	2,100	1,084.00	2,276,400

Gunosy	14,600	691.00	10,088,600
デザインワン・ジャパン	4,800	159.00	763,200
イー・ガーディアン	6,900	1,551.00	10,701,900
リブセンス	6,500	281.00	1,826,500
ジャパンマテリアル	54,700	2,260.00	123,622,000
ベクトル	22,100	1,117.00	24,685,700
ウチヤマホールディングス	5,900	350.00	2,065,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,100	1,192.00	17,999,200
キャリアリンク	6,700	2,132.00	14,284,400
I B J	14,100	712.00	10,039,200
アサンテ	9,000	1,580.00	14,220,000
バリューHR	15,800	1,405.00	22,199,000
M & Aキャピタルパートナーズ	14,500	2,152.00	31,204,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,300	1,022.00	7,460,600
E R Iホールディングス	3,200	1,792.00	5,734,400
アビスト	1,900	3,075.00	5,842,500
シグマクシス・ホールディングス	24,200	1,310.00	31,702,000
ウィルグループ	15,100	1,092.00	16,489,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	141.00	2,072,700
メドピア	16,000	774.00	12,384,000
レアジョブ	2,600	941.00	2,446,600
リクルートホールディングス	1,320,000	5,118.00	6,755,760,000
エラン	24,000	946.00	22,704,000
土木管理総合試験所	6,400	320.00	2,048,000
日本郵政	2,095,300	1,314.00	2,753,224,200
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,645.00	31,748,500
鎌倉新書	15,700	590.00	9,263,000
S M N	3,600	291.00	1,047,600
グローバルキッズCOMPANY	2,700	642.00	1,733,400
エアトリ	13,200	1,819.00	24,010,800
アトラエ	10,800	788.00	8,510,400
ストライク	7,600	3,810.00	28,956,000
ソラスト	49,600	590.00	29,264,000
セラク	5,700	1,299.00	7,404,300
インソース	39,000	985.00	38,415,000
ベイカレント・コンサルティング	131,100	4,645.00	608,959,500
Orchestra Holdings	4,100	940.00	3,854,000
アイモバイル	24,400	470.00	11,468,000
キャリアインデックス	5,100	228.00	1,162,800
MS - Japan	5,900	1,157.00	6,826,300
船場	2,800	922.00	2,581,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,900	2,292.00	132,706,800

フルテック	1,900	1,211.00	2,300,900
GameWith	4,500	310.00	1,395,000
MS&Consulting	1,900	663.00	1,259,700
ウェルビー	13,500	719.00	9,706,500
エル・ティー・エス	2,100	3,570.00	7,497,000
ミダックホールディングス	11,000	1,815.00	19,965,000
キュービーネットホールディングス	8,700	1,558.00	13,554,600
RPAホールディングス	25,100	283.00	7,103,300
スプリックス	3,800	794.00	3,017,200
マネジメントソリューションズ	7,700	2,936.00	22,607,200
プロレド・パートナーズ	5,100	374.00	1,907,400
テノ・ホールディングス	2,000	461.00	922,000
フロンティア・マネジメント	5,200	1,578.00	8,205,600
ピアラ	2,900	320.00	928,000
コプロ・ホールディングス	4,200	1,490.00	6,258,000
ギークス	2,000	501.00	1,002,000
アンビスホールディングス	19,200	2,806.00	53,875,200
カーブスホールディングス	49,200	640.00	31,488,000
フォーラムエンジニアリング	12,300	1,511.00	18,585,300
Fast Fitness Japan	6,300	1,079.00	6,797,700
ダイレクトマーケティングミックス	19,100	459.00	8,766,900
ポピンズ	2,900	1,376.00	3,990,400
LITALICO	14,000	2,083.00	29,162,000
コンフィデンス・インターワークス	1,000	1,500.00	1,500,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	451.00	2,751,100
リログループ	89,500	1,537.50	137,606,250
東祥	12,700	792.00	10,058,400
ID&Eホールディングス	10,800	3,305.00	35,694,000
ビーウィズ	4,700	2,250.00	10,575,000
TREホールディングス	34,400	1,154.00	39,697,600
人・夢・技術グループ	6,900	1,795.00	12,385,500
NISSOホールディングス	15,800	803.00	12,687,400
大栄環境	32,500	2,306.00	74,945,000
日本管財ホールディングス	18,800	2,497.00	46,943,600
M&A総研ホールディングス	8,600	3,555.00	30,573,000
エイチ・アイ・エス	52,000	1,768.00	91,936,000
ラックランド	8,200	2,641.00	21,656,200
共立メンテナンス	28,000	6,149.00	172,172,000
イチネンホールディングス	19,100	1,541.00	29,433,100
建設技術研究所	9,200	4,635.00	42,642,000
スペース	12,300	903.00	11,106,900
燦ホールディングス	17,000	1,058.00	17,986,000

スバル興業	1,000	13,660.00	13,660,000	
東京テアトル	4,400	1,070.00	4,708,000	
タナベコンサルティンググループ	5,600	1,007.00	5,639,200	
ナガワ	5,600	6,400.00	35,840,000	
東京都競馬	15,000	4,275.00	64,125,000	
カナモト	27,800	2,530.00	70,334,000	
ニシオホールディングス	16,700	3,595.00	60,036,500	
トランス・コスモス	22,200	3,110.00	69,042,000	
乃村工藝社	78,100	826.00	64,510,600	
藤田観光	7,100	4,045.00	28,719,500	
KNT-CTホールディングス	10,600	1,271.00	13,472,600	
トーカイ	15,900	1,896.00	30,146,400	
セコム	181,600	10,600.00	1,924,960,000	
セントラル警備保障	9,700	2,468.00	23,939,600	
丹青社	34,900	877.00	30,607,300	
メイテックグループホールディングス	64,300	2,894.50	186,116,350	
応用地質	16,800	2,089.00	35,095,200	
船井総研ホールディングス	37,200	2,524.00	93,892,800	
進学会ホールディングス	4,900	283.00	1,386,700	
オオバ	7,700	934.00	7,191,800	
いであ	3,400	1,644.00	5,589,600	
学究社	7,300	1,940.00	14,162,000	
ベネッセホールディングス	60,100	2,613.00	157,041,300	
イオンディライト	19,800	3,390.00	67,122,000	
ナック	7,900	971.00	7,670,900	
ダイセキ	36,500	4,120.00	150,380,000	
ステップ	6,700	1,851.00	12,401,700	
合計	261,429,900		584,817,153,820	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

資産総額	2,540,224,338円
負債総額	2,299,358円
純資産総額（ - ）	2,537,924,980円
発行済口数	2,387,804,755口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0629円
（1万口当たり純資産額）	（10,629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

(2023年12月29日現在)

資産総額	302,074,794,805円
負債総額	205,827,710円
純資産総額（ - ）	301,868,967,095円
発行済口数	89,034,389,708口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3905円
（1万口当たり純資産額）	（33,905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

(2023年12月29日現在)

資産総額	594,166,725,557円
負債総額	287,749,566円
純資産総額（ - ）	593,878,975,991円
発行済口数	244,296,624,247口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4310円
（1万口当たり純資産額）	（24,310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、
- 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、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、
- 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、

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、）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（2023年12月29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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(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、監査等委員以外の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発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2024年 2月20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。

2023年12月29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	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	63	218,373
単体型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

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37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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38期事業年度の間接会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の間接財務諸表について、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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918

その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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
	其他有価証券 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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

株主資本				
------	--	--	--	--

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

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. 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）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21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。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（表示方法の変更）

（貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額の重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

（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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

（株主資本等変動計算書関係）

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

(2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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	当事業年度末
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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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・カテゴリ毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払い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。

(4) 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。

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 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（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	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)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
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	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*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（貸借対照表計上額は960百万円）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貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

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

前事業年度（2022年3月31日）

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）
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計	7,458	-	48	48	

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

(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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	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100百万円、当事業年度109百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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 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あります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (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（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）

当事業年度（2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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いません。

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

負債の部

流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023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		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間
（自 2023年4月1日
至 2023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。

（表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額の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38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
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38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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38期中間会計期間末（2023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)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(*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1,041百万円）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16,243百万円です。

(*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271百万円）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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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38期中間会計期間末（2023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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(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271百万円）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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(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	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(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	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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	5,057百万円

〔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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86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38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
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) 通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実行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

2024年 2月20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（2023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） （2023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	19,495	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。
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（2023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
2023年 6月15日	臨時報告書
2023年 8月18日	有価証券届出書
2023年 8月18日	有価証券報告書
2023年 9月15日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2023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2023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

2024年1月31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 公認会計士 中島紀子
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2023年5月20日から2023年11月20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2023年11月20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

2023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

田中洋一

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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、継続企業の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に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、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。