

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年8月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。  
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

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

### （６）【申込単位】

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

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

### （７）【申込期間】

2024年 8月21日から2025年 2月19日までとします。

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

2024年11月5日受付分からは、取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半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所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資

コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
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－バ ル  (日本を 含む)	ファミリー ファンド  ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり  ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	日本  北米  欧州  アジア  オセアニ ア  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、短期 金融資産)資産 配分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## < 商品分類表定義 >

### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

### [ 投資対象地域による区分 ]

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

### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

### [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)... 「MRF及びMMF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)... 「MRF及びMMF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 ]

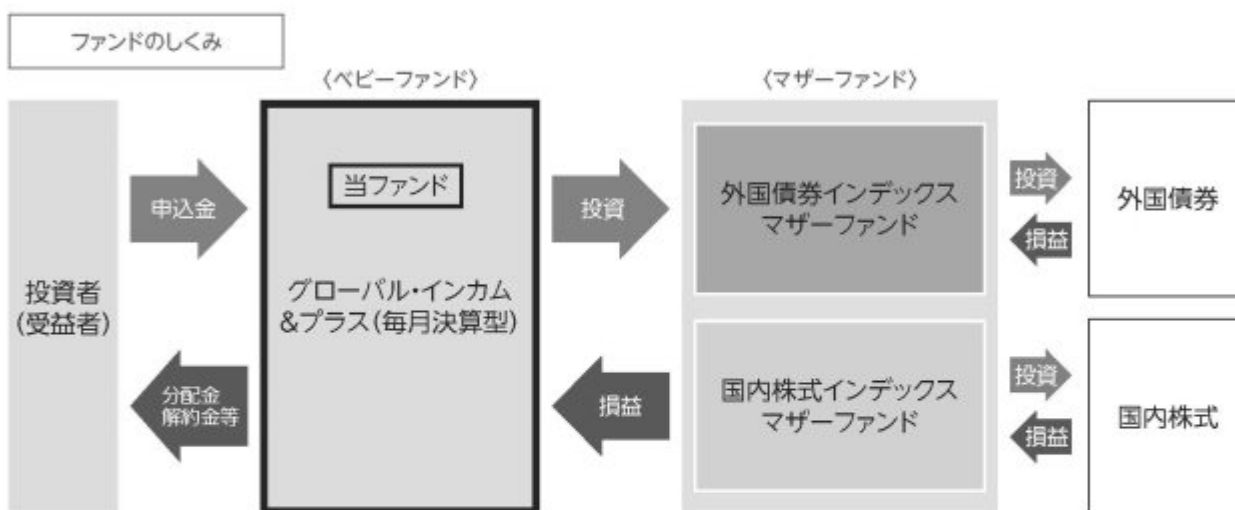
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、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。

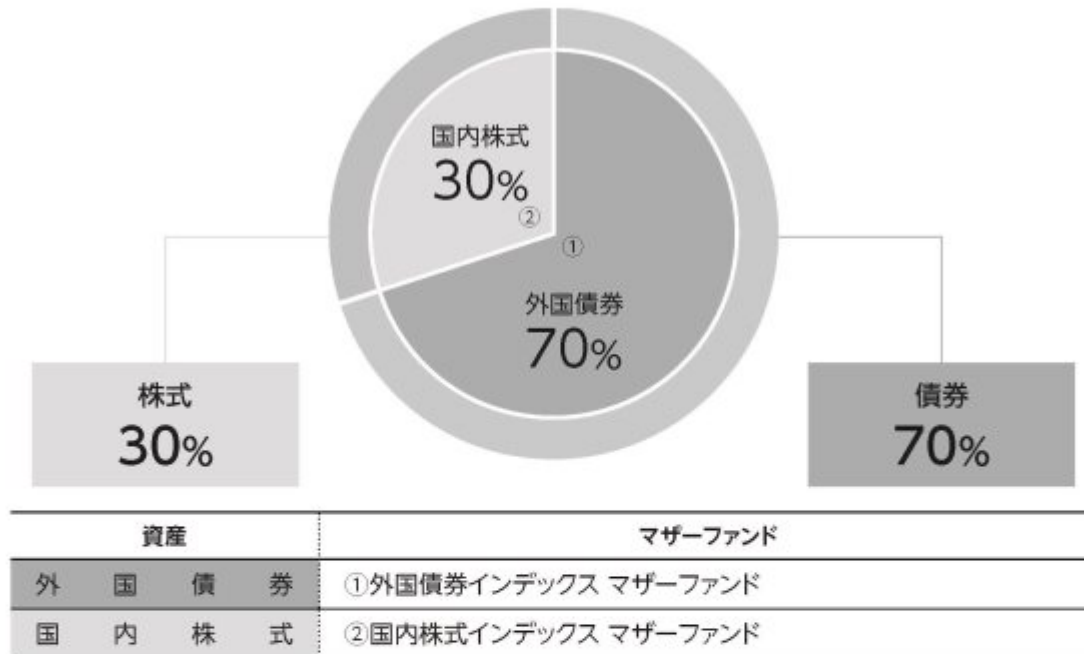
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※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。

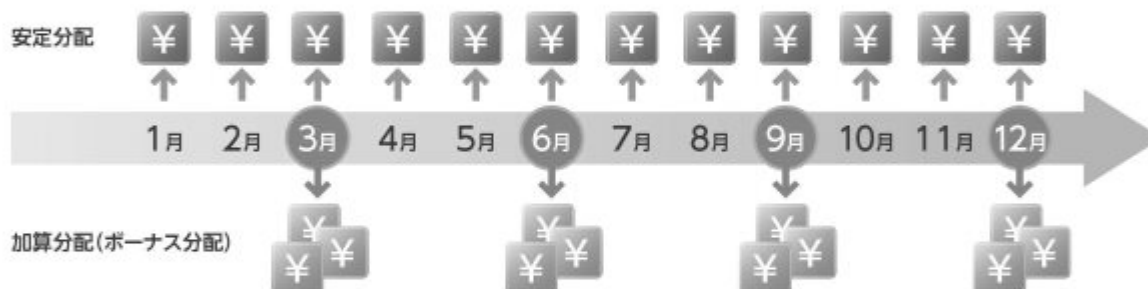
4.

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

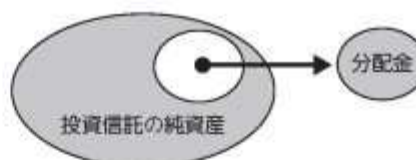
- 株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

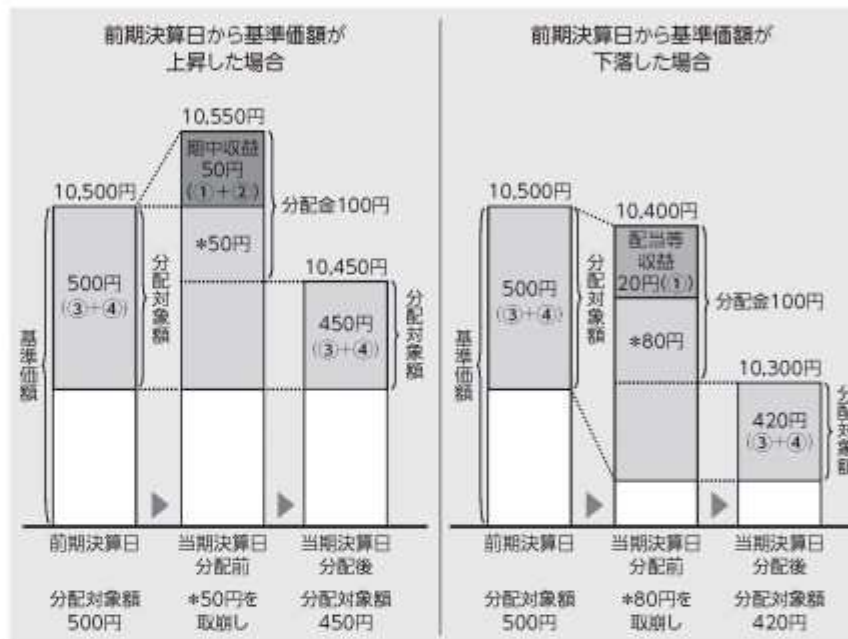


分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超過して支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

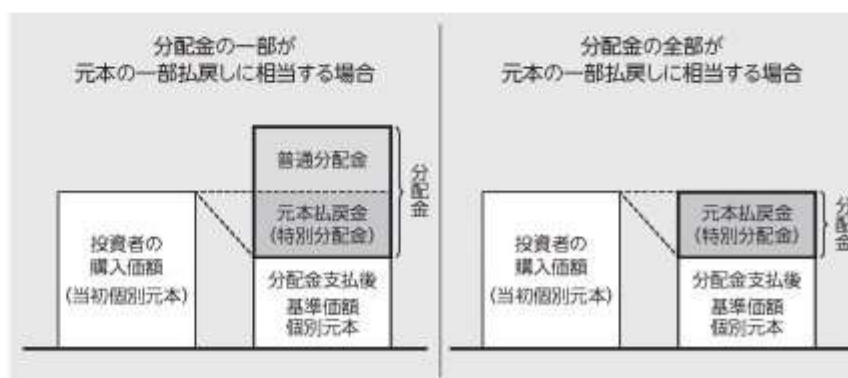
※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。分配対象額とは、  
① 経費控除後の配当等収益  
② 経費控除後の評価益を含む売買益  
③ 分配準備積立金  
④ 収益調整金  
です。

※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

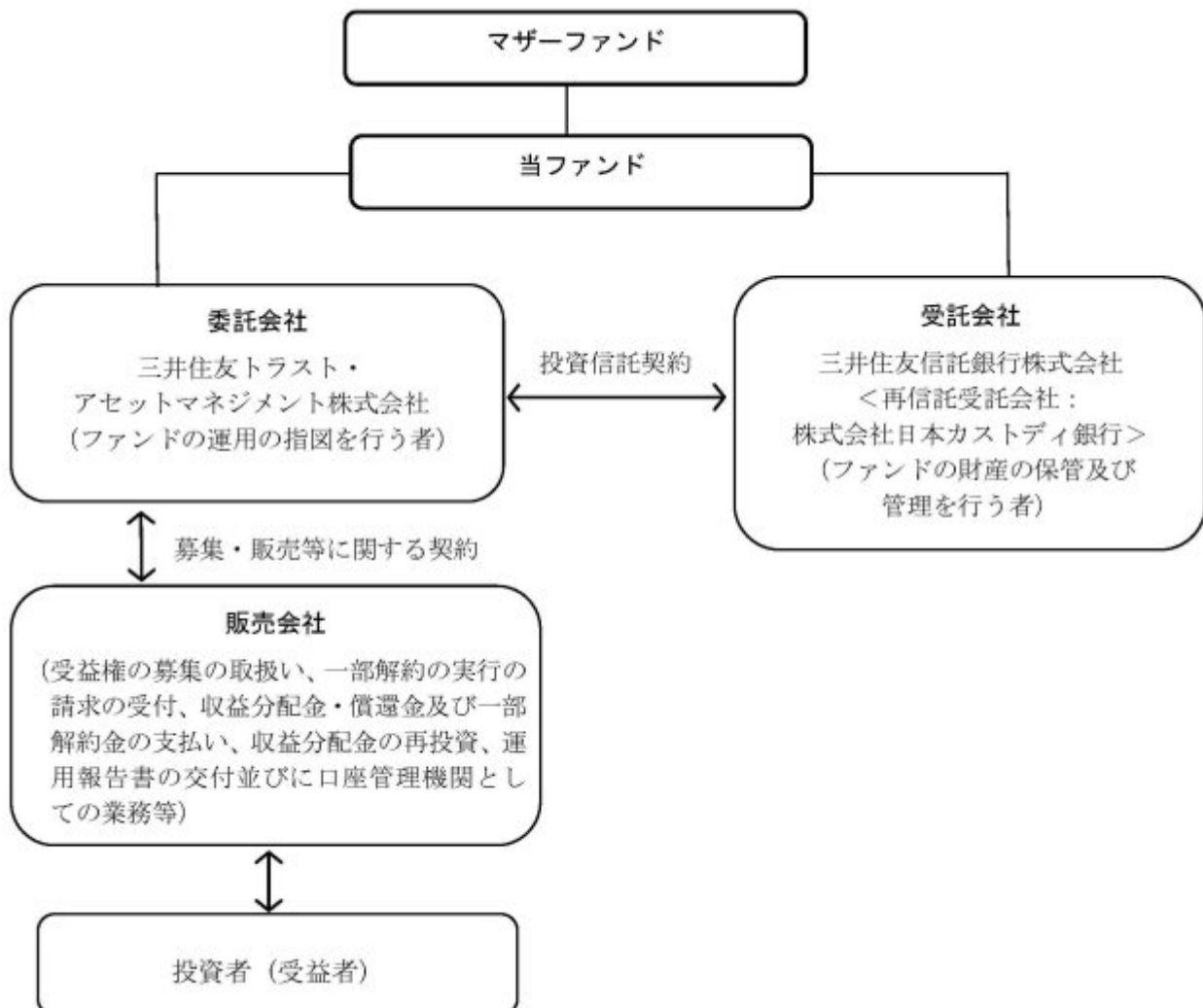
2012年4月1日

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（2024年 6月28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。

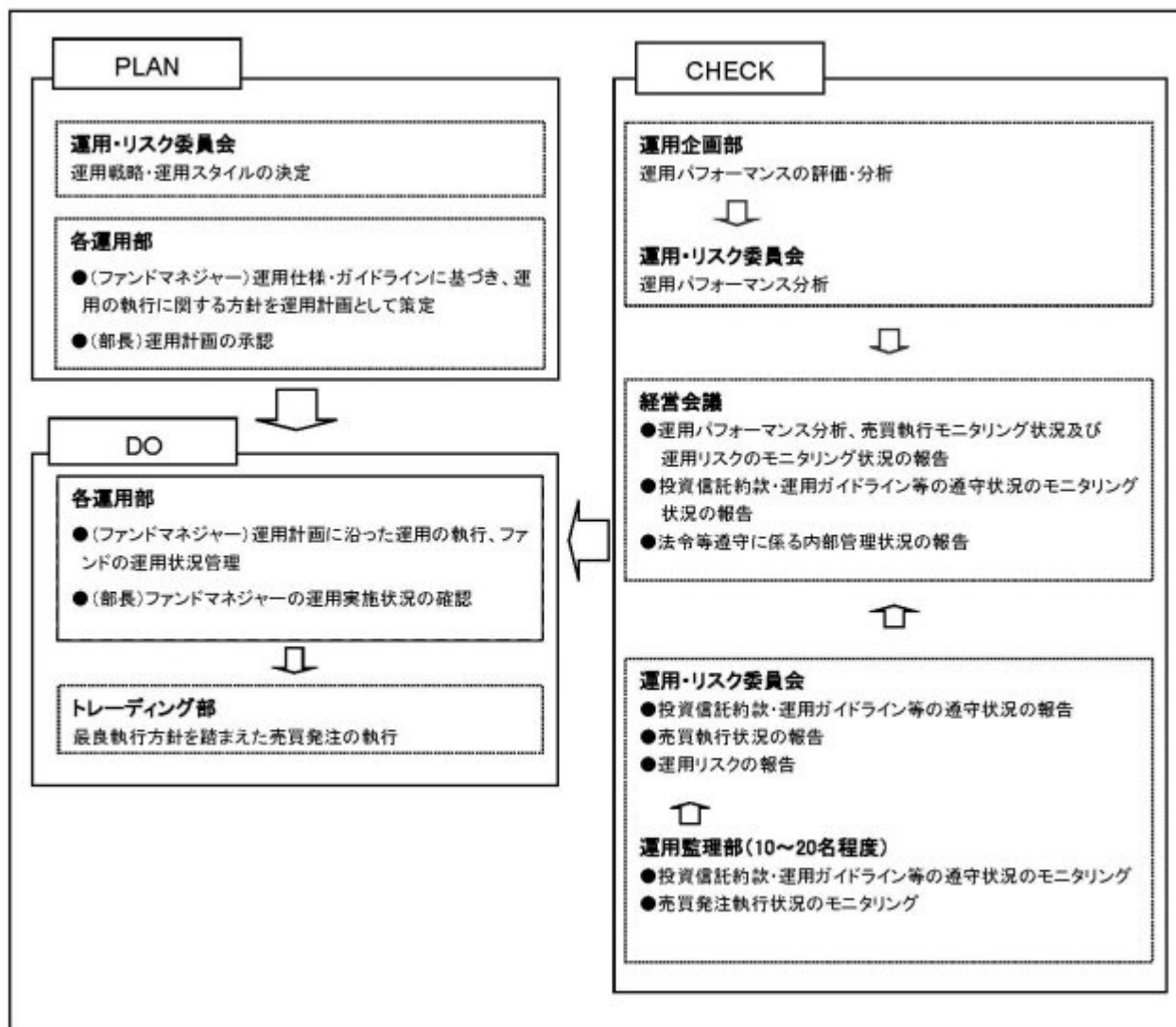
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

##### 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、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性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。

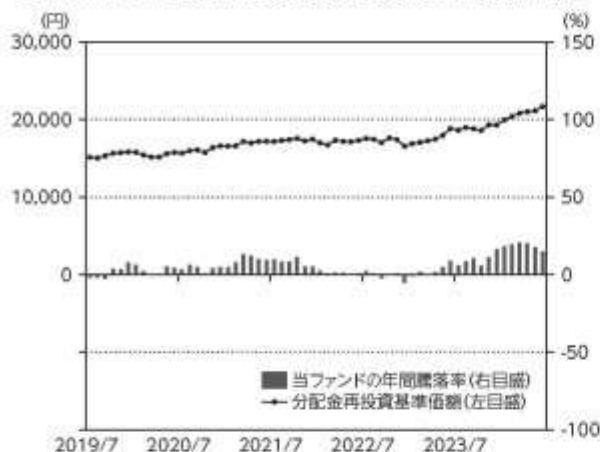
## (2) リスクの管理体制

### 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】

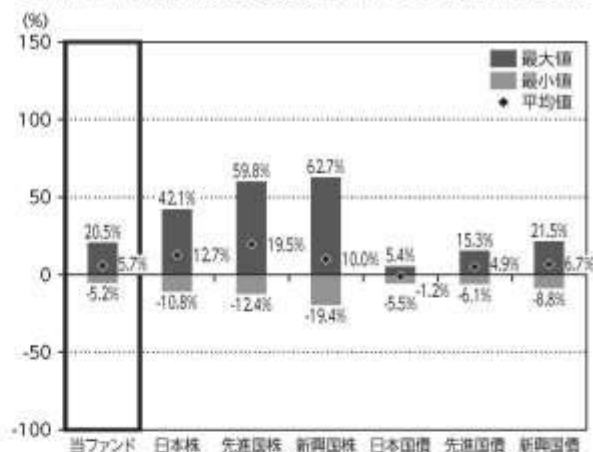
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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7月～2024年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を高めるマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の知的所有権及びその他の権利は株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は債権に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の知的所有権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。
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。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の権利は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きを表す投資収益指数で、一定の組み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。同指数の知的所有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・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、排他又は遅延につき自ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPELガバナンス・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバインデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

じ。 )。

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

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

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

## (2) 【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額( )の控除はありません。

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

## (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、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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 (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

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率( ) を乗じて得た額

2024年8月21日現在、合計で49.5% (税抜45%) 以内とし、その配分は委託会社29.7% (税抜27%)、受託会社19.8% (税抜18%) です。(品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。)

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ず（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6月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

**(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11月21日～2024年5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、2024年6月28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	2,473,238,817	97.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		70,706,570	2.78
合計(純資産総額)		2,543,945,387	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(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	463,705,400	3.6993	1,715,385,387	3.7511	1,739,405,325	68.37
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	251,295,628	2.8328	711,870,255	2.9202	733,833,492	28.85

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(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	97.22
合計	97.22

(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
第39特定期間末	(2024年 5月20日)	2,603,356,560	2,605,702,994	11,095	11,105
	2023年 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	
	2024年 1月末日	2,607,015,595		10,979	
	2月末日	2,649,104,841		11,218	
	3月末日	2,563,957,755		10,922	
	4月末日	2,588,714,506		11,013	
	5月末日	2,585,909,603		11,069	
	6月末日	2,543,945,387		10,842	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第39特定期間	2023年11月21日～2024年 5月20日	610

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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
第39特定期間	2023年11月21日～2024年 5月20日	9.0

(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
第39特定期間	2023年11月21日～2024年 5月20日	35,218,604	104,259,926	2,346,434,066

(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	168,082,972,717	46.19
	中国	35,187,888,723	9.67
	フランス	26,923,633,882	7.40
	イタリア	25,040,783,619	6.88
	ドイツ	21,795,862,145	5.99
	イギリス	18,646,340,811	5.12
	スペイン	16,570,758,781	4.55
	カナダ	7,205,465,743	1.98
	ベルギー	6,079,521,334	1.67
	オランダ	5,229,107,856	1.44
	オーストラリア	4,576,534,110	1.26
	オーストリア	4,101,620,953	1.13
	メキシコ	2,771,446,124	0.76

	ポーランド	1,920,635,987	0.53
	フィンランド	1,904,230,101	0.52
	アイルランド	1,765,775,986	0.49
	マレーシア	1,741,553,750	0.48
	シンガポール	1,485,894,524	0.41
	イスラエル	1,090,749,304	0.30
	ニュージーランド	914,347,511	0.25
	デンマーク	912,214,907	0.25
	スウェーデン	579,853,321	0.16
	ノルウェー	575,387,062	0.16
	小計	355,102,579,251	97.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,821,162,892	2.42
合計(純資産総額)		363,923,742,143	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,188,609,093	0.60
	買建	ドイツ	1,894,416,796	0.52

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,979,748,923	1.37

(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を用いております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	14,967.55	2,319,971,108	15,074.20	2,336,501,247	1.500	2026/8/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	15,946.87	2,256,482,629	16,111.71	2,279,808,219	4.375	2028/8/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,625.99	2,187,638,901	15,920.44	2,228,862,754	4.125	2032/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,723.74	2,006,846,905	15,018.20	2,046,981,271	3.375	2033/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	15,050.39	1,989,662,101	15,194.06	2,008,654,762	2.875	2028/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	14,126.65	1,822,338,741	14,408.84	1,858,740,872	2.750	2032/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	15,060.67	1,760,592,806	15,178.95	1,774,420,413	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	15,725.08	1,753,347,298	15,768.04	1,758,136,615	3.000	2025/7/15	0.48

アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	15,358.65	1,700,203,546	15,591.07	1,725,931,741	3.875	2033/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,894.57	1,668,191,919	15,182.42	1,700,431,097	3.500	2033/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	13,945.45	1,677,638,014	14,131.06	1,699,966,663	1.125	2028/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,895.66	1,622,274,893	13,162.43	1,655,834,834	1.375	2031/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	15,112.26	1,627,591,150	15,206.64	1,637,755,540	1.625	2026/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	15,723.20	1,603,766,447	15,771.01	1,608,643,832	3.125	2025/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,970.15	1,597,015,347	16,040.62	1,604,062,160	4.500	2026/7/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	14,700.78	1,587,684,601	14,815.29	1,600,051,767	0.625	2026/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	15,143.09	1,576,396,368	15,317.37	1,594,539,199	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	13,321.93	1,561,330,904	13,589.65	1,592,707,226	1.875	2032/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,702.50	1,517,949,785	12,951.66	1,547,723,827	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	15,080.17	1,517,065,982	15,236.84	1,532,826,551	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	16,021.74	1,525,270,231	16,099.13	1,532,637,677	4.625	2026/10/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	16,047.85	1,487,636,346	16,357.41	1,516,332,239	4.500	2033/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	14,312.26	1,445,538,761	14,586.58	1,473,245,317	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	15,711.87	1,445,492,514	15,953.16	1,467,691,233	4.125	2030/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,825.51	1,430,044,733	13,074.98	1,457,860,609	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/28/31	9,000,000	15,878.60	1,429,074,700	16,069.24	1,446,232,430	4.250	2031/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	14,873.17	1,412,951,974	14,978.25	1,422,933,914	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	15,593.58	1,403,423,044	15,659.33	1,409,340,477	2.875	2025/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	13,968.41	1,340,968,146	14,130.74	1,356,551,677	0.625	2027/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,987.92	1,328,852,668	14,175.10	1,346,634,852	1.250	2028/9/30	0.37

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.58
合計	97.58

(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	53	アメリカドル	5,644,066.99	909,089,870	5,654,437.5	910,760,248	0.25
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	33	アメリカドル	3,628,505.97	584,443,457	3,638,250	586,012,928	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	36	アメリカドル	4,275,123.65	688,594,166	4,295,250	691,835,917	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	18	ユーロ	1,900,967.8	327,593,781	1,903,230	327,983,626	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,140,346.7	541,175,946	3,147,930	542,482,776	0.15

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	45	ユーロ	5,924,414.5	1,020,954,351	5,941,800	1,023,950,394	0.28
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	---------------	-----------	---------------	------

(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	15,200,000.00	2,402,193,389	2,441,556,240	0.67
	カナダドル	買建	1,570,000.00	180,735,066	183,920,947	0.05
	ユーロ	買建	9,090,000.00	1,540,696,374	1,563,418,188	0.43
	イギリスポンド	買建	1,340,000.00	268,453,282	271,939,600	0.07
	オフショア人民元	買建	23,590,000.00	512,703,906	518,913,948	0.14

(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	669,539,029,090	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,252,405,913	2.08
合計(純資産総額)		683,791,435,003	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	14,164,920,000	2.07

(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	9,011,100	3,389.70	30,544,925,670	3,290.00	29,646,519,000	4.34
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,163,300	1,636.96	16,636,948,600	1,729.00	17,572,345,700	2.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,186,600	12,495.00	14,826,567,000	13,640.00	16,185,224,000	2.37
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,112,500	3,170.84	13,040,117,500	3,601.00	14,809,112,500	2.17

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,168,700	10,040.00	11,733,748,000	10,725.00	12,534,307,500	1.83
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	358,600	35,375.82	12,685,772,000	34,900.00	12,515,140,000	1.83
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,500	70,009.48	11,866,607,000	70,550.00	11,958,225,000	1.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,442,500	3,356.67	11,555,340,200	3,148.00	10,836,990,000	1.58
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,254,600	7,763.63	9,740,261,800	8,607.00	10,798,342,200	1.58
日本	株式	三井物産	卸売業	2,685,600	4,032.08	10,828,564,000	3,651.00	9,805,125,600	1.43
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,630,200	5,360.83	8,739,229,400	6,005.00	9,789,351,000	1.43
日本	株式	信越化学工業	化学	1,522,800	5,888.16	8,966,498,200	6,238.00	9,499,226,400	1.39
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,205,700	7,287.30	8,786,303,100	7,854.00	9,469,567,800	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	1,070,300	8,269.47	8,850,818,000	8,556.00	9,157,486,800	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	838,700	8,962.89	7,517,179,800	10,390.00	8,714,093,000	1.27
日本	株式	第一三共	医薬品	1,481,200	5,451.71	8,075,083,700	5,524.00	8,182,148,800	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	50,576,200	152.00	7,687,636,900	151.80	7,677,467,160	1.12
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,253,700	3,132.06	7,058,733,600	3,358.00	7,567,924,600	1.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,016,800	1,739.94	6,989,026,800	1,720.00	6,908,896,000	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,504,800	4,112.90	6,189,104,700	4,172.00	6,278,025,600	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	333,700	18,635.18	6,218,562,500	18,705.00	6,241,858,500	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,714,800	1,874.47	5,088,837,650	1,964.50	5,333,224,600	0.78
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,250,500	4,276.13	5,347,300,565	4,254.00	5,319,627,000	0.78
日本	株式	三菱重工業	機械	2,994,400	1,308.11	3,917,015,400	1,723.00	5,159,351,200	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,514,300	2,944.84	4,459,371,212	3,322.00	5,030,504,600	0.74
日本	株式	ディスコ	機械	82,400	62,723.05	5,168,380,000	61,040.00	5,029,696,000	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,875,400	2,698.02	5,059,866,708	2,567.50	4,815,089,500	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	204,400	22,943.35	4,689,622,500	22,370.00	4,572,428,000	0.67
日本	株式	丸紅	卸売業	1,487,800	3,093.70	4,602,813,200	2,975.50	4,426,948,900	0.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,014,300	4,411.01	4,474,088,100	4,348.00	4,410,176,400	0.64

(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	0.33
		建設業	1.97
		食料品	2.99
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.51
		医薬品	4.27
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.65

鉄鋼	0.86
非鉄金属	0.75
金属製品	0.50
機械	5.61
電気機器	17.41
輸送用機器	8.15
精密機器	2.18
その他製品	2.39
電気・ガス業	1.42
陸運業	2.19
海運業	0.72
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	6.90
卸売業	7.45
小売業	3.89
銀行業	7.99
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	3.16
その他金融業	1.16
不動産業	1.87
サービス業	4.44
小計	97.92
合計	97.92

(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	504円		14,004,905,200	14,164,920,000	2.07

(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：2024年6月28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)を再投資したもとして計算しております。  
 ※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

基準価額	10,842円
純資産総額	25,44億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

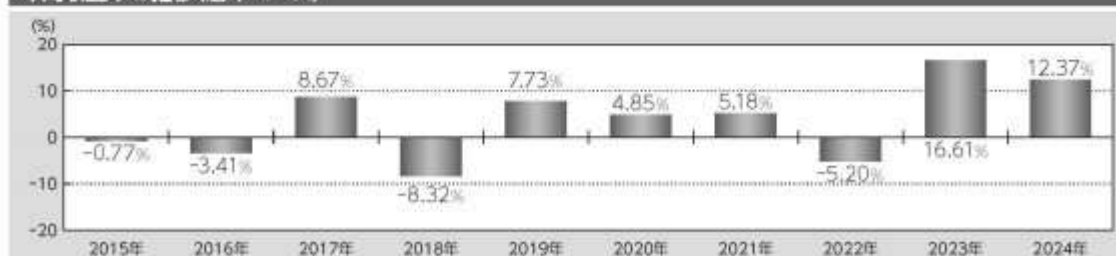
決算期	分配金
2024年2月	10円
2024年3月	510円
2024年4月	10円
2024年5月	10円
2024年6月	510円
最近1年間 分配金合計額	1,320円
設定来 分配金合計額	6,646円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期間	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 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.4%
		T 4.375% 08/31/28	アメリカ	国債	-	4.375%	2028/08/31	0.4%
		T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.4%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.4%
		T 2.875% 08/15/28	アメリカ	国債	-	2.875%	2028/08/15	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	28.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.3%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.7%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		日立製作所	日本	株式	電気機器	-	-	0.6%
		三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

※2024年は年当初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

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

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



#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、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。

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 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ませんとします。

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つき、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1万口当たり換算した価額で表示することがあり

ます。

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1) わが国の取引所に上場されている株式

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

2) 公社債

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

(a) 価格情報会社の提供する価額

(b) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2004年12月1日設定）

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

#### （4）【計算期間】

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

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

#### (2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

### < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

#### (1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

#### (2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎年5月及び11月の決算時並びに償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っ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39特定期間(2023年11月21日から2024年5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38特定期間 （2023年11月20日現在）	第39特定期間 （2024年 5月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	53,500,698	51,239,755
親投資信託受益証券	2,540,877,894	2,551,515,327
未収入金	3,830,000	5,840,000
未収利息	-	95
流動資産合計	2,598,208,592	2,608,595,177
資産合計	2,598,208,592	2,608,595,177
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,415,475	2,346,434
未払解約金	1,215	300
未払受託者報酬	171,268	167,996
未払委託者報酬	2,764,733	2,711,895
未払利息	38	-
その他未払費用	12,223	11,992
流動負債合計	5,364,952	5,238,617
負債合計	5,364,952	5,238,617
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,415,475,388	2,346,434,066
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	177,368,252	256,922,494
（分配準備積立金）	197,819,460	273,705,946
元本等合計	2,592,843,640	2,603,356,560
純資産合計	2,592,843,640	2,603,356,560
負債純資産合計	2,598,208,592	2,608,595,177

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日	第39特定期間 自 2023年11月21日 至 2024年 5月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	142	6,892
有価証券売買等損益	214,097,350	246,537,433
営業収益合計	214,097,492	246,544,325
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,551	2,772
受託者報酬	1,000,397	988,705
委託者報酬	16,149,225	15,960,457
その他費用	71,393	70,565
営業費用合計	17,236,566	17,022,499
営業利益又は営業損失（ ）	196,860,926	229,521,826
経常利益又は経常損失（ ）	196,860,926	229,521,826
当期純利益又は当期純損失（ ）	196,860,926	229,521,826
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（ ）	694,575	998,885
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	35,460,586	177,368,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	642,831	2,815,771
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	2,815,771
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,622,773	8,773,065
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	8,773,065
分配金	51,278,743	143,011,405
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	177,368,252	256,922,494

## (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39特定期間は前特定期間末日及び当特定期間末日が休業日のため、2023年11月21日から2024年5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38特定期間 (2023年11月20日現在)	第39特定期間 (2024年5月20日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,415,475,388口	2,346,434,066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) 1.0734円 (10,734円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1095円 (11,095円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日			第39特定期間 自 2023年11月21日 至 2024年 5月20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			分配金の計算過程 第227期 自 2023年11月21日 至 2023年12月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,248,540円	費用控除後の配当等収益額	A	752,710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	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	9,247,515円	収益調整金額	C	9,800,599円
分配準備積立金額	D	87,027,019円	分配準備積立金額	D	196,040,425円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,718,006円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	206,593,734円
当ファンドの期末残存口数	F	2,475,647,157口	当ファンドの期末残存口数	F	2,394,412,988口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	665円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	862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	60円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,475,647円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	14,366,477円
第222期 自 2023年 6月20日 至 2023年 7月19日			第228期 自 2023年12月20日 至 2024年 1月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,487,928円	費用控除後の配当等収益額	A	4,457,792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	57,285,781円
収益調整金額	C	9,278,715円	収益調整金額	C	9,929,344円
分配準備積立金額	D	152,341,305円	分配準備積立金額	D	181,039,295円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	163,107,948円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	252,712,212円
当ファンドの期末残存口数	F	2,466,143,436口	当ファンドの期末残存口数	F	2,378,721,263口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	661円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,062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	2,466,143円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,378,721円
第223期 自 2023年 7月20日 至 2023年 8月21日			第229期 自 2024年 1月20日 至 2024年 2月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,164,422円	費用控除後の配当等収益額	A	3,583,750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	45,514,593円
収益調整金額	C	9,287,261円	収益調整金額	C	10,033,657円
分配準備積立金額	D	150,738,400円	分配準備積立金額	D	238,899,544円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	162,190,083円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	298,031,544円
当ファンドの期末残存口数	F	2,456,679,525口	当ファンドの期末残存口数	F	2,365,410,498口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	660円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,259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	2,456,679円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,365,410円
第224期 自 2023年 8月22日 至 2023年 9月19日			第230期 自 2024年 2月20日 至 2024年 3月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,415,051円	費用控除後の配当等収益額	A	3,414,933円

第38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日			第39特定期間 自 2023年11月21日 至 2024年 5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	52,608,872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	27,201,278円
収益調整金額	C	9,292,438円	収益調整金額	C	10,246,327円
分配準備積立金額	D	149,321,537円	分配準備積立金額	D	281,910,487円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	214,637,898円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	322,773,025円
当ファンドの期末残存口数	F	2,439,458,858口	当ファンドの期末残存口数	F	2,337,323,368口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	879円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,380円
1万口当たり分配金額	H	160円	1万口当たり分配金額	H	510円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	39,031,341円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	119,203,491円
第225期 自 2023年 9月20日 至 2023年10月19日			第231期 自 2024年 3月20日 至 2024年 4月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,429,489円	費用控除後の配当等収益額	A	7,825,128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	9,859,784円	収益調整金額	C	12,529,527円
分配準備積立金額	D	165,335,157円	分配準備積立金額	D	192,281,023円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	182,624,430円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	212,635,678円
当ファンドの期末残存口数	F	2,433,458,342口	当ファンドの期末残存口数	F	2,350,872,784口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	750円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	904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	2,433,458円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,350,872円
第226期 自 2023年10月20日 至 2023年11月20日			第232期 自 2024年 4月20日 至 2024年 5月20日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,903,756円	費用控除後の配当等収益額	A	4,385,037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	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	74,406,277円
収益調整金額	C	9,831,990円	収益調整金額	C	12,627,143円
分配準備積立金額	D	169,027,456円	分配準備積立金額	D	197,261,066円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	210,066,925円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	288,679,523円
当ファンドの期末残存口数	F	2,415,475,388口	当ファンドの期末残存口数	F	2,346,434,066口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	869円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,230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	2,415,475円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	2,346,434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39特定期間 自 2023年11月21日 至 2024年 5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39特定期間 (2024年 5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39特定期間 (2024年 5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38特定期間 自 2023年 5月20日 至 2023年11月20日	第39特定期間 自 2023年11月21日 至 2024年 5月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,500,979,723円	2,415,475,388円
期中追加設定元本額	13,193,122円	35,218,604円
期中一部解約元本額	98,697,457円	104,259,926円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第38特定期間 (2023年11月20日現在)	第39特定期間 (2024年 5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	112,692,510	88,410,071
合計	112,692,510	88,410,071

## （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	268,641,204	771,994,227	
	外国債券インデックス マザーファンド	489,067,526	1,779,521,100	
合計		757,708,730	2,551,515,327	

(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

	2024年 5月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,142,914,303
コール・ローン	3,772,005,151
国債証券	340,741,587,541
派生商品評価勘定	17,218,987
未収入金	1,707,934
未収利息	2,421,587,665
前払費用	242,243,048
差入委託証拠金	214,305,076
流動資産合計	348,553,569,705
資産合計	348,553,569,705
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,548,644
前受金	2,011,374
未払金	2,033,316,942
未払解約金	107,582,584
流動負債合計	2,146,459,544
負債合計	2,146,459,544
純資産の部	
元本等	
元本	95,203,556,127
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	251,203,554,034
元本等合計	346,407,110,161
純資産合計	346,407,110,161
負債純資産合計	348,553,569,705

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5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、最初の利払日までには個別法）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>

2024年 5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)

2024年 5月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	95,203,556,127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) 3.6386円 (36,386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

2024年 5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

2024年 5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	2024年 5月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月21日
期首元本額	88,713,199,804円
期中追加設定元本額	9,408,537,669円
期中一部解約元本額	2,918,181,346円
期末元本額	95,203,556,127円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,093,063,420円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	489,067,526円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,361,822,557円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,289,236円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,733,088,865円
世界経済インデックスファンド	22,364,489,798円
DCマイセレクション25	1,883,978,215円
DCマイセレクション50	1,812,321,031円
DCマイセレクション75	1,450,590,543円
DC外国債券インデックス・オープン	2,227,663,637円
DCマイセレクションS25	1,115,058,137円
DCマイセレクションS50	988,882,353円
DCマイセレクションS75	574,102,120円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,244,051円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,409,461円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,269,468円
DC世界経済インデックスファンド	14,523,028,680円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	785,562,870円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,041,844円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	997,055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）	13,646,565円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	23,130,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	46,572,182円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,436,368円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,767,118円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	732,707,383円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	356,741,086円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,500,288,290円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	50,453,080円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,173,354円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	331,594,909円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	125,953,518円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	164,570,934円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	629,965,197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）	1,483,409,224円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	624,198,319円
外国債券ファンド・シリーズ1	763,995,353円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	777,802,839円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,496,265,072円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,553,077円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,838,774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）	1,228,653,448円
SMT インデックスバランス・オープン	170,576,499円
SMT 世界経済インデックス・オープン	427,095,191円

区分	2024年 5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）	627,738,369円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	943,296,445円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,303,874円
グローバル経済コア	1,120,288,789円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,017,194円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,888,430円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	65,232,232円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	90,713,594円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	45,157,846円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	60,357,995円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	734,799,234円
10資産分散投資ファンド	35,744,317円
グローバル10資産バランスファンド	24,541,462円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,342円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,496円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,344円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	21,744円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	21,683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）	13,135,100,155円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	270,973,891円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	142,122,851円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	128,431,242円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 5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	699,522,344
合計	699,522,344

(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

（2024年 5月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,359,686,466	-	1,361,697,840	2,011,374
合計		1,359,686,466	-	1,361,697,840	2,011,374

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2024年 5月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	買建	3,467,205,289	-	3,478,864,258	11,658,969
	アメリカドル	1,657,546,020	-	1,660,709,035	3,163,015
	カナダドル	106,029,749	-	106,467,014	437,265
	メキシコペソ	17,474,940	-	17,626,520	151,580
	ユーロ	1,099,972,393	-	1,105,769,687	5,797,294
	イギリスポンド	190,101,844	-	191,624,207	1,522,363
	ポーランドズロチ	15,989,512	-	16,071,766	82,254
	オーストラリアドル	31,134,900	-	31,349,040	214,140
	オフショア人民元	348,955,931	-	349,246,989	291,058
	合計	3,467,205,289	-	3,478,864,258	11,658,969

## (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	3,710,772.11	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,603,914.07	
		T 0.25% 07/31/25	7,640,000.00	7,217,263.28	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,941,152.37	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,813,671.86	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,364,804.69	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,412,968.72	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,651,446.16	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,818,300.79	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,730,768.75	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,798,964.84	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,719,531.24	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,166,718.75	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,610,398.42	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,098,183.58	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,144,375.00	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,088,239.85	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,539,208.97	

T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,707,812.50	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,293,330.04	
T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	9,876,726.57	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,490,914.06	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,183,203.12	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,359,125.02	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,415,253.88	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,566,171.86	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,786,386.69	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,688,750.00	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,673,484.96	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,380,000.00	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,653,783.21	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,949,617.18	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,313,246.86	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,063,124.96	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,043,701.16	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,140,109.38	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,467,744.73	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,506,125.00	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,064,687.52	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,734,350.57	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,287,031.28	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,911,738.27	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,438,442.60	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,291,904.28	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,431,386.71	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,537,179.50	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,899,763.67	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,083,506.23	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,160,315.62	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,762,539.04	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,570,078.92	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,523,984.36	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,517,444.15	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,436,796.87	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,593,701.20	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,297,468.73	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,125,903.48	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,970,546.90	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,876,191.44	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,603,015.63	

T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,756,996.11
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,434,103.52
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,315,273.46
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,658,971.90
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,619,843.75
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,778,417.21
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,372,925.80
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,833,027.35
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,034,843.75
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,534,660.52
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,880,627.31
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,904,589.85
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,073,730.46
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,108,914.51
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,415,218.76
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,212,230.44
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,726,300.79
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,156,054.65
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,653,218.75
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,007,018.00
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,090,471.88
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,543,847.67
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,229,328.13
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,085,663.09
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,987,607.41
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,456,511.73
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,482,492.19
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,968,964.42
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,455,483.62
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,342,388.65
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,713,207.02
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,997,844.13
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,722,943.36
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,700,902.32
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,016,982.42
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,516,415.03
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,135,765.97
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,266,875.00
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,612,889.82
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,150,859.37
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,172,603.50
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,265,263.67
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,363,789.09

T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,413,728.56
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,434,828.12
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,943,764.65
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,705,398.47
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,594,953.12
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,212,441.39
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,916,429.44
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,070,160.14
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,465,438.30
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,051,533.24
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	3,911,974.62
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,478,062.51
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,886,742.22
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,734,012.25
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,323,073.46
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,711,708.57
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,741,800.78
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	704,155.46
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,725,078.08
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,662,783.21
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,324,937.50
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,688,995.12
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	3,018,246.87
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,240,824.24
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	858,292.97
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,068,500.00
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,709,167.95
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,967,312.50
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,466,537.50
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	5,880,577.17
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,707,314.47
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	9,840,906.43
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,439,150.40
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,835,820.32
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,571,279.11
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,500,416.39
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,936,716.79
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,294,656.25
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,810,625.00
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,447,937.47
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	691,315.62
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,329,033.19

T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,843,246.10
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,225,838.67
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,096,609.37
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	1,950,328.12
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,074,863.29
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,440,268.18
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,889,785.16
T 3.75% 11/15/43	4,730,000.00	4,169,790.62
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,392,089.86
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,253,027.35
T 3.875% 08/15/33	8,170,000.00	7,825,647.24
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,337,908.19
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,443,203.12
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,902,614.06
T 3% 02/15/47	6,600,000.00	5,047,710.95
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	759,355.47
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	755,449.22
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,957,990.24
T 3% 05/15/45	700,000.00	542,746.09
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,450,508.99
T 3% 07/15/25	11,150,000.00	10,894,116.19
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,460,541.98
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,896,546.88
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,089,914.05
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,862,890.60
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,180,281.26
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,778,007.82
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	3,991,189.43
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,041,156.29
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,057,496.08
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,701,406.32
T 4.25% 02/15/54	3,250,000.00	3,084,707.00
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	877,078.12
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,828,978.50
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	713,261.72
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	996,367.19
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,866,675.78
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	634,511.72
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,950,781.28
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,085,606.46
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	945,674.99
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,483,828.12
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,111,118.75

	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	554,232.42
	T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	9,943,554.70
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,700,796.87
	T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,317,074.17
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,396,818.75
	T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,040,746.66
	T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,500,476.57
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	766,435.54
	T 4.75% 11/15/53	3,180,000.00	3,277,387.50
	T 4.875% 10/31/30	2,500,000.00	2,560,449.22
	T 4% 01/15/27	3,200,000.00	3,147,437.50
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,403,261.73
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,059,046.84
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,885,630.45
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,407,998.03
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,721,281.25
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	425,125.00
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,341,996.09
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,068,371.08
	T 5% 08/31/25	4,250,000.00	4,246,679.68
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,736,855.47
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,524,142.57
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,148,519.52
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>1,160,890,000.00</b>	<b>1,023,245,402.26</b> <b>(159,534,190,666)</b>
<b>カナダドル</b>	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,126,341.83
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,864,327.61
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,903,431.60
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,747,335.69
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,157,734.61
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	863,444.70
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,275,047.44
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,115,198.42
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	1,993,151.89
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	744,504.07
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,428,335.64
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,250,787.32
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	225,476.51
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,110,871.75
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,119,888.23
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,545,785.87
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	919,317.01



	CAN 2.75% 12/01/55	1,420,000.00	1,228,367.07
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	530,803.49
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	384,370.92
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,348,433.60
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,685,616.49
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,030,945.64
	CAN 3.25% 12/01/33	1,310,000.00	1,270,610.39
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,148,292.64
	CAN 3.5% 08/01/25	920,000.00	909,017.44
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	953,425.13
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,310,621.61
	CAN 3% 06/01/34	1,850,000.00	1,754,200.44
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,226,847.66
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	778,879.88
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	300,766.31
	CAN 4.5% 11/01/25	1,330,000.00	1,330,936.73
	CAN 4% 03/01/29	2,400,000.00	2,431,893.16
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,240,455.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,636,269.18
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,882,116.79
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	720,642.88
	カナダドル 小計	65,620,000.00	60,494,493.14 (6,931,459,023)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,768,452.50
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	29,647,132.50
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,260,630.35
	MBONO 7.5% 05/26/33	24,150,000.00	20,991,180.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,441,683.60
	MBONO 7.75% 05/29/31	41,040,000.00	36,979,502.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	31,010,000.00	25,704,654.15
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,250,000.00	8,969,928.75
	MBONO 7% 09/03/26	9,290,000.00	8,672,029.20
	MBONO 8.5% 03/01/29	14,540,000.00	13,861,127.40
	MBONO 8.5% 05/31/29	30,830,000.00	29,315,938.70
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,447,510.70
	MBONO 8% 07/31/53	21,820,000.00	18,165,586.40
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,670,642.00
	メキシコペソ 小計	349,130,000.00	313,895,998.65 (2,950,339,880)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,205,821.40
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	997,113.32
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	423,737.48
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	182,785.68

BGB 0.8% 06/22/25	2,000,000.00	1,945,176.00
BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,417,091.21
BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,476,582.40
BGB 0.9% 06/22/29	1,670,000.00	1,520,879.02
BGB 0% 10/22/27	900,000.00	816,651.00
BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,183,366.50
BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,142,165.42
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	659,968.37
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	653,768.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	772,224.84
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	775,445.00
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	553,501.00
BGB 1% 06/22/26	1,840,000.00	1,764,539.76
BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,375,790.52
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	652,854.40
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	514,125.17
BGB 2.7% 10/22/29	180,000.00	178,813.62
BGB 2.75% 04/22/39	560,000.00	527,575.00
BGB 2.85% 10/22/34	680,000.00	668,602.52
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	985,011.96
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	444,568.16
BGB 3.5% 06/22/55	530,000.00	528,907.93
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	980,782.65
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,455,064.85
BGB 3% 06/22/34	1,050,000.00	1,049,895.00
BGB 4.25% 03/28/41	1,750,000.00	1,960,813.75
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,168,432.51
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,162,869.48
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,234,183.52
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,131,381.79
BKO 2.5% 03/19/26	250,000.00	247,568.87
BKO 2.8% 06/12/25	1,490,000.00	1,482,137.27
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,357,637.23
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,818,726.00
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,499,897.28
BTPS 0.45% 02/15/29	1,880,000.00	1,647,515.44
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,820,333.14
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,161,745.00
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,585,457.64
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,197,157.79
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,467,025.15
BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	931,572.84
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,904,815.12

BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,925,016.28
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,383,161.04
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,781,687.32
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,105,868.80
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,005,566.80
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,211,376.13
BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	826,896.23
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,589,158.64
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,008,941.75
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	913,271.62
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,255,626.58
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	796,900.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,362,442.38
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,043,814.60
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,124,038.70
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,274,496.34
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	827,344.80
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	695,630.30
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,653,049.18
BTPS 2.05% 08/01/27	2,320,000.00	2,236,322.24
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,404,348.48
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	424,074.27
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	682,471.80
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,211,621.88
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,390,067.25
BTPS 2.45% 09/01/33	2,600,000.00	2,358,816.20
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,007,347.56
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,639,767.92
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,321,092.04
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,724,359.22
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	875,966.49
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	612,768.41
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,546,002.80
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,392,239.00
BTPS 2.95% 02/15/27	330,000.00	326,926.71
BTPS 2.95% 09/01/38	1,110,000.00	984,507.84
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,161,854.98
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,155,496.96
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,260,497.08
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,714,101.60
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,974,178.14
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,815,785.37

BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,008,680.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,624,180.74
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	911,477.84
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,377,527.72
BTPS 3.7% 06/15/30	1,030,000.00	1,045,007.10
BTPS 3.8% 04/15/26	1,440,000.00	1,451,287.72
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,794,122.88
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,391,355.00
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	870,019.00
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,927,364.44
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,132,156.60
BTPS 4.1% 02/01/29	440,000.00	454,931.31
BTPS 4.15% 10/01/39	460,000.00	463,169.40
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	1,993,766.40
BTPS 4.35% 11/01/33	1,800,000.00	1,893,726.00
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,121,545.08
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,612,272.48
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,119,994.86
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,565,060.64
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,781,822.27
BTPS 4.75% 09/01/44	1,600,000.00	1,722,313.60
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,112,673.00
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	897,608.36
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,291,367.50
BTPS 4% 11/15/30	1,800,000.00	1,855,803.60
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,958,508.28
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,969,231.82
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,637,102.72
BTPS 5% 08/01/34	3,170,000.00	3,504,454.02
BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,494,526.98
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,984,040.00
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,319,887.44
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,529,150.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,813,577.96
DBR 0.25% 02/15/29	1,370,000.00	1,233,069.87
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,899,335.57
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,874,285.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,259,727.20
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	326,810.40
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	843,447.98
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,410,817.93
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,571,443.80
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,805,410.88

DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,790,725.32	
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,741,240.52	
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,594,117.90	
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,021,223.25	
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,273,955.67	
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,352,880.79	
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,322,105.80	
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,460,405.56	
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,209,479.36	
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,778,273.95	
DBR 1.25% 08/15/48	3,490,000.00	2,619,485.81	
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,983,912.16	
DBR 1.8% 08/15/53	3,050,000.00	2,531,606.75	
DBR 1% 05/15/38	2,080,000.00	1,684,579.52	
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,365,040.63	
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,356,844.96	
DBR 2.2% 02/15/34	1,830,000.00	1,781,914.92	
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,568,255.47	
DBR 2.4% 11/15/30	1,390,000.00	1,381,956.07	
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,842,349.05	
DBR 2.5% 08/15/46	2,920,000.00	2,830,808.60	
DBR 2.5% 08/15/54	1,330,000.00	1,290,548.21	
DBR 2.6% 08/15/33	1,790,000.00	1,806,315.85	
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,190,002.57	
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	2,949,905.11	
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,163,799.24	
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,548,938.82	
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,549,612.13	
DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,512,911.84	
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,659,008.12	
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,094,852.51	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,490,600.87	
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	2,988,644.87	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	4,008,624.30	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,950,000.00	3,836,311.10	
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,277,731.50	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,040,000.00	4,496,289.84	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,776,449.10	
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	488,295.80	
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,203,465.20	
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,808,221.60	
FRTR 0.75% 05/25/28	5,410,000.00	4,981,365.70	

FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,560,552.00
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,577,638.40
FRTR 0.75% 11/25/28	3,850,000.00	3,511,889.15
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,806,385.24
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,689,204.00
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,011,053.50
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,133,887.46
FRTR 0% 11/25/30	5,810,000.00	4,841,949.42
FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,956,024.67
FRTR 1.25% 05/25/34	4,460,000.00	3,793,100.66
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,632,081.10
FRTR 1.25% 05/25/38	2,740,000.00	2,141,597.70
FRTR 1.5% 05/25/31	6,080,000.00	5,569,313.43
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,070,358.30
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,107,051.12
FRTR 1.75% 06/25/39	3,250,000.00	2,692,634.75
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,695,910.71
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,519,049.67
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,468,121.46
FRTR 2.5% 05/25/43	1,440,000.00	1,270,673.28
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,101,048.30
FRTR 2.75% 02/25/29	4,370,000.00	4,348,324.80
FRTR 2.75% 10/25/27	4,730,000.00	4,703,767.42
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,223,458.38
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,703,333.60
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,823,286.18
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,765,806.10
FRTR 3.5% 11/25/33	3,100,000.00	3,231,202.85
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,228,947.92
FRTR 3% 05/25/54	2,380,000.00	2,186,791.60
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	723,233.28
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,988,920.80
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,820,325.24
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,811,526.00
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,990,161.04
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,338,014.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,626,492.80
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,275,957.81
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,971,012.50
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	620,060.88
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	665,716.30
IRISH 0.35% 10/18/32	380,000.00	311,719.70
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	529,354.20

IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	241,034.40
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	717,041.71
IRISH 0% 10/18/31	1,070,000.00	875,242.88
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	906,263.82
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	379,651.30
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	430,247.40
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	571,317.60
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	638,103.48
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	962,004.13
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	912,404.40
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	194,874.40
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	819,024.22
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	365,776.45
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,845,571.88
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	839,566.30
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,035,588.23
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,661,283.75
NETHER 0.5% 07/15/32	1,150,000.00	965,999.50
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	844,769.88
NETHER 0.75% 07/15/28	1,610,000.00	1,485,828.75
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,132,141.60
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,604,695.05
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,420,185.83
NETHER 0% 01/15/38	1,170,000.00	793,054.81
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	821,972.66
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,146,449.70
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,133,452.54
NETHER 2.5% 01/15/30	1,000,000.00	988,606.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,523,528.17
NETHER 2.5% 07/15/33	1,320,000.00	1,293,013.92
NETHER 2.5% 07/15/34	500,000.00	487,039.50
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,810,642.80
NETHER 2% 01/15/54	1,120,000.00	935,062.16
NETHER 3.25% 01/15/44	680,000.00	716,046.80
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,897,812.00
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,856,600.44
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,671,884.55
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,905,589.22
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,357,617.80
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,506,482.50
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,832,520.00
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,395,851.29

OBL 2.1% 04/12/29	1,480,000.00	1,449,275.52
OBL 2.2% 04/13/28	2,950,000.00	2,904,732.25
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,236,500.56
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	512,158.01
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,263,684.30
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,390,043.35
RAGB 0.7% 04/20/71	350,000.00	155,470.00
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	814,748.00
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	447,766.80
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,404,772.40
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	103,379.25
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,059,931.59
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,258,319.68
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,378,648.46
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	776,775.12
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	348,526.15
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,157,044.14
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	790,230.60
RAGB 1.5% 11/02/86	310,000.00	184,948.94
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	510,923.40
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	484,323.45
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	883,678.09
RAGB 2.9% 02/20/33	1,500,000.00	1,495,057.87
RAGB 2.9% 02/20/34	720,000.00	715,456.08
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	220,776.60
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	696,976.00
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	435,442.04
RAGB 3.45% 10/20/30	230,000.00	237,636.00
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	475,755.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,460,000.00	1,621,569.44
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,205,673.30
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,295,789.86
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	312,580.40
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	211,070.50
RFGB 0.125% 09/15/31	630,000.00	516,900.81
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	190,310.40
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	543,403.61
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	306,723.34
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	499,655.25
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	660,687.96
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	469,159.97
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	443,337.18
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	426,961.04



RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	429,301.44
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	602,275.52
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	540,088.96
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	334,893.65
RFGB 1.375% 04/15/47	610,000.00	437,422.46
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	511,120.99
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	436,236.79
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	382,786.80
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	547,771.40
RFGB 2.875% 04/15/29	240,000.00	240,070.08
RFGB 2.95% 04/15/55	230,000.00	221,151.55
RFGB 3% 09/15/33	580,000.00	582,197.62
RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	644,888.51
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,803,234.40
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,783,638.17
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,139,270.57
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,738,735.79
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,835,721.80
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,276,947.00
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,465,595.00
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,059,127.80
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,522,653.56
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,681,311.83
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,735,435.20
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,954,864.52
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,483,382.75
SPGB 1.25% 10/31/30	2,980,000.00	2,677,378.02
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,984,550.40
SPGB 1.4% 04/30/28	2,450,000.00	2,308,794.25
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,925,876.60
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,507,257.54
SPGB 1.45% 10/31/27	2,280,000.00	2,166,316.51
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	325,317.30
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,435,935.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,425,212.25
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,891,704.48
SPGB 1.9% 10/31/52	1,810,000.00	1,219,523.70
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,248,038.40
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,904,140.88
SPGB 1% 07/30/42	1,180,000.00	771,528.84
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,092,504.00
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,546,277.30

	SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,046,916.35
	SPGB 2.55% 10/31/32	2,530,000.00	2,423,196.05
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,427,636.25
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,670,000.00	1,657,441.60
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,850,000.00	1,623,362.05
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,990,000.00	1,986,807.38
	SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,148,467.74
	SPGB 3.45% 07/30/43	1,190,000.00	1,147,862.10
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,530,000.00	1,397,270.87
	SPGB 3.5% 05/31/29	660,000.00	675,880.92
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,330,497.77
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,330,000.00	1,379,061.04
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	1,945,267.20
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,882,537.52
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,138,883.52
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	2,000,319.42
	SPGB 4% 10/31/54	650,000.00	664,131.65
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,044,990.74
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,713,026.94
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,679,097.50
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,442,132.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,030,884.40
	ユーロ 小計	685,160,000.00	636,165,832.55 (107,874,640,225)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,175,157.90
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,308,037.50
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,083,489.19
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,716,180.60
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,542,417.40
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,855,880.87
	UKT 0.5% 10/22/61	2,150,000.00	647,537.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,343,337.52
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,539,675.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	584,549.52
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	760,345.74
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,569,862.80
	UKT 0.875% 10/22/29	1,410,000.00	1,200,325.80
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,329,884.20
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	384,568.17
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,144,587.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,182,634.64
	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,244,999.00
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,509,142.40

UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	959,827.48
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	580,907.52
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	969,099.00
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	699,651.52
UKT 1.625% 10/22/71	1,550,000.00	714,705.00
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	633,615.91
UKT 1.75% 07/22/57	1,740,000.00	922,548.00
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,405,782.00
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	2,967,333.40
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	901,632.97
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,302,531.00
UKT 3.25% 01/22/44	2,010,000.00	1,672,464.72
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,726,035.28
UKT 3.5% 01/22/45	1,820,000.00	1,561,829.36
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,204,665.00
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,312,165.00
UKT 3.75% 01/29/38	1,930,000.00	1,813,042.00
UKT 3.75% 03/07/27	650,000.00	639,921.22
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,000,994.50
UKT 3.75% 10/22/53	2,910,000.00	2,518,168.50
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,323,911.88
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,894,210.92
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,343,350.80
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,246,383.08
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,808,856.00
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,415,084.00
UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,689,047.98
UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,529,612.37
UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,609,050.00
UKT 4.375% 07/31/54	430,000.00	414,659.83
UKT 4.5% 06/07/28	2,690,000.00	2,726,664.70
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,430,242.44
UKT 4.5% 12/07/42	2,440,000.00	2,436,584.00
UKT 4.625% 01/31/34	1,780,000.00	1,851,006.32
UKT 4.75% 10/22/43	1,030,000.00	1,056,699.24
UKT 4.75% 12/07/30	1,710,000.00	1,786,813.20
UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,457,121.68
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,135,713.50
UKT 4% 10/22/63	1,190,000.00	1,077,069.00
UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,175,965.70
イギリス債券 小計	107,290,000.00	89,037,578.77 (17,638,344,354)

スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,845,040.36
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,352,531.44
	SGB 0.75% 11/12/29	6,440,000.00	5,928,555.41
	SGB 1.75% 11/11/33	4,360,000.00	4,152,043.63
	SGB 1% 11/12/26	7,580,000.00	7,276,464.73
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,479,312.05
	SGB 2.5% 05/12/25	7,560,000.00	7,508,144.29
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,494,357.60
スウェーデンクローナ 小計		46,670,000.00	45,036,449.51 (656,181,069)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,065,217.92
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,566,991.52
	NGB 1.5% 02/19/26	4,520,000.00	4,342,354.96
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,396,393.35
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,743,566.50
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,343,803.26
	NGB 2% 04/26/28	4,650,000.00	4,381,313.23
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,867,300.50
	NGB 3.625% 04/13/34	2,470,000.00	2,468,024.00
	NGB 3% 08/15/33	4,630,000.00	4,403,966.17
ノルウェークローネ 小計		40,570,000.00	37,578,931.41 (549,403,977)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,570,000.00	2,943,184.24
	DGB 0.5% 11/15/27	4,430,000.00	4,123,412.40
	DGB 0.5% 11/15/29	5,570,000.00	5,019,065.17
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,465,776.25
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,442,280.80
	DGB 2.25% 11/15/33	3,680,000.00	3,601,645.44
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	11,618,743.94
デンマーククローネ 小計		41,820,000.00	39,214,108.24 (891,336,680)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	2,007,343.30
	POLGB 0% 10/25/25	940,000.00	874,406.23
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,018,311.40
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,560,000.00	2,693,656.20
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,623,110.80
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,084,038.68
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,270,000.00	2,973,574.50
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,248,290.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,480,000.00	4,382,640.64
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,020,603.52
	POLGB 5.75% 04/25/29	4,320,000.00	4,367,056.89
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,453,068.90

	POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,875,984.80
ポーランドズロチ 小計		49,230,000.00	45,622,085.86 (1,815,248,049)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,985,688.74
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,211,193.53
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,230,361.78
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	2,024,293.75
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,046,017.94
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,656,925.95
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,228,532.34
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,413,922.68
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,393,148.03
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,157,698.71
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,056,394.12
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,470,000.00	1,276,290.62
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,475,730.82
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,584,556.08
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,677,308.82
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,810,000.00	1,758,529.33
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	820,410.39
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,585,218.92
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,220,000.00	1,151,751.83
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,980,000.00	1,906,080.91
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,049,570.05
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,668,765.71
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,781,201.62
	ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,083,116.81
ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,059,821.06	
ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	742,041.93	
オーストラリアドル 小計		47,940,000.00	43,024,572.47 (4,496,498,068)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	990,000.00	838,904.73
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	672,642.35
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	822,121.54
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	295,481.23
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	509,135.84
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	409,964.50
	NZGB 2% 05/15/32	700,000.00	581,907.96
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,217,965.45
	NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	777,752.40
	NZGB 4.25% 05/15/34	450,000.00	437,291.71
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	839,209.50
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	491,245.04

	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	434,242.69
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	385,733.32
ニュージーランドドル 小計		9,860,000.00	8,713,598.26 (833,455,673)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	757,531.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	827,109.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	504,168.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	556,260.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	316,478.40
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	810,254.30
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	687,800.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	889,470.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	341,380.60
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	704,736.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	441,278.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	758,151.50
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	589,113.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	640,380.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	415,506.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	710,000.00	697,149.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	842,118.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	743,996.00
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	148,855.50
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	462,805.00
シンガポールドル 小計		12,860,000.00	12,134,539.30 (1,406,878,486)
マレーシアリングgit	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,533,885.22
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,507,711.35
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	706,638.24
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,283,886.29
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,936,968.41
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,273,132.22
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,760,928.83
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,874,097.30
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,180,832.98
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,140,030.55
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,989,373.17
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,493,092.77
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	605,168.04
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,702,053.75
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,990,368.98
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,551,697.46

	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,792,725.55
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,563,571.80
	MGS 4.457% 03/31/53	1,090,000.00	1,130,972.55
	MGS 4.498% 04/15/30	3,070,000.00	3,188,024.00
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,722.85
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	922,794.73
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,120,369.70
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,059,030.92
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,988,498.88
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,013,056.78
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,858,885.72
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,136,207.62
	マレーシアリングット 小計	49,630,000.00	50,666,726.66 (1,684,992,928)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,420,744.50
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,337,782.92
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,510,000.00	1,971,699.62
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,630,000.00	1,797,896.93
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,341,636.87
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,910,238.25
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,485,553.31
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,420,000.00	934,722.81
	ILGOV 2% 03/31/27	2,030,000.00	1,906,799.90
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,040,000.00	1,992,015.32
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,131,334.41
	ILGOV 4% 03/30/35	760,000.00	719,735.58
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,012,022.43
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,399,376.74
	イスラエルシェケル 小計	30,790,000.00	27,361,559.59 (1,149,713,580)
オフショア人民元	CGB 2.18% 08/15/26	28,600,000.00	28,760,400.24
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,182,372.41
	CGB 2.22% 09/25/25	27,270,000.00	27,425,992.58
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,433,208.14
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,505,206.01
	CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,533,639.12
	CGB 2.37% 01/15/29	19,460,000.00	19,695,608.05
	CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,368,669.62
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,230,129.52
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,082,732.38
	CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	17,919,115.38
	CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,593,547.91
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,294,184.00

CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,898,803.80
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,155,938.28
CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	59,246,373.01
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,024,752.50
CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,767,496.57
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	32,706,432.07
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,107,197.05
CGB 2.62% 04/15/28	23,550,000.00	24,006,844.09
CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,189,439.56
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,409,395.22
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	38,955,501.85
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,148,638.06
CGB 2.67% 11/25/33	13,600,000.00	13,985,036.40
CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	34,364,964.06
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,459,300.00
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	19,946,272.29
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,960,238.70
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,226,536.09
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	11,042,365.76
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,255,016.61
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,799,936.74
CGB 2.8% 03/25/30	42,000,000.00	43,337,628.60
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,769,453.42
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,836,593.82
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,797,171.75
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,233,908.68
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	30,186,983.36
CGB 2% 06/15/25	43,900,000.00	44,008,735.91
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,052,186.45
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,793,791.08
CGB 3.02% 10/22/25	53,270,000.00	54,237,601.60
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,225,265.40
CGB 3.12% 10/25/52	8,970,000.00	9,797,469.04
CGB 3.19% 04/15/53	18,160,000.00	20,302,765.59
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,322,232.83
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,774,887.18
CGB 3.32% 04/15/52	13,750,000.00	15,641,934.00
CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	23,873,666.36
CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,815,896.77
CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	16,297,671.49
CGB 3.81% 09/14/50	19,620,000.00	23,984,543.55
CGB 3.86% 07/22/49	17,280,000.00	21,155,648.25
CGB 3% 10/15/53	9,330,000.00	10,204,594.20



	CGB 4.08% 10/22/48	15,720,000.00	19,758,794.97
	オフショア人民元 小計	1,449,280,000.00	1,500,090,708.37 (32,328,904,883)
	合計		340,741,587,541 (340,741,587,541)

## 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 211銘柄	100.0%	46.8%
カナダドル	国債証券 38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 366銘柄	100.0%	31.7%
イギリスポンド	国債証券 59銘柄	100.0%	5.2%
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 7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 26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 57銘柄	100.0%	9.5%

(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

	2024年 5月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,759,148,685
株式	659,051,095,450
派生商品評価勘定	163,957,700
未収配当金	6,854,516,455
未収利息	8,870

	2024年 5月20日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	639,313,992
流動資産合計	671,468,041,152
資産合計	671,468,041,152
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,134,800
前受金	159,048,400
未払金	176,700
未払解約金	218,131,351
流動負債合計	382,491,251
負債合計	382,491,251
純資産の部	
元本等	
元本	233,529,011,031
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	437,556,538,870
元本等合計	671,085,549,901
純資産合計	671,085,549,901
負債純資産合計	671,468,041,152

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 5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。
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)

	2024年 5月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	233,529,011,031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 2.8737円 (1万口当たり純資産額) (28,737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

	2024年 5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。

2024年 5月20日現在	
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

2024年 5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	2024年 5月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年11月21日
期首元本額	243,768,698,223円
期中追加設定元本額	11,864,733,039円
期中一部解約元本額	22,104,420,231円
期末元本額	233,529,011,031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）	268,641,204円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,253,509,561円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,749,846円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,495,243,781円
世界経済インデックスファンド	5,964,186,162円
日本株式インデックス・オープン	2,823,739,981円
DCマイセクション25	4,720,090,258円
DCマイセクション50	15,558,030,017円
DCマイセクション75	17,839,080,393円
DC日本株式インデックス・オープン	6,017,781,775円
DCマイセクションS25	2,864,503,397円

区分	2024年 5月20日現在
DCマイセレクションS50	9,080,134,975円
DCマイセレクションS75	8,497,287,459円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,530,555,805円
DCターゲット・イヤールファンド2025	57,142,793円
DCターゲット・イヤールファンド2035	554,232,964円
DCターゲット・イヤールファンド2045	450,514,943円
DC世界経済インデックスファンド	3,954,858,310円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	695,239,242円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,269,905円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,300,182円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,243,691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）	135,859,549円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,797,454円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	60,324,905円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,949,675円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,514,138円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	413,268,504円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	288,030,221円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,956,879,985円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,771,657円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,552,242円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	289,460,967円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	162,430,682円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	216,748,631円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,960,135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）	360,905,817円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,407,483,902円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,895,794,342円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,366,846円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	654,655,453円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	415,092,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	185,836,318円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,513,357円
SMT インデックスバランス・オープン	48,081,812円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,602,036,566円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	239,439,855円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,398,336円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	240,088,243円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	39,048,989円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,993,524円
グローバル経済コア	268,251,280円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,024,410円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,155,895,886円
DCターゲット・イヤールファンド2055	30,438,691円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	485,317,449円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	123,670,049円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2030	63,268,258円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2040	62,267,610円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2050	27,087,486円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2060	33,176,873円
10資産分散投資ファンド	113,723,354円
グローバル10資産バランスファンド	32,281,557円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2035	32,694円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2040	35,914円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2045	38,209円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2050	38,209円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2055	32,814円

区分	2024年 5月20日現在
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	20,588円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	18,210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）	41,600,479,902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）	243,935,817円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	290,105,994円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,428,325円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	156,681,751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）	49,016,645,974円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,807,481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）	202,031,208円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 5月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	142,035,760,500
合計	142,035,760,500

(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

(2024年 5月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,195,901,600	-	11,354,950,000	159,048,400
合計		11,195,901,600	-	11,354,950,000	159,048,400

## (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	9,800	3,750.00	36,750,000	
ニッスイ	236,400	919.00	217,251,600	
マルハニチロ	35,100	3,214.00	112,811,400	
雪国まいたけ	20,100	981.00	19,718,100	
カネコ種苗	6,700	1,438.00	9,634,600	
サカタのタネ	26,900	3,550.00	95,495,000	
ホクト	18,900	1,840.00	34,776,000	
ホクリヨウ	1,300	1,003.00	1,303,900	
住石ホールディングス	30,100	2,354.00	70,855,400	

日鉄鉱業	9,500	5,390.00	51,205,000
三井松島ホールディングス	14,000	5,000.00	70,000,000
I N P E X	794,000	2,456.00	1,950,064,000
石油資源開発	27,400	6,910.00	189,334,000
K & O エナジーグループ	10,700	3,435.00	36,754,500
ショーボンドホールディングス	32,200	6,168.00	198,609,600
ミライト・ワン	71,400	1,853.00	132,304,200
タマホーム	14,900	4,555.00	67,869,500
サンヨーホームズ	900	735.00	661,500
日本アクア	3,300	920.00	3,036,000
ファーストコーポレーション	2,300	820.00	1,886,000
ベステラ	1,900	973.00	1,848,700
キャンディル	1,400	598.00	837,200
ダイセキ環境ソリューション	1,600	996.00	1,593,600
第一カッター興業	6,800	1,428.00	9,710,400
安藤・間	137,000	1,146.00	157,002,000
東急建設	74,100	780.00	57,798,000
コムシスホールディングス	75,500	3,165.00	238,957,500
ビーアールホールディングス	34,700	360.00	12,492,000
高松コンストラクショングループ	17,600	2,815.00	49,544,000
東建コーポレーション	5,900	10,620.00	62,658,000
ソネック	800	931.00	744,800
ヤマウラ	12,000	1,311.00	15,732,000
オリエンタル白石	87,500	351.00	30,712,500
大成建設	151,500	5,830.00	883,245,000
大林組	591,400	1,843.00	1,089,950,200
清水建設	468,900	902.80	423,322,920
飛島建設	17,000	1,515.00	25,755,000
長谷工コーポレーション	151,700	1,827.50	277,231,750
松井建設	15,400	826.00	12,720,400
銭高組	800	4,525.00	3,620,000
鹿島建設	366,700	2,765.50	1,014,108,850
不動テトラ	11,400	2,363.00	26,938,200
大末建設	2,200	1,781.00	3,918,200
鉄建建設	11,900	2,666.00	31,725,400
西松建設	31,500	4,559.00	143,608,500
三井住友建設	123,100	398.00	48,993,800
大豊建設	5,700	3,290.00	18,753,000
佐田建設	3,500	781.00	2,733,500
ナカノフドー建設	3,900	529.00	2,063,100
奥村組	26,800	4,865.00	130,382,000
東鉄工業	20,500	3,055.00	62,627,500

イチケン	1,400	2,521.00	3,529,400
富士ピー・エス	2,400	443.00	1,063,200
浅沼組	12,200	3,700.00	45,140,000
戸田建設	223,800	1,075.00	240,585,000
熊谷組	27,300	3,650.00	99,645,000
北野建設	1,000	3,600.00	3,600,000
植木組	1,600	1,675.00	2,680,000
矢作建設工業	22,500	1,584.00	35,640,000
ピーエス三菱	21,000	1,023.00	21,483,000
日本ハウスホールディングス	35,300	316.00	11,154,800
新日本建設	23,200	1,601.00	37,143,200
東亜道路工業	32,900	1,196.00	39,348,400
日本道路	19,400	1,815.00	35,211,000
東亜建設工業	51,100	998.00	50,997,800
日本国土開発	47,000	504.00	23,688,000
若築建設	5,700	3,325.00	18,952,500
東洋建設	41,700	1,380.00	57,546,000
五洋建設	234,500	669.60	157,021,200
世紀東急工業	21,200	1,687.00	35,764,400
福田組	6,200	5,560.00	34,472,000
住友林業	142,900	6,003.00	857,828,700
日本基礎技術	3,300	547.00	1,805,100
巴コーポレーション	6,900	722.00	4,981,800
大和ハウス工業	457,300	4,112.00	1,880,417,600
ライト工業	32,900	2,033.00	66,885,700
積水ハウス	501,600	3,575.00	1,793,220,000
日特建設	15,800	1,118.00	17,664,400
北陸電気工事	11,300	1,102.00	12,452,600
ユアテック	36,400	1,622.00	59,040,800
日本リーテック	12,900	1,136.00	14,654,400
四電工	6,900	3,580.00	24,702,000
中電工	25,700	3,155.00	81,083,500
関電工	103,600	1,777.00	184,097,200
きんでん	115,000	3,036.00	349,140,000
東京エネシス	15,400	1,331.00	20,497,400
トーエネック	5,500	5,180.00	28,490,000
住友電設	15,700	3,500.00	54,950,000
日本電設工業	31,000	1,952.00	60,512,000
エクシオグループ	161,600	1,625.50	262,680,800
新日本空調	10,700	4,040.00	43,228,000
九電工	35,700	6,276.00	224,053,200
三機工業	35,700	2,113.00	75,434,100

日揮ホールディングス	163,600	1,314.50	215,052,200
中外炉工業	5,400	3,325.00	17,955,000
ヤマト	4,600	1,159.00	5,331,400
太平電業	10,300	4,800.00	49,440,000
高砂熱学工業	44,300	5,450.00	241,435,000
三晃金属工業	700	4,525.00	3,167,500
朝日工業社	15,400	1,422.00	21,898,800
明星工業	32,000	1,302.00	41,664,000
大気社	19,100	4,970.00	94,927,000
ダイダン	21,700	3,270.00	70,959,000
日比谷総合設備	12,000	3,010.00	36,120,000
フィル・カンパニー	2,600	607.00	1,578,200
テスホールディングス	35,600	411.00	14,631,600
インフロニア・ホールディングス	190,600	1,436.00	273,701,600
東洋エンジニアリング	24,300	1,019.00	24,761,700
レイズネクスト	23,900	1,825.00	43,617,500
ニッポン	49,700	2,286.00	113,614,200
日清製粉グループ本社	153,500	1,862.00	285,817,000
日東富士製粉	3,000	6,000.00	18,000,000
昭和産業	16,100	3,220.00	51,842,000
鳥越製粉	4,900	682.00	3,341,800
中部飼料	23,000	1,523.00	35,029,000
フィード・ワン	24,300	943.00	22,914,900
東洋精糖	1,000	1,816.00	1,816,000
日本甜菜製糖	9,700	1,995.00	19,351,500
D M三井製糖ホールディングス	16,500	3,215.00	53,047,500
塩水港精糖	7,200	290.00	2,088,000
ウェルネオシュガー	8,300	2,333.00	19,363,900
森永製菓	70,700	2,477.00	175,123,900
中村屋	4,100	3,245.00	13,304,500
江崎グリコ	47,500	4,137.00	196,507,500
名糖産業	6,500	1,792.00	11,648,000
井村屋グループ	9,900	2,475.00	24,502,500
不二家	11,400	2,469.00	28,146,600
山崎製パン	111,100	3,560.00	395,516,000
第一屋製パン	1,000	670.00	670,000
モロゾフ	5,400	4,230.00	22,842,000
亀田製菓	9,500	3,950.00	37,525,000
寿スピリッツ	78,500	1,770.00	138,945,000
カルビー	76,000	3,153.00	239,628,000
森永乳業	58,000	3,344.00	193,952,000
六甲バター	12,200	1,479.00	18,043,800



ヤクルト本社	237,300	3,027.00	718,307,100
明治ホールディングス	203,500	3,467.00	705,534,500
雪印メグミルク	40,200	2,486.00	99,937,200
プリマハム	22,300	2,349.00	52,382,700
日本ハム	71,400	4,941.00	352,787,400
林兼産業	1,800	533.00	959,400
丸大食品	16,700	1,620.00	27,054,000
S Foods	18,300	3,010.00	55,083,000
柿安本店	6,500	2,587.00	16,815,500
伊藤ハム米久ホールディングス	25,400	4,240.00	107,696,000
サッポロホールディングス	54,700	5,285.00	289,089,500
アサヒグループホールディングス	383,600	5,945.00	2,280,502,000
キリンホールディングス	691,600	2,235.00	1,545,726,000
宝ホールディングス	111,900	1,082.00	121,075,800
オエノンホールディングス	49,600	353.00	17,508,800
養命酒製造	5,500	2,295.00	12,622,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,100	1,932.00	251,353,200
ライフドリンク カンパニー	3,300	5,310.00	17,523,000
サントリー食品インターナショナル	116,900	5,728.00	669,603,200
ダイトーグループホールディングス	18,800	2,702.00	50,797,600
伊藤園	56,300	3,830.00	215,629,000
キーコーヒー	18,600	2,038.00	37,906,800
ユニカフェ	1,800	915.00	1,647,000
ジャパンフーズ	900	1,991.00	1,791,900
日清オイリオグループ	23,400	4,870.00	113,958,000
不二製油グループ本社	38,700	2,355.50	91,157,850
かどや製油	700	3,660.00	2,562,000
J - オイルミルズ	19,000	1,957.00	37,183,000
キッコーマン	550,100	1,818.00	1,000,081,800
味の素	394,500	6,109.00	2,410,000,500
ブルドックソース	8,800	2,018.00	17,758,400
キューピー	89,200	3,123.00	278,571,600
ハウス食品グループ本社	57,200	2,986.00	170,799,200
カゴメ	71,400	3,817.00	272,533,800
アリアケジャパン	16,600	5,350.00	88,810,000
ピエトロ	800	1,794.00	1,435,200
エバラ食品工業	4,000	2,871.00	11,484,000
やまみ	800	3,220.00	2,576,000
ニチレイ	76,100	3,740.00	284,614,000
東洋水産	83,900	11,535.00	967,786,500
イトアンドホールディングス	7,900	2,027.00	16,013,300
大冷	800	1,910.00	1,528,000

ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,600	1,464.00	11,126,400
日清食品ホールディングス	175,100	4,134.00	723,863,400
永谷園ホールディングス	8,100	2,192.00	17,755,200
一正蒲鉾	2,400	775.00	1,860,000
フジッコ	17,100	1,861.00	31,823,100
ロック・フィールド	20,300	1,478.00	30,003,400
日本たばこ産業	1,008,900	4,451.00	4,490,613,900
ケンコーマヨネーズ	11,400	1,990.00	22,686,000
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,396.00	26,595,600
なとり	10,400	2,097.00	21,808,800
イフジ産業	1,100	1,353.00	1,488,300
ファーマフーズ	23,700	882.00	20,903,400
ユーグレナ	103,300	540.00	55,782,000
紀文食品	14,400	1,143.00	16,459,200
ピクルスホールディングス	9,700	1,171.00	11,358,700
ミヨシ油脂	2,100	1,411.00	2,963,100
理研ビタミン	14,300	2,565.00	36,679,500
片倉工業	15,800	1,888.00	29,830,400
ゲンゼ	12,100	5,280.00	63,888,000
東洋紡	73,300	1,074.00	78,724,200
ユニチカ	57,200	245.00	14,014,000
富士紡ホールディングス	7,500	4,450.00	33,375,000
倉敷紡績	12,100	4,415.00	53,421,500
シキボウ	10,100	1,083.00	10,938,300
日本毛織	43,600	1,341.00	58,467,600
トーア紡コーポレーション	2,200	434.00	954,800
帝国繊維	19,200	2,296.00	44,083,200
帝人	162,500	1,436.00	233,350,000
東レ	1,132,200	792.90	897,721,380
住江織物	1,200	2,607.00	3,128,400
日本フェルト	4,000	454.00	1,816,000
イチカワ	900	1,642.00	1,477,800
日東製網	600	1,451.00	870,600
アツギ	4,000	652.00	2,608,000
ダイニック	1,800	822.00	1,479,600
セーレン	32,800	2,549.00	83,607,200
ソトー	1,900	720.00	1,368,000
東海染工	600	847.00	508,200
小松マテーレ	24,600	727.00	17,884,200
ワコールホールディングス	34,600	3,662.00	126,705,200
ホギメディカル	22,300	3,905.00	87,081,500
T S Iホールディングス	55,000	865.00	47,575,000

マツオカコーポレーション	1,800	1,557.00	2,802,600
ワールド	23,900	2,081.00	49,735,900
三陽商会	7,200	2,664.00	19,180,800
ナイガイ	2,100	259.00	543,900
オンワードホールディングス	99,700	604.00	60,218,800
ルックホールディングス	5,000	2,834.00	14,170,000
ゴールドウイン	29,900	8,223.00	245,867,700
デサント	29,100	3,440.00	100,104,000
キング	2,200	664.00	1,460,800
ヤマトインターナショナル	4,600	343.00	1,577,800
特種東海製紙	9,200	3,490.00	32,108,000
王子ホールディングス	703,600	631.50	444,323,400
日本製紙	95,300	1,014.00	96,634,200
三菱製紙	7,600	775.00	5,890,000
北越コーポレーション	83,000	1,191.00	98,853,000
中越パルプ工業	2,300	1,611.00	3,705,300
大王製紙	74,600	957.90	71,459,340
阿波製紙	1,500	509.00	763,500
レンゴー	153,800	1,055.50	162,335,900
トモク	9,800	2,796.00	27,400,800
ザ・パック	12,500	3,890.00	48,625,000
北の達人コーポレーション	71,200	174.00	12,388,800
クラレ	246,100	1,933.00	475,711,300
旭化成	1,142,600	1,048.00	1,197,444,800
共和レザー	3,200	748.00	2,393,600
巴川コーポレーション	1,600	1,021.00	1,633,600
レゾナック・ホールディングス	163,200	3,678.00	600,249,600
住友化学	1,253,400	335.50	420,515,700
住友精化	7,900	5,200.00	41,080,000
日産化学	78,900	4,782.00	377,299,800
ラサ工業	6,500	3,055.00	19,857,500
クレハ	36,900	2,926.00	107,969,400
多木化学	6,600	3,935.00	25,971,000
テイカ	14,400	1,596.00	22,982,400
石原産業	28,000	1,644.00	46,032,000
片倉コープアグリ	1,300	1,130.00	1,469,000
日本曹達	19,900	5,290.00	105,271,000
東ソー	225,500	1,975.00	445,362,500
トクヤマ	54,500	3,102.00	169,059,000
セントラル硝子	18,000	3,585.00	64,530,000
東亜合成	81,200	1,578.50	128,174,200
大阪ソーダ	11,800	8,830.00	104,194,000

関東電化工業	32,700	889.00	29,070,300
デンカ	61,400	2,287.50	140,452,500
信越化学工業	1,514,600	6,083.00	9,213,311,800
日本カーバイド工業	8,000	1,840.00	14,720,000
堺化学工業	12,900	2,720.00	35,088,000
第一稀元素化学工業	18,500	884.00	16,354,000
エア・ウォーター	159,400	2,253.00	359,128,200
日本酸素ホールディングス	163,900	4,538.00	743,778,200
日本化学工業	6,200	2,401.00	14,886,200
東邦アセチレン	5,900	374.00	2,206,600
日本パーカラライジング	75,300	1,201.00	90,435,300
高压ガス工業	24,500	922.00	22,589,000
チタン工業	700	1,050.00	735,000
四国化成ホールディングス	21,500	1,895.00	40,742,500
戸田工業	3,800	1,786.00	6,786,800
ステラ ケミファ	9,200	4,175.00	38,410,000
保土谷化学工業	5,300	5,300.00	28,090,000
日本触媒	98,400	1,582.00	155,668,800
大日精化工業	11,700	2,992.00	35,006,400
カネカ	42,700	3,983.00	170,074,100
三菱瓦斯化学	123,300	3,048.00	375,818,400
三井化学	139,300	4,628.00	644,680,400
東京応化工業	80,600	4,367.00	351,980,200
大阪有機化学工業	14,100	3,420.00	48,222,000
三菱ケミカルグループ	1,234,700	835.00	1,030,974,500
KHネオケム	25,800	2,219.00	57,250,200
ダイセル	217,100	1,617.00	351,050,700
住友ベークライト	47,300	4,400.00	208,120,000
積水化学工業	339,400	2,215.50	751,940,700
日本ゼオン	115,800	1,453.00	168,257,400
アイカ工業	42,600	3,382.00	144,073,200
UBE	80,400	2,951.50	237,300,600
積水樹脂	25,200	2,326.00	58,615,200
タキロンシーアイ	43,100	747.00	32,195,700
旭有機材	11,200	4,625.00	51,800,000
ニチバン	9,200	1,775.00	16,330,000
リケンテクノス	31,700	1,032.00	32,714,400
大倉工業	7,800	2,983.00	23,267,400
積水化成成品工業	23,700	456.00	10,807,200
群栄化学工業	4,000	3,080.00	12,320,000
タイガースポリマー	2,600	853.00	2,217,800
ミライアル	1,900	1,534.00	2,914,600

ダイキアクシス	2,300	752.00	1,729,600
ダイキョーニシカワ	37,300	713.00	26,594,900
竹本容器	2,100	862.00	1,810,200
森六ホールディングス	8,800	2,657.00	23,381,600
恵和	12,200	1,520.00	18,544,000
日本化薬	129,000	1,298.50	167,506,500
カーリットホールディングス	18,200	1,190.00	21,658,000
日本精化	11,200	2,565.00	28,728,000
扶桑化学工業	17,900	3,905.00	69,899,500
トリケミカル研究所	20,500	4,435.00	90,917,500
A D E K A	58,900	3,216.00	189,422,400
日油	152,900	2,053.00	313,903,700
新日本理化	7,700	195.00	1,501,500
ハリマ化成グループ	11,800	888.00	10,478,400
花王	381,900	6,968.00	2,661,079,200
第一工業製薬	6,700	3,675.00	24,622,500
石原ケミカル	7,600	1,850.00	14,060,000
日華化学	2,200	1,116.00	2,455,200
ニイタカ	1,100	1,939.00	2,132,900
三洋化成工業	10,400	3,995.00	41,548,000
有機合成薬品工業	4,500	312.00	1,404,000
大日本塗料	18,700	1,129.00	21,112,300
日本ペイントホールディングス	896,800	1,171.50	1,050,601,200
関西ペイント	146,000	2,195.50	320,543,000
神東塗料	4,700	127.00	596,900
中国塗料	34,700	2,059.00	71,447,300
日本特殊塗料	4,000	1,260.00	5,040,000
藤倉化成	19,500	484.00	9,438,000
太陽ホールディングス	29,400	3,205.00	94,227,000
D I C	66,000	3,154.00	208,164,000
サカタインクス	37,600	1,723.00	64,784,800
a r t i e n c e	36,800	3,300.00	121,440,000
富士フイルムホールディングス	941,200	3,454.00	3,250,904,800
資生堂	353,100	4,918.00	1,736,545,800
ライオン	215,200	1,297.00	279,114,400
高砂香料工業	12,700	3,605.00	45,783,500
マンダム	36,500	1,216.00	44,384,000
ミルボン	23,000	3,540.00	81,420,000
ファンケル	74,000	2,009.00	148,666,000
コーセー	34,400	9,822.00	337,876,800
コタ	17,100	1,458.00	24,931,800
シーボン	800	1,406.00	1,124,800

ポーラ・オルビスホールディングス	86,700	1,409.00	122,160,300	
ノエビアホールディングス	15,100	5,260.00	79,426,000	
アジュバンホールディングス	1,400	850.00	1,190,000	
新日本製薬	9,600	1,673.00	16,060,800	
I - n e	4,500	1,601.00	7,204,500	
アクシージア	11,100	958.00	10,633,800	
エステー	13,100	1,526.00	19,990,600	
アグロ カネショウ	6,800	1,180.00	8,024,000	
コニシ	48,800	1,246.00	60,804,800	
長谷川香料	32,300	3,080.00	99,484,000	
小林製薬	49,200	5,601.00	275,569,200	
荒川化学工業	14,300	1,137.00	16,259,100	
メック	13,900	4,590.00	63,801,000	
日本高純度化学	3,800	3,300.00	12,540,000	
タカラバイオ	45,600	1,083.00	49,384,800	
J C U	18,700	3,665.00	68,535,500	
新田ゼラチン	3,800	778.00	2,956,400	
O A T アグリオ	6,300	1,570.00	9,891,000	
デクセリアルズ	42,200	6,389.00	269,615,800	
アース製薬	15,400	4,540.00	69,916,000	
北興化学工業	17,000	1,630.00	27,710,000	
大成ラミック	4,900	2,818.00	13,808,200	
クミアイ化学工業	67,200	812.00	54,566,400	
日本農薬	31,000	755.00	23,405,000	
アキレス	10,700	1,617.00	17,301,900	
有沢製作所	29,600	1,558.00	46,116,800	
日東電工	108,600	12,305.00	1,336,323,000	
レック	21,700	1,253.00	27,190,100	
三光合成	21,300	716.00	15,250,800	
きもと	9,300	214.00	1,990,200	
藤森工業	13,400	4,155.00	55,677,000	
前澤化成工業	10,900	1,820.00	19,838,000	
未来工業	6,100	3,985.00	24,308,500	
ウェーブロックホールディングス	2,100	647.00	1,358,700	
J S P	11,900	2,186.00	26,013,400	
エフピコ	32,000	2,664.50	85,264,000	
天馬	12,300	2,324.00	28,585,200	
信越ポリマー	36,500	1,587.00	57,925,500	
東リ	12,400	404.00	5,009,600	
ニフコ	50,600	3,718.00	188,130,800	
バルカー	14,100	3,860.00	54,426,000	
ユニ・チャーム	352,300	4,951.00	1,744,237,300	

ショーエイコーポレーション	1,800	593.00	1,067,400
協和キリン	204,300	2,618.50	534,959,550
武田薬品工業	1,496,700	4,165.00	6,233,755,500
アステラス製薬	1,483,400	1,511.50	2,242,159,100
住友ファーマ	125,400	339.00	42,510,600
塩野義製薬	213,200	7,144.00	1,523,100,800
わかもと製薬	5,900	245.00	1,445,500
日本新薬	44,300	3,693.00	163,599,900
中外製薬	529,400	5,036.00	2,666,058,400
科研製薬	29,000	3,440.00	99,760,000
エーザイ	205,700	6,655.00	1,368,933,500
ロート製薬	163,800	2,881.50	471,989,700
小野薬品工業	345,900	2,306.00	797,645,400
久光製薬	37,600	3,809.00	143,218,400
持田製薬	19,300	3,045.00	58,768,500
参天製薬	298,400	1,569.00	468,189,600
扶桑薬品工業	6,000	2,287.00	13,722,000
日本ケミファ	600	1,562.00	937,200
ツムラ	53,200	3,957.00	210,512,400
キッセイ薬品工業	28,000	3,160.00	88,480,000
生化学工業	28,700	784.00	22,500,800
栄研化学	30,300	2,146.00	65,023,800
鳥居薬品	9,100	3,850.00	35,035,000
JCRファーマ	57,200	636.00	36,379,200
東和薬品	26,000	2,730.00	70,980,000
富士製薬工業	12,500	1,518.00	18,975,000
ゼリア新薬工業	23,400	2,001.00	46,823,400
ネクセラファーマ	74,000	1,470.00	108,780,000
第一三共	1,473,300	5,531.00	8,148,822,300
杏林製薬	36,700	1,715.00	62,940,500
大幸薬品	35,100	400.00	14,040,000
ダイト	12,900	2,305.00	29,734,500
大塚ホールディングス	351,700	6,505.00	2,287,808,500
ペプチドリーム	82,000	1,915.50	157,071,000
セルソース	6,200	1,419.00	8,797,800
あすか製薬ホールディングス	17,300	2,284.00	39,513,200
サワイグループホールディングス	38,700	6,105.00	236,263,500
日本コークス工業	171,600	146.00	25,053,600
ニチレキ	22,000	2,326.00	51,172,000
ユシロ化学工業	8,800	1,709.00	15,039,200
ビーピー・カストロール	2,200	990.00	2,178,000
富士石油	49,300	494.00	24,354,200

MORESCO	2,000	1,322.00	2,644,000
出光興産	878,100	1,041.50	914,541,150
Eneosホールディングス	2,677,300	794.80	2,127,918,040
コスモエネルギーホールディングス	50,100	7,633.00	382,413,300
横浜ゴム	85,500	4,177.00	357,133,500
TOYO TIRE	97,200	2,781.50	270,361,800
ブリヂストン	495,000	6,974.00	3,452,130,000
住友ゴム工業	165,900	1,840.00	305,256,000
藤倉コンポジット	14,600	1,350.00	19,710,000
オカモト	8,000	4,600.00	36,800,000
フコク	8,900	1,906.00	16,963,400
ニッタ	17,200	3,950.00	67,940,000
住友理工	26,200	1,279.00	33,509,800
三ツ星ベルト	19,600	4,385.00	85,946,000
バンドー化学	25,100	1,828.00	45,882,800
日東紡績	21,400	6,680.00	142,952,000
AGC	150,800	5,570.00	839,956,000
日本板硝子	80,700	461.00	37,202,700
石塚硝子	1,000	2,923.00	2,923,000
日本山村硝子	2,200	1,977.00	4,349,400
日本電気硝子	69,100	3,622.00	250,280,200
オハラ	8,100	1,291.00	10,457,100
住友大阪セメント	28,200	3,869.00	109,105,800
太平洋セメント	100,000	3,853.00	385,300,000
日本ヒューム	14,900	994.00	14,810,600
日本コンクリート工業	33,000	368.00	12,144,000
三谷セキサン	7,100	5,180.00	36,778,000
アジアパイルホールディングス	24,100	1,025.00	24,702,500
東海カーボン	156,100	1,002.50	156,490,250
日本カーボン	9,000	5,450.00	49,050,000
東洋炭素	11,900	7,180.00	85,442,000
ノリタケカンパニーリミテド	18,700	4,010.00	74,987,000
TOTO	111,600	4,297.00	479,545,200
日本碍子	196,700	2,111.50	415,332,050
日本特殊陶業	141,600	4,844.00	685,910,400
MARUWA	6,200	33,450.00	207,390,000
品川リフラクトリーズ	20,900	1,946.00	40,671,400
黒崎播磨	13,800	3,200.00	44,160,000
ヨータイ	10,500	1,796.00	18,858,000
東京窯業	6,200	448.00	2,777,600
ニッカトー	2,700	575.00	1,552,500
フジインコーポレーテッド	45,500	3,205.00	145,827,500



クニミネ工業	1,700	1,117.00	1,898,900
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,433.00	1,719,600
ニチアス	42,800	4,400.00	188,320,000
ニチハ	21,200	3,485.00	73,882,000
日本製鉄	779,200	3,355.00	2,614,216,000
神戸製鋼所	349,900	2,000.00	699,800,000
中山製鋼所	39,800	979.00	38,964,200
合同製鐵	9,700	5,550.00	53,835,000
J F E ホールディングス	483,900	2,334.00	1,129,422,600
東京製鐵	48,900	1,665.00	81,418,500
共英製鋼	19,800	2,172.00	43,005,600
大和工業	32,800	8,742.00	286,737,600
東京鐵鋼	7,700	5,220.00	40,194,000
大阪製鐵	8,000	2,801.00	22,408,000
淀川製鋼所	19,800	5,770.00	114,246,000
中部鋼鈹	11,400	2,745.00	31,293,000
丸一鋼管	53,000	3,855.00	204,315,000
モリ工業	3,800	5,700.00	21,660,000
大同特殊鋼	109,600	1,611.50	176,620,400
日本高周波鋼業	2,300	449.00	1,032,700
日本冶金工業	12,700	4,850.00	61,595,000
山陽特殊製鋼	17,200	2,266.00	38,975,200
愛知製鋼	10,000	3,725.00	37,250,000
日本金属	1,500	794.00	1,191,000
大平洋金属	14,800	1,364.00	20,187,200
新日本電工	86,600	301.00	26,066,600
栗本鐵工所	8,100	4,700.00	38,070,000
虹技	800	1,210.00	968,000
三菱製鋼	12,900	1,524.00	19,659,600
日亜鋼業	5,900	323.00	1,905,700
日本精線	13,800	1,265.00	17,457,000
エンビプロ・ホールディングス	15,000	519.00	7,785,000
シンニッタン	7,300	236.00	1,722,800
新家工業	1,300	5,080.00	6,604,000
大紀アルミニウム工業所	22,000	1,328.00	29,216,000
日本輕金属ホールディングス	50,800	1,932.00	98,145,600
三井金属鈹業	50,600	5,099.00	258,009,400
三菱マテリアル	124,400	3,253.00	404,673,200
住友金属鈹山	201,700	5,488.00	1,106,929,600
D O W A ホールディングス	43,000	6,061.00	260,623,000
古河機械金属	23,000	1,997.00	45,931,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,200	2,450.00	73,990,000

東邦チタニウム	36,000	1,220.00	43,920,000
U A C J	24,400	4,545.00	110,898,000
C Kサンエツ	4,200	3,895.00	16,359,000
古河電気工業	57,900	3,911.00	226,446,900
住友電気工業	650,800	2,427.50	1,579,817,000
フジクラ	205,200	2,910.00	597,132,000
S W C C	19,400	4,290.00	83,226,000
タツタ電線	31,900	716.00	22,840,400
カナレ電気	1,000	1,573.00	1,573,000
平河ヒューテック	11,100	1,355.00	15,040,500
リョービ	18,500	2,650.00	49,025,000
アーレスティ	6,300	718.00	4,523,400
A R Eホールディングス	65,400	2,013.00	131,650,200
稲葉製作所	9,700	1,834.00	17,789,800
宮地エンジニアリンググループ	8,700	4,560.00	39,672,000
トーカロ	50,200	1,965.00	98,643,000
アルファC o	2,100	1,400.00	2,940,000
S U M C O	309,100	2,477.50	765,795,250
川田テクノロジーズ	12,300	2,837.00	34,895,100
R S Technologies	11,600	3,200.00	37,120,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,793.00	1,793,000
信和	3,700	742.00	2,745,400
東洋製罐グループホールディングス	99,800	2,482.00	247,703,600
ホッカンホールディングス	8,500	1,650.00	14,025,000
コロナ	9,700	925.00	8,972,500
横河ブリッジホールディングス	27,200	2,752.00	74,854,400
駒井ハルテック	1,000	1,789.00	1,789,000
高田機工	400	3,575.00	1,430,000
三和ホールディングス	174,800	2,890.00	505,172,000
文化シャッター	45,500	1,700.00	77,350,000
三協立山	21,900	873.00	19,118,700
アルインコ	13,300	1,085.00	14,430,500
東洋シャッター	1,300	933.00	1,212,900
L I X I L	271,700	1,802.50	489,739,250
日本フィルコン	3,800	554.00	2,105,200
ノーリツ	27,600	1,764.00	48,686,400
長府製作所	17,300	2,247.00	38,873,100
リンナイ	83,200	3,859.00	321,068,800
ダイニチ工業	2,900	688.00	1,995,200
日東精工	25,200	596.00	15,019,200
三洋工業	700	3,070.00	2,149,000
岡部	31,100	778.00	24,195,800

ジーテクト	22,200	1,935.00	42,957,000
東プレ	30,700	2,306.00	70,794,200
高周波熱錬	25,800	1,090.00	28,122,000
東京製綱	11,300	1,318.00	14,893,400
サンコール	17,100	450.00	7,695,000
モリテック スチール	5,100	243.00	1,239,300
パイオラックス	21,600	2,199.00	47,498,400
エイチワン	17,900	812.00	14,534,800
日本発條	153,900	1,823.00	280,559,700
中央発條	12,900	1,110.00	14,319,000
アドバネクス	700	1,079.00	755,300
立川ブラインド工業	7,900	1,390.00	10,981,000
三益半導体工業	15,700	3,700.00	58,090,000
日本ドライケミカル	1,400	2,585.00	3,619,000
日本製鋼所	46,900	4,713.00	221,039,700
三浦工業	71,100	2,962.00	210,598,200
タクマ	57,600	1,679.00	96,710,400
ツガミ	37,900	1,478.00	56,016,200
オークマ	14,900	7,137.00	106,341,300
芝浦機械	17,000	3,475.00	59,075,000
アマダ	258,100	1,814.50	468,322,450
アイダエンジニアリング	39,500	918.00	36,261,000
F U J I	80,200	2,685.00	215,337,000
牧野フライス製作所	18,800	6,730.00	126,524,000
オーエスジー	75,100	2,019.50	151,664,450
ダイジェット工業	600	845.00	507,000
旭ダイヤモンド工業	39,300	902.00	35,448,600
D M G 森精機	105,700	4,523.00	478,081,100
ソディック	41,500	719.00	29,838,500
ディスコ	82,000	55,700.00	4,567,400,000
日東工器	8,300	2,286.00	18,973,800
日進工具	15,800	951.00	15,025,800
パンチ工業	5,600	482.00	2,699,200
富士ダイス	11,100	758.00	8,413,800
豊和工業	3,100	840.00	2,604,000
リケンN P R	18,500	2,850.00	52,725,000
東洋機械金属	4,700	728.00	3,421,600
エンシュウ	1,400	717.00	1,003,800
島精機製作所	27,100	1,547.00	41,923,700
オプトラン	28,000	2,099.00	58,772,000
N C ホールディングス	1,300	1,745.00	2,268,500
イワキポンプ	11,400	2,334.00	26,607,600

フリー	16,100	1,056.00	17,001,600
ヤマシンフィルタ	40,600	380.00	15,428,000
日阪製作所	18,600	1,033.00	19,213,800
やまびこ	27,800	2,110.00	58,658,000
野村マイクロ・サイエンス	23,100	5,190.00	119,889,000
平田機工	8,100	7,410.00	60,021,000
P E G A S U S	18,900	515.00	9,733,500
マルマエ	7,400	1,970.00	14,578,000
タツモ	10,300	3,685.00	37,955,500
ナプテスコ	106,900	2,790.00	298,251,000
三井海洋開発	21,600	2,837.00	61,279,200
レオン自動機	19,700	1,592.00	31,362,400
S M C	51,000	83,630.00	4,265,130,000
ホソカワミクロン	11,900	4,435.00	52,776,500
ユニオンツール	7,500	5,370.00	40,275,000
瑞光	12,300	1,104.00	13,579,200
オイレス工業	23,100	2,226.00	51,420,600
日精エー・エス・ビー機械	6,800	5,140.00	34,952,000
サトーホールディングス	24,200	2,152.00	52,078,400
技研製作所	16,000	1,855.00	29,680,000
日本エアーテック	8,000	1,178.00	9,424,000
カワタ	1,800	907.00	1,632,600
日精樹脂工業	12,700	1,053.00	13,373,100
オカダアイヨン	1,900	2,581.00	4,903,900
ワイエイシイホールディングス	7,200	2,345.00	16,884,000
小松製作所	798,300	4,682.00	3,737,640,600
住友重機械工業	100,800	4,357.00	439,185,600
日立建機	67,800	4,520.00	306,456,000
日工	25,300	731.00	18,494,300
巴工業	6,700	4,325.00	28,977,500
井関農機	16,000	1,025.00	16,400,000
T O W A	19,000	13,820.00	262,580,000
丸山製作所	1,000	2,448.00	2,448,000
北川鉄工所	6,700	1,417.00	9,493,900
ローツェ	8,900	32,650.00	290,585,000
タカキタ	1,900	485.00	921,500
クボタ	890,400	2,395.50	2,132,953,200
荏原実業	9,000	3,460.00	31,140,000
三菱化工機	6,000	4,215.00	25,290,000
月島ホールディングス	23,100	1,420.00	32,802,000
帝国電機製作所	11,700	2,275.00	26,617,500
新東工業	34,500	1,141.00	39,364,500

澁谷工業	16,000	3,615.00	57,840,000
アイチ コーポレーション	23,700	1,199.00	28,416,300
小森コーポレーション	42,000	1,181.00	49,602,000
鶴見製作所	13,000	4,010.00	52,130,000
日本ギア工業	2,200	556.00	1,223,200
酒井重工業	3,000	5,310.00	15,930,000
荏原製作所	69,900	12,715.00	888,778,500
石井鐵工所	700	2,796.00	1,957,200
西島製作所	14,700	3,270.00	48,069,000
北越工業	17,100	2,055.00	35,140,500
ダイキン工業	203,300	24,775.00	5,036,757,500
オルガノ	20,500	8,170.00	167,485,000
トーヨーカネツ	5,800	3,910.00	22,678,000
栗田工業	95,300	6,946.00	661,953,800
椿本チエイン	24,000	6,000.00	144,000,000
大同工業	2,500	815.00	2,037,500
木村化工機	13,100	713.00	9,340,300
アネスト岩田	26,300	1,360.00	35,768,000
ダイフク	287,400	3,128.00	898,987,200
サムコ	4,600	4,595.00	21,137,000
加藤製作所	2,900	1,373.00	3,981,700
油研工業	1,000	2,379.00	2,379,000
タダノ	98,000	1,168.50	114,513,000
フジテック	39,800	4,260.00	169,548,000
C K D	47,100	3,225.00	151,897,500
平和	50,400	2,021.00	101,858,400
理想科学工業	13,600	2,991.00	40,677,600
S A N K Y O	164,000	1,551.50	254,446,000
日本金銭機械	20,600	1,248.00	25,708,800
マースグループホールディングス	8,600	3,430.00	29,498,000
フクシマガリレイ	11,100	6,240.00	69,264,000
オーイズミ	2,200	360.00	792,000
ダイコク電機	8,400	3,405.00	28,602,000
竹内製作所	30,900	6,320.00	195,288,000
アマノ	48,300	3,795.00	183,298,500
J U K I	26,400	533.00	14,071,200
ジャノメ	17,300	687.00	11,885,100
マックス	24,000	3,570.00	85,680,000
グローリー	40,900	2,754.50	112,659,050
新晃工業	17,200	4,395.00	75,594,000
大和冷機工業	26,100	1,469.00	38,340,900
セガサミーホールディングス	152,100	2,277.50	346,407,750

T P R	21,600	2,367.00	51,127,200
ツバキ・ナカシマ	34,100	807.00	27,518,700
ホシザキ	100,500	5,895.00	592,447,500
大豊工業	14,800	856.00	12,668,800
日本精工	315,300	779.00	245,618,700
N T N	369,400	303.00	111,928,200
ジェイテクト	151,600	1,187.50	180,025,000
不二越	12,600	3,350.00	42,210,000
日本トムソン	46,400	603.00	27,979,200
T H K	98,300	3,211.00	315,641,300
ユーシン精機	13,500	701.00	9,463,500
前澤給装工業	12,200	1,355.00	16,531,000
イーグル工業	18,800	1,863.00	35,024,400
前澤工業	3,600	1,235.00	4,446,000
日本ピラー工業	15,800	5,610.00	88,638,000
キッツ	57,000	1,122.00	63,954,000
マキタ	194,200	4,829.00	937,791,800
三井E & S	84,500	1,582.00	133,679,000
日立造船	150,300	1,129.00	169,688,700
三菱重工業	2,978,200	1,347.50	4,013,124,500
I H I	126,800	3,986.00	505,424,800
スター精密	31,300	2,062.00	64,540,600
日清紡ホールディングス	128,000	1,128.50	144,448,000
イビデン	88,900	5,364.00	476,859,600
コニカミノルタ	380,700	462.50	176,073,750
ブラザー工業	227,600	2,906.00	661,405,600
ミネベアミツミ	296,300	3,370.00	998,531,000
日立製作所	818,500	14,565.00	11,921,452,500
三菱電機	1,895,500	2,824.50	5,353,839,750
富士電機	103,600	9,823.00	1,017,662,800
東洋電機製造	2,000	1,147.00	2,294,000
安川電機	185,000	6,380.00	1,180,300,000
シンフォニアテクノロジー	18,800	3,730.00	70,124,000
明電舎	31,600	3,720.00	117,552,000
オリジン	1,300	1,271.00	1,652,300
山洋電気	7,400	7,270.00	53,798,000
デンヨー	13,000	2,641.00	34,333,000
PHCホールディングス	32,000	1,106.00	35,392,000
K O K U S A I E L E C T R I C	88,100	3,840.00	338,304,000
ソシオネクスト	124,000	4,600.00	570,400,000
東芝テック	21,800	3,045.00	66,381,000
芝浦メカトロニクス	9,700	6,620.00	64,214,000

マブチモーター	83,800	2,415.00	202,377,000
ニデック	376,000	7,353.00	2,764,728,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,300	387.00	4,373,100
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,776.00	15,806,400
東光高岳	10,400	2,125.00	22,100,000
ダブル・スコープ	48,800	493.00	24,058,400
ダイヘン	16,100	8,940.00	143,934,000
ヤーマン	33,300	945.00	31,468,500
JVCケンウッド	134,700	828.00	111,531,600
ミマキエンジニアリング	16,300	1,486.00	24,221,800
I - P E X	11,900	2,105.00	25,049,500
大崎電気工業	37,300	603.00	22,491,900
オムロン	130,000	5,437.00	706,810,000
日東工業	23,000	3,475.00	79,925,000
I D E C	25,100	2,716.00	68,171,600
正興電機製作所	2,100	1,521.00	3,194,100
不二電機工業	1,300	1,118.00	1,453,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66,500	3,053.00	203,024,500
サクサホールディングス	1,300	2,698.00	3,507,400
メルコホールディングス	5,400	3,530.00	19,062,000
テクノメディカ	4,300	1,764.00	7,585,200
日本電気	223,700	11,050.00	2,471,885,000
富士通	1,567,100	2,333.50	3,656,827,850
沖電気工業	77,000	1,039.00	80,003,000
岩崎通信機	2,700	677.00	1,827,900
電気興業	6,900	2,117.00	14,607,300
サンケン電気	15,800	6,190.00	97,802,000
ナカヨ	900	1,154.00	1,038,600
アイホン	9,200	2,923.00	26,891,600
ルネサスエレクトロニクス	1,061,700	2,757.50	2,927,637,750
セイコーエプソン	218,500	2,443.50	533,904,750
ワコム	124,400	734.00	91,309,600
アルバック	37,300	10,895.00	406,383,500
アクセル	7,800	1,271.00	9,913,800
E I Z O	12,500	4,870.00	60,875,000
日本信号	38,800	1,010.00	39,188,000
京三製作所	35,700	552.00	19,706,400
能美防災	23,100	2,258.00	52,159,800
ホーチキ	12,800	2,145.00	27,456,000
星和電機	2,900	589.00	1,708,100
エレコム	40,800	1,542.00	62,913,600
パナソニック ホールディングス	2,011,800	1,346.50	2,708,888,700

シャープ	287,100	838.50	240,733,350
アンリツ	119,900	1,209.00	144,959,100
富士通ゼネラル	48,300	2,215.50	107,008,650
ソニーグループ	1,192,800	13,065.00	15,583,932,000
T D K	269,700	7,448.00	2,008,725,600
帝国通信工業	7,600	1,949.00	14,812,400
タムラ製作所	67,800	640.00	43,392,000
アルプスアルパイン	152,200	1,450.00	220,690,000
池上通信機	1,800	784.00	1,411,200
日本電波工業	20,600	1,135.00	23,381,000
鈴木	9,200	1,382.00	12,714,400
メイコー	16,900	6,390.00	107,991,000
日本トリム	3,900	3,380.00	13,182,000
ローランド ディー . ジー .	9,500	5,340.00	50,730,000
フォスター電機	12,600	1,364.00	17,186,400
S M K	4,500	2,405.00	10,822,500
ヨコオ	15,200	2,024.00	30,764,800
ホシデン	38,800	1,909.00	74,069,200
ヒロセ電機	25,100	17,430.00	437,493,000
日本航空電子工業	40,700	2,392.00	97,354,400
T O A	19,400	1,092.00	21,184,800
マクセル	37,700	1,544.00	58,208,800
古野電気	22,200	2,015.00	44,733,000
スミダコーポレーション	23,000	1,161.00	26,703,000
アイコム	6,600	3,065.00	20,229,000
リオン	7,100	3,030.00	21,513,000
横河電機	186,300	4,102.00	764,202,600
新電元工業	6,500	3,000.00	19,500,000
アズビル	116,000	4,466.00	518,056,000
東亜ディーケーケー	2,900	859.00	2,491,100
日本光電工業	72,400	4,474.00	323,917,600
チノー	7,000	2,588.00	18,116,000
共和電業	5,200	470.00	2,444,000
日本電子材料	10,400	3,815.00	39,676,000
堀場製作所	32,200	13,825.00	445,165,000
アドバンテスト	483,100	5,520.00	2,666,712,000
小野測器	2,600	687.00	1,786,200
エスペック	13,600	3,120.00	42,432,000
キーエンス	168,700	73,110.00	12,333,657,000
日置電機	8,000	7,300.00	58,400,000
シスメックス	436,600	2,767.50	1,208,290,500
日本マイクロニクス	30,300	6,660.00	201,798,000



メガチップス	13,400	4,360.00	58,424,000
O B A R A G R O U P	10,600	4,115.00	43,619,000
澤藤電機	800	1,230.00	984,000
原田工業	2,800	623.00	1,744,400
コーセル	18,200	1,430.00	26,026,000
イリソ電子工業	15,600	3,065.00	47,814,000
オブテックスグループ	31,000	1,740.00	53,940,000
千代田インテグレ	6,700	2,853.00	19,115,100
レーザーテック	77,300	43,330.00	3,349,409,000
スタンレー電気	108,000	2,915.00	314,820,000
ウシオ電機	74,700	2,028.00	151,491,600
岡谷電機産業	5,100	252.00	1,285,200
ハリオス テクノ ホールディング	6,000	504.00	3,024,000
エノモト	1,700	1,509.00	2,565,300
日本セラミック	13,800	2,460.00	33,948,000
遠藤照明	2,700	1,606.00	4,336,200
古河電池	12,600	1,125.00	14,175,000
双信電機	3,500	479.00	1,676,500
山一電機	15,200	3,750.00	57,000,000
図研	14,700	4,085.00	60,049,500
日本電子	42,300	6,589.00	278,714,700
カシオ計算機	121,800	1,161.50	141,470,700
ファナック	822,200	4,674.00	3,842,962,800
日本シイエムケイ	39,900	600.00	23,940,000
エンプラス	4,900	7,380.00	36,162,000
大真空	25,400	712.00	18,084,800
ローム	311,900	2,069.00	645,321,100
浜松ホトニクス	135,400	5,205.00	704,757,000
三井ハイテック	15,000	7,779.00	116,685,000
新光電気工業	59,700	5,590.00	333,723,000
京セラ	1,047,800	1,869.50	1,958,862,100
太陽誘電	82,200	3,222.00	264,848,400
村田製作所	1,534,200	2,874.50	4,410,057,900
双葉電子工業	32,600	520.00	16,952,000
北陸電気工業	2,200	1,378.00	3,031,600
ニチコン	44,400	1,234.00	54,789,600
日本ケミコン	18,100	1,566.00	28,344,600
K O A	25,700	1,504.00	38,652,800
市光工業	30,800	538.00	16,570,400
小糸製作所	174,800	2,232.50	390,241,000
ミツバ	31,600	1,088.00	34,380,800
S C R E E Nホールディングス	57,700	15,800.00	911,660,000

キヤノン電子	18,700	2,264.00	42,336,800
キヤノン	841,000	4,392.00	3,693,672,000
リコー	422,800	1,291.00	545,834,800
象印マホービン	45,900	1,490.00	68,391,000
MUTOHホールディングス	900	2,597.00	2,337,300
東京エレクトロン	356,900	36,340.00	12,969,746,000
イノテック	11,300	1,746.00	19,729,800
トヨタ紡織	71,000	2,287.50	162,412,500
芦森工業	1,200	2,410.00	2,892,000
ユニプレス	30,300	1,514.00	45,874,200
豊田自動織機	143,800	15,010.00	2,158,438,000
モリタホールディングス	29,600	1,760.00	52,096,000
三櫻工業	25,800	983.00	25,361,400
デンソー	1,391,200	2,611.50	3,633,118,800
東海理化電機製作所	47,600	2,264.00	107,766,400
川崎重工業	137,600	5,629.00	774,550,400
名村造船所	47,200	1,909.00	90,104,800
日本車輛製造	5,600	2,303.00	12,896,800
三菱ロジスネクスト	26,900	1,700.00	45,730,000
近畿車輛	800	1,944.00	1,555,200
日産自動車	2,275,500	559.90	1,274,052,450
いすゞ自動車	490,200	2,031.50	995,841,300
トヨタ自動車	9,258,700	3,447.00	31,914,738,900
日野自動車	253,600	462.80	117,366,080
三菱自動車工業	657,800	442.60	291,142,280
エフテック	4,000	662.00	2,648,000
レシップホールディングス	2,400	565.00	1,356,000
GMB	1,100	1,411.00	1,552,100
ファルテック	1,200	565.00	678,000
武蔵精密工業	41,300	1,764.00	72,853,200
日産車体	17,100	1,022.00	17,476,200
新明和工業	48,600	1,330.00	64,638,000
極東開発工業	27,800	2,453.00	68,193,400
トピー工業	13,700	2,481.00	33,989,700
ティラド	3,800	3,765.00	14,307,000
曙ブレーキ工業	102,900	145.00	14,920,500
タチエス	31,100	2,030.00	63,133,000
NOK	65,500	2,103.50	137,779,250
フタバ産業	45,300	896.00	40,588,800
カヤバ	15,900	5,120.00	81,408,000
大同メタル工業	33,100	605.00	20,025,500
プレス工業	67,400	671.00	45,225,400

ミクニ	7,200	421.00	3,031,200
太平洋工業	38,700	1,553.00	60,101,100
アイシン	130,100	5,667.00	737,276,700
マツダ	557,700	1,607.50	896,502,750
今仙電機製作所	3,600	634.00	2,282,400
本田技研工業	3,995,200	1,770.00	7,071,504,000
スズキ	1,238,800	1,838.50	2,277,533,800
S U B A R U	522,900	3,316.00	1,733,936,400
安永	2,500	612.00	1,530,000
ヤマハ発動機	728,700	1,511.00	1,101,065,700
T B K	6,200	325.00	2,015,000
エクセディ	27,600	2,824.00	77,942,400
豊田合成	48,300	3,079.00	148,715,700
愛三工業	28,000	1,423.00	39,844,000
盟和産業	800	1,000.00	800,000
日本プラスト	4,900	453.00	2,219,700
ヨロズ	15,900	1,006.00	15,995,400
エフ・シー・シー	29,900	2,170.00	64,883,000
シマノ	68,000	25,960.00	1,765,280,000
テイ・エス テック	60,100	1,805.00	108,480,500
ジャムコ	9,200	1,547.00	14,232,400
テルモ	940,000	2,774.00	2,607,560,000
クリエートメディック	1,800	961.00	1,729,800
日機装	39,300	1,260.00	49,518,000
日本エム・ディ・エム	13,400	637.00	8,535,800
島津製作所	224,000	4,350.00	974,400,000
J M S	15,600	539.00	8,408,400
長野計器	12,300	2,924.00	35,965,200
ブイ・テクノロジー	8,900	2,865.00	25,498,500
東京計器	12,900	3,075.00	39,667,500
愛知時計電機	7,300	2,108.00	15,388,400
インターアクション	10,200	1,497.00	15,269,400
オーバル	4,900	464.00	2,273,600
東京精密	34,500	10,665.00	367,942,500
マニー	67,500	1,884.00	127,170,000
ニコン	243,800	1,679.00	409,340,200
トプコン	82,000	1,713.50	140,507,000
オリンパス	996,100	2,553.00	2,543,043,300
理研計器	23,900	3,690.00	88,191,000
タムロン	10,300	8,080.00	83,224,000
H O Y A	331,900	18,800.00	6,239,720,000
シード	3,400	585.00	1,989,000

ノーリツ銅機	16,000	3,815.00	61,040,000
A & Dホロンホールディングス	24,600	2,922.00	71,881,200
朝日インテック	205,500	2,330.50	478,917,750
シチズン時計	155,100	1,030.00	159,753,000
リズム	1,300	4,040.00	5,252,000
大研医器	4,800	549.00	2,635,200
メニコン	58,000	1,371.50	79,547,000
シンシア	700	487.00	340,900
松風	7,600	3,165.00	24,054,000
セイコーグループ	23,500	4,380.00	102,930,000
ニプロ	140,600	1,194.50	167,946,700
KYORITSU	8,300	169.00	1,402,700
中本パックス	1,800	1,657.00	2,982,600
パラマウントベッドホールディングス	35,000	2,628.00	91,980,000
トランザクション	11,100	1,945.00	21,589,500
粧美堂	1,500	561.00	841,500
ニホンフラッシュ	15,800	920.00	14,536,000
前田工織	14,600	3,185.00	46,501,000
永大産業	6,600	243.00	1,603,800
アートネイチャー	15,200	799.00	12,144,800
フルヤ金属	5,300	12,380.00	65,614,000
バンダイナムコホールディングス	461,900	3,100.00	1,431,890,000
アイフィスジャパン	1,500	582.00	873,000
SHOEI	47,400	2,051.00	97,217,400
フランスベッドホールディングス	21,800	1,201.00	26,181,800
パイロットコーポレーション	23,700	4,301.00	101,933,700
萩原工業	11,300	1,551.00	17,526,300
フジシールインターナショナル	34,100	2,198.00	74,951,800
タカラトミー	76,700	2,722.00	208,777,400
広済堂ホールディングス	49,000	634.00	31,066,000
エステールホールディングス	1,300	645.00	838,500
タカノ	2,100	974.00	2,045,400
プロネクサス	17,500	1,262.00	22,085,000
ホクシン	4,300	120.00	516,000
ウッドワン	2,000	937.00	1,874,000
TOPPANホールディングス	207,300	3,891.00	806,604,300
大日本印刷	174,800	4,790.00	837,292,000
共同印刷	4,700	3,500.00	16,450,000
NISSHA	28,900	1,828.00	52,829,200
光村印刷	500	1,566.00	783,000
TAKARA & COMPANY	10,000	2,656.00	26,560,000
アシックス	143,700	8,102.00	1,164,257,400

ツツミ	3,900	2,240.00	8,736,000
ローランド	12,400	4,135.00	51,274,000
小松ウオール工業	6,900	3,270.00	22,563,000
ヤマハ	106,300	3,476.00	369,498,800
河合楽器製作所	5,100	3,385.00	17,263,500
クリナップ	16,500	716.00	11,814,000
ピジョン	107,400	1,526.00	163,892,400
キングジム	14,900	890.00	13,261,000
リンテック	33,800	3,255.00	110,019,000
イトーキ	34,400	1,556.00	53,526,400
任天堂	1,064,600	8,391.00	8,933,058,600
三菱鉛筆	23,900	2,349.00	56,141,100
タカラスタANDARD	35,300	1,766.00	62,339,800
コクヨ	69,000	2,647.00	182,643,000
ナカバヤシ	18,200	541.00	9,846,200
グローブライド	15,100	1,986.00	29,988,600
オカムラ	50,800	2,271.00	115,366,800
美津濃	16,800	7,670.00	128,856,000
東京電力ホールディングス	1,520,000	975.00	1,482,000,000
中部電力	621,300	2,009.50	1,248,502,350
関西電力	651,100	2,488.00	1,619,936,800
中国電力	292,900	1,042.00	305,201,800
北陸電力	172,400	1,048.00	180,675,200
東北電力	443,900	1,278.50	567,526,150
四国電力	157,000	1,412.50	221,762,500
九州電力	388,700	1,703.00	661,956,100
北海道電力	162,900	1,465.00	238,648,500
沖縄電力	43,100	1,143.00	49,263,300
電源開発	138,500	2,561.00	354,698,500
エフオン	12,300	391.00	4,809,300
イーレックス	30,000	708.00	21,240,000
レノバ	45,000	1,046.00	47,070,000
東京瓦斯	328,300	3,518.00	1,154,959,400
大阪瓦斯	336,000	3,607.00	1,211,952,000
東邦瓦斯	73,000	3,859.00	281,707,000
北海道瓦斯	10,100	3,630.00	36,663,000
広島ガス	35,600	376.00	13,385,600
西部ガスホールディングス	17,600	1,910.00	33,616,000
静岡ガス	33,600	963.00	32,356,800
メタウォーター	20,200	2,001.00	40,420,200
SBSホールディングス	15,000	2,644.00	39,660,000
東武鉄道	185,200	2,800.00	518,560,000

相鉄ホールディングス	60,300	2,514.00	151,594,200
東急	472,800	1,832.00	866,169,600
京浜急行電鉄	208,700	1,204.50	251,379,150
小田急電鉄	278,800	1,676.00	467,268,800
京王電鉄	81,100	3,833.00	310,856,300
京成電鉄	108,700	5,849.00	635,786,300
富士急行	20,800	3,235.00	67,288,000
東日本旅客鉄道	929,300	2,843.00	2,641,999,900
西日本旅客鉄道	400,000	3,172.00	1,268,800,000
東海旅客鉄道	649,500	3,491.00	2,267,404,500
西武ホールディングス	204,000	2,334.50	476,238,000
鴻池運輸	28,700	2,220.00	63,714,000
西日本鉄道	45,000	2,450.50	110,272,500
ハマキョウレックス	14,400	3,905.00	56,232,000
サカイ引越センター	18,700	2,407.00	45,010,900
近鉄グループホールディングス	168,300	3,519.00	592,247,700
阪急阪神ホールディングス	224,500	4,033.00	905,408,500
南海電気鉄道	75,100	2,714.00	203,821,400
京阪ホールディングス	92,800	3,110.00	288,608,000
神戸電鉄	4,600	2,796.00	12,861,600
名古屋鉄道	173,600	2,069.50	359,265,200
山陽電気鉄道	12,700	2,062.00	26,187,400
アルプス物流	13,400	5,660.00	75,844,000
ヤマトホールディングス	204,600	1,753.00	358,663,800
山九	42,800	5,511.00	235,870,800
丸運	3,300	278.00	917,400
丸全昭和運輸	10,400	4,775.00	49,660,000
センコーグループホールディングス	89,100	1,154.00	102,821,400
トナミホールディングス	3,700	4,740.00	17,538,000
ニッコンホールディングス	53,600	3,049.00	163,426,400
日本石油輸送	600	2,839.00	1,703,400
福山通運	19,200	3,705.00	71,136,000
セイノーホールディングス	94,700	2,092.50	198,159,750
エスライングループ本社	1,600	1,536.00	2,457,600
神奈川中央交通	4,800	3,025.00	14,520,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	43,000	1,160.00	49,880,000
C & F ロジホールディングス	16,200	4,500.00	72,900,000
九州旅客鉄道	119,000	3,302.00	392,938,000
S Gホールディングス	282,700	1,600.00	452,320,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	57,100	7,564.00	431,904,400
日本郵船	482,700	4,977.00	2,402,397,900
商船三井	365,700	5,121.00	1,872,749,700

川崎汽船	405,900	2,288.00	928,699,200
N S ユナイテッド海運	9,200	4,965.00	45,678,000
飯野海運	62,300	1,269.00	79,058,700
共栄タンカー	1,700	1,170.00	1,989,000
乾汽船	20,400	1,077.00	21,970,800
日本航空	413,500	2,715.50	1,122,859,250
A N A ホールディングス	458,100	3,035.00	1,390,333,500
パスコ	1,100	1,898.00	2,087,800
トランコム	4,900	6,030.00	29,547,000
日新	12,800	4,775.00	61,120,000
三菱倉庫	41,300	5,116.00	211,290,800
三井倉庫ホールディングス	15,700	4,275.00	67,117,500
住友倉庫	45,200	2,507.00	113,316,400
澁澤倉庫	7,700	3,090.00	23,793,000
東陽倉庫	1,500	1,484.00	2,226,000
日本トランスシティ	33,900	876.00	29,696,400
ケイヒン	1,000	2,065.00	2,065,000
中央倉庫	9,000	1,158.00	10,422,000
川西倉庫	1,000	1,147.00	1,147,000
安田倉庫	11,500	1,474.00	16,951,000
ファイズホールディングス	800	1,005.00	804,000
東洋埠頭	1,600	1,353.00	2,164,800
上組	77,700	3,164.00	245,842,800
サンリツ	1,400	926.00	1,296,400
キムラユニティー	2,700	1,762.00	4,757,400
キューソー流通システム	8,600	1,175.00	10,105,000
東海運	3,300	289.00	953,700
エーアイティー	10,600	1,802.00	19,101,200
内外トランスライン	6,700	2,500.00	16,750,000
日本コンセプト	6,100	1,816.00	11,077,600
N E C ネットズエスアイ	65,900	2,350.00	154,865,000
クロスキャット	10,700	1,372.00	14,680,400
システナ	255,900	284.00	72,675,600
デジタルアーツ	10,700	3,835.00	41,034,500
日鉄ソリューションズ	28,900	4,925.00	142,332,500
キューブシステム	9,000	1,094.00	9,846,000
コア	7,500	1,882.00	14,115,000
手間いらず	2,900	3,125.00	9,062,500
ラクーンホールディングス	12,600	672.00	8,467,200
ソリトンシステムズ	8,700	1,186.00	10,318,200
ソフトクリエイトホールディングス	13,900	1,950.00	27,105,000
T I S	178,800	2,984.00	533,539,200

テクミラホールディングス	2,600	391.00	1,016,600
グリー	56,700	500.00	28,350,000
GMOペパボ	2,100	1,379.00	2,895,900
コーエーテクモホールディングス	106,000	1,418.00	150,308,000
三菱総合研究所	8,300	4,760.00	39,508,000
電算	700	1,489.00	1,042,300
AGS	2,300	1,025.00	2,357,500
ファインデックス	13,400	997.00	13,359,800
ブレインパッド	14,100	1,255.00	17,695,500
KLab	31,100	246.00	7,650,600
ポルトゥウィンホールディングス	28,900	481.00	13,900,900
ネクソン	371,000	2,643.50	980,738,500
アイスタイル	56,500	478.00	27,007,000
エムアップホールディングス	20,700	1,182.00	24,467,400
エイチーム	11,300	673.00	7,604,900
エニグモ	21,600	355.00	7,668,000
テクノスジャパン	5,000	644.00	3,220,000
コロプラ	65,300	589.00	38,461,700
ブロードリーフ	80,300	514.00	41,274,200
クロス・マーケティンググループ	2,700	484.00	1,306,800
デジタルハーツホールディングス	10,600	1,019.00	10,801,400
メディアドゥ	7,600	1,425.00	10,830,000
じげん	49,300	651.00	32,094,300
ブイキューブ	20,300	260.00	5,278,000
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	618.00	803,400
サイバーリンクス	2,200	724.00	1,592,800
フィックスターズ	19,000	2,008.00	38,152,000
CARTA HOLDINGS	8,000	1,694.00	13,552,000
オブティム	17,400	800.00	13,920,000
セレス	6,800	2,100.00	14,280,000
SHIFT	11,200	18,435.00	206,472,000
ティーガイア	17,700	1,964.00	34,762,800
セック	2,300	4,610.00	10,603,000
テクマトリックス	30,900	1,747.00	53,982,300
プロシップ	8,100	1,424.00	11,534,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,000	2,556.00	112,464,000
GMOペイメントゲートウェイ	38,600	7,928.00	306,020,800
ザッパラス	1,300	418.00	543,400
システムリサーチ	11,600	1,567.00	18,177,200
インターネットイニシアティブ	80,800	2,458.00	198,606,400
さくらインターネット	19,000	5,660.00	107,540,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	2,964.00	15,412,800



S R Aホールディングス	8,700	4,070.00	35,409,000
システムインテグレータ	1,700	365.00	620,500
朝日ネット	18,200	644.00	11,720,800
e B A S E	23,800	703.00	16,731,400
アバントグループ	21,400	1,338.00	28,633,200
アドソル日進	7,100	1,615.00	11,466,500
O D Kソリューションズ	1,100	609.00	669,900
フリービット	7,400	1,486.00	10,996,400
コムチュア	24,400	1,898.00	46,311,200
アステリア	13,300	575.00	7,647,500
アイル	9,500	2,788.00	26,486,000
マークラインズ	9,200	3,225.00	29,670,000
メディカル・データ・ビジョン	20,200	485.00	9,797,000
g u m i	27,500	380.00	10,450,000
ショーケース	1,300	311.00	404,300
モバイルファクトリー	1,200	684.00	820,800
テラスカイ	7,300	2,065.00	15,074,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,800	1,703.00	14,986,400
P C Iホールディングス	2,300	942.00	2,166,600
アイビーシー	900	480.00	432,000
ネオジャパン	5,700	1,464.00	8,344,800
P R T I M E S	3,400	1,871.00	6,361,400
ラクス	80,000	1,817.50	145,400,000
ランドコンピュータ	2,700	850.00	2,295,000
ダブルスタンダード	5,100	1,818.00	9,271,800
オープンドア	9,900	682.00	6,751,800
アカツキ	8,200	2,112.00	17,318,400
ベネフィットジャパン	400	1,154.00	461,600
U b i c o mホールディングス	5,300	1,225.00	6,492,500
カナミックネットワーク	21,300	490.00	10,437,000
ノムラシステムコーポレーション	6,200	141.00	874,200
チェンジホールディングス	36,800	1,274.00	46,883,200
シンクロ・フード	3,600	542.00	1,951,200
オークネット	6,300	2,524.00	15,901,200
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	799.00	878,900
セグエグループ	5,200	602.00	3,130,400
エイトレッド	900	1,464.00	1,317,600
マクロミル	33,200	795.00	26,394,000
ビーグリー	1,200	1,105.00	1,326,000
オロ	6,100	2,960.00	18,056,000
ユーザーローカル	7,100	2,214.00	15,719,400
テモナ	1,400	227.00	317,800

ニーズウェル	3,100	826.00	2,560,600
マネーフォワード	37,800	5,704.00	215,611,200
サインポスト	2,200	712.00	1,566,400
Sun Asterisk	12,000	922.00	11,064,000
プラスアルファ・コンサルティング	21,300	2,043.00	43,515,900
電算システムホールディングス	7,500	2,567.00	19,252,500
Appier Group	57,900	1,347.00	77,991,300
ビジョナル	19,800	7,930.00	157,014,000
ソルクシーズ	4,600	320.00	1,472,000
フェイス	1,600	434.00	694,400
プロトコーポレーション	18,500	1,345.00	24,882,500
ハイマックス	5,300	1,345.00	7,128,500
野村総合研究所	366,200	4,206.00	1,540,237,200
CEホールディングス	2,700	561.00	1,514,700
日本システム技術	14,100	1,848.00	26,056,800
インテージホールディングス	19,100	1,432.00	27,351,200
東邦システムサイエンス	6,900	1,294.00	8,928,600
ソースネクスト	77,500	206.00	15,965,000
インフォコム	21,700	3,910.00	84,847,000
シンプレクス・ホールディングス	25,700	2,715.00	69,775,500
HEROZ	6,700	1,346.00	9,018,200
ラクスル	40,800	950.00	38,760,000
メルカリ	82,500	1,931.50	159,348,750
I P S	4,900	2,540.00	12,446,000
F I G	6,500	340.00	2,210,000
システムサポート	6,600	1,928.00	12,724,800
イーソル	12,200	914.00	11,150,800
東海ソフト	900	1,429.00	1,286,100
ウイングアーク1st	17,600	2,817.00	49,579,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,700	955.00	5,443,500
サーバーワークス	3,500	3,025.00	10,587,500
東名	600	2,368.00	1,420,800
ヴィッツ	600	788.00	472,800
トビラシステムズ	1,600	789.00	1,262,400
Sansan	55,500	1,570.00	87,135,000
Link-Uグループ	1,100	614.00	675,400
ギフティ	14,800	1,125.00	16,650,000
メドレー	22,700	3,625.00	82,287,500
ベース	5,900	3,125.00	18,437,500
JMDC	28,800	2,927.50	84,312,000
フォーカスシステムズ	11,300	1,167.00	13,187,100
クレスコ	13,900	2,237.00	31,094,300

フジ・メディア・ホールディングス	162,400	1,763.00	286,311,200
オービック	56,500	21,155.00	1,195,257,500
ジャストシステム	24,300	2,755.00	66,946,500
TDCソフト	31,700	1,110.00	35,187,000
LINEヤフー	2,407,800	390.40	940,005,120
トレンドマイクロ	80,000	7,413.00	593,040,000
IDホールディングス	11,400	1,449.00	16,518,600
日本オラクル	32,400	12,250.00	396,900,000
アルファシステムズ	4,400	2,824.00	12,425,600
フューチャー	36,100	1,534.00	55,377,400
CAC Holdings	9,100	1,925.00	17,517,500
SBテクノロジー	7,100	2,945.00	20,909,500
トーセ	1,600	689.00	1,102,400
オービックビジネスコンサルタント	23,800	6,810.00	162,078,000
アイティフォー	21,700	1,304.00	28,296,800
東計電算	4,700	3,630.00	17,061,000
エクスネット	800	1,491.00	1,192,800
大塚商会	167,700	2,915.50	488,929,350
サイボウズ	23,300	1,640.00	38,212,000
電通総研	20,600	5,240.00	107,944,000
ACCESS	17,600	1,572.00	27,667,200
デジタルガレージ	27,000	2,620.00	70,740,000
EMシステムズ	28,200	605.00	17,061,000
ウェザーニューズ	5,200	4,645.00	24,154,000
CIJ	42,200	458.00	19,327,600
ビジネスエンジニアリング	3,500	3,545.00	12,407,500
日本エンタープライズ	5,900	138.00	814,200
WOWOW	12,700	1,045.00	13,271,500
スカラ	15,700	714.00	11,209,800
インテリジェント ウェイブ	3,000	1,089.00	3,267,000
ANYCOLOR	23,900	2,292.00	54,778,800
IMAGICA GROUP	17,000	552.00	9,384,000
ネットワンシステムズ	67,900	2,952.00	200,440,800
システムソフト	59,100	68.00	4,018,800
アルゴグラフィックス	15,500	4,010.00	62,155,000
マーベラス	27,500	648.00	17,820,000
エイベックス	28,800	1,246.00	35,884,800
BIPROGY	55,300	4,019.00	222,250,700
都築電気	8,900	2,224.00	19,793,600
TBSホールディングス	85,000	3,694.00	313,990,000
日本テレビホールディングス	149,700	2,078.50	311,151,450
朝日放送グループホールディングス	15,900	650.00	10,335,000

テレビ朝日ホールディングス	41,100	1,964.00	80,720,400
スカパーJ S A Tホールディングス	131,400	913.00	119,968,200
テレビ東京ホールディングス	12,200	3,075.00	37,515,000
日本BS放送	2,000	891.00	1,782,000
ビジョン	25,500	1,269.00	32,359,500
スマートバリュー	1,600	471.00	753,600
U-NEXT HOLDINGS	19,000	4,520.00	85,880,000
ワイヤレスゲート	2,500	241.00	602,500
日本通信	166,600	189.00	31,487,400
クロップス	700	1,063.00	744,100
日本電信電話	50,303,700	151.80	7,636,101,660
KDDI	1,306,800	4,379.00	5,722,477,200
ソフトバンク	2,699,100	1,926.50	5,199,816,150
光通信	17,000	24,695.00	419,815,000
エムティーアイ	11,600	733.00	8,502,800
GMOインターネットグループ	62,200	2,677.00	166,509,400
ファイバーゲート	9,100	1,276.00	11,611,600
アйдママーケティングコミュニケーション	1,600	230.00	368,000
KADOKAWA	89,400	3,263.00	291,712,200
学研ホールディングス	30,400	984.00	29,913,600
ゼンリン	28,900	870.00	25,143,000
昭文社ホールディングス	2,400	374.00	897,600
インプレスホールディングス	5,700	158.00	900,600
アイネット	10,200	2,401.00	24,490,200
松竹	8,800	9,246.00	81,364,800
東宝	94,100	4,871.00	458,361,100
東映	27,900	3,530.00	98,487,000
NTTデータグループ	442,200	2,339.00	1,034,305,800
ピー・シー・エー	9,700	1,992.00	19,322,400
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	2,100.00	13,860,000
D T S	35,500	4,120.00	146,260,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,300	5,004.00	386,809,200
シーイーシー	21,300	1,773.00	37,764,900
カブコン	302,500	2,729.50	825,673,750
アイ・エス・ビー	8,700	1,396.00	12,145,200
ジャステック	10,400	1,940.00	20,176,000
S C S K	118,300	2,930.50	346,678,150
N S W	7,500	3,075.00	23,062,500
アイネス	13,200	1,654.00	21,832,800
T K C	29,400	3,430.00	100,842,000
富士ソフト	34,000	6,350.00	215,900,000
N S D	60,000	2,869.00	172,140,000

コナミグループ	63,300	11,320.00	716,556,000
福井コンピュータホールディングス	10,400	2,220.00	23,088,000
J B C Cホールディングス	11,200	3,165.00	35,448,000
ミロク情報サービス	15,400	1,809.00	27,858,600
ソフトバンクグループ	834,200	8,312.00	6,933,870,400
リョーサン菱洋ホールディングス	33,600	3,000.00	100,800,000
高千穂交易	6,300	3,695.00	23,278,500
オルパヘルスケアホールディングス	1,000	2,189.00	2,189,000
伊藤忠食品	4,000	7,560.00	30,240,000
エレマテック	16,000	1,916.00	30,656,000
あらた	27,300	3,200.00	87,360,000
トーメンデバイス	2,600	6,890.00	17,914,000
東京エレクトロン デバイス	17,800	4,825.00	85,885,000
円谷フィールズホールディングス	30,600	1,608.00	49,204,800
双日	198,600	4,296.00	853,185,600
アルフレッサ ホールディングス	179,100	2,142.00	383,632,200
横浜冷凍	48,400	1,043.00	50,481,200
ラサ商事	7,900	1,794.00	14,172,600
アルコニックス	23,500	1,418.00	33,323,000
神戸物産	138,000	3,510.00	484,380,000
ハイパー	1,400	302.00	422,800
あい ホールディングス	28,600	2,464.00	70,470,400
ディーブイエックス	1,600	1,004.00	1,606,400
ダイワボウホールディングス	79,000	2,678.00	211,562,000
マクニカホールディングス	42,200	6,413.00	270,628,600
ラクト・ジャパン	7,000	2,694.00	18,858,000
グリムス	7,500	2,213.00	16,597,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,000	1,200.00	32,400,000
八洲電機	14,400	1,506.00	21,686,400
メディアスホールディングス	10,400	840.00	8,736,000
レスター	15,200	2,922.00	44,414,400
ジオリーブグループ	1,400	1,206.00	1,688,400
大光	3,100	639.00	1,980,900
O C H Iホールディングス	1,400	1,480.00	2,072,000
T O K A Iホールディングス	96,900	959.00	92,927,100
黒谷	1,600	771.00	1,233,600
C o m i n i x	1,200	846.00	1,015,200
三洋貿易	20,000	1,573.00	31,460,000
ビューティガレージ	5,600	2,089.00	11,698,400
ウイン・パートナーズ	11,600	1,155.00	13,398,000
ミタチ産業	1,700	1,140.00	1,938,000
シップヘルスケアホールディングス	64,100	2,374.00	152,173,400

明治電機工業	6,600	1,656.00	10,929,600	
デリカフーズホールディングス	2,600	574.00	1,492,400	
スターティアホールディングス	1,600	2,046.00	3,273,600	
コメダホールディングス	43,700	2,618.00	114,406,600	
ピーバンドットコム	800	383.00	306,400	
アセンテック	6,900	558.00	3,850,200	
富士興産	1,700	1,711.00	2,908,700	
協栄産業	600	2,765.00	1,659,000	
フルサト・マルカホールディングス	15,900	2,218.00	35,266,200	
ヤマエグループホールディングス	15,700	2,463.00	38,669,100	
小野建	17,800	1,603.00	28,533,400	
南陽	2,400	1,125.00	2,700,000	
佐島電機	11,200	2,223.00	24,897,600	
エコートレーディング	1,200	1,228.00	1,473,600	
伯東	10,200	5,080.00	51,816,000	
コンドーテック	13,700	1,306.00	17,892,200	
中山福	3,200	362.00	1,158,400	
ナガイレーベン	22,500	2,370.00	53,325,000	
三菱食品	16,500	5,330.00	87,945,000	
松田産業	13,600	2,757.00	37,495,200	
第一興商	69,000	1,713.00	118,197,000	
メディバルホールディングス	181,400	2,256.00	409,238,400	
S P K	7,900	2,042.00	16,131,800	
萩原電気ホールディングス	7,700	3,985.00	30,684,500	
アズワン	55,600	2,429.00	135,052,400	
スズデン	6,200	1,852.00	11,482,400	
尾家産業	1,400	1,956.00	2,738,400	
シモジマ	11,900	1,294.00	15,398,600	
ドウシシャ	16,500	2,124.00	35,046,000	
小津産業	1,300	1,800.00	2,340,000	
高速	10,600	2,203.00	23,351,800	
たけびし	6,800	2,071.00	14,082,800	
リックス	3,900	3,255.00	12,694,500	
丸文	15,900	1,220.00	19,398,000	
ハピネット	15,200	3,285.00	49,932,000	
橋本総業ホールディングス	7,100	1,270.00	9,017,000	
日本ライフライン	52,000	1,172.00	60,944,000	
タカショー	15,600	520.00	8,112,000	
I D O M	47,200	1,327.00	62,634,400	
進和	10,900	2,733.00	29,789,700	
エスケイジャパン	1,500	880.00	1,320,000	
ダイトロン	7,000	3,155.00	22,085,000	

シークス	25,400	1,345.00	34,163,000
田中商事	1,700	797.00	1,354,900
オーハシテクニカ	9,400	1,667.00	15,669,800
白銅	5,000	2,884.00	14,420,000
ダイコー通産	600	1,396.00	837,600
伊藤忠商事	1,199,200	7,333.00	8,793,733,600
丸紅	1,479,800	3,057.00	4,523,748,600
高島	4,000	1,082.00	4,328,000
長瀬産業	81,800	3,081.00	252,025,800
蝶理	11,200	3,590.00	40,208,000
豊田通商	156,300	9,632.00	1,505,481,600
三共生興	24,700	767.00	18,944,900
兼松	74,600	2,650.00	197,690,000
ツカモトコーポレーション	800	1,190.00	952,000
三井物産	1,336,300	8,180.00	10,930,934,000
日本紙パルプ商事	8,500	6,160.00	52,360,000
カメイ	19,000	2,054.00	39,026,000
東都水産	500	6,230.00	3,115,000
OUGホールディングス	900	2,610.00	2,349,000
スターゼン	12,300	2,785.00	34,255,500
山善	54,100	1,363.00	73,738,300
椿本興業	11,100	2,274.00	25,241,400
住友商事	1,079,700	4,170.00	4,502,349,000
内田洋行	7,200	7,090.00	51,048,000
三菱商事	3,425,600	3,408.00	11,674,444,800
第一実業	16,800	2,282.00	38,337,600
キャノンマーケティングジャパン	41,300	4,488.00	185,354,400
西華産業	7,000	3,900.00	27,300,000
佐藤商事	12,400	1,677.00	20,794,800
東京産業	16,300	653.00	10,643,900
ユアサ商事	13,900	5,610.00	77,979,000
神鋼商事	4,500	7,010.00	31,545,000
トルク	4,300	243.00	1,044,900
阪和興業	32,000	6,350.00	203,200,000
正栄食品工業	11,900	4,330.00	51,527,000
カナデン	13,400	1,575.00	21,105,000
R Y O D E N	14,400	2,534.00	36,489,600
岩谷産業	40,600	9,286.00	377,011,600
ナイス	1,800	1,880.00	3,384,000
ニチモウ	1,900	2,067.00	3,927,300
極東貿易	10,700	1,768.00	18,917,600
アステナホールディングス	33,600	493.00	16,564,800

三愛オブリ	41,600	2,103.00	87,484,800
稲畑産業	35,300	3,300.00	116,490,000
G S I クレオス	9,600	2,231.00	21,417,600
明和産業	21,100	714.00	15,065,400
クワザワホールディングス	2,100	930.00	1,953,000
ワキタ	29,500	1,546.00	45,607,000
東邦ホールディングス	49,100	3,733.00	183,290,300
サンゲツ	41,100	3,095.00	127,204,500
ミツウロコグループホールディングス	22,800	1,248.00	28,454,400
シナネンホールディングス	4,900	4,735.00	23,201,500
伊藤忠エネクス	44,200	1,541.00	68,112,200
サンリオ	144,900	2,502.50	362,612,250
サンワテクノス	9,100	2,275.00	20,702,500
新光商事	24,000	914.00	21,936,000
トーヨー	7,000	3,125.00	21,875,000
三信電気	7,200	2,149.00	15,472,800
東陽テクニカ	18,000	1,510.00	27,180,000
モスフードサービス	26,200	3,420.00	89,604,000
加賀電子	16,300	5,880.00	95,844,000
ソーダニッカ	15,800	1,092.00	17,253,600
立花エレテック	11,800	2,914.00	34,385,200
フォーバル	7,000	1,432.00	10,024,000
P A L T A C	24,000	4,313.00	103,512,000
三谷産業	31,200	361.00	11,263,200
西本Wismettacホールディングス	4,500	4,355.00	19,597,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	500	2,750.00	1,375,000
コア商事ホールディングス	12,500	883.00	11,037,500
K P P グループホールディングス	46,200	815.00	37,653,000
ヤマタネ	7,900	2,750.00	21,725,000
丸紅建材リース	500	3,225.00	1,612,500
泉州電業	11,100	5,900.00	65,490,000
トラスコ中山	37,500	2,578.00	96,675,000
オートバックスセブン	62,100	1,520.00	94,392,000
モリト	12,800	1,533.00	19,622,400
加藤産業	22,100	4,135.00	91,383,500
北恵	1,500	857.00	1,285,500
イエローハット	28,300	2,041.00	57,760,300
J K ホールディングス	13,700	1,055.00	14,453,500
日伝	12,000	2,890.00	34,680,000
北沢産業	3,600	366.00	1,317,600
杉本商事	8,600	2,470.00	21,242,000
因幡電機産業	46,300	3,735.00	172,930,500



東テク	17,900	2,857.00	51,140,300
ミスミグループ本社	269,400	2,758.00	743,005,200
アルテック	3,200	287.00	918,400
タキヒヨー	1,400	1,195.00	1,673,000
蔵王産業	1,100	2,538.00	2,791,800
スズケン	63,700	4,657.00	296,650,900
ジェコス	10,700	1,003.00	10,732,100
サンエー	13,700	4,680.00	64,116,000
カワチ薬品	14,100	2,795.00	39,409,500
エービーシー・マート	78,200	3,087.00	241,403,400
ハードオフコーポレーション	7,300	2,003.00	14,621,900
アスクル	43,200	2,263.00	97,761,600
ゲオホールディングス	20,200	1,803.00	36,420,600
アダストリア	21,600	3,590.00	77,544,000
くら寿司	21,000	4,975.00	104,475,000
キャンドウ	6,500	2,855.00	18,557,500
I Kホールディングス	3,000	437.00	1,311,000
パルグループホールディングス	35,200	1,866.00	65,683,200
エディオン	70,900	1,544.00	109,469,600
サーラコーポレーション	37,900	824.00	31,229,600
ワッツ	3,000	685.00	2,055,000
ハローズ	8,200	4,235.00	34,727,000
あみやき亭	4,400	5,880.00	25,872,000
大黒天物産	5,500	8,430.00	46,365,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,698.00	27,168,000
ファーマライズホールディングス	1,900	657.00	1,248,300
アルペン	14,900	1,990.00	29,651,000
ハブ	2,400	827.00	1,984,800
クオールホールディングス	24,700	1,532.00	37,840,400
ジーンズホールディングス	13,700	3,640.00	49,868,000
ビックカメラ	107,000	1,480.00	158,360,000
D C Mホールディングス	94,500	1,447.00	136,741,500
Monotaro	253,100	1,668.50	422,297,350
東京一番フーズ	2,400	513.00	1,231,200
きちりホールディングス	1,700	937.00	1,592,900
J.フロント リテイリング	205,000	1,456.50	298,582,500
ドトール・日レスホールディングス	31,800	2,111.00	67,129,800
マツキヨココカラ&カンパニー	324,700	2,343.50	760,934,450
ブロンコビリー	10,600	3,950.00	41,870,000
Z O Z O	113,800	3,596.00	409,224,800
トレジャー・ファクトリー	11,300	1,639.00	18,520,700
物語コーポレーション	29,900	3,680.00	110,032,000

三越伊勢丹ホールディングス	300,800	2,877.50	865,552,000
H a m e e	7,500	1,276.00	9,570,000
マーケットエンタープライズ	1,000	862.00	862,000
ウエルシアホールディングス	92,700	2,290.00	212,283,000
クリエイティブSDホールディングス	25,400	3,395.00	86,233,000
丸善CHIホールディングス	8,000	333.00	2,664,000
ミサワ	1,800	619.00	1,114,200
ティーライフ	1,100	1,404.00	1,544,400
チムニー	1,800	1,304.00	2,347,200
シュッピン	16,400	1,263.00	20,713,200
オイシックス・ラ・大地	24,300	1,257.00	30,545,100
ネクステージ	40,900	2,931.00	119,877,900
ジョイフル本田	52,100	2,114.00	110,139,400
エターナルホスピタリティグループ	6,700	3,970.00	26,599,000
ホットランド	13,800	2,318.00	31,988,400
すかいらーくホールディングス	244,000	2,208.00	538,752,000
SFPホールディングス	8,600	2,070.00	17,802,000
綿半ホールディングス	14,100	1,558.00	21,967,800
ヨシックスホールディングス	4,200	2,857.00	11,999,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,200	888.00	44,577,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	530.00	4,611,000
B E E N O S	10,800	2,184.00	23,587,200
あさひ	16,800	1,370.00	23,016,000
日本調剤	12,000	1,436.00	17,232,000
コスモス薬品	15,200	13,990.00	212,648,000
トーエル	3,100	809.00	2,507,900
セブン&アイ・ホールディングス	1,826,500	2,037.00	3,720,580,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	120,800	1,090.00	131,672,000
ツルハホールディングス	37,500	9,564.00	358,650,000
サンマルクホールディングス	14,500	2,098.00	30,421,000
フェリシモ	1,700	910.00	1,547,000
トリドールホールディングス	50,100	3,735.00	187,123,500
T O K Y O B A S E	21,500	306.00	6,579,000
ウイルプラスホールディングス	1,500	1,022.00	1,533,000
J Mホールディングス	13,600	2,670.00	36,312,000
サツドラホールディングス	2,800	880.00	2,464,000
アレンザホールディングス	13,700	1,095.00	15,001,500
串カツ田中ホールディングス	5,000	1,642.00	8,210,000
パロックジャパンリミテッド	14,300	780.00	11,154,000
クスリのアオキホールディングス	53,800	3,146.00	169,254,800
力の源ホールディングス	10,300	1,480.00	15,244,000

FOOD & LIFE COMPANIES	95,300	3,020.00	287,806,000	
メディカルシステムネットワーク	19,900	636.00	12,656,400	
はるやまホールディングス	3,400	597.00	2,029,800	
ノジマ	52,000	1,726.00	89,752,000	
カップ・クリエイト	28,000	1,631.00	45,668,000	
ライトオン	4,500	387.00	1,741,500	
良品計画	212,600	2,360.00	501,736,000	
パリミキホールディングス	8,300	359.00	2,979,700	
アドヴァングループ	16,900	1,032.00	17,440,800	
アルビス	6,000	2,621.00	15,726,000	
コナカ	7,000	323.00	2,261,000	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,591.00	1,591,000	
G - 7ホールディングス	19,700	1,507.00	29,687,900	
イオン北海道	52,900	946.00	50,043,400	
コジマ	34,800	850.00	29,580,000	
ヒマラヤ	2,500	914.00	2,285,000	
コーナン商事	21,900	4,410.00	96,579,000	
エコス	6,800	2,357.00	16,027,600	
ワタミ	18,800	916.00	17,220,800	
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	360,300	3,829.00	1,379,588,700	
西松屋チェーン	35,300	2,265.00	79,954,500	
ゼンショーホールディングス	90,900	6,418.00	583,396,200	
幸楽苑ホールディングス	13,200	1,255.00	16,566,000	
ハークスレイ	2,200	800.00	1,760,000	
サイゼリヤ	26,400	5,490.00	144,936,000	
V Tホールディングス	69,700	496.00	34,571,200	
魚力	6,400	2,374.00	15,193,600	
フジ・コーポレーション	8,700	1,829.00	15,912,300	
ユナイテッドアローズ	21,200	1,756.00	37,227,200	
ハイデイ日高	26,600	2,859.00	76,049,400	
YU - WA Creation Holdings	5,700	143.00	815,100	
コロワイド	76,700	2,001.50	153,515,050	
壱番屋	70,800	1,094.00	77,455,200	
PLANT	1,500	1,758.00	2,637,000	
スギホールディングス	108,000	2,408.00	260,064,000	
薬王堂ホールディングス	8,800	2,866.00	25,220,800	
スクロール	26,900	1,007.00	27,088,300	
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,887.00	32,267,700	
木曽路	27,100	2,479.00	67,180,900	
SRSホールディングス	29,700	1,172.00	34,808,400	

千趣会	32,800	317.00	10,397,600
リテールパートナーズ	26,700	1,682.00	44,909,400
上新電機	17,800	2,574.00	45,817,200
日本瓦斯	94,700	2,493.00	236,087,100
ロイヤルホールディングス	31,400	2,582.00	81,074,800
いなげや	17,400	1,253.00	21,802,200
チヨダ	17,400	908.00	15,799,200
ライフコーポレーション	18,700	3,975.00	74,332,500
リンガーハット	23,000	2,290.00	52,670,000
MrMaxHD	23,000	650.00	14,950,000
AOKIホールディングス	38,500	1,285.00	49,472,500
オークワ	25,800	937.00	24,174,600
コメリ	27,500	3,660.00	100,650,000
青山商事	38,400	1,531.00	58,790,400
しまむら	41,900	7,597.00	318,314,300
はせがわ	3,800	341.00	1,295,800
高島屋	123,300	2,403.00	296,289,900
松屋	30,400	969.00	29,457,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,000	2,086.00	164,794,000
近鉄百貨店	7,800	2,092.00	16,317,600
丸井グループ	118,500	2,374.00	281,319,000
アクシアル リテイリング	49,000	993.00	48,657,000
イオン	604,800	3,323.00	2,009,750,400
イズミ	31,700	3,392.00	107,526,400
平和堂	29,900	2,356.00	70,444,400
フジ	27,400	1,907.00	52,251,800
ヤオコー	21,100	8,810.00	185,891,000
ゼビオホールディングス	24,500	950.00	23,275,000
ケースホールディングス	120,100	1,430.50	171,803,050
Olympicグループ	3,300	511.00	1,686,300
日産東京販売ホールディングス	9,400	525.00	4,935,000
シルバーライフ	5,200	942.00	4,898,400
Genky DrugStores	7,900	5,680.00	44,872,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,200	1,304.00	1,564,800
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,642.00	19,539,800
ギフトホールディングス	7,700	2,860.00	22,022,000
アインホールディングス	24,600	5,903.00	145,213,800
元気寿司	10,200	3,305.00	33,711,000
ヤマダホールディングス	549,500	431.10	236,889,450
アークランズ	53,300	1,879.00	100,150,700
ニトリホールディングス	65,000	18,265.00	1,187,225,000
グルメ杵屋	14,800	1,094.00	16,191,200

愛眼	4,400	185.00	814,000	
ケーユーホールディングス	8,700	1,192.00	10,370,400	
吉野家ホールディングス	65,800	2,895.00	190,491,000	
松屋フーズホールディングス	8,500	5,180.00	44,030,000	
サガミホールディングス	27,000	1,530.00	41,310,000	
関西フードマーケット	12,300	2,179.00	26,801,700	
王将フードサービス	13,300	8,120.00	107,996,000	
ミニストップ	13,000	1,564.00	20,332,000	
アークス	32,800	2,896.00	94,988,800	
パローホールディングス	34,200	2,316.00	79,207,200	
ベルク	8,900	7,470.00	66,483,000	
大庄	9,800	1,214.00	11,897,200	
ファーストリテイリング	100,300	41,360.00	4,148,408,000	
サンドラッグ	60,300	4,055.00	244,516,500	
サックスパー ホールディングス	15,500	796.00	12,338,000	
ヤマザワ	1,500	1,260.00	1,890,000	
やまや	1,300	3,110.00	4,043,000	
ベルーナ	43,500	699.00	30,406,500	
いよぎんホールディングス	197,600	1,363.50	269,427,600	
しずおかフィナンシャルグループ	369,000	1,550.50	572,134,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	139,800	1,586.50	221,792,700	
楽天銀行	77,000	2,900.00	223,300,000	
京都フィナンシャルグループ	210,400	2,640.00	555,456,000	
島根銀行	1,600	558.00	892,800	
じもとホールディングス	4,900	421.00	2,062,900	
めぶきフィナンシャルグループ	769,600	604.10	464,915,360	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,300	4,450.00	94,785,000	
九州フィナンシャルグループ	321,400	973.30	312,818,620	
ゆうちょ銀行	1,824,900	1,544.00	2,817,645,600	
富山第一銀行	52,700	1,122.00	59,129,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	891,100	931.70	830,237,870	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,200	2,057.00	191,712,400	
三十三フィナンシャルグループ	14,900	2,072.00	30,872,800	
第四北越フィナンシャルグループ	26,100	4,860.00	126,846,000	
ひろぎんホールディングス	236,400	1,172.50	277,179,000	
おきなわフィナンシャルグループ	14,200	2,628.00	37,317,600	
十六フィナンシャルグループ	21,500	4,710.00	101,265,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,500	5,540.00	96,950,000	
プロクレアホールディングス	19,000	1,802.00	34,238,000	
あいちフィナンシャルグループ	34,100	2,691.00	91,763,100	
あおぞら銀行	119,300	2,390.00	285,127,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,113,500	1,563.00	15,807,400,500	

りそなホールディングス	1,920,600	1,023.00	1,964,773,800
三井住友トラスト・ホールディングス	596,300	3,653.00	2,178,283,900
三井住友フィナンシャルグループ	1,180,700	9,869.00	11,652,328,300
千葉銀行	462,800	1,368.50	633,341,800
群馬銀行	322,300	1,039.50	335,030,850
武蔵野銀行	23,200	3,175.00	73,660,000
千葉興業銀行	35,300	995.00	35,123,500
筑波銀行	72,900	312.00	22,744,800
七十七銀行	48,300	4,720.00	227,976,000
秋田銀行	11,100	2,324.00	25,796,400
山形銀行	18,400	1,126.00	20,718,400
岩手銀行	10,500	2,630.00	27,615,000
東邦銀行	131,400	375.00	49,275,000
東北銀行	2,700	1,201.00	3,242,700
ふくおかフィナンシャルグループ	144,600	4,255.00	615,273,000
スルガ銀行	146,400	982.00	143,764,800
八十二銀行	356,400	1,048.00	373,507,200
山梨中央銀行	18,600	1,959.00	36,437,400
大垣共立銀行	31,700	2,142.00	67,901,400
福井銀行	14,800	1,929.00	28,549,200
清水銀行	6,600	1,577.00	10,408,200
富山銀行	900	1,844.00	1,659,600
滋賀銀行	27,600	4,145.00	114,402,000
南都銀行	25,000	3,365.00	84,125,000
百五銀行	156,200	643.00	100,436,600
紀陽銀行	59,400	1,910.00	113,454,000
ほくほくフィナンシャルグループ	102,800	2,137.50	219,735,000
山陰合同銀行	103,900	1,448.00	150,447,200
鳥取銀行	1,900	1,380.00	2,622,000
百十四銀行	16,300	3,255.00	53,056,500
四国銀行	24,300	1,106.00	26,875,800
阿波銀行	23,300	2,838.00	66,125,400
大分銀行	10,000	3,435.00	34,350,000
宮崎銀行	10,000	3,250.00	32,500,000
佐賀銀行	9,700	2,515.00	24,395,500
琉球銀行	35,300	1,291.00	45,572,300
セブン銀行	520,500	267.70	139,337,850
みずほフィナンシャルグループ	2,241,600	3,232.00	7,244,851,200
高知銀行	1,900	895.00	1,700,500
山口フィナンシャルグループ	162,800	1,779.50	289,702,600
名古屋銀行	10,600	7,550.00	80,030,000
北洋銀行	251,600	568.00	142,908,800

大光銀行	1,800	1,537.00	2,766,600
愛媛銀行	22,400	1,178.00	26,387,200
トマト銀行	2,000	1,204.00	2,408,000
京葉銀行	68,400	806.00	55,130,400
栃木銀行	82,900	387.00	32,082,300
北日本銀行	5,400	2,531.00	13,667,400
東和銀行	30,500	669.00	20,404,500
福島銀行	5,800	275.00	1,595,000
大東銀行	2,400	732.00	1,756,800
トモニホールディングス	157,200	409.00	64,294,800
フィデアホールディングス	17,200	1,603.00	27,571,600
池田泉州ホールディングス	230,300	388.00	89,356,400
F P G	61,800	2,115.00	130,707,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	27,000	1,398.00	37,746,000
マーキュリアホールディングス	2,900	922.00	2,673,800
S B Iホールディングス	266,500	4,005.00	1,067,332,500
ジャフコ グループ	49,500	1,825.00	90,337,500
大和証券グループ本社	1,286,500	1,133.00	1,457,604,500
野村ホールディングス	2,792,800	908.00	2,535,862,400
岡三証券グループ	145,900	772.00	112,634,800
丸三証券	55,300	1,044.00	57,733,200
東洋証券	44,300	382.00	16,922,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,300	584.00	115,223,200
光世証券	1,400	685.00	959,000
水戸証券	49,200	537.00	26,420,400
いちよし証券	31,200	834.00	26,020,800
松井証券	81,800	815.00	66,667,000
マネックスグループ	162,800	822.00	133,821,600
極東証券	22,800	1,587.00	36,183,600
岩井コスモホールディングス	19,000	2,334.00	44,346,000
アイザワ証券グループ	24,000	1,790.00	42,960,000
マネーパートナーズグループ	6,000	269.00	1,614,000
スパークス・グループ	18,500	1,792.00	33,152,000
かんぽ生命保険	169,100	2,878.50	486,754,350
F P パートナー	4,400	4,545.00	19,998,000
S O M P Oホールディングス	749,500	3,132.00	2,347,434,000
アニコム ホールディングス	56,400	577.00	32,542,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	1,115,500	2,767.50	3,087,146,250
第一生命ホールディングス	780,800	3,876.00	3,026,380,800
東京海上ホールディングス	1,621,400	4,967.00	8,053,493,800
T & Dホールディングス	445,900	2,623.50	1,169,818,650
アドバンスクリエイト	10,600	1,023.00	10,843,800

N E X Y Z . G r o u p	2,600	620.00	1,612,000
全国保証	43,500	5,558.00	241,773,000
あんしん保証	4,600	222.00	1,021,200
イントラスト	2,700	823.00	2,222,100
日本モーゲージサービス	4,100	421.00	1,726,100
C a s a	2,700	864.00	2,332,800
S B I アルヒ	16,600	885.00	14,691,000
プレミアグループ	28,300	2,213.00	62,627,900
ネットプロテクションズホールディングス	57,700	190.00	10,963,000
クレディセゾン	105,400	3,310.00	348,874,000
芙蓉総合リース	15,300	12,950.00	198,135,000
みずほリース	139,500	1,100.00	153,450,000
東京センチュリー	124,500	1,534.00	190,983,000
日本証券金融	61,400	1,677.00	102,967,800
アイフル	245,700	408.00	100,245,600
リコーリース	15,900	5,190.00	82,521,000
イオンフィナンシャルサービス	95,800	1,322.50	126,695,500
アコム	297,700	398.50	118,633,450
ジャックス	17,800	5,060.00	90,068,000
オリエントコーポレーション	54,700	1,037.00	56,723,900
オリックス	996,100	3,422.00	3,408,654,200
三菱HCキャピタル	740,500	1,045.00	773,822,500
九州リースサービス	2,600	1,187.00	3,086,200
日本取引所グループ	428,300	3,666.00	1,570,147,800
イー・ギャランティ	27,400	1,451.00	39,757,400
アサックス	3,100	848.00	2,628,800
N E C キャピタルソリューション	8,300	3,910.00	32,453,000
r o b o t h o m e	49,800	175.00	8,715,000
大東建託	60,900	16,665.00	1,014,898,500
いちご	192,500	413.00	79,502,500
日本駐車場開発	200,500	199.00	39,899,500
スター・マイカ・ホールディングス	20,200	638.00	12,887,600
S R E ホールディングス	7,300	4,050.00	29,565,000
A D ワークスグループ	14,000	241.00	3,374,000
ヒューリック	387,700	1,535.50	595,313,350
野村不動産ホールディングス	92,600	4,202.00	389,105,200
三重交通グループホールディングス	36,500	571.00	20,841,500
サムティ	26,600	2,672.00	71,075,200
ディア・ライフ	28,800	897.00	25,833,600
地主	12,900	2,529.00	32,624,100
プレサンスコーポレーション	26,600	1,749.00	46,523,400
ハウスコム	1,500	969.00	1,453,500



J P M C	10,000	1,199.00	11,990,000
サンセイランディック	2,100	1,012.00	2,125,200
フージャースホールディングス	25,600	1,107.00	28,339,200
オープンハウスグループ	61,000	4,621.00	281,881,000
東急不動産ホールディングス	499,800	1,110.00	554,778,000
飯田グループホールディングス	159,400	2,086.00	332,508,400
イーランド	1,200	1,552.00	1,862,400
ムゲンエステート	4,100	1,190.00	4,879,000
A n d D oホールディングス	10,000	1,195.00	11,950,000
シーアールイー	9,700	1,394.00	13,521,800
ケイアイスター不動産	8,100	3,235.00	26,203,500
グッドコムアセット	16,100	828.00	13,330,800
ジェイ・エス・ビー	8,500	2,828.00	24,038,000
ロードスターキャピタル	11,000	3,490.00	38,390,000
テンポイノベーション	2,300	866.00	1,991,800
フェイスネットワーク	1,900	1,873.00	3,558,700
霞ヶ関キャピタル	6,800	18,910.00	128,588,000
パーク24	108,200	1,729.00	187,077,800
パラカ	6,200	1,944.00	12,052,800
三井不動産	2,304,300	1,490.00	3,433,407,000
三菱地所	1,085,700	2,761.50	2,998,160,550
平和不動産	27,100	3,910.00	105,961,000
東京建物	145,300	2,613.00	379,668,900
京阪神ビルディング	31,400	1,552.00	48,732,800
住友不動産	240,300	5,206.00	1,251,001,800
テーオーシー	30,300	699.00	21,179,700
レオパレス21	166,200	551.00	91,576,200
スターツコーポレーション	24,000	3,420.00	82,080,000
フジ住宅	21,700	771.00	16,730,700
空港施設	24,300	604.00	14,677,200
明和地所	11,200	945.00	10,584,000
ゴールドクレスト	13,700	2,474.00	33,893,800
エスリード	8,000	4,095.00	32,760,000
日神グループホールディングス	27,700	537.00	14,874,900
日本エスコン	31,100	1,084.00	33,712,400
M I R A R T Hホールディングス	76,300	584.00	44,559,200
A V A N T I A	3,700	836.00	3,093,200
イオンモール	86,400	1,839.00	158,889,600
毎日コムネット	2,700	811.00	2,189,700
ファースト住建	2,700	1,059.00	2,859,300
カチタス	44,900	1,731.00	77,721,900
トーセイ	27,900	2,373.00	66,206,700

穴吹興産	1,600	2,223.00	3,556,800
サンフロンティア不動産	24,900	2,065.00	51,418,500
FJネクストホールディングス	17,900	1,285.00	23,001,500
インテリックス	1,300	552.00	717,600
ランドビジネス	2,000	253.00	506,000
サンネクスタグループ	2,300	1,024.00	2,355,200
グランディハウス	14,900	593.00	8,835,700
日本空港ビルディング	58,800	5,325.00	313,110,000
明豊ファシリティワークス	3,200	913.00	2,921,600
LIFULL	60,600	169.00	10,241,400
MIXI	37,300	2,730.00	101,829,000
ジェイエイシーリクルートメント	63,000	694.00	43,722,000
日本M&Aセンターホールディングス	276,500	768.80	212,573,200
メンバーズ	6,200	885.00	5,487,000
中広	1,500	490.00	735,000
UTグループ	22,600	3,205.00	72,433,000
アイティメディア	6,800	1,813.00	12,328,400
ケアネット	35,900	531.00	19,062,900
E・Jホールディングス	10,300	1,852.00	19,075,600
オープンアップグループ	52,200	2,046.00	106,801,200
コシダカホールディングス	52,200	864.00	45,100,800
アルトナー	2,500	2,150.00	5,375,000
パソナグループ	21,100	2,284.00	48,192,400
CDS	1,600	1,792.00	2,867,200
リンクアンドモチベーション	49,900	450.00	22,455,000
エス・エム・エス	60,900	2,063.00	125,636,700
サニーサイドアップグループ	2,400	721.00	1,730,400
パーソルホールディングス	1,765,700	236.70	417,941,190
リニカル	4,300	407.00	1,750,100
クックパッド	49,000	183.00	8,967,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,100	768.00	2,380,800
学情	9,000	1,790.00	16,110,000
スタジオアリス	8,800	2,034.00	17,899,200
エプコ	1,900	827.00	1,571,300
NJS	3,900	3,340.00	13,026,000
総合警備保障	289,800	915.90	265,427,820
カカクコム	112,600	1,893.00	213,151,800
アイロムグループ	7,100	2,782.00	19,752,200
セントケア・ホールディング	12,900	847.00	10,926,300
サイネックス	1,300	736.00	956,800
ルネサンス	13,700	964.00	13,206,800
ディップ	26,600	2,746.00	73,043,600

デジタルホールディングス	9,200	1,051.00	9,669,200
新日本科学	15,900	1,360.00	21,624,000
キャリアデザインセンター	1,200	1,710.00	2,052,000
エムスリー	342,700	1,613.00	552,775,100
ツカダ・グローバルホールディング	3,700	484.00	1,790,800
ウェルネット	5,600	599.00	3,354,400
ワールドホールディングス	7,900	2,298.00	18,154,200
ディー・エヌ・エー	61,800	1,463.50	90,444,300
博報堂D Yホールディングス	221,200	1,373.00	303,707,600
ぐるなび	33,100	310.00	10,261,000
タカミヤ	24,000	490.00	11,760,000
ファンコミュニケーションズ	24,900	408.00	10,159,200
ライク	6,600	1,623.00	10,711,800
A o b a - B B T	2,800	346.00	968,800
エスプール	50,600	327.00	16,546,200
W D Bホールディングス	9,000	1,709.00	15,381,000
ティア	4,400	461.00	2,028,400
C D G	800	1,251.00	1,000,800
アドウェイズ	24,500	415.00	10,167,500
バリューコマース	15,400	1,070.00	16,478,000
インフォマート	180,700	314.00	56,739,800
J Pホールディングス	44,900	492.00	22,090,800
エコナックホールディングス	6,900	129.00	890,100
C Lホールディングス	4,300	1,403.00	6,032,900
プレステージ・インターナショナル	81,500	641.00	52,241,500
アミューズ	10,700	1,596.00	17,077,200
ドリームインキュベータ	6,000	2,327.00	13,962,000
クイック	12,200	2,192.00	26,742,400
T A C	4,100	181.00	742,100
電通グループ	170,400	4,174.00	711,249,600
イオンファンタジー	6,300	2,264.00	14,263,200
シーティーエス	22,200	760.00	16,872,000
H . U . グループホールディングス	50,900	2,530.00	128,777,000
アルプス技研	16,500	2,582.00	42,603,000
日本空調サービス	18,900	935.00	17,671,500
オリエンタルランド	917,400	4,687.00	4,299,853,800
ダスキン	38,500	3,414.00	131,439,000
明光ネットワークジャパン	21,400	721.00	15,429,400
ファルコホールディングス	7,800	2,292.00	17,877,600
ラウンドワン	163,700	725.00	118,682,500
リゾートトラスト	75,400	2,510.50	189,291,700
ビー・エム・エル	21,400	2,794.00	59,791,600

リソー教育	89,500	268.00	23,986,000
早稲田アカデミー	9,800	1,526.00	14,954,800
ユー・エス・エス	389,100	1,268.00	493,378,800
東京個別指導学院	21,200	411.00	8,713,200
サイバーエージェント	383,300	1,039.50	398,440,350
楽天グループ	1,487,600	815.20	1,212,691,520
クリーク・アンド・リバー社	8,900	1,719.00	15,299,100
SBIグローバルアセットマネジメント	34,300	674.00	23,118,200
テー・オー・ダブリュー	34,600	362.00	12,525,200
山田コンサルティンググループ	7,700	1,965.00	15,130,500
セントラルスポーツ	6,600	2,503.00	16,519,800
フルキャストホールディングス	16,700	1,423.00	23,764,100
エン・ジャパン	28,300	2,734.00	77,372,200
リソルホールディングス	600	5,000.00	3,000,000
テクノプロ・ホールディングス	101,600	2,671.50	271,424,400
アトラグループ	1,700	163.00	277,100
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	1,231.00	11,325,200
Keeper 技研	10,800	3,985.00	43,038,000
ファーストロジック	2,300	503.00	1,156,900
三機サービス	1,200	1,298.00	1,557,600
Gunosy	14,100	744.00	10,490,400
デザインワン・ジャパン	3,600	135.00	486,000
イー・ガーディアン	8,400	1,893.00	15,901,200
リブセンス	3,700	241.00	891,700
ジャパンマテリアル	53,200	2,201.00	117,093,200
ベクトル	21,400	1,355.00	28,997,000
ウチヤマホールディングス	3,200	346.00	1,107,200
チャーム・ケア・コーポレーション	14,600	1,599.00	23,345,400
キャリアリンク	6,500	2,475.00	16,087,500
I B J	13,700	615.00	8,425,500
アサンテ	8,700	1,688.00	14,685,600
バリューHR	15,300	1,324.00	20,257,200
M&Aキャピタルパートナーズ	14,100	2,114.00	29,807,400
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,065.00	7,561,500
E R Iホールディングス	1,700	2,290.00	3,893,000
アビスト	1,000	3,270.00	3,270,000
シグマクシス・ホールディングス	22,900	1,452.00	33,250,800
ウィルグループ	14,700	986.00	14,494,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	141.00	1,212,600
メドピア	15,500	614.00	9,517,000
レアジョブ	1,500	482.00	723,000
リクルートホールディングス	1,248,400	7,818.00	9,759,991,200

エラン	23,200	902.00	20,926,400
土木管理総合試験所	3,400	325.00	1,105,000
日本郵政	2,037,100	1,468.50	2,991,481,350
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,573.00	29,572,400
鎌倉新書	15,200	572.00	8,694,400
S MN	1,800	304.00	547,200
グローバルキッズCOMPANY	1,500	640.00	960,000
エアトリ	12,900	1,374.00	17,724,600
アトラエ	13,700	596.00	8,165,200
ストライク	8,600	4,350.00	37,410,000
ソラスト	48,300	468.00	22,604,400
セラク	5,500	1,070.00	5,885,000
インソース	37,900	1,023.00	38,771,700
ベイカレント・コンサルティング	127,500	3,409.00	434,647,500
Orchestra Holdings	4,000	1,375.00	5,500,000
アイモバイル	22,600	461.00	10,418,600
キャリアインデックス	3,400	182.00	618,800
MS - Japan	7,300	1,073.00	7,832,900
船場	1,400	1,250.00	1,750,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	56,300	2,692.00	151,559,600
フルテック	1,000	1,109.00	1,109,000
GameWith	3,400	293.00	996,200
MS&Consulting	1,200	600.00	720,000
エル・ティー・エス	2,100	2,111.00	4,433,100
ミダックホールディングス	10,700	1,576.00	16,863,200
キュービーネットホールディングス	10,200	1,167.00	11,903,400
RPAホールディングス	24,500	257.00	6,296,500
スプリックス	2,000	778.00	1,556,000
マネジメントソリューションズ	7,600	1,893.00	14,386,800
プロレド・パートナーズ	4,800	519.00	2,491,200
テノ・ホールディングス	1,300	425.00	552,500
フロンティア・マネジメント	4,500	1,283.00	5,773,500
コプロ・ホールディングス	2,000	1,531.00	3,062,000
ギークス	1,300	476.00	618,800
アンビスホールディングス	37,200	2,150.00	79,980,000
カーブスホールディングス	47,700	765.00	36,490,500
フォーラムエンジニアリング	23,900	914.00	21,844,600
Fast Fitness Japan	6,100	1,197.00	7,301,700
ダイレクトマーケティングミックス	18,900	263.00	4,970,700
ポピンズ	2,800	1,344.00	3,763,200
LITALICO	13,600	1,930.00	26,248,000
コンフィデンス・インターワークス	700	1,839.00	1,287,300

アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	469.00	1,688,400	
リログループ	87,000	1,646.00	143,202,000	
東祥	12,400	719.00	8,915,600	
I D & Eホールディングス	10,500	4,330.00	45,465,000	
ビーウィズ	3,700	1,990.00	7,363,000	
T R Eホールディングス	33,400	1,204.00	40,213,600	
人・夢・技術グループ	7,100	1,707.00	12,119,700	
N I S S Oホールディングス	15,300	841.00	12,867,300	
大栄環境	31,600	2,531.00	79,979,600	
日本管財ホールディングス	18,300	2,539.00	46,463,700	
M & A総研ホールディングス	18,500	4,505.00	83,342,500	
エイチ・アイ・エス	50,500	1,745.00	88,122,500	
ラックランド	8,000	1,835.00	14,680,000	
共立メンテナンス	54,500	3,210.00	174,945,000	
イチネンホールディングス	18,500	1,645.00	30,432,500	
建設技術研究所	9,000	5,090.00	45,810,000	
スペース	11,600	1,074.00	12,458,400	
燦ホールディングス	16,500	1,167.00	19,255,500	
スバル興業	5,800	2,807.00	16,280,600	
東京テアトル	2,100	1,117.00	2,345,700	
タナベコンサルティンググループ	6,500	1,024.00	6,656,000	
ナガワ	5,400	7,510.00	40,554,000	
東京都競馬	14,600	4,265.00	62,269,000	
カナモト	27,000	2,680.00	72,360,000	
ニシオホールディングス	16,100	3,970.00	63,917,000	
トランス・コスモス	21,600	3,150.00	68,040,000	
乃村工藝社	75,900	835.00	63,376,500	
藤田観光	6,900	6,600.00	45,540,000	
K N T - C Tホールディングス	10,300	1,304.00	13,431,200	
トーカイ	15,500	2,054.00	31,837,000	
セコム	176,600	10,000.00	1,766,000,000	
セントラル警備保障	9,400	2,902.00	27,278,800	
丹青社	33,900	852.00	28,882,800	
メイテックグループホールディングス	62,200	3,189.00	198,355,800	
応用地質	16,300	2,572.00	41,923,600	
船井総研ホールディングス	34,800	2,307.00	80,283,600	
進学会ホールディングス	2,500	238.00	595,000	
オオバ	4,100	1,101.00	4,514,100	
いであ	1,700	2,415.00	4,105,500	
学究社	7,000	2,134.00	14,938,000	
イオンディライト	18,700	3,745.00	70,031,500	
ナック	15,200	533.00	8,101,600	

ダイセキ	35,500	3,215.00	114,132,500	
ステップ	6,400	1,975.00	12,640,000	
合 計	270,779,600		659,051,095,450	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル・インカム&amp;プラス（毎月決算型）】

## 【純資産額計算書】

（2024年 6月28日現在）

資産総額	2,545,789,481円
負債総額	1,844,094円
純資産総額（ - ）	2,543,945,387円
発行済口数	2,346,433,109口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0842円
（1万口当たり純資産額）	（10,842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

（2024年 6月28日現在）

資産総額	364,125,047,346円
負債総額	201,305,203円
純資産総額（ - ）	363,923,742,143円
発行済口数	97,018,559,945口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7511円
（1万口当たり純資産額）	（37,511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

（2024年 6月28日現在）

資産総額	684,312,560,933円
負債総額	521,125,930円
純資産総額（ - ）	683,791,435,003円
発行済口数	234,158,809,291口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9202円
（1万口当たり純資産額）	（29,202円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について



当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年 6月28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、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

委託会社の機構は2024年 8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。

2024年 6月28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	530	15,316,532
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	214,489
単体型公社債投資信託	52	172,333
合計	644	15,703,355

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。  
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 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。

## (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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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  
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

## (リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8・ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

## 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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（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)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024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)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(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(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)
店頭	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。

当事業年度(2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	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) 株式関連

前事業年度(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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(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（2023年3月31日）

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		1,729	-	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

当事業年度（2024年3月31日）

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		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

### (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券届出書(内国投資信託受益証券)	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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、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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2024年8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（2024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） （2024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	135,000	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	13,195	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	54,323	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（2024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【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月3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**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2024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7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11月21日から2024年5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2024年5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。