

## 【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】	2022年2月18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】	投資業務推進部長 民野 誠
【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】**

2022年 2月19日から2022年 8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。

< 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
<u>追加型</u>	海外	債券	MRF	特殊型
	<u>内外</u>	不動産投信	ETF	
		その他資産 ( )		
		<u>資産複合</u>		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## < 商品分類表定義 >

### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

### [ 投資対象地域による区分 ]

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

### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

### [ 独立した区分 ]

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

### [ 補足分類 ]

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

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

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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



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

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

[ 投資形態による属性区分 ]

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

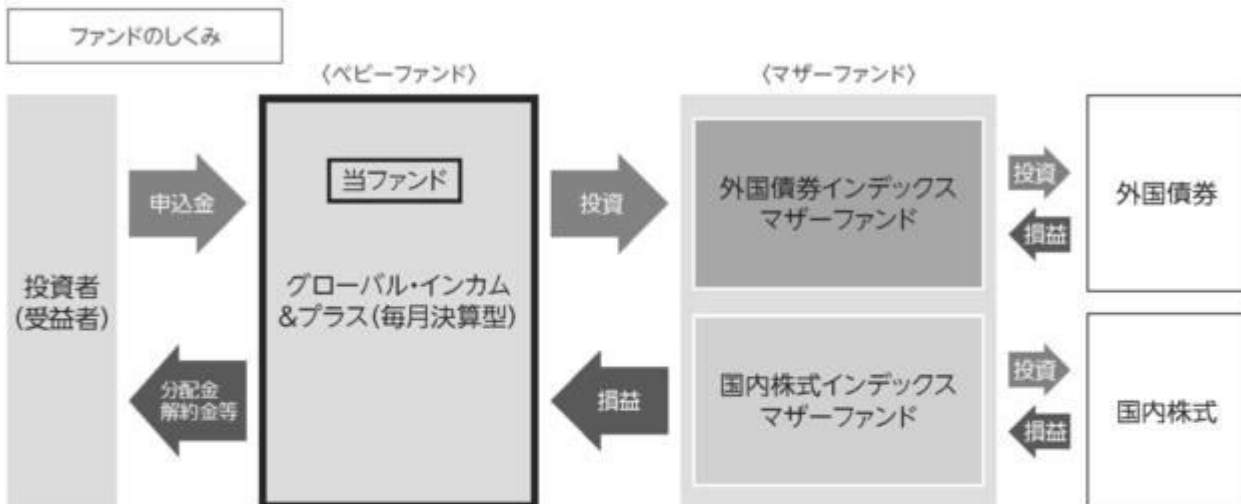
## [ 特殊型 ]

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

## &lt; ファンドの特色 &gt;

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



### ? ファミリーファンド方式とは

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

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

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

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

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

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

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

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

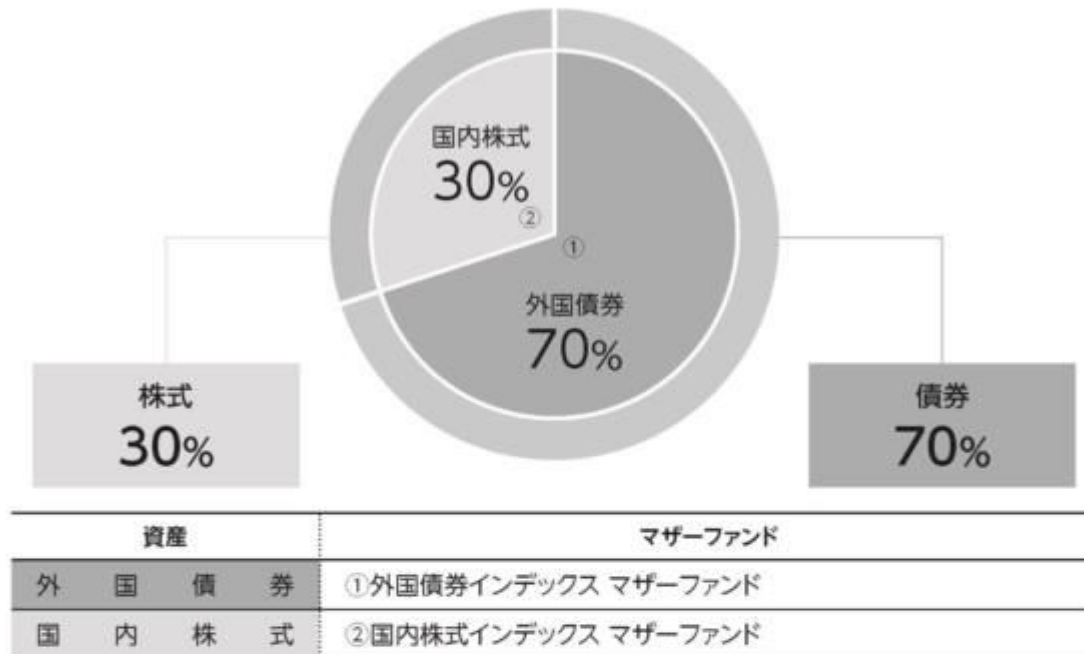
※2 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

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

2022年4月4日に東京証券取引所(以下「東証」といいます。)は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ(スタンダード・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

### 3. 債券70%、株式30%を基本資産配分比率として運用します。

#### 基本資産配分比率



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

#### ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

4.

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

#### 分配方針

- 原則として、毎月19日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、毎決算時に安定した分配を行うことを目指します。
- 年4回(3月、6月、9月、12月)の決算時には、売買益を配当等収益に加算して分配することを目指します。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。

#### 収益分配のイメージ



※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 売買益が確保できた場合でも、基準価額水準、市況動向等を勘案して、ボーナス分配を行わないことがあります。

#### 主な投資制限

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

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## 【収益分配金に関する留意事項】

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

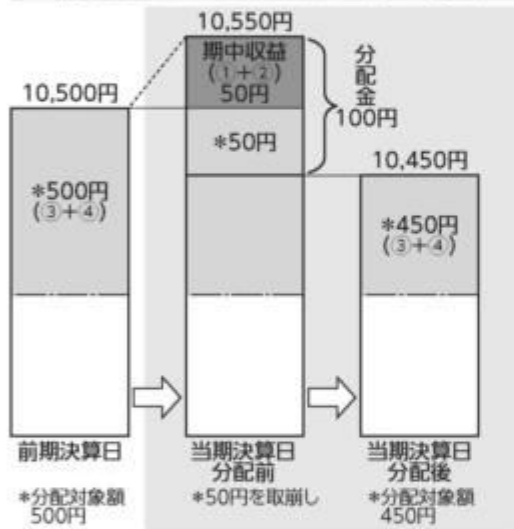
投資信託で分配金が  
支払われるイメージ



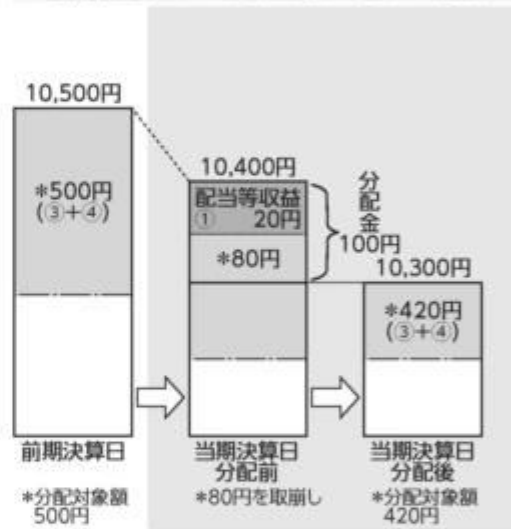
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)

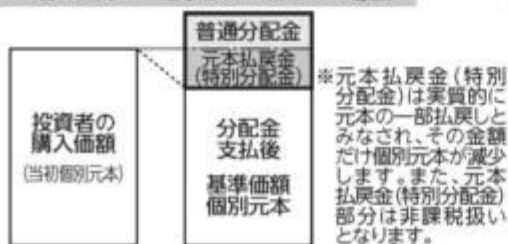


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

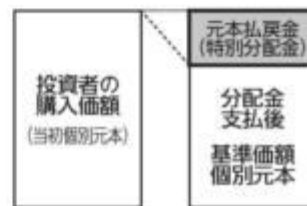
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、後掲「4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2004年12月1日

本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

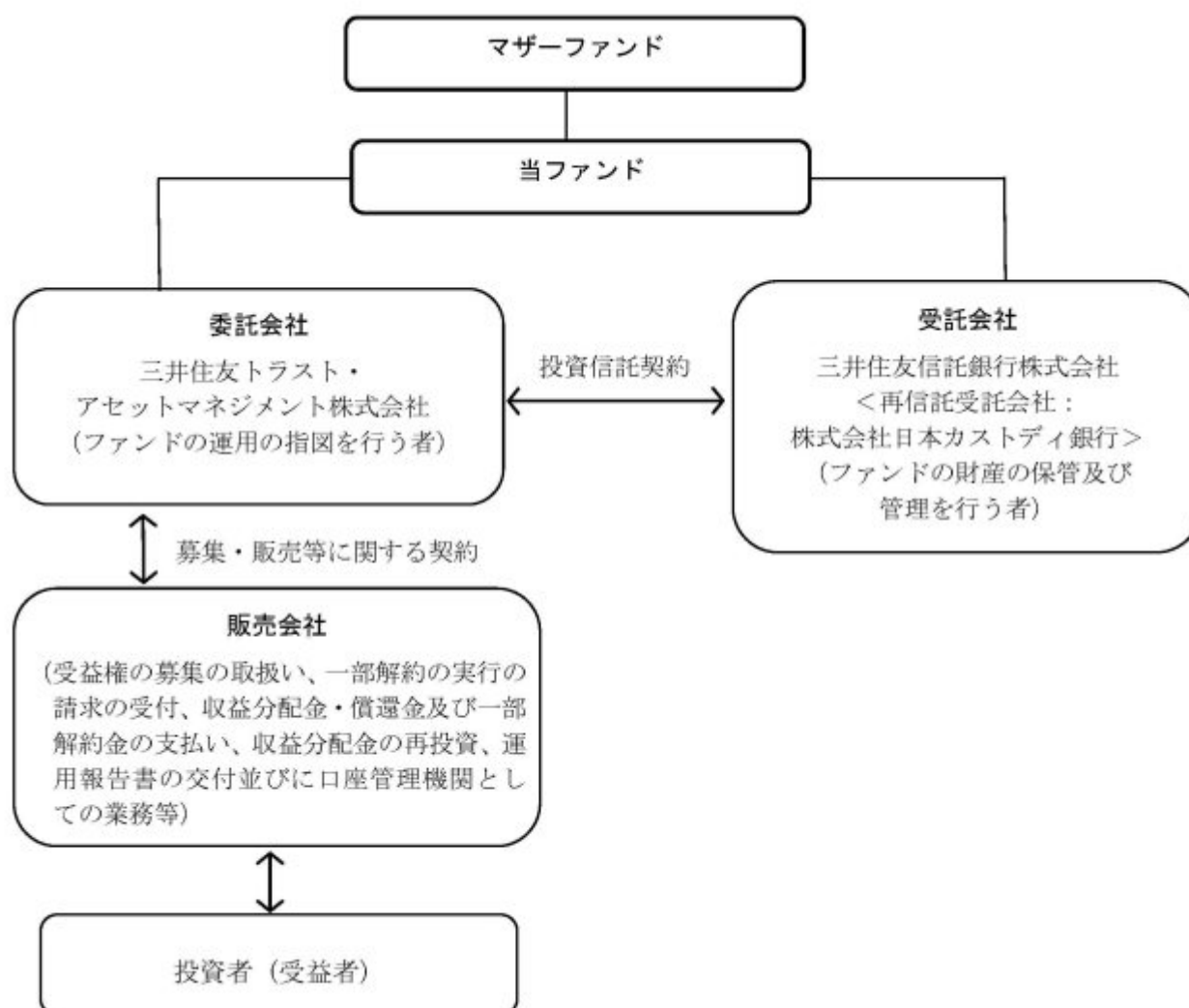
2012年4月1日

本ファンドの名称を「住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」から「グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」に変更

本ファンドの主要投資対象である「住信 外国債券インデックス マザーファンド」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」および「国内株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

### （３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

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

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### （イ）基本方針

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

#### （ロ）運用方法

##### 投資対象

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

##### 投資態度

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

### （2）【投資対象】



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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

受益証券に限ります。）

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

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

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

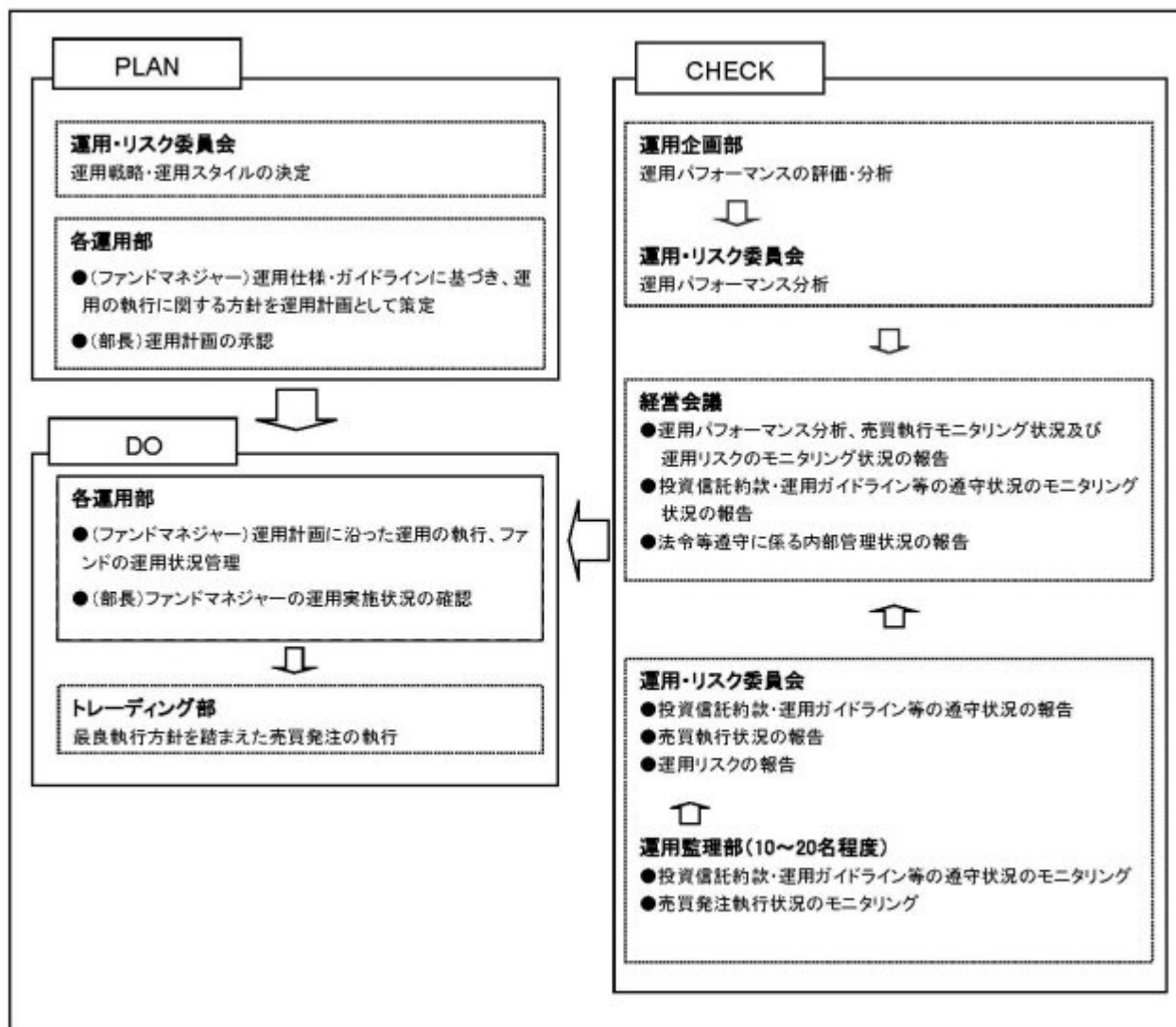
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

##### ・ 分配対象額の範囲

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

##### ・ 分配対象額についての分配方針

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

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

・留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

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

（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

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



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

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

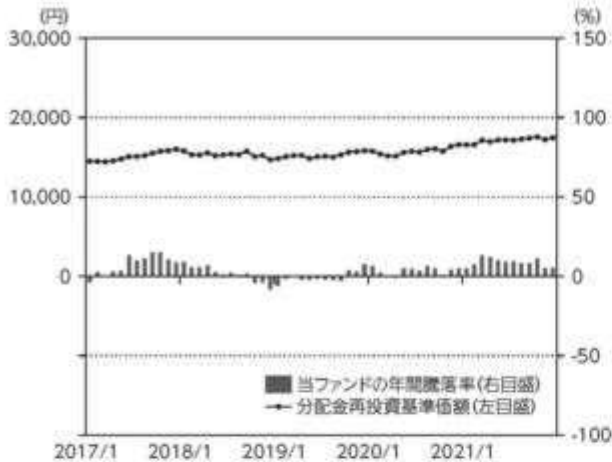
## (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

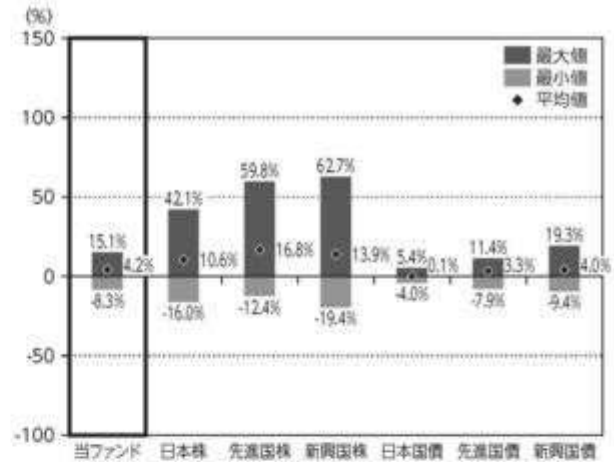
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2017年1月～2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、格付けの公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設立又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要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及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された資産ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに限り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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

## （4）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息

（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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

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

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

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

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2021年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）】

## ( 1 ) 【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,632,611,349	98.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		49,783,162	1.86
合計(純資産総額)		2,682,394,511	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	589,049,133	3.1025	1,827,524,936	3.1153	1,835,064,764	68.41
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	410,408,370	1.8911	776,123,269	1.9433	797,546,585	29.73

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.14
合計	98.14

(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15特定期間末	(2012年 5月21日)	7,706,373,531	7,719,351,627	5,938	5,948
第16特定期間末	(2012年11月19日)	7,027,296,398	7,038,630,742	6,200	6,210
第17特定期間末	(2013年 5月20日)	8,355,696,022	8,365,533,163	8,494	8,504
第18特定期間末	(2013年11月19日)	7,086,429,852	7,095,014,692	8,255	8,265
第19特定期間末	(2014年 5月19日)	6,225,643,060	6,233,124,547	8,321	8,331
第20特定期間末	(2014年11月19日)	6,141,678,470	6,148,136,758	9,510	9,520
第21特定期間末	(2015年 5月19日)	5,510,603,193	5,516,194,852	9,855	9,865
第22特定期間末	(2015年11月19日)	4,914,724,750	4,919,765,815	9,749	9,759
第23特定期間末	(2016年 5月19日)	4,141,974,161	4,146,719,038	8,729	8,739
第24特定期間末	(2016年11月21日)	3,774,731,381	3,779,110,340	8,620	8,630
第25特定期間末	(2017年 5月19日)	3,631,064,374	3,635,099,419	8,999	9,009
第26特定期間末	(2017年11月20日)	3,542,257,330	3,545,979,493	9,517	9,527
第27特定期間末	(2018年 5月21日)	3,521,297,931	3,525,050,764	9,383	9,393
第28特定期間末	(2018年11月19日)	3,128,759,601	3,132,233,675	9,006	9,016
第29特定期間末	(2019年 5月20日)	2,950,960,395	2,954,274,243	8,905	8,915
第30特定期間末	(2019年11月19日)	2,913,847,466	2,917,008,272	9,219	9,229
第31特定期間末	(2020年 5月19日)	2,657,035,815	2,660,011,967	8,928	8,938
第32特定期間末	(2020年11月19日)	2,687,460,239	2,690,308,087	9,437	9,447
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
	2020年12月末日	2,706,589,419		9,657	
	2021年 1月末日	2,687,612,760		9,634	
	2月末日	2,679,764,945		9,643	
	3月末日	2,751,118,233		9,948	
	4月末日	2,710,922,190		9,838	
	5月末日	2,728,282,810		9,947	
	6月末日	2,721,233,385		9,948	
	7月末日	2,701,527,153		9,910	
	8月末日	2,707,338,473		9,980	
	9月末日	2,702,608,881		10,039	
	10月末日	2,719,228,334		10,116	
	11月末日	2,661,349,752		9,915	
	12月末日	2,682,394,511		10,035	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	60
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	60



第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	60
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	60
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	60
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	60
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	60
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	60
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	60
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	60
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	60
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	60
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	60
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	60
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	60
第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	60
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	60
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	60
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

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	3.4
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	5.4
第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	38.0
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	2.1
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	1.5
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	15.0
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	4.3
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	0.5
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	9.8
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	0.6
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	5.1
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	6.4
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	0.8
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	3.4
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	0.5
第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	4.2
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	2.5
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	6.4
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
---------	-------------------------	-----

(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15特定期間	2011年11月22日～2012年 5月21日	24,470,201	2,373,692,339	12,978,096,518
第16特定期間	2012年 5月22日～2012年11月19日	21,751,501	1,665,503,835	11,334,344,184
第17特定期間	2012年11月20日～2013年 5月20日	30,551,318	1,527,753,571	9,837,141,931
第18特定期間	2013年 5月21日～2013年11月19日	18,582,737	1,270,884,312	8,584,840,356
第19特定期間	2013年11月20日～2014年 5月19日	19,874,914	1,123,227,709	7,481,487,561
第20特定期間	2014年 5月20日～2014年11月19日	16,229,854	1,039,428,546	6,458,288,869
第21特定期間	2014年11月20日～2015年 5月19日	26,204,502	892,833,400	5,591,659,971
第22特定期間	2015年 5月20日～2015年11月19日	14,940,340	565,534,341	5,041,065,970
第23特定期間	2015年11月20日～2016年 5月19日	11,974,884	308,163,096	4,744,877,758
第24特定期間	2016年 5月20日～2016年11月21日	10,418,827	376,336,749	4,378,959,836
第25特定期間	2016年11月22日～2017年 5月19日	8,607,056	352,521,557	4,035,045,335
第26特定期間	2017年 5月20日～2017年11月20日	10,872,907	323,754,271	3,722,163,971
第27特定期間	2017年11月21日～2018年 5月21日	246,694,847	216,025,727	3,752,833,091
第28特定期間	2018年 5月22日～2018年11月19日	8,083,059	286,841,845	3,474,074,305
第29特定期間	2018年11月20日～2019年 5月20日	8,367,199	168,593,378	3,313,848,126
第30特定期間	2019年 5月21日～2019年11月19日	8,156,132	161,198,091	3,160,806,167
第31特定期間	2019年11月20日～2020年 5月19日	7,421,919	192,075,711	2,976,152,375
第32特定期間	2020年 5月20日～2020年11月19日	10,530,677	138,834,428	2,847,848,624
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

(注)当該特定期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	143,446,178,095	46.50
	フランス	29,808,492,115	9.66
	イタリア	26,441,357,744	8.57
	ドイツ	21,868,590,657	7.09

イギリス	18,063,259,484	5.86
スペイン	17,376,418,396	5.63
ベルギー	6,724,068,344	2.18
カナダ	5,871,758,981	1.90
オランダ	5,684,549,220	1.84
オーストラリア	4,976,594,864	1.61
オーストリア	4,154,605,119	1.35
アイルランド	2,358,163,785	0.76
メキシコ	2,130,906,245	0.69
フィンランド	1,790,049,856	0.58
マレーシア	1,465,014,952	0.47
ポーランド	1,462,755,004	0.47
イスラエル	1,437,179,285	0.47
シンガポール	1,342,997,891	0.44
デンマーク	1,332,311,608	0.43
中国	1,324,406,947	0.43
スウェーデン	878,118,678	0.28
ノルウェー	738,756,516	0.24
小計	300,676,533,786	97.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	7,780,121,072	2.52
合計(純資産総額)	308,456,654,858	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	3,066,290,346	0.99
	買建	ドイツ	3,309,558,064	1.07

(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。

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		6,546,694,704	2.12

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,606.10	1,691,673,283	10,693.26	1,705,575,867	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,040.12	1,661,538,483	11,129.08	1,674,927,089	1.125	2031/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	11,421.26	1,656,083,782	11,348.34	1,645,509,376	1.250	2028/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	11,241.26	1,629,982,926	11,025.74	1,598,733,069	1.750	2041/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,745.42	1,461,377,736	11,253.08	1,530,420,183	1.875	2051/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,649.23	1,501,542,076	10,722.02	1,511,804,908	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,503.79	1,495,493,635	11,361.81	1,477,036,519	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	12,680,000	11,238.09	1,424,989,849	11,210.85	1,421,536,492	1.250	2031/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	12,000,000	11,822.54	1,418,704,873	11,594.55	1,391,346,624	2.000	2051/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	11,457.60	1,374,912,273	11,419.77	1,370,373,437	0.250	2023/9/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,274.95	1,333,826,647	11,233.32	1,328,901,818	0.750	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,716.56	1,306,396,669	11,612.52	1,294,796,770	1.625	2031/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,376.19	1,308,262,641	11,164.57	1,283,926,472	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	11,442.07	1,258,628,204	11,404.95	1,254,544,706	0.250	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,499.75	1,264,972,889	11,272.40	1,239,965,019	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,823.56	1,206,827,137	10,905.33	1,215,944,713	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,175.94	1,244,381,610	11,890.19	1,215,177,673	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,230.31	1,241,376,485	11,920.74	1,209,955,585	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,528.50	1,170,143,617	11,462.46	1,163,439,880	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,260.68	1,149,716,249	11,262.07	1,149,857,911	1.125	2028/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,471.89	1,147,189,708	11,355.07	1,135,507,989	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,441.03	1,144,103,365	11,341.15	1,134,115,178	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,341.60	1,134,160,105	11,147.05	1,114,705,553	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,110.21	1,111,021,313	10,988.90	1,098,890,303	0.625	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,648.88	1,106,643,652	11,366.31	1,079,799,678	1.250	2028/6/30	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,330.05	1,103,539,848	12,038.90	1,077,482,426	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	12,990.07	1,091,165,985	12,770.81	1,072,748,407	3.125	2028/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	11,026.64	1,047,531,177	10,908.02	1,036,262,811	0.375	2027/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,318.82	1,053,259,261	12,052.38	1,030,479,228	2.250	2027/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,499.12	1,036,071,117	11,355.97	1,023,173,666	0.375	2024/7/15	0.33

(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	97.48
合計	97.48

(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	79	アメリカドル	9,546,690	1,098,060,283	9,543,570.51	1,097,701,480	0.36
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	58	アメリカドル	7,544,600.07	867,779,900	7,552,687.5	868,710,116	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	60	アメリカドル	9,621,488.27	1,106,663,581	9,562,500	1,099,878,750	0.36
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,701,699.3	483,108,776	3,696,825	482,472,631	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	48	ユーロ	6,434,650.8	839,786,276	6,397,440	834,929,894	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	89	ユーロ	15,479,056.9	2,020,171,716	15,264,390	1,992,155,539	0.65

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

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

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	28,140,000.00	3,203,544,210	3,236,266,026	1.05
	カナダドル	買建	2,820,000.00	251,810,719	253,873,038	0.08
	ユーロ	買建	20,180,000.00	2,600,916,352	2,634,353,704	0.85
	イギリスポンド	買建	2,720,000.00	411,769,081	422,201,936	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	489,327,104,570	98.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,531,440,023	1.12

合計(純資産総額)	494,858,544,593	100.00
-----------	-----------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,258,880,000	1.06

(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	9,098,200	1,832.35	16,671,113,557	2,105.50	19,156,260,100	3.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,125,200	10,864.23	12,224,438,406	14,475.00	16,287,270,000	3.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	162,800	54,452.13	8,864,807,101	72,280.00	11,767,184,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,324,100	5,730.91	7,588,298,919	6,972.00	9,231,625,200	1.87
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	114,000	49,128.86	5,600,690,421	66,280.00	7,555,920,000	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,126,600	619.46	6,892,483,636	624.90	6,953,012,340	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	465,600	12,534.37	5,836,003,443	13,520.00	6,294,912,000	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	302,100	18,847.73	5,693,902,203	19,920.00	6,017,832,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	350,500	14,478.89	5,074,852,796	17,110.00	5,997,055,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	228,800	21,734.40	4,972,832,535	26,090.00	5,969,392,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,846,600	2,935.27	5,420,269,582	3,150.00	5,816,790,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,056,900	8,160.40	8,624,732,619	5,434.00	5,743,194,600	1.16
日本	株式	任天堂	その他製品	101,400	67,042.40	6,798,099,727	53,650.00	5,440,110,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	863,900	5,777.00	4,990,755,004	6,230.00	5,382,097,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,325,600	3,107.79	4,119,699,373	3,652.00	4,841,091,200	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,226,300	3,942.99	4,835,292,428	3,943.00	4,835,300,900	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	527,700	8,300.99	4,380,433,215	9,157.00	4,832,148,900	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,414,200	3,354.95	4,744,570,485	3,230.00	4,567,866,000	0.92
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,411,800	3,702.58	5,227,307,139	3,137.00	4,428,816,600	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,237,400	3,252.01	4,024,040,969	3,518.00	4,353,173,200	0.88

日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,285,000	3,700.76	4,755,479,170	3,362.00	4,320,170,000	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	1,411,500	2,533.01	3,575,349,134	2,925.00	4,128,637,500	0.83
日本	株式	S M C	機械	52,600	65,733.47	3,457,581,037	77,590.00	4,081,234,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	202,800	16,502.71	3,346,750,137	19,395.00	3,933,306,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,669,700	1,465.46	3,912,352,292	1,454.50	3,883,078,650	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	157,600	26,201.40	4,129,340,692	24,380.00	3,842,288,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	395,500	7,529.10	2,977,759,442	9,529.00	3,768,719,500	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	1,373,800	2,421.67	3,326,890,554	2,723.50	3,741,544,300	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	583,500	5,202.21	3,035,491,713	6,392.00	3,729,732,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	692,100	4,746.21	3,284,855,798	5,056.00	3,499,257,600	0.71

(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	0.23
		建設業	2.15
		食料品	3.23
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.68
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.74
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.63
		機械	5.49
		電気機器	19.93
		輸送用機器	8.03
		精密機器	2.88
		その他製品	2.19
		電気・ガス業	1.05
陸運業	2.89		
海運業	0.51		
空運業	0.38		
倉庫・運輸関連業	0.17		

	情報・通信業	7.90
	卸売業	5.22
	小売業	4.04
	銀行業	4.69
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.95
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.82
	サービス業	6.23
	小計	98.88
合計		98.88

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	264	円	5,246,554,100	5,258,880,000	1.06

(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

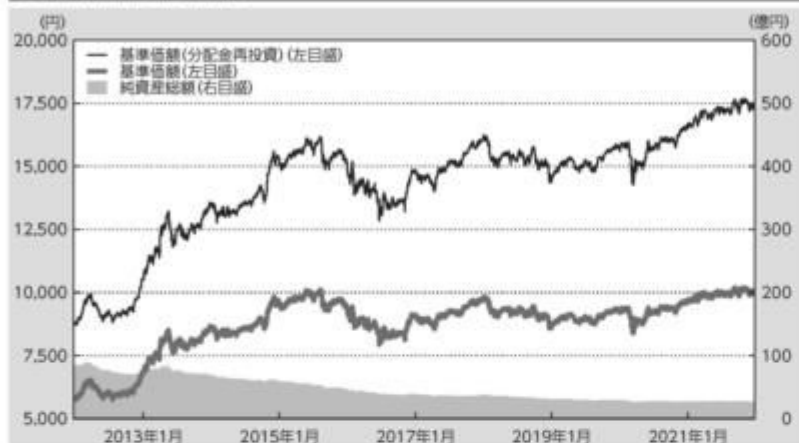
交付目論見書に記載するファンドの運用実績




**運用実績**

当初設定日：2004年12月1日

作成基準日：2021年12月30日

**基準価額・純資産の推移**

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したも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直近10年間を表示しております。

基準価額 10,035円  
 純資産総額 26.82億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

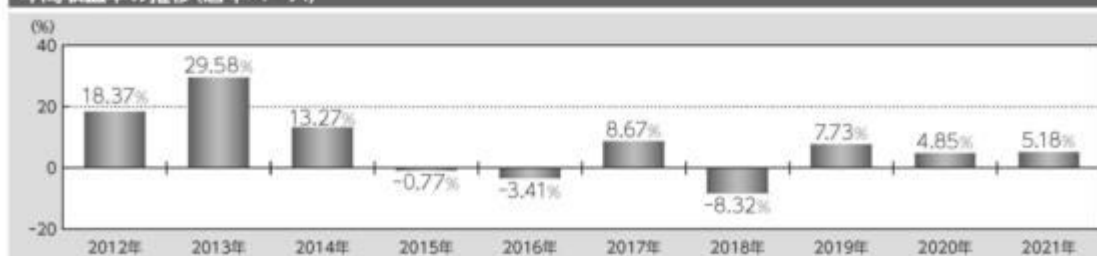
決算期	分配金
2021年8月	10円
2021年9月	10円
2021年10月	10円
2021年11月	10円
2021年12月	10円
直近1年間 分配金合計額	120円
設定来 分配金合計額	5,146円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	68.4%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.4%
		T 1.125% 02/15/31	アメリカ	国債	-	1.125%	2031/02/15	0.4%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.4%
		T 1.75% 08/15/41	アメリカ	国債	-	1.750%	2041/08/15	0.4%
		T 1.875% 02/15/51	アメリカ	国債	-	1.875%	2051/02/15	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	29.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	1.0%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
		リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	-	-	0.6%
		東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

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

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

## &lt; 申込手続 &gt;

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1)わが国の取引所に上場されている株式

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

2)公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、

原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評

価します。

(a)価格情報会社の提供する価額

(b)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2004年12月 1日設定）

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

（4）【計算期間】

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34特定期間(2021年5月20日から2021年11月19日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・インカム&amp;プラス（毎月決算型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第33特定期間 （2021年 5月19日現在）	第34特定期間 （2021年11月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	55,010,203	51,299,789
親投資信託受益証券	2,642,189,391	2,677,564,803
未収入金	5,000,000	-
流動資産合計	2,702,199,594	2,728,864,592
資産合計	2,702,199,594	2,728,864,592
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,744,948	2,686,304
未払解約金	101	-
未払受託者報酬	171,476	178,118
未払委託者報酬	2,768,109	2,875,331
未払利息	30	84
その他未払費用	12,239	12,714
流動負債合計	5,696,903	5,752,551
負債合計	5,696,903	5,752,551
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,744,948,646	2,686,304,481
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	48,445,955	36,807,560
（分配準備積立金）	94,606,667	92,062,701
元本等合計	2,696,502,691	2,723,112,041
純資産合計	2,696,502,691	2,723,112,041
負債純資産合計	2,702,199,594	2,728,864,592

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第33特定期間 自 2020年11月20日 至 2021年 5月19日	第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日
営業収益		
受取利息	75	149
有価証券売買等損益	143,230,545	119,815,412
営業収益合計	143,230,620	119,815,561
営業費用		
支払利息	7,388	13,766
受託者報酬	1,037,885	1,055,391
委託者報酬	16,754,423	17,036,975
その他費用	74,073	75,326
営業費用合計	17,873,769	18,181,458
営業利益又は営業損失（ ）	125,356,851	101,634,103
経常利益又は経常損失（ ）	125,356,851	101,634,103
当期純利益又は当期純損失（ ）	125,356,851	101,634,103
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（ ）	279,320	616,615
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	160,388,385	48,445,955
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,694,274	509,841
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,694,274	509,841
剰余金減少額又は欠損金増加額	163,993	3,916
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	163,993	3,916
分配金	16,665,382	16,269,898
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	48,445,955	36,807,560

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第33特定期間 (2021年 5月19日現在)	第34特定期間 (2021年11月19日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	2,744,948,646口	2,686,304,481口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 48,445,955円	元本の欠損 - 円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9824円 (1万口当たり純資産額) (9,824円)	1口当たり純資産額 1.0137円 (1万口当たり純資産額) (10,137円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第33特定期間 自 2020年11月20日 至 2021年 5月19日	第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日																																																						
分配金の計算過程 第191期 自 2020年11月20日 至 2020年12月21日	分配金の計算過程 第197期 自 2021年 5月20日 至 2021年 6月21日																																																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,867,429円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>8,876,027円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>95,475,449円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>107,218,905円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,822,538,849口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>379円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,867,429円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	8,876,027円	分配準備積立金額	D	95,475,449円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	107,218,905円	当ファンドの期末残存口数	F	2,822,538,849口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	379円	1万口当たり分配金額	H	10円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,511,253円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>8,866,236円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>94,376,441円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>105,753,930円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,738,940,385口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>386円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,511,253円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	8,866,236円	分配準備積立金額	D	94,376,441円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	105,753,930円	当ファンドの期末残存口数	F	2,738,940,385口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	386円	1万口当たり分配金額	H	10円
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	2,867,429円																																																					
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																					
収益調整金額	C	8,876,027円																																																					
分配準備積立金額	D	95,475,449円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	107,218,905円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,822,538,849口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	379円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	2,511,253円																																																					
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																					
収益調整金額	C	8,866,236円																																																					
分配準備積立金額	D	94,376,441円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	105,753,930円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	2,738,940,385口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	386円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					

第33特定期間 自 2020年11月20日 至 2021年 5月19日			第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日		
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,822,538円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,738,940円
第192期 自 2020年12月22日 至 2021年 1月19日			第198期 自 2021年 6月22日 至 2021年 7月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,168,247円	費用控除後の配当等収益額	A	2,450,284円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,805,755円	収益調整金額	C	8,888,744円
分配準備積立金額	D	94,518,166円	分配準備積立金額	D	93,970,511円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	106,492,168円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,309,539円
当ファンドの期末残存口数	F	2,793,535,233口	当ファンドの期末残存口数	F	2,734,793,374口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	381円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	385円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,793,535円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,734,793円
第193期 自 2021年 1月20日 至 2021年 2月19日			第199期 自 2021年 7月20日 至 2021年 8月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,716,688円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,831,320円	収益調整金額	C	8,856,150円
分配準備積立金額	D	94,390,508円	分配準備積立金額	D	93,107,978円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,938,516円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,964,128円
当ファンドの期末残存口数	F	2,780,682,148口	当ファンドの期末残存口数	F	2,718,508,091口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	380円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	375円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,780,682円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	2,718,508円
第194期 自 2021年 2月20日 至 2021年 3月19日			第200期 自 2021年 8月20日 至 2021年 9月21日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,679,633円	費用控除後の配当等収益額	A	2,813,176円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,838,934円	収益調整金額	C	8,855,250円
分配準備積立金額	D	93,752,478円	分配準備積立金額	D	89,688,568円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	105,271,045円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	101,356,994円
当ファンドの期末残存口数	F	2,765,399,742口	当ファンドの期末残存口数	F	2,699,278,108口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	380円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	375円

第33特定期間 自 2020年11月20日 至 2021年 5月19日			第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日		
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,765,399円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,699,278円
第195期 自 2021年 3月20日 至 2021年 4月19日			第201期 自 2021年 9月22日 至 2021年10月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,741,071円	費用控除後の配当等収益額	A	8,128,358円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,883,948円	収益調整金額	C	8,856,593円
分配準備積立金額	D	93,360,734円	分配準備積立金額	D	89,538,077円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	108,985,753円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	106,523,028円
当ファンドの期末残存口数	F	2,758,280,859口	当ファンドの期末残存口数	F	2,692,075,882口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	395円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	395円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,758,280円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,692,075円
第196期 自 2021年 4月20日 至 2021年 5月19日			第202期 自 2021年10月20日 至 2021年11月19日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	499,882円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	8,862,347円	収益調整金額	C	8,859,416円
分配準備積立金額	D	96,851,733円	分配準備積立金額	D	94,749,005円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	106,213,962円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	103,608,421円
当ファンドの期末残存口数	F	2,744,948,646口	当ファンドの期末残存口数	F	2,686,304,481口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	386円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	385円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,744,948円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	2,686,304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34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第34特定期間 (2021年11月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第33特定期間 自 2020年11月20日 至 2021年 5月19日	第34特定期間 自 2021年 5月20日 至 2021年11月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,847,848,624円	2,744,948,646円
期中追加設定元本額	7,356,311円	5,525,447円
期中一部解約元本額	110,256,289円	64,169,612円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第33特定期間 (2021年 5月19日現在)	第34特定期間 (2021年11月19日現在)
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	13,671,322	1,197
合計	13,671,322	1,197

## （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	412,288,649	821,031,615	
	外国債券インデックス マザーファンド	595,634,505	1,856,533,188	
合計		1,007,923,154	2,677,564,803	

(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

項目	2021年11月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	448,402,180
コール・ローン	5,412,902,570
国債証券	296,874,952,916
派生商品評価勘定	38,183,274
未収入金	201,739
未収利息	1,441,984,512
前払費用	39,717,105
差入委託証拠金	459,429,258
流動資産合計	304,715,773,554
資産合計	304,715,773,554
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,539,971
前受金	19,490,026
未払金	445,655
未払解約金	204,442,098
未払利息	8,927
流動負債合計	240,926,677
負債合計	240,926,677
純資産の部	
元本等	
元本	97,685,548,105
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	206,789,298,772

	2021年11月19日現在
項目	金額（円）
元本等合計	304,474,846,877
純資産合計	304,474,846,877
負債純資産合計	304,715,773,554

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		2021年11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			97,685,548,105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)		3.1169円 (31,169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

		2021年11月19日現在	
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2021年11月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。	

	2021年11月19日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月20日
期首元本額	98,164,128,619円
期中追加設定元本額	9,284,510,838円
期中一部解約元本額	9,763,091,352円
期末元本額	97,685,548,105円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,370,343,648円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	595,634,505円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円

区分	2021年11月19日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,109,249,520円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,539,655円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,910,644,678円
世界経済インデックスファンド	11,616,849,794円
D C マイセレクション 2 5	1,893,408,595円
D C マイセレクション 5 0	1,615,186,852円
D C マイセレクション 7 5	1,119,963,046円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,254,132,186円
D C マイセレクション S 2 5	897,602,223円
D C マイセレクション S 5 0	704,445,883円
D C マイセレクション S 7 5	382,310,089円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	33,838,755円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	87,502,457円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	44,063,230円
D C 世界経済インデックスファンド	11,905,271,502円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	646,473,387円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,076,012円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,233,869円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	29,974,783円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,617,261円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	93,668,845円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	78,570,045円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	84,844,761円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,441,059,077円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	461,258,186円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,841,566,827円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	145,408,896円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	58,041,254円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	483,917,290円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	176,520,401円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	224,631,051円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	765,681,235円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,054,537,902円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ 1	683,662,518円
コア投資戦略ファンド（安定型）	707,634,266円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,882,347,304円
分散投資コア戦略ファンド A	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンド S	556,972,964円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	496,074,474円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,803,633,980円
コア投資戦略ファンド（切替型）	774,547,899円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,743,256円

区分	2021年11月19日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,322,672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）	1,330,051,356円
SMT インデックスバランス・オープン	198,775,714円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,256,772,880円
SMT 世界経済インデックス・オープン	212,160,604円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	247,537,901円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	412,362,311円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,918,936円
グローバル経済コア	835,400,801円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,791,418円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,371,682円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,271,580円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	5,367,476円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,705,534円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,524,684円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,521,795円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	385,183,119円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,702,687,681円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,401,338円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	334,646,563円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	258,504,975円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	33,431,118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）	25,403,830円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年11月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		72,322,240
合計		72,322,240

(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

（2021年11月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	債券先物取引 買建	5,410,184,348	-	5,429,674,374	19,490,026
合計		5,410,184,348	-	5,429,674,374	19,490,026

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年11月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	5,309,555,933	-	5,311,709,210	2,153,277
	アメリカドル	2,565,489,942	-	2,572,533,000	7,043,058
	カナダドル	216,698,033	-	215,968,816	729,217
	ユーロ	2,178,282,173	-	2,171,392,450	6,889,723
	イギリスポンド	349,085,785	-	351,814,944	2,729,159
合計		5,309,555,933	-	5,311,709,210	2,153,277

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,898,828.10	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,660,140.22	

T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,983,593.75	
T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,473,486.30	
T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,774,101.58	
T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,973,535.15	
T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,008,995.35	
T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,942,812.48	
T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,220,419.93	
T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,393,500.03	
T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,881,171.94	
T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,139,096.66	
T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,889,062.50	
T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,982,500.00	
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,892,070.29	
T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	973,281.25	
T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,719,140.60	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,272,363.30	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,484,265.61	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,751,250.00	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,949,960.92	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,840,625.04	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,924,123.43	
T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,022,031.25	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,948,632.80	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,567,812.48	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,914,218.75	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,881,406.24	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,191,835.99	
T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,791,246.13	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,116,212.50	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,820,217.96	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,351,796.87	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,792,980.45	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,445,203.12	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,134,667.95	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,095,375.00	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,791,250.00	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,774,933.67	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,392,968.75	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,558,984.40	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,177,597.63	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,811,796.93	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,945,625.00	



T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	11,581,385.21
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,888,125.04
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,541,105.52
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,524,425.85
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,878,750.00
T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,425,170.34
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	6,309,367.22
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,993,835.20
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,100,310.53
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,919,375.04
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,266,675.82
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	9,387,929.73
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,613,540.02
T 1.25% 08/15/31	8,580,000.00	8,336,676.59
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,061,718.76
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,078,906.25
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,579,742.23
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,540,527.35
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,066,406.24
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,720,312.50
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,290,820.32
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,081,562.50
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,471,516.43
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,921,417.99
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,064,609.36
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,606,347.66
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,669,667.99
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,265,796.87
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,564,736.31
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,315,932.04
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	11,234,496.14
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,019,062.50
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,826,464.87
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,554,003.90
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,857,312.50
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,196,150.00
T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,416,304.74
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,878,027.33
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,655,265.61
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,685,516.61
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,765,673.81
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,463,281.25
T 1.75% 08/15/41	2,500,000.00	2,398,828.12

T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,061,875.00	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,748,789.10	
T 1.875% 02/15/51	13,600,000.00	13,295,062.56	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,355,025.80	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,182,812.50	
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,570,917.00	
T 1% 07/31/28	5,000,000.00	4,857,421.90	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,273,519.54	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,654,085.95	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,495,250.00	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,752,718.76	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,977,375.02	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,188,476.55	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,765,739.06	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,432,738.30	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,144,375.00	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,400,996.13	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,852,734.37	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,265,781.25	
T 2.25% 05/15/41	4,600,000.00	4,794,421.89	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,987,853.53	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	4,395,571.87	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,827,421.87	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,563,320.34	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,574,238.33	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,601,781.27	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,047,441.44	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,658,906.25	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,757,656.29	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,126,855.45	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,987,250.02	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,737,718.75	
T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,178,537.50	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,518,760.19	
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,003,515.62	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,218,359.40	
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,640,898.46	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,613,950.79	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,255,468.75	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,502,912.50	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,385,312.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,170,155.27	

T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,251,796.87
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,539,613.30
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,712,538.10
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,980,193.75
T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,085,689.06
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,441,863.27
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,655,546.87
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,075,136.73
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,650,253.91
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,179,657.84
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,143,085.93
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,087,304.68
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,724,875.00
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,020,650.00
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,841,601.59
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,039,277.34
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,466,765.62
T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	8,146,054.68
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,560,732.42
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,337,179.72
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,422,451.57
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,182,634.37
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,527,515.62
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,260,156.24
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,919,639.09
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,778,335.93
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,647,882.05
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,071,135.16
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,828,336.73
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,283,212.50
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,681,656.25
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,960,224.59
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,614,208.97
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,209,850.77
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,032,617.22
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,107,421.90
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,755,439.10
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,029,687.50
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,429,798.03
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,417,445.71
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,681,328.12
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,135,994.56
T 2% 08/15/51	4,500,000.00	4,533,046.87

T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,174,023.40	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,612,432.05	
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,037,539.06	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,253,027.34	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,390,000.00	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,357,832.81	
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,985,142.20	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,335,156.29	
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,083,593.75	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,758,972.67	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,885,031.25	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	962,500.00	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,100,500.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,574,062.50	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,587,187.50	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,936,328.14	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,898,820.31	
T 3% 02/15/47	800,000.00	962,625.00	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,393,191.42	
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,535,625.00	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,899,576.57	
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,159,257.83	
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,891,256.25	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,617,492.18	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,510,242.19	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,374,218.75	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,313,187.50	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,229,132.81	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,221,519.54	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,377,343.75	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,641,742.19	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,724,972.66	
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,746,871.87	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,500,112.50	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	768,367.18	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,390,625.00	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,970,165.62	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,092,773.43	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,602,218.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,631,601.56	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,603,554.68	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,514,250.00	

	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,045,246.09
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,852,035.16
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,450,558.59
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,816,643.54
アメリカドル 小計		1,183,050,000.00	1,216,614,593.09 (139,132,044,865)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,039,834.60
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,170,696.80
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,351,448.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,576,548.00
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,344,183.20
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,762,318.20
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,403,268.80
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,186,542.60
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	1,958,882.80
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,461,628.40
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,079,865.40
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,365,072.80
	CAN 1.5% 06/01/31	3,260,000.00	3,205,166.80
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,210,380.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,662,354.00
	CAN 1.75% 12/01/53	900,000.00	831,177.00
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,684,155.00
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,496,646.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,359,892.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,859,868.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,322,622.00
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	310,149.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,157,506.80
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	655,799.20
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,347,466.00
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,522,487.60
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,663,512.30
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,662,843.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,390,294.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,516,729.50
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,353,052.80
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,159,734.20
カナダドル 小計		63,500,000.00	65,072,125.30 (5,905,946,092)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,336,779.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	32,990,436.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	42,990,000.00	40,628,129.40

	MBONO 6.75% 03/09/23	22,180,000.00	22,287,573.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	39,273,419.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	31,580,000.00	32,136,123.80
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	23,691,444.10
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	10,765,572.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	36,208,623.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,220,000.00	29,779,437.20
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	35,228,684.70
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	24,688,373.10
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	35,698,162.50
	メキシコペソ 小計	365,720,000.00	373,712,758.00 (2,058,148,272)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,396,167.00
	BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,050,115.90
	BGB 0.4% 06/22/40	1,140,000.00	1,118,773.20
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,678,028.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	562,624.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,818,636.40
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,807,201.50
	BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,323,231.20
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,562,511.60
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	439,881.40
	BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,015,144.80
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,699,110.00
	BGB 1.45% 06/22/37	890,000.00	1,035,559.50
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,674,243.60
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,619,462.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,304,016.00
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,441,082.00
	BGB 1% 06/22/31	2,480,000.00	2,726,140.00
	BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,127,187.60
	BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,058,914.30
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,105,858.60
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,327,528.20
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,030,880.00
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,391,962.60
	BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,163,441.60
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,397,594.40
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,526,439.60
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,842,627.20
	BGB 5% 03/28/35	2,220,000.00	3,619,932.00
	BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,213.20
	BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,104,529.70

BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,992,570.00	
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,128.80	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,662,964.80	
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,940,542.00	
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	589,361.20	
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,783,124.10	
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,284,765.20	
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,129,891.20	
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	3,081,316.00	
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	684,177.20	
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,325,555.00	
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,825,460.00	
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,036,980.00	
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	973,018.80	
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,630,155.20	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,269,158.80	
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,466,870.00	
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,705,508.00	
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,007,620.00	
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	3,020,220.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,057,815.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,045,652.40	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,754,315.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,425,281.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,517,096.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	600,000.00	586,914.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,546,189.10	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,025,496.40	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,226,388.90	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,731,185.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,420,000.00	1,397,947.40	
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,367,008.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,896,137.90	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,581,197.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,887,677.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,012,630.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,498,880.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	718,006.10	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,525,510.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,090,221.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,046,982.40	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,091,961.80	

BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,069,002.40
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,247,566.50
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,190,720.00
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,672,243.60
BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,193,889.60
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,192,286.60
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,542,676.50
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,487,310.80
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,259,958.80
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,794,979.40
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,573,746.50
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,813,450.40
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,904,039.60
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,875,195.60
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,388,392.00
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,725,253.40
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,972,628.80
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,052,967.50
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,479,464.00
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,842,127.60
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,977,295.50
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,668,978.60
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,890,339.50
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,875,818.50
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,686,360.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,856,623.20
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,646,719.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,437,647.20
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,278,540.00
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,338,694.80
BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,566,614.40
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,908,060.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,342,350.60
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,893,556.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	946,912.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,060,304.20
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,094,925.20
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,763,840.70
DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,404,756.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,148,380.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,710,000.00	2,886,177.10
DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,286,722.80
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,691,451.40



DBR 0% 02/15/31	2,450,000.00	2,524,774.00	
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,881,588.80	
DBR 0% 05/15/36	2,170,000.00	2,207,584.40	
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,479,717.00	
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,617,600.00	
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	4,329,820.30	
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	696,109.90	
DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,545,047.50	
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,414,033.00	
DBR 0% 08/15/52	700,000.00	693,126.00	
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,229,184.80	
DBR 0% 11/15/28	900,000.00	929,727.00	
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,807,940.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,046,668.80	
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,126,213.40	
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,421,652.10	
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,745,683.50	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,098,100.00	
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,893,862.40	
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,676,850.20	
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	6,272,822.10	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,001,198.20	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,826,278.60	
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,840,770.20	
DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,161,095.40	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,467,337.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,942,200.90	
DBR 4.75% 07/04/40	2,680,000.00	5,199,709.20	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,412,422.80	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,277,662.40	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,722,801.10	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,949,987.50	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,380,624.00	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,844,268.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,807,059.70	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,319,202.70	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,630,286.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,157,675.50	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	820,997.10	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,505,780.10	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,725,079.30	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,787,764.00	

FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	761,106.50
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	6,264,765.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,070,971.50
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,630.00
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,323,004.90
FRTR 0% 02/25/27	2,560,000.00	2,612,864.00
FRTR 0% 03/25/23	5,060,000.00	5,113,636.00
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,049,365.00
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,520,100.40
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,316,545.00
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,062,408.40
FRTR 0% 11/25/31	3,620,000.00	3,595,528.80
FRTR 1.25% 05/25/34	5,090,000.00	5,734,801.20
FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,713,412.30
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,736,687.50
FRTR 1.5% 05/25/50	3,890,000.00	4,679,747.80
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,585,946.40
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,161,380.00
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,719,533.60
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,464,595.20
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,011,491.00
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,610,739.20
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,408,935.00
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,825,133.80
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,096,658.40
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,730,136.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	4,859,534.50
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,487,602.50
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,511,407.80
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	7,938,024.00
FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,013,571.40
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,733,616.80
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,175,466.40
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,402,851.40
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,398,890.40
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,040,174.40
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,400,251.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,132,960.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	955,147.20
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,044,028.60
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	764,316.80
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	497,770.00
IRISH 0.9% 05/15/28	810,000.00	867,445.20

IRISH 0% 10/18/31	1,300,000.00	1,277,185.00	
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,304,664.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	748,684.80	
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	694,648.00	
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	921,632.40	
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	975,217.80	
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,513,081.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,461,692.10	
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,495,598.00	
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,063,236.40	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,071,569.60	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,390,758.80	
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,386,114.50	
NETHER 0.25% 07/15/29	2,070,000.00	2,158,057.80	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,562,976.00	
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,436,580.00	
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,258,670.60	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,745,307.00	
NETHER 0% 01/15/24	1,670,000.00	1,698,373.30	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,886,533.60	
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	691,355.00	
NETHER 0% 01/15/52	1,230,000.00	1,169,496.30	
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,957,113.60	
NETHER 0% 07/15/31	970,000.00	983,502.40	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,024,118.40	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,607,698.80	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,430,000.00	4,056,885.00	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,136,842.10	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,643,818.80	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,930,210.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,508,230.40	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,371,726.20	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	219,392.00	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,393,503.10	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	3,156,911.70	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,841,500.00	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,245,907.40	
OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,983,984.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,593,590.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,534,069.40	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,567,896.80	
RAGB 0.25% 10/20/36	730,000.00	729,934.30	

RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,864,518.00
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	935,220.90
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,730,176.20
RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	734,338.80
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,206,713.60
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	322,413.30
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,465,239.50
RAGB 0% 02/20/31	880,000.00	883,599.20
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	949,892.70
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,134,705.60
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,467,072.00
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	393,913.80
RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	750,022.00
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,306,421.10
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	456,083.10
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,059,032.70
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,395,608.90
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,397,355.30
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,392,055.20
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,346,434.30
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,458,176.00
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,015,082.50
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,921,937.20
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,698,156.10
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,635,539.00
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	534,907.80
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	426,153.20
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	406,288.00
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	499,030.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	649,363.20
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	916,919.10
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	685,782.50
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	803,449.20
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	669,085.40
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	730,054.50
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	547,835.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,576.40
RFGB 0% 09/15/26	700,000.00	716,674.00
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	637,131.60
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	633,628.80
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	618,571.10
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	671,697.00
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	873,270.80

RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	507,973.20
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	779,340.70
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	972,751.70
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,125,456.40
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,335,479.40
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,649,988.90
SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,488,019.40
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,963,771.00
SPGB 0.5% 10/31/31	1,710,000.00	1,720,961.10
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,051,834.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,562,756.40
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	958,320.00
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,310,643.20
SPGB 0% 01/31/26	1,530,000.00	1,548,497.70
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,930,386.00
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,402,229.20
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,274,490.00
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,344,094.60
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,306,230.50
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,962,217.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,714,896.80
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,611,091.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,958,488.90
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,316,092.80
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	603,735.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,891,521.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,262,981.50
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,158,100.00
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,090,831.40
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,367,858.20
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	2,331,013.10
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,091,786.80
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,934,661.20
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,510,172.50
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,343,928.50
SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,853,743.50
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,799,441.60
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,789,791.20
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,793,026.60
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,956,874.90
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,372,926.00
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,441,483.20

	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,686,536.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,820,185.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,810,976.60
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,260,000.00	4,178,468.80
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,251,515.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,450,646.20
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,496,890.80
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,502,151.00
	ユーロ 小計	772,040,000.00	900,326,018.80 (117,033,379,183)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,491,256.80
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,496,379.80
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,944,220.40
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,182,165.60
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	3,066,475.20
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,881,770.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,320,005.60
	UKT 0.5% 01/31/29	350,000.00	342,905.50
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,133,104.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,706,596.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	2,210,258.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,649,671.20
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,372,342.80
	UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	901,526.40
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,711,033.00
	UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	496,670.00
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	982,233.50
	UKT 1.25% 07/31/51	550,000.00	570,333.50
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,844,100.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,084,400.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,563,581.60
	UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	224,116.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,720,909.80
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,140,953.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,463,190.40
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,495,910.00
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,683,603.00
	UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,191,063.00
	UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,620,096.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,578,750.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,980,473.60
	UKT 2.75% 09/07/24	1,470,000.00	1,560,478.50
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,877,312.60

	UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,638,238.60	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	3,385,215.40	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,798,568.10	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,712,960.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	2,967,820.90	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,793,336.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,439,882.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,659,946.80	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,685,095.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	3,214,099.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,658,506.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,656,313.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,470,000.00	3,485,491.10	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,815,533.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,955,932.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,587,200.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,010,730.80	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,061,396.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,703,812.50	
	イギリスポンド 小計	96,350,000.00	117,717,963.00 (18,167,413,229)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	6,382,978.50	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,664,056.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,744,363.30	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,914,625.00	
	SGB 1% 11/12/26	10,030,000.00	10,490,276.70	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,504,612.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,119,981.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,321,230.80	
	スウェーデンクローナ 小計	62,440,000.00	68,142,124.00 (877,670,557)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,895,360.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	6,349,298.40	
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,728,577.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,114,358.20	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,220,000.00	5,262,804.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,540,000.00	6,599,056.20	
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,619,051.80	
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,791,437.80	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,628,272.00	
	ノルウェークローネ 小計	55,570,000.00	55,988,215.80 (726,167,158)	

デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,237,828.20
	DGB 0.25% 11/15/52	4,180,000.00	4,166,373.20
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,926,412.00
	DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	13,079,643.60
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,860,670.80
	DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,836,879.40
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,743,289.40
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,931,924.00
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	26,955,311.60
デンマーククローネ 小計		71,520,000.00	85,738,332.20 (1,498,706,046)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,200,000.00	1,900,624.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,288,799.20
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,181,058.30
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,500,068.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,837,330.60
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	5,844,529.60
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,890,000.00	2,852,285.50
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,866,504.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,626,721.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,214,780.20
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	5,988,927.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,923,551.60
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	3,834,034.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	699,138.00
ポーランドズロチ 小計		54,530,000.00	52,558,352.10 (1,462,126,052)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,868,763.00
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,249,956.80
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,957,257.60
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,587,683.40
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,109,803.40
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,487,516.80
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,010,000.00	1,987,287.00
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,011,417.50
	ACGB 1% 12/21/30	3,310,000.00	3,097,431.80
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,671,078.40
	ACGB 2.25% 11/21/22	2,760,000.00	2,815,972.80
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,024,601.00
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,448,544.60
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,716,813.80
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	1,140,499.50
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,069,982.90



	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,787,139.40
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,720,000.00	1,857,823.60
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,190,000.00	3,418,499.70
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,448,864.00
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,112,525.40
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,955,599.20
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,837,113.60
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,129,368.50
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,429,080.70
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,723,332.00
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,679,375.00
	オーストラリアドル 小計	60,340,000.00	62,623,331.40 (5,210,261,172)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	729,487.50
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	296,226.00
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	811,056.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	680,000.00	648,040.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	309,369.60
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	765,086.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	920,429.10
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	760,959.30
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	453,353.30
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	563,485.40
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	847,924.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,002,798.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,105,042.50
	SIGB 2.875% 07/01/29	950,000.00	1,028,527.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,109,290.80
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	420,233.60
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	956,409.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	969,663.20
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,677,450.00
	シンガポールドル 小計	14,580,000.00	15,374,830.70 (1,295,944,479)
マレーシアリングgit	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	731,840.20
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,958,822.40
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,365,439.30
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,531,336.30
	MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,679,785.90
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,111,200.50
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	521,977.50
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	952,487.40
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,669,499.00

	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,065,452.60
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,538,325.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,166,069.60
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,030,045.60
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,491,969.60
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	620,886.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,467,988.60
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,846,856.80
	MGS 4.065% 06/15/50	1,560,000.00	1,517,490.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,328,166.40
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,138,240.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,096,482.50
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,069,147.90
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,044,498.60
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,035,005.20
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,561,370.40
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,445,049.20
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,496,786.60
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,815,878.40
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,120,114.70
	マレーシアリングット 小計	50,500,000.00	52,418,212.20 (1,434,429,618)
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	701,007.79
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	860,562.52
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,432,993.46
	ILGOV 1.25% 11/30/22	4,960,000.00	5,023,372.43
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,107,396.48
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,799,441.16
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,143,087.55
	ILGOV 1% 03/31/30	2,650,000.00	2,643,683.45
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,588,136.00
	ILGOV 2% 03/31/27	1,050,000.00	1,127,367.04
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,424,807.32
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,051,664.80
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,853,228.50
	ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,321,948.20
	イスラエルシェケル 小計	34,580,000.00	39,078,696.70 (1,448,350,288)
香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	5,100,000.00	4,982,751.00
	CGB 2.56% 10/21/23	8,110,000.00	8,121,272.90
	CGB 2.68% 05/21/30	4,500,000.00	4,400,505.00
	CGB 2.84% 04/08/24	3,100,000.00	3,121,576.00

	CGB 2.85% 06/04/27	3,750,000.00	3,756,900.00
	CGB 3.01% 05/13/28	1,050,000.00	1,058,095.50
	CGB 3.02% 05/27/31	500,000.00	504,680.00
	CGB 3.03% 03/11/26	3,300,000.00	3,343,098.00
	CGB 3.27% 11/19/30	500,000.00	513,740.00
	CGB 3.28% 12/03/27	1,060,000.00	1,088,386.80
	CGB 3.39% 03/16/50	920,000.00	905,905.60
	CGB 3.72% 04/12/51	540,000.00	567,934.20
	CGB 3.81% 09/14/50	920,000.00	979,496.40
	CGB 3.86% 07/22/49	760,000.00	813,010.00
	CGB 4.08% 10/22/48	610,000.00	679,247.20
	香港・オフショア人民元 小計	34,720,000.00	34,836,598.60 (624,365,905)
	合計		296,874,952,916 (296,874,952,916)

## 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 218銘柄	100.0%	46.9%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 336銘柄	100.0%	39.4%
イギリスポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
香港・オフショア人民元	国債証券 15銘柄	100.0%	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	2021年11月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,696,394,242
株式	493,838,945,770
派生商品評価勘定	91,881,100
未収入金	15,200,000
未収配当金	4,085,102,589
差入委託証拠金	320,170,000
流動資産合計	501,047,693,701
資産合計	501,047,693,701
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,867,150
前受金	68,098,100
未払解約金	183,420,964
未払利息	4,447
流動負債合計	275,390,661
負債合計	275,390,661
純資産の部	
元本等	
元本	251,467,289,772
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	249,305,013,268
元本等合計	500,772,303,040
純資産合計	500,772,303,040
負債純資産合計	501,047,693,701

##### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年11月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2021年11月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2021年11月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,467,289,772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 1.9914円 (1万口当たり純資産額) (19,914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

2021年11月19日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>

	2021年11月19日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年11月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 5月20日
期首元本額	248,227,985,566円
期中追加設定元本額	15,493,988,896円
期中一部解約元本額	12,254,684,690円
期末元本額	251,467,289,772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)	412,288,649円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,898,361,583円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,937,230円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,908,089,907円
世界経済インデックスファンド	3,284,502,698円
日本株式インデックス・オープン	3,404,435,274円
DCマイセレクション25	6,027,567,573円
DCマイセレクション50	17,968,803,095円
DCマイセレクション75	18,087,479,959円
DC日本株式インデックス・オープン	5,968,688,627円
DCマイセレクションS25	2,975,082,645円
DCマイセレクションS50	8,592,263,507円
DCマイセレクションS75	6,295,005,953円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,912,143,722円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	222,999,445円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	692,491,039円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	494,123,688円
DC世界経済インデックスファンド	3,381,374,629円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,691,136,468円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	7,257,008円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	21,712,749円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	20,260,254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)	190,578,724円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,239,914円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	34,550,822円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	148,215,139円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	26,316,407円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	85,275,716円

区分	2021年11月19日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,004,890,828円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	449,784,145円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,947,677,334円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	93,539,393円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,676,015円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	522,264,886円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	290,140,954円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	372,414,747円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,320,584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）	595,251,842円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,908,099,395円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,370,121,973円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,746,727,045円
分散投資コア戦略ファンドA	1,322,664,148円
分散投資コア戦略ファンドS	5,718,049,945円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	435,401,259円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,750,822円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,986,012,249円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	213,279,933円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,600,334円
SMT インデックスバランス・オープン	59,564,305円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	25,943,143,075円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,578,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,563,232円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	139,293,436円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	26,368,874円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,842,775円
グローバル経済コア	215,803,627円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	24,454,524円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	79,220,705円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,869,376円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,226,885,412円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	157,096,979円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	5,199,177円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,690,579円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,772,705円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,228,558円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,093,640,229円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,063,673,371円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	237,592,640円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	36,833,279円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	47,713,148,857円



区分	2021年11月19日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,808,162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）	69,512,950円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年11月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	29,596,245,960	
合計	29,596,245,960	

(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

（2021年11月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,854,141,900	-	6,922,240,000	68,098,100
合計		6,854,141,900	-	6,922,240,000	68,098,100

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,400	3,040.00	25,536,000	
日本水産	239,400	591.00	141,485,400	
マルハニチロ	37,500	2,364.00	88,650,000	
雪国まいたけ	17,500	1,335.00	23,362,500	
カネコ種苗	7,200	1,420.00	10,224,000	

サカタのタネ	28,500	3,270.00	93,195,000
ホクト	20,100	1,922.00	38,632,200
ホクリヨウ	3,200	711.00	2,275,200
住石ホールディングス	41,900	135.00	5,656,500
日鉄鉱業	5,500	6,410.00	35,255,000
三井松島ホールディングス	10,000	1,368.00	13,680,000
I N P E X	960,400	963.00	924,865,200
石油資源開発	28,200	2,263.00	63,816,600
K & O エナジーグループ	11,600	1,480.00	17,168,000
ヒノキヤグループ	5,200	2,188.00	11,377,600
ショーボンドホールディングス	34,200	5,030.00	172,026,000
ミライト・ホールディングス	77,100	2,048.00	157,900,800
タマホーム	14,500	2,286.00	33,147,000
サンヨーホームズ	2,800	728.00	2,038,400
日本アクア	9,500	693.00	6,583,500
ファーストコーポレーション	7,300	758.00	5,533,400
ベステラ	4,800	1,420.00	6,816,000
Robot Home	39,900	244.00	9,735,600
キャンディル	4,100	509.00	2,086,900
スペースバリューホールディングス	26,500	1,147.00	30,395,500
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,810.00	8,326,000
第一カッター興業	5,900	1,339.00	7,900,100
安藤・間	131,600	893.00	117,518,800
東急建設	70,100	685.00	48,018,500
コムシスホールディングス	77,200	2,716.00	209,675,200
ピーアールホールディングス	32,600	388.00	12,648,800
高松コンストラクショングループ	14,900	1,906.00	28,399,400
東建コーポレーション	7,400	9,310.00	68,894,000
ソネック	2,500	1,000.00	2,500,000
ヤマウラ	11,500	932.00	10,718,000
オリエンタル白石	80,500	245.00	19,722,500
大成建設	159,800	3,580.00	572,084,000
大林組	552,800	913.00	504,706,400
清水建設	517,900	755.00	391,014,500
飛島建設	14,800	1,027.00	15,199,600
長谷工コーポレーション	164,600	1,458.00	239,986,800
松井建設	21,800	740.00	16,132,000
銭高組	2,400	3,875.00	9,300,000
鹿島建設	405,100	1,360.00	550,936,000
不動テトラ	11,700	1,722.00	20,147,400
大末建設	5,800	1,231.00	7,139,800
鉄建建設	12,000	1,791.00	21,492,000

西松建設	33,500	3,585.00	120,097,500
三井住友建設	124,600	412.00	51,335,200
大豊建設	8,100	3,775.00	30,577,500
佐田建設	12,200	483.00	5,892,600
ナカノフドー建設	13,200	339.00	4,474,800
奥村組	32,600	3,250.00	105,950,000
東鉄工業	25,700	2,407.00	61,859,900
イチケン	4,000	1,856.00	7,424,000
富士ピー・エス	7,100	502.00	3,564,200
浅沼組	6,200	5,570.00	34,534,000
戸田建設	229,600	720.00	165,312,000
熊谷組	28,200	2,754.00	77,662,800
北野建設	3,400	2,114.00	7,187,600
植木組	4,900	1,430.00	7,007,000
矢作建設工業	24,400	722.00	17,616,800
ピーエス三菱	18,200	630.00	11,466,000
日本ハウスホールディングス	37,700	383.00	14,439,100
大東建託	56,600	13,340.00	755,044,000
新日本建設	23,500	841.00	19,763,500
N I P P O	45,700	4,060.00	185,542,000
東亜道路工業	2,900	4,865.00	14,108,500
日本道路	5,300	7,990.00	42,347,000
東亜建設工業	13,500	2,496.00	33,696,000
日本国土開発	53,800	575.00	30,935,000
若築建設	9,200	2,039.00	18,758,800
東洋建設	62,000	557.00	34,534,000
五洋建設	219,100	723.00	158,409,300
世紀東急工業	26,500	799.00	21,173,500
福田組	5,900	4,200.00	24,780,000
住友林業	141,400	2,465.00	348,551,000
日本基礎技術	15,200	529.00	8,040,800
巴コーポレーション	24,500	432.00	10,584,000
大和ハウス工業	510,500	3,408.00	1,739,784,000
ライト工業	34,800	1,988.00	69,182,400
積水ハウス	599,600	2,398.50	1,438,140,600
日特建設	11,400	678.00	7,729,200
北陸電気工事	9,600	1,006.00	9,657,600
ユアテック	31,600	641.00	20,255,600
日本リーテック	11,600	1,420.00	16,472,000
四電工	6,000	1,609.00	9,654,000
中電工	25,500	2,125.00	54,187,500
関電工	89,900	860.00	77,314,000

きんでん	123,500	1,743.00	215,260,500
東京エネシス	18,400	1,103.00	20,295,200
トーエネック	5,600	3,085.00	17,276,000
住友電設	13,900	2,011.00	27,952,900
日本電設工業	30,300	1,649.00	49,964,700
エクシオグループ	83,800	2,569.00	215,282,200
新日本空調	14,600	2,287.00	33,390,200
九電工	42,700	3,540.00	151,158,000
三機工業	35,900	1,428.00	51,265,200
日揮ホールディングス	170,300	1,063.00	181,028,900
中外炉工業	5,500	1,691.00	9,300,500
ヤマト	16,200	777.00	12,587,400
太平電業	12,200	2,651.00	32,342,200
高砂熱学工業	50,000	1,989.00	99,450,000
三晃金属工業	2,200	2,430.00	5,346,000
朝日工業社	3,700	3,145.00	11,636,500
明星工業	35,800	665.00	23,807,000
大気社	26,900	3,005.00	80,834,500
ダイダン	12,300	2,117.00	26,039,100
日比谷総合設備	17,800	1,845.00	32,841,000
フィル・カンパニー	3,200	2,555.00	8,176,000
テスホールディングス	10,100	2,725.00	27,522,500
インフロニア・ホールディングス	235,700	990.00	233,343,000
東洋エンジニアリング	23,200	743.00	17,237,600
レイズネクスト	26,700	1,194.00	31,879,800
ニッポン	51,800	1,606.00	83,190,800
日清製粉グループ本社	199,900	1,712.00	342,228,800
日東富士製粉	2,600	3,490.00	9,074,000
昭和産業	16,700	2,789.00	46,576,300
鳥越製粉	15,700	747.00	11,727,900
中部飼料	19,900	1,026.00	20,417,400
フィード・ワン	23,800	752.00	17,897,600
東洋精糖	3,000	1,164.00	3,492,000
日本甜菜製糖	9,200	1,642.00	15,106,400
D M三井製糖ホールディングス	16,100	1,971.00	31,733,100
塩水港精糖	21,100	217.00	4,578,700
日新製糖	8,400	1,672.00	14,044,800
森永製菓	41,500	3,910.00	162,265,000
中村屋	4,300	3,720.00	15,996,000
江崎グリコ	48,700	3,740.00	182,138,000
名糖産業	7,800	1,723.00	13,439,400
井村屋グループ	10,000	2,286.00	22,860,000

不二家	9,900	2,297.00	22,740,300
山崎製パン	132,600	1,609.00	213,353,400
第一屋製パン	3,400	655.00	2,227,000
モロゾフ	2,800	5,580.00	15,624,000
亀田製菓	10,100	4,430.00	44,743,000
寿スピリッツ	17,000	7,080.00	120,360,000
カルビー	80,600	2,699.00	217,539,400
森永乳業	32,700	5,860.00	191,622,000
六甲バター	12,900	1,615.00	20,833,500
ヤクルト本社	131,100	5,750.00	753,825,000
明治ホールディングス	117,000	7,000.00	819,000,000
雪印メグミルク	42,600	2,057.00	87,628,200
プリマハム	22,100	2,594.00	57,327,400
日本ハム	67,600	3,960.00	267,696,000
林兼産業	5,400	560.00	3,024,000
丸大食品	17,400	1,529.00	26,604,600
S Foods	15,900	3,410.00	54,219,000
柿安本店	6,100	2,663.00	16,244,300
伊藤ハム米久ホールディングス	113,900	666.00	75,857,400
サッポロホールディングス	60,400	2,308.00	139,403,200
アサヒグループホールディングス	416,200	4,602.00	1,915,352,400
キリンホールディングス	650,300	1,870.00	1,216,061,000
宝ホールディングス	120,200	1,336.00	160,587,200
オエノンホールディングス	50,300	374.00	18,812,200
養命酒製造	5,400	1,800.00	9,720,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,200	1,454.00	180,586,800
サントリー食品インターナショナル	118,400	4,490.00	531,616,000
ダイトーグループホールディングス	9,100	5,280.00	48,048,000
伊藤園	53,700	7,540.00	404,898,000
キーコーヒー	17,400	1,999.00	34,782,600
ユニカフェ	5,300	1,090.00	5,777,000
ジャパンフーズ	2,500	1,216.00	3,040,000
日清オイリオグループ	22,100	2,926.00	64,664,600
不二製油グループ本社	38,300	2,433.00	93,183,900
かどや製油	1,900	4,040.00	7,676,000
J - オイルミルズ	16,500	1,730.00	28,545,000
キッコーマン	127,300	9,390.00	1,195,347,000
味の素	390,700	3,500.00	1,367,450,000
ブルドックソース	7,400	2,128.00	15,747,200
キューピー	92,900	2,456.00	228,162,400
ハウス食品グループ本社	66,200	3,000.00	198,600,000
カゴメ	67,100	2,892.00	194,053,200

焼津水産化学工業	8,600	971.00	8,350,600
アリアケジャパン	16,200	6,760.00	109,512,000
ピエトロ	2,300	1,781.00	4,096,300
エバラ食品工業	3,900	2,440.00	9,516,000
やまみ	1,900	1,926.00	3,659,400
ニチレイ	84,300	2,629.00	221,624,700
東洋水産	85,000	4,620.00	392,700,000
イトアンドホールディングス	6,700	2,157.00	14,451,900
大冷	2,000	1,938.00	3,876,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,100	732.00	6,661,200
日清食品ホールディングス	69,400	8,590.00	596,146,000
永谷園ホールディングス	7,900	1,933.00	15,270,700
一正蒲鉾	6,900	906.00	6,251,400
フジッコ	19,200	1,929.00	37,036,800
ロック・フィールド	19,100	1,552.00	29,643,200
日本たばこ産業	948,600	2,298.00	2,179,882,800
ケンコーマヨネーズ	9,900	1,358.00	13,444,200
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,001.00	23,211,600
なとり	9,900	1,939.00	19,196,100
イフジ産業	3,100	952.00	2,951,200
ピクルスコーポレーション	8,400	1,874.00	15,741,600
ファーマフーズ	16,700	2,708.00	45,223,600
ユーグレナ	90,100	949.00	85,504,900
紀文食品	10,300	1,049.00	10,804,700
ミヨシ油脂	6,800	1,319.00	8,969,200
理研ビタミン	18,400	1,684.00	30,985,600
片倉工業	19,500	2,245.00	43,777,500
ゲンゼ	11,700	4,205.00	49,198,500
東洋紡	68,600	1,337.00	91,718,200
ユニチカ	48,700	305.00	14,853,500
富士紡ホールディングス	7,800	4,165.00	32,487,000
倉敷紡績	15,000	1,899.00	28,485,000
シキボウ	9,000	910.00	8,190,000
日本毛織	52,600	893.00	46,971,800
トーア紡コーポレーション	6,400	438.00	2,803,200
帝国繊維	19,700	2,047.00	40,325,900
帝人	162,800	1,423.00	231,664,400
東レ	1,250,700	715.10	894,375,570
住江織物	3,800	1,740.00	6,612,000
日本フェルト	10,800	436.00	4,708,800
イチカワ	2,600	1,343.00	3,491,800
日東製網	1,900	1,474.00	2,800,600

アツギ	13,600	689.00	9,370,400
ダイニック	6,500	738.00	4,797,000
セーレン	35,600	2,312.00	82,307,200
ソトー	6,500	856.00	5,564,000
東海染工	2,200	1,124.00	2,472,800
小松マテーレ	28,600	1,182.00	33,805,200
ワコールホールディングス	43,200	2,154.00	93,052,800
ホギメディカル	23,300	3,120.00	72,696,000
T S Iホールディングス	58,300	358.00	20,871,400
マツオカコーポレーション	5,700	1,376.00	7,843,200
ワールド	22,700	1,296.00	29,419,200
三陽商会	8,300	900.00	7,470,000
ナイガイ	6,600	310.00	2,046,000
オンワードホールディングス	104,300	332.00	34,627,600
ルックホールディングス	5,600	1,408.00	7,884,800
ゴールドウイン	31,200	7,110.00	221,832,000
デサント	33,700	4,990.00	168,163,000
キング	8,800	547.00	4,813,600
ヤマトインターナショナル	15,800	316.00	4,992,800
特種東海製紙	10,600	4,185.00	44,361,000
王子ホールディングス	721,700	560.00	404,152,000
日本製紙	82,700	1,121.00	92,706,700
三菱製紙	24,500	331.00	8,109,500
北越コーポレーション	113,200	837.00	94,748,400
中越パルプ工業	6,600	1,118.00	7,378,800
巴川製紙所	5,300	799.00	4,234,700
大王製紙	83,200	1,877.00	156,166,400
阿波製紙	4,500	378.00	1,701,000
レンゴー	163,200	820.00	133,824,000
トーモク	10,600	1,875.00	19,875,000
ザ・パック	13,100	2,841.00	37,217,100
北の達人コーポレーション	61,800	401.00	24,781,800
クラレ	252,500	1,020.00	257,550,000
旭化成	1,144,300	1,144.50	1,309,651,350
共和レザー	10,700	648.00	6,933,600
昭和電工	149,700	2,636.00	394,609,200
住友化学	1,268,400	570.00	722,988,000
住友精化	7,600	3,135.00	23,826,000
日産化学	93,900	7,090.00	665,751,000
ラサ工業	6,100	1,802.00	10,992,200
クレハ	13,700	8,350.00	114,395,000
多木化学	6,700	5,930.00	39,731,000

テイカ	12,700	1,252.00	15,900,400
石原産業	28,700	1,358.00	38,974,600
片倉コープアグリ	4,200	1,155.00	4,851,000
日本曹達	22,100	3,310.00	73,151,000
東ソー	249,100	1,768.00	440,408,800
トクヤマ	55,200	1,972.00	108,854,400
セントラル硝子	28,200	2,089.00	58,909,800
東亜合成	98,300	1,276.00	125,430,800
大阪ソーダ	16,100	2,717.00	43,743,700
関東電化工業	37,800	1,055.00	39,879,000
デンカ	63,000	3,540.00	223,020,000
信越化学工業	296,400	20,235.00	5,997,654,000
日本カーバイド工業	6,000	1,327.00	7,962,000
堺化学工業	12,100	2,229.00	26,970,900
第一稀元素化学工業	16,000	1,395.00	22,320,000
エア・ウォーター	163,500	1,771.00	289,558,500
日本酸素ホールディングス	165,900	2,648.00	439,303,200
日本化学工業	5,400	2,716.00	14,666,400
東邦アセチレン	2,900	1,227.00	3,558,300
日本パーカラライジング	87,100	1,126.00	98,074,600
高压ガス工業	27,400	760.00	20,824,000
チタン工業	2,000	1,801.00	3,602,000
四国化成工業	22,500	1,378.00	31,005,000
戸田工業	3,700	3,725.00	13,782,500
ステラ ケミファ	8,700	2,683.00	23,342,100
保土谷化学工業	5,500	4,960.00	27,280,000
日本触媒	29,000	5,540.00	160,660,000
大日精化工業	14,300	2,276.00	32,546,800
カネカ	44,700	4,020.00	179,694,000
三菱瓦斯化学	160,600	2,012.00	323,127,200
三井化学	156,800	3,370.00	528,416,000
J S R	160,900	4,340.00	698,306,000
東京応化工業	29,600	7,690.00	227,624,000
大阪有機化学工業	14,700	4,050.00	59,535,000
三菱ケミカルホールディングス	1,154,100	949.80	1,096,164,180
K Hネオケム	28,500	3,480.00	99,180,000
ダイセル	248,700	831.00	206,669,700
住友ベークライト	27,100	5,400.00	146,340,000
積水化学工業	361,300	1,905.00	688,276,500
日本ゼオン	155,700	1,356.00	211,129,200
アイカ工業	48,100	3,390.00	163,059,000
宇部興産	81,400	2,022.00	164,590,800



積水樹脂	26,100	2,098.00	54,757,800
タキロンシーアイ	37,400	545.00	20,383,000
旭有機材	9,800	1,455.00	14,259,000
ニチバン	10,200	1,893.00	19,308,600
リケンテクノス	42,100	522.00	21,976,200
大倉工業	8,800	2,153.00	18,946,400
積水化成成品工業	23,100	516.00	11,919,600
群栄化学工業	3,900	3,340.00	13,026,000
タイガースポリマー	9,100	428.00	3,894,800
ミライアル	5,500	1,698.00	9,339,000
ダイキアクシス	6,700	864.00	5,788,800
ダイキョーニシカワ	36,400	571.00	20,784,400
竹本容器	6,200	844.00	5,232,800
森六ホールディングス	9,300	1,745.00	16,228,500
恵和	4,300	6,560.00	28,208,000
日本化薬	136,000	1,217.00	165,512,000
カーリットホールディングス	17,100	752.00	12,859,200
日本精化	13,900	2,007.00	27,897,300
扶桑化学工業	15,500	5,160.00	79,980,000
トリケミカル研究所	17,800	3,710.00	66,038,000
A D E K A	79,500	2,508.00	199,386,000
日油	58,900	5,980.00	352,222,000
新日本理化	28,600	269.00	7,693,400
ハリマ化成グループ	12,800	845.00	10,816,000
花王	389,900	6,226.00	2,427,517,400
第一工業製薬	6,400	3,345.00	21,408,000
石原ケミカル	8,700	1,339.00	11,649,300
日華化学	5,800	899.00	5,214,200
ニイタカ	3,600	2,338.00	8,416,800
三洋化成工業	10,300	5,430.00	55,929,000
有機合成薬品工業	12,000	294.00	3,528,000
大日本塗料	21,100	836.00	17,639,600
日本ペイントホールディングス	648,700	1,301.00	843,958,700
関西ペイント	179,000	2,827.00	506,033,000
神東塗料	13,600	188.00	2,556,800
中国塗料	40,700	868.00	35,327,600
日本特殊塗料	12,900	926.00	11,945,400
藤倉化成	21,800	513.00	11,183,400
太陽ホールディングス	25,400	3,360.00	85,344,000
D I C	72,900	3,150.00	229,635,000
サカタインクス	34,300	995.00	34,128,500
東洋インキＳＣホールディングス	36,500	1,986.00	72,489,000

T & K T O K A	13,900	811.00	11,272,900	
富士フィルムホールディングス	309,800	9,375.00	2,904,375,000	
資生堂	328,400	7,420.00	2,436,728,000	
ライオン	212,800	1,736.00	369,420,800	
高砂香料工業	12,100	2,754.00	33,323,400	
マンダム	37,000	1,572.00	58,164,000	
ミルボン	21,700	6,050.00	131,285,000	
ファンケル	71,300	3,560.00	253,828,000	
コーセー	33,200	14,590.00	484,388,000	
コタ	11,200	1,524.00	17,068,800	
シーボン	2,300	1,768.00	4,066,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	2,175.00	163,560,000	
ノエビアホールディングス	15,000	5,590.00	83,850,000	
アジュバンホールディングス	3,900	1,138.00	4,438,200	
新日本製薬	4,800	1,382.00	6,633,600	
エステー	11,300	1,549.00	17,503,700	
アグロ カネショウ	5,900	1,297.00	7,652,300	
コニシ	29,000	1,731.00	50,199,000	
長谷川香料	30,400	3,035.00	92,264,000	
星光 P M C	10,000	766.00	7,660,000	
小林製薬	49,400	9,410.00	464,854,000	
荒川化学工業	14,700	1,193.00	17,537,100	
メック	13,200	4,190.00	55,308,000	
日本高純度化学	4,800	2,718.00	13,046,400	
タカラバイオ	46,100	2,727.00	125,714,700	
J C U	19,800	5,020.00	99,396,000	
新田ゼラチン	11,100	616.00	6,837,600	
O A T アグリオ	3,600	2,279.00	8,204,400	
デクセリアルズ	45,800	3,430.00	157,094,000	
アース製薬	14,500	6,490.00	94,105,000	
北興化学工業	16,400	927.00	15,202,800	
大成ラミック	5,400	2,889.00	15,600,600	
クミアイ化学工業	65,600	866.00	56,809,600	
日本農薬	31,400	487.00	15,291,800	
アキレス	11,300	1,285.00	14,520,500	
有沢製作所	25,700	951.00	24,440,700	
日東電工	106,500	8,830.00	940,395,000	
レック	23,000	901.00	20,723,000	
三光合成	18,500	417.00	7,714,500	
きもと	27,000	225.00	6,075,000	
藤森工業	15,800	4,015.00	63,437,000	
前澤化成工業	11,200	1,310.00	14,672,000	

未来工業	6,300	1,624.00	10,231,200
ウェーブロックホールディングス	6,700	727.00	4,870,900
J S P	10,300	1,572.00	16,191,600
エフピコ	32,400	4,155.00	134,622,000
天馬	14,700	2,573.00	37,823,100
信越ポリマー	31,700	1,036.00	32,841,200
東リ	43,900	231.00	10,140,900
ニフコ	58,800	3,685.00	216,678,000
バルカー	14,300	2,525.00	36,107,500
ユニ・チャーム	339,800	4,844.00	1,645,991,200
ショーエイコーポレーション	4,700	723.00	3,398,100
協和キリン	206,900	3,320.00	686,908,000
武田薬品工業	1,385,500	3,227.00	4,471,008,500
アステラス製薬	1,528,400	1,923.00	2,939,113,200
大日本住友製薬	108,900	1,468.00	159,865,200
塩野義製薬	221,700	7,868.00	1,744,335,600
わかもと製薬	21,000	311.00	6,531,000
日本新薬	46,100	8,620.00	397,382,000
中外製薬	551,400	4,112.00	2,267,356,800
科研製薬	27,700	4,255.00	117,863,500
エーザイ	211,000	7,238.00	1,527,218,000
ロート製薬	90,500	3,365.00	304,532,500
小野薬品工業	404,800	2,440.50	987,914,400
久光製薬	46,600	4,015.00	187,099,000
持田製薬	22,200	3,375.00	74,925,000
参天製薬	328,700	1,555.00	511,128,500
扶桑薬品工業	6,200	2,590.00	16,058,000
日本ケミファ	2,100	2,103.00	4,416,300
ツムラ	54,600	3,505.00	191,373,000
日医工	54,700	690.00	37,743,000
キッセイ薬品工業	31,200	2,223.00	69,357,600
生化学工業	31,100	977.00	30,384,700
栄研化学	31,000	1,888.00	58,528,000
日水製薬	6,500	957.00	6,220,500
鳥居薬品	9,500	2,913.00	27,673,500
J C R ファーマ	49,700	2,622.00	130,313,400
東和薬品	25,400	2,754.00	69,951,600
富士製薬工業	10,800	1,103.00	11,912,400
ゼリア新薬工業	32,000	2,016.00	64,512,000
第一三共	1,385,300	2,995.00	4,148,973,500
キョーリン製薬ホールディングス	35,400	1,730.00	61,242,000
大幸薬品	26,600	809.00	21,519,400

ダイト	11,300	2,977.00	33,640,100
大塚ホールディングス	366,400	4,116.00	1,508,102,400
大正製薬ホールディングス	41,900	5,740.00	240,506,000
ペプチドリーム	92,500	2,705.00	250,212,500
あすか製薬ホールディングス	20,100	1,009.00	20,280,900
サワイグループホールディングス	38,600	4,470.00	172,542,000
日本コークス工業	148,900	126.00	18,761,400
ニチレキ	22,500	1,264.00	28,440,000
ユシロ化学工業	9,100	1,079.00	9,818,900
ビーピー・カストロール	6,300	1,392.00	8,769,600
富士石油	47,100	246.00	11,586,600
MORESCO	5,800	1,127.00	6,536,600
出光興産	195,600	2,996.00	586,017,600
ENEOSホールディングス	2,651,900	434.60	1,152,515,740
コスモエネルギーホールディングス	51,000	2,287.00	116,637,000
横浜ゴム	102,100	1,963.00	200,422,300
TOYO TIRE	92,800	1,958.00	181,702,400
ブリヂストン	507,800	4,907.00	2,491,774,600
住友ゴム工業	158,400	1,232.00	195,148,800
藤倉コンポジット	14,100	851.00	11,999,100
オカモト	10,500	3,975.00	41,737,500
フコク	7,700	985.00	7,584,500
ニッタ	18,200	2,677.00	48,721,400
住友理工	34,200	623.00	21,306,600
三ツ星ベルト	21,400	2,003.00	42,864,200
バンドー化学	28,400	891.00	25,304,400
日東紡績	26,300	3,005.00	79,031,500
AGC	161,800	5,620.00	909,316,000
日本板硝子	84,600	563.00	47,629,800
石塚硝子	3,000	2,153.00	6,459,000
日本山村硝子	6,900	794.00	5,478,600
日本電気硝子	70,800	3,015.00	213,462,000
オハラ	7,000	1,534.00	10,738,000
住友大阪セメント	32,600	3,370.00	109,862,000
太平洋セメント	100,200	2,353.00	235,770,600
日本ヒューム	17,800	709.00	12,620,200
日本コンクリート工業	35,100	279.00	9,792,900
三谷セキサン	8,200	7,370.00	60,434,000
アジアパイルホールディングス	27,300	436.00	11,902,800
東海カーボン	147,800	1,270.00	187,706,000
日本カーボン	9,100	4,430.00	40,313,000
東洋炭素	11,500	3,135.00	36,052,500

ノリタケカンパニーリミテド	9,800	4,770.00	46,746,000
TOTO	125,900	5,400.00	679,860,000
日本碍子	191,000	1,999.00	381,809,000
日本特殊陶業	134,100	1,968.00	263,908,800
MARUWA	6,100	14,190.00	86,559,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,645.00	15,309,000
黒崎播磨	3,000	4,140.00	12,420,000
ヨータイ	11,300	1,236.00	13,966,800
イソライト工業	7,900	961.00	7,591,900
東京窯業	22,700	322.00	7,309,400
ニッカトー	8,100	717.00	5,807,700
フジミインコーポレーテッド	14,200	7,490.00	106,358,000
クニミネ工業	5,600	1,067.00	5,975,200
エーアンドエーマテリアル	3,100	915.00	2,836,500
ニチアス	40,900	2,637.00	107,853,300
ニチハ	24,500	3,065.00	75,092,500
日本製鉄	780,200	1,842.50	1,437,518,500
神戸製鋼所	325,500	591.00	192,370,500
中山製鋼所	27,800	447.00	12,426,600
合同製鐵	9,400	1,384.00	13,009,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	470,800	1,411.00	664,298,800
東京製鐵	59,500	1,290.00	76,755,000
共英製鋼	19,700	1,332.00	26,240,400
大和工業	33,400	3,705.00	123,747,000
東京鐵鋼	7,700	1,310.00	10,087,000
大阪製鐵	9,300	1,059.00	9,848,700
淀川製鋼所	22,900	2,405.00	55,074,500
丸一鋼管	61,800	2,587.00	159,876,600
モリ工業	5,200	2,652.00	13,790,400
大同特殊鋼	28,600	4,135.00	118,261,000
日本高周波鋼業	6,600	374.00	2,468,400
日本冶金工業	12,700	2,185.00	27,749,500
山陽特殊製鋼	17,900	1,924.00	34,439,600
愛知製鋼	9,800	2,620.00	25,676,000
日立金属	187,800	2,132.00	400,389,600
日本金属	4,400	999.00	4,395,600
大平洋金属	10,800	2,226.00	24,040,800
新日本電工	112,700	306.00	34,486,200
栗本鐵工所	7,900	1,547.00	12,221,300
虹技	2,500	1,056.00	2,640,000
三菱製鋼	11,200	999.00	11,188,800
日亜鋼業	22,900	278.00	6,366,200

日本精線	2,900	4,570.00	13,253,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,400	2,144.00	15,865,600	
シンニッタン	21,400	229.00	4,900,600	
新家工業	4,300	1,866.00	8,023,800	
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,448.00	38,082,400	
日本軽金属ホールディングス	44,200	1,775.00	78,455,000	
三井金属鉱業	47,100	3,070.00	144,597,000	
東邦亜鉛	9,700	2,289.00	22,203,300	
三菱マテリアル	115,200	2,056.00	236,851,200	
住友金属鉱山	222,800	4,423.00	985,444,400	
DOWAホールディングス	47,500	4,655.00	221,112,500	
古河機械金属	28,900	1,226.00	35,431,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,300	880.00	17,864,000	
東邦チタニウム	31,300	1,013.00	31,706,900	
UACJ	26,500	2,558.00	67,787,000	
CKサンエツ	3,700	3,400.00	12,580,000	
古河電気工業	54,200	2,488.00	134,849,600	
住友電気工業	651,800	1,620.50	1,056,241,900	
フジクラ	194,500	592.00	115,144,000	
昭和電線ホールディングス	15,200	1,951.00	29,655,200	
東京特殊電線	2,600	2,804.00	7,290,400	
タツタ電線	30,900	482.00	14,893,800	
カナレ電気	2,700	1,715.00	4,630,500	
平河ヒューテック	9,700	1,194.00	11,581,800	
リョービ	21,500	1,083.00	23,284,500	
アーレスティ	18,800	401.00	7,538,800	
アサヒホールディングス	69,800	2,042.00	142,531,600	
稲葉製作所	9,800	1,375.00	13,475,000	
宮地エンジニアリンググループ	5,300	2,893.00	15,332,900	
トーカロ	45,000	1,604.00	72,180,000	
アルファC o	6,700	1,200.00	8,040,000	
SUMCO	268,300	2,525.00	677,457,500	
川田テクノロジーズ	3,600	3,875.00	13,950,000	
RS Technologies	5,700	7,110.00	40,527,000	
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,116.00	4,020,400	
信和	10,800	770.00	8,316,000	
東洋製罐グループホールディングス	111,000	1,458.00	161,838,000	
ホッカンホールディングス	9,600	1,467.00	14,083,200	
コロナ	9,600	906.00	8,697,600	
横河ブリッジホールディングス	29,900	2,190.00	65,481,000	
駒井ハルテック	3,300	1,634.00	5,392,200	
高田機工	1,600	2,722.00	4,355,200	

三和ホールディングス	164,400	1,321.00	217,172,400
文化シャッター	55,300	1,073.00	59,336,900
三協立山	22,500	726.00	16,335,000
アルインコ	12,700	954.00	12,115,800
東洋シャッター	3,800	634.00	2,409,200
L I X I L	274,400	3,015.00	827,316,000
日本フィルコン	12,100	569.00	6,884,900
ノーリツ	33,400	1,680.00	56,112,000
長府製作所	17,700	2,088.00	36,957,600
リンナイ	32,900	12,230.00	402,367,000
ダイニチ工業	8,300	806.00	6,689,800
日東精工	21,900	626.00	13,709,400
三洋工業	2,100	1,867.00	3,920,700
岡部	35,300	693.00	24,462,900
ジーテクト	21,600	1,389.00	30,002,400
東プレ	32,500	1,195.00	38,837,500
高周波熱錬	31,200	586.00	18,283,200
東京製網	10,700	811.00	8,677,700
サンコール	14,900	475.00	7,077,500
モリテック スチール	13,600	408.00	5,548,800
パイオラックス	25,800	1,713.00	44,195,400
エイチワン	17,100	679.00	11,610,900
日本発條	160,300	877.00	140,583,100
中央発條	8,400	923.00	7,753,200
アドバネクス	2,400	1,081.00	2,594,400
立川ブラインド工業	7,700	1,194.00	9,193,800
三益半導体工業	13,600	2,544.00	34,598,400
日本ドライケミカル	4,400	1,976.00	8,694,400
日本製鋼所	53,000	3,185.00	168,805,000
三浦工業	75,500	4,305.00	325,027,500
タクマ	59,300	1,542.00	91,440,600
ツガミ	42,400	1,589.00	67,373,600
オークマ	20,400	5,180.00	105,672,000
芝浦機械	19,800	3,290.00	65,142,000
アマダ	275,500	1,153.00	317,651,500
アイダエンジニアリング	46,000	1,004.00	46,184,000
滝澤鉄工所	5,100	1,125.00	5,737,500
F U J I	80,400	2,768.00	222,547,200
牧野フライス製作所	19,200	3,830.00	73,536,000
オーエスジー	80,800	1,899.00	153,439,200
ダイジェット工業	2,300	1,076.00	2,474,800
旭ダイヤモンド工業	46,300	659.00	30,511,700

DMG森精機	103,600	1,949.00	201,916,400
ソディック	38,700	833.00	32,237,100
ディスコ	25,700	33,700.00	866,090,000
日東工器	9,600	1,726.00	16,569,600
日進工具	13,800	1,579.00	21,790,200
パンチ工業	14,700	554.00	8,143,800
富士ダイス	8,900	650.00	5,785,000
豊和工業	9,400	822.00	7,726,800
OKK	6,700	544.00	3,644,800
東洋機械金属	11,600	532.00	6,171,200
津田駒工業	3,400	728.00	2,475,200
エンシュウ	4,400	672.00	2,956,800
島精機製作所	25,700	2,128.00	54,689,600
オプトラン	21,900	2,387.00	52,275,300
NCホールディングス	5,000	1,450.00	7,250,000
イワキポンプ	11,200	1,065.00	11,928,000
フリュー	15,600	1,342.00	20,935,200
ヤマシンフィルタ	35,300	608.00	21,462,400
日阪製作所	21,600	844.00	18,230,400
やまびこ	33,900	1,273.00	43,154,700
野村マイクロ・サイエンス	4,600	5,250.00	24,150,000
平田機工	8,300	6,520.00	54,116,000
ペガサスミシン製造	17,900	481.00	8,609,900
マルマエ	7,200	3,225.00	23,220,000
タツモ	8,200	1,814.00	14,874,800
ナプテスコ	99,500	3,615.00	359,692,500
三井海洋開発	18,600	1,557.00	28,960,200
レオン自動機	18,700	1,363.00	25,488,100
S M C	51,600	77,120.00	3,979,392,000
ホソカワミクロン	12,300	3,005.00	36,961,500
ユニオンツール	6,500	3,900.00	25,350,000
オイレス工業	24,500	1,701.00	41,674,500
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,170.00	18,703,000
サトーホールディングス	23,000	2,345.00	53,935,000
技研製作所	15,400	4,555.00	70,147,000
日本エアーテック	8,100	1,267.00	10,262,700
カワタ	5,600	935.00	5,236,000
日精樹脂工業	12,500	1,066.00	13,325,000
オカダアイヨン	5,600	1,425.00	7,980,000
ワイエイシイホールディングス	6,900	1,063.00	7,334,700
小松製作所	799,000	2,918.00	2,331,482,000
住友重機械工業	101,000	2,710.00	273,710,000



日立建機	70,700	3,730.00	263,711,000
日工	24,700	640.00	15,808,000
巴工業	7,000	2,310.00	16,170,000
井関農機	16,600	1,534.00	25,464,400
TOWA	15,100	3,500.00	52,850,000
丸山製作所	3,800	1,531.00	5,817,800
北川鉄工所	8,200	1,454.00	11,922,800
ローツェ	8,700	12,570.00	109,359,000
タカキタ	6,300	633.00	3,987,900
クボタ	860,000	2,484.50	2,136,670,000
荏原実業	8,200	2,664.00	21,844,800
三菱化工機	5,800	2,499.00	14,494,200
月島機械	32,800	1,166.00	38,244,800
帝国電機製作所	12,400	1,407.00	17,446,800
新東工業	39,300	717.00	28,178,100
澁谷工業	15,500	3,135.00	48,592,500
アイチ コーポレーション	26,200	808.00	21,169,600
小森コーポレーション	45,200	660.00	29,832,000
鶴見製作所	13,800	1,506.00	20,782,800
住友精密工業	2,700	2,316.00	6,253,200
日本ギア工業	6,700	281.00	1,882,700
酒井重工業	3,300	2,888.00	9,530,400
荏原製作所	73,200	6,470.00	473,604,000
石井鐵工所	2,600	2,993.00	7,781,800
西島製作所	16,400	911.00	14,940,400
北越工業	16,900	996.00	16,832,400
ダイキン工業	224,600	24,965.00	5,607,139,000
オルガノ	5,100	7,130.00	36,363,000
トーヨーカネツ	6,800	2,626.00	17,856,800
栗田工業	95,500	5,770.00	551,035,000
椿本チエイン	23,200	3,100.00	71,920,000
大同工業	8,200	909.00	7,453,800
木村化工機	15,200	1,022.00	15,534,400
アネスト岩田	27,500	863.00	23,732,500
ダイフク	97,000	10,080.00	977,760,000
サムコ	4,400	3,150.00	13,860,000
加藤製作所	8,800	860.00	7,568,000
油研工業	3,200	1,754.00	5,612,800
タダノ	92,400	1,167.00	107,830,800
フジテック	65,400	2,519.00	164,742,600
C K D	52,100	2,329.00	121,340,900
キトー	15,000	1,858.00	27,870,000

平和	49,200	1,932.00	95,054,400
理想科学工業	14,800	2,156.00	31,908,800
SANKYO	38,100	3,020.00	115,062,000
日本金銭機械	18,000	736.00	13,248,000
マースグループホールディングス	11,300	1,625.00	18,362,500
フクシマガリレイ	12,100	4,375.00	52,937,500
オーイズミ	6,500	335.00	2,177,500
ダイコク電機	8,200	1,221.00	10,012,200
竹内製作所	26,900	2,969.00	79,866,100
アマノ	46,200	2,708.00	125,109,600
JUKI	24,500	825.00	20,212,500
ジャノメ	15,100	665.00	10,041,500
マックス	23,500	1,852.00	43,522,000
グローリー	45,300	2,253.00	102,060,900
新晃工業	16,400	1,987.00	32,586,800
大和冷機工業	25,600	1,258.00	32,204,800
セガサミーホールディングス	174,900	1,947.00	340,530,300
日本ピストンリング	6,500	1,324.00	8,606,000
リケン	7,600	2,627.00	19,965,200
TPR	23,800	1,497.00	35,628,600
ツバキ・ナカシマ	38,700	1,480.00	57,276,000
ホシザキ	51,500	8,880.00	457,320,000
大豊工業	14,500	799.00	11,585,500
日本精工	332,000	775.00	257,300,000
NTN	378,800	235.00	89,018,000
ジェイテクト	169,200	1,082.00	183,074,400
不二越	15,000	4,275.00	64,125,000
日本トムソン	48,500	722.00	35,017,000
THK	102,600	2,735.00	280,611,000
ユーシン精機	13,800	771.00	10,639,800
前澤給装工業	13,300	1,032.00	13,725,600
イーグル工業	21,900	1,091.00	23,892,900
前澤工業	10,700	673.00	7,201,100
日本ピラー工業	17,900	3,280.00	58,712,000
キッツ	59,500	738.00	43,911,000
マキタ	214,600	5,279.00	1,132,873,400
三井E&Sホールディングス	63,700	407.00	25,925,900
日立造船	149,500	864.00	129,168,000
三菱重工業	277,100	2,848.50	789,319,350
IHI	110,200	2,563.00	282,442,600
スター精密	27,200	1,557.00	42,350,400
日清紡ホールディングス	107,800	859.00	92,600,200

イビデン	92,700	6,860.00	635,922,000
コニカミノルタ	387,100	488.00	188,904,800
ブラザー工業	215,800	2,105.00	454,259,000
ミネベアミツミ	304,200	3,215.00	978,003,000
日立製作所	847,800	7,289.00	6,179,614,200
東芝	308,100	4,685.00	1,443,448,500
三菱電機	1,762,700	1,523.00	2,684,592,100
富士電機	106,200	6,080.00	645,696,000
東洋電機製造	6,900	1,012.00	6,982,800
安川電機	189,700	5,290.00	1,003,513,000
シンフォニアテクノロジー	21,200	1,350.00	28,620,000
明電舎	29,900	2,778.00	83,062,200
オリジン	4,500	1,354.00	6,093,000
山洋電気	8,000	6,160.00	49,280,000
デンヨー	15,000	1,645.00	24,675,000
東芝テック	18,900	4,715.00	89,113,500
芝浦メカトロニクス	3,300	8,490.00	28,017,000
マブチモーター	41,600	3,965.00	164,944,000
日本電産	457,000	13,460.00	6,151,220,000
トレックス・セミコンダクター	9,300	3,685.00	34,270,500
東光高岳	10,600	1,409.00	14,935,400
ダイヘン	19,300	4,605.00	88,876,500
ヤーマン	29,700	1,157.00	34,362,900
JVCケンウッド	149,100	177.00	26,390,700
ミマキエンジニアリング	17,000	968.00	16,456,000
I - P E X	8,800	2,171.00	19,104,800
日新電機	41,300	1,485.00	61,330,500
大崎電気工業	32,400	493.00	15,973,200
オムロン	146,700	11,430.00	1,676,781,000
日東工業	23,500	1,585.00	37,247,500
I D E C	21,800	2,766.00	60,298,800
正興電機製作所	6,400	1,232.00	7,884,800
不二電機工業	4,200	1,265.00	5,313,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,300	2,400.00	142,320,000
サクサホールディングス	4,100	1,460.00	5,986,000
メルコホールディングス	5,100	4,110.00	20,961,000
テクノメディカ	4,700	1,670.00	7,849,000
日本電気	224,000	5,280.00	1,182,720,000
富士通	158,600	20,605.00	3,267,953,000
沖電気工業	71,600	919.00	65,800,400
岩崎通信機	7,400	877.00	6,489,800
電気興業	9,300	2,616.00	24,328,800

サンケン電気	16,500	5,990.00	98,835,000
ナカヨ	3,300	1,332.00	4,395,600
アイホン	10,000	2,193.00	21,930,000
ルネサスエレクトロニクス	955,000	1,561.00	1,490,755,000
セイコーエプソン	218,700	1,922.00	420,341,400
ワコム	138,200	900.00	124,380,000
アルバック	32,400	6,980.00	226,152,000
アクセル	9,000	890.00	8,010,000
E I Z O	13,700	4,160.00	56,992,000
日本信号	44,900	915.00	41,083,500
京三製作所	37,800	464.00	17,539,200
能美防災	23,800	2,102.00	50,027,600
ホーチキ	13,700	1,299.00	17,796,300
星和電機	10,200	527.00	5,375,400
エレコム	41,000	1,479.00	60,639,000
パナソニック	1,880,200	1,383.50	2,601,256,700
シャープ	200,900	1,366.00	274,429,400
アンリツ	113,500	1,920.00	217,920,000
富士通ゼネラル	47,900	2,790.00	133,641,000
ソニーグループ	1,104,300	14,345.00	15,841,183,500
T D K	255,600	4,815.00	1,230,714,000
帝国通信工業	8,600	1,334.00	11,472,400
タムラ製作所	67,900	743.00	50,449,700
アルプスアルパイン	156,900	1,114.00	174,786,600
池上通信機	5,300	743.00	3,937,900
鈴木	9,100	972.00	8,845,200
メイコー	14,700	4,015.00	59,020,500
日本トリム	3,600	3,430.00	12,348,000
ローランド ディー . ジー .	10,800	2,810.00	30,348,000
フォスター電機	17,800	786.00	13,990,800
S M K	4,100	2,463.00	10,098,300
ヨコオ	13,500	2,796.00	37,746,000
ホシデン	43,500	1,299.00	56,506,500
ヒロセ電機	27,200	19,950.00	542,640,000
日本航空電子工業	40,400	1,873.00	75,669,200
T O A	19,300	795.00	15,343,500
マクセル	35,800	1,371.00	49,081,800
古野電気	21,900	1,230.00	26,937,000
ユニデンホールディングス	3,900	3,380.00	13,182,000
スミダコーポレーション	17,400	1,303.00	22,672,200
アイコム	6,700	2,297.00	15,389,900
リオン	7,200	2,288.00	16,473,600

本多通信工業	16,100	457.00	7,357,700
横河電機	176,400	2,285.00	403,074,000
新電元工業	6,800	3,780.00	25,704,000
アズビル	103,300	5,420.00	559,886,000
東亜ディーケーケー	10,000	857.00	8,570,000
日本光電工業	73,100	3,505.00	256,215,500
チノー	5,600	1,510.00	8,456,000
共和電業	16,900	401.00	6,776,900
日本電子材料	8,600	2,295.00	19,737,000
堀場製作所	32,600	7,300.00	237,980,000
アドバンテスト	131,000	10,430.00	1,366,330,000
小野測器	9,500	509.00	4,835,500
エスペック	14,800	2,272.00	33,625,600
キーエンス	159,700	74,640.00	11,920,008,000
日置電機	8,600	9,370.00	80,582,000
シスメックス	149,100	14,665.00	2,186,551,500
日本マイクロニクス	31,400	1,849.00	58,058,600
メガチップス	16,700	4,900.00	81,830,000
O B A R A G R O U P	8,300	3,500.00	29,050,000
澤藤電機	2,700	1,923.00	5,192,100
原田工業	9,400	970.00	9,118,000
コーセル	22,700	928.00	21,065,600
イリソ電子工業	15,000	5,110.00	76,650,000
オブテックスグループ	29,700	1,563.00	46,421,100
千代田インテグレ	7,900	2,297.00	18,146,300
アイ・オー・データ機器	7,700	860.00	6,622,000
レーザーテック	77,400	31,960.00	2,473,704,000
スタンレー電気	123,700	3,300.00	408,210,000
岩崎電気	7,000	2,303.00	16,121,000
ウシオ電機	90,900	2,244.00	203,979,600
岡谷電機産業	15,900	336.00	5,342,400
ヘリオス テクノ ホールディング	18,700	302.00	5,647,400
エノモト	5,500	1,853.00	10,191,500
日本セラミック	16,800	2,976.00	49,996,800
遠藤照明	9,100	1,158.00	10,537,800
古河電池	13,300	1,616.00	21,492,800
双信電機	9,100	664.00	6,042,400
山一電機	13,400	2,336.00	31,302,400
図研	11,700	4,035.00	47,209,500
日本電子	36,800	9,370.00	344,816,000
カシオ計算機	127,600	1,605.00	204,798,000
ファナック	154,700	23,355.00	3,613,018,500

日本シイエムケイ	37,200	518.00	19,269,600
エンプラス	4,700	2,716.00	12,765,200
大真空	24,800	1,694.00	42,011,200
ローム	79,000	11,370.00	898,230,000
浜松ホトニクス	126,600	7,340.00	929,244,000
三井ハイテック	17,400	9,360.00	162,864,000
新光電気工業	52,000	5,270.00	274,040,000
京セラ	248,200	7,132.00	1,770,162,400
太陽誘電	85,700	6,870.00	588,759,000
村田製作所	517,900	8,951.00	4,635,722,900
双葉電子工業	31,600	741.00	23,415,600
北陸電気工業	7,700	1,263.00	9,725,100
ニチコン	56,500	1,181.00	66,726,500
日本ケミコン	16,700	1,921.00	32,080,700
K O A	27,300	1,678.00	45,809,400
市光工業	23,100	553.00	12,774,300
小糸製作所	97,000	7,320.00	710,040,000
ミツバ	32,400	506.00	16,394,400
S C R E E Nホールディングス	30,600	12,140.00	371,484,000
キャノン電子	16,900	1,617.00	27,327,300
キャノン	875,900	2,612.50	2,288,288,750
リコー	489,200	1,071.00	523,933,200
象印マホービン	48,400	1,649.00	79,811,600
M U T O Hホールディングス	2,900	1,708.00	4,953,200
東京エレクトロン	111,900	62,820.00	7,029,558,000
トヨタ紡織	71,900	2,382.00	171,265,800
芦森工業	3,300	958.00	3,161,400
ユニプレス	26,300	800.00	21,040,000
豊田自動織機	142,700	10,180.00	1,452,686,000
モリタホールディングス	28,200	1,348.00	38,013,600
三櫻工業	24,400	1,031.00	25,156,400
デンソー	388,100	9,031.00	3,504,931,100
東海理化電機製作所	46,400	1,657.00	76,884,800
川崎重工業	128,700	2,086.00	268,468,200
名村造船所	52,900	203.00	10,738,700
日本車輛製造	6,400	2,059.00	13,177,600
三菱ロジスネクスト	23,300	1,144.00	26,655,200
近畿車輛	2,700	1,045.00	2,821,500
日産自動車	2,079,000	636.20	1,322,659,800
いすゞ自動車	553,100	1,662.00	919,252,200
トヨタ自動車	8,929,000	2,132.50	19,041,092,500
日野自動車	220,100	1,060.00	233,306,000

三菱自動車工業	652,500	388.00	253,170,000
エフテック	12,300	554.00	6,814,200
レシップホールディングス	7,000	571.00	3,997,000
G M B	3,200	773.00	2,473,600
ファルテック	3,100	699.00	2,166,900
武蔵精密工業	39,300	2,047.00	80,447,100
日産車体	25,800	714.00	18,421,200
新明和工業	49,800	904.00	45,019,200
極東開発工業	32,700	1,444.00	47,218,800
トピー工業	14,500	1,103.00	15,993,500
ティラド	5,000	3,025.00	15,125,000
曙ブレーキ工業	96,800	204.00	19,747,200
タチエス	30,900	1,174.00	36,276,600
N O K	85,300	1,329.00	113,363,700
フタバ産業	44,100	413.00	18,213,300
K Y B	18,300	3,165.00	57,919,500
大同メタル工業	33,800	605.00	20,449,000
プレス工業	87,400	415.00	36,271,000
ミクニ	22,400	315.00	7,056,000
太平洋工業	36,900	1,162.00	42,877,800
河西工業	21,600	313.00	6,760,800
アイシン	129,000	4,575.00	590,175,000
マツダ	553,200	1,046.00	578,647,200
今仙電機製作所	12,100	586.00	7,090,600
本田技研工業	1,387,900	3,324.00	4,613,379,600
スズキ	403,200	5,332.00	2,149,862,400
S U B A R U	505,200	2,308.00	1,166,001,600
安永	8,500	1,043.00	8,865,500
ヤマハ発動機	230,000	3,040.00	699,200,000
T B K	20,000	407.00	8,140,000
エクセディ	26,600	1,750.00	46,550,000
豊田合成	56,900	2,463.00	140,144,700
愛三工業	27,600	825.00	22,770,000
盟和産業	2,600	991.00	2,576,600
日本プラスト	13,800	531.00	7,327,800
ヨロズ	16,500	1,133.00	18,694,500
エフ・シー・シー	28,800	1,566.00	45,100,800
シマノ	71,000	32,990.00	2,342,290,000
テイ・エス テック	74,400	1,453.00	108,103,200
ジャムコ	10,300	977.00	10,063,100
テルモ	498,800	5,014.00	2,500,983,200
クリエートメディック	5,300	985.00	5,220,500

日機装	52,900	925.00	48,932,500
日本エム・ディ・エム	10,200	2,286.00	23,317,200
島津製作所	226,900	4,890.00	1,109,541,000
JMS	14,900	646.00	9,625,400
長野計器	12,800	1,819.00	23,283,200
ブイ・テクノロジー	7,700	3,720.00	28,644,000
東京計器	11,200	1,039.00	11,636,800
愛知時計電機	2,500	4,490.00	11,225,000
インターアクション	8,800	2,517.00	22,149,600
オーバル	15,900	263.00	4,181,700
東京精密	29,800	5,140.00	153,172,000
マニー	70,200	1,808.00	126,921,600
ニコン	269,200	1,186.00	319,271,200
トプコン	82,900	2,027.00	168,038,300
オリンパス	924,400	2,631.50	2,432,558,600
理研計器	14,300	4,990.00	71,357,000
タムロン	13,700	2,594.00	35,537,800
HOYA	344,000	18,965.00	6,523,960,000
シード	8,300	604.00	5,013,200
ノーリツ鋼機	15,900	2,310.00	36,729,000
エー・アンド・デイ	16,100	1,336.00	21,509,600
朝日インテック	193,300	2,841.00	549,165,300
シチズン時計	206,500	503.00	103,869,500
リズム	5,500	1,247.00	6,858,500
大研医器	14,000	565.00	7,910,000
メニコン	58,400	4,010.00	234,184,000
シンシア	1,900	559.00	1,062,100
松風	7,400	2,102.00	15,554,800
セイコーホールディングス	24,900	2,429.00	60,482,100
ニプロ	131,400	1,139.00	149,664,600
中本パックス	4,900	1,667.00	8,168,300
スノーピーク	11,500	8,880.00	102,120,000
パラマウントベッドホールディングス	33,800	1,978.00	66,856,400
トランザクション	9,600	1,103.00	10,588,800
粧美堂	5,100	390.00	1,989,000
ニホンフラッシュ	15,100	1,159.00	17,500,900
前田工織	19,400	3,670.00	71,198,000
永大産業	23,000	284.00	6,532,000
アートネイチャー	15,100	654.00	9,875,400
バンダイナムコホールディングス	157,900	9,269.00	1,463,575,100
アイフィスジャパン	4,500	650.00	2,925,000
共立印刷	29,500	148.00	4,366,000



SHOEI	16,500	5,350.00	88,275,000
フランスベッドホールディングス	22,700	880.00	19,976,000
パイロットコーポレーション	29,700	4,190.00	124,443,000
萩原工業	11,400	1,465.00	16,701,000
トッパン・フォームズ	25,200	1,546.00	38,959,200
フジシールインターナショナル	42,800	2,218.00	94,930,400
タカラトミー	73,800	1,076.00	79,408,800
広済堂ホールディングス	10,900	887.00	9,668,300
エステールホールディングス	4,500	639.00	2,875,500
タカノ	6,000	692.00	4,152,000
プロネクサス	13,700	1,049.00	14,371,300
ホクシン	12,400	171.00	2,120,400
ウッドワン	5,400	1,018.00	5,497,200
大建工業	10,400	2,332.00	24,252,800
凸版印刷	267,900	1,839.00	492,668,100
大日本印刷	208,300	2,772.00	577,407,600
共同印刷	5,400	2,766.00	14,936,400
NISSHA	36,200	1,732.00	62,698,400
光村印刷	1,500	1,486.00	2,229,000
TAKARA & COMPANY	8,600	1,798.00	15,462,800
アシックス	155,900	3,020.00	470,818,000
ツツミ	4,400	2,237.00	9,842,800
ローランド	12,200	4,775.00	58,255,000
小松ウオール工業	5,400	1,903.00	10,276,200
ヤマハ	104,800	6,420.00	672,816,000
河合楽器製作所	4,900	3,380.00	16,562,000
クリナップ	16,400	518.00	8,495,200
ピジョン	106,500	2,408.00	256,452,000
兼松サステック	1,100	1,779.00	1,956,900
キングジム	14,200	884.00	12,552,800
リンテック	37,800	2,659.00	100,510,200
イトーキ	32,500	359.00	11,667,500
任天堂	99,500	51,940.00	5,168,030,000
三菱鉛筆	29,000	1,184.00	34,336,000
タカラスタンダード	36,400	1,402.00	51,032,800
コクヨ	84,600	1,774.00	150,080,400
ナカバヤシ	16,000	518.00	8,288,000
グローブライド	15,800	3,535.00	55,853,000
オカムラ	60,600	1,335.00	80,901,000
美津濃	17,500	2,340.00	40,950,000
東京電力ホールディングス	1,319,300	307.00	405,025,100
中部電力	539,300	1,168.00	629,902,400

関西電力	667,900	1,028.00	686,601,200
中国電力	275,500	884.00	243,542,000
北陸電力	161,200	561.00	90,433,200
東北電力	412,800	756.00	312,076,800
四国電力	158,700	752.00	119,342,400
九州電力	363,300	814.00	295,726,200
北海道電力	153,200	471.00	72,157,200
沖縄電力	37,400	1,385.00	51,799,000
電源開発	150,300	1,439.00	216,281,700
エフオン	10,700	688.00	7,361,600
イーレックス	25,900	2,703.00	70,007,700
レノバ	34,400	5,480.00	188,512,000
東京瓦斯	337,900	1,957.00	661,270,300
大阪瓦斯	319,300	1,821.00	581,445,300
東邦瓦斯	80,900	3,190.00	258,071,000
北海道瓦斯	8,700	1,499.00	13,041,300
広島ガス	33,800	360.00	12,168,000
西部ガスホールディングス	19,800	2,183.00	43,223,400
静岡ガス	45,900	1,017.00	46,680,300
メタウォーター	19,800	2,011.00	39,817,800
SBSホールディングス	13,000	3,570.00	46,410,000
東武鉄道	172,200	2,722.00	468,728,400
相鉄ホールディングス	56,400	2,076.00	117,086,400
東急	444,600	1,685.00	749,151,000
京浜急行電鉄	226,400	1,240.00	280,736,000
小田急電鉄	262,200	2,257.00	591,785,400
京王電鉄	91,500	5,280.00	483,120,000
京成電鉄	122,700	3,575.00	438,652,500
富士急行	21,000	4,965.00	104,265,000
新京成電鉄	4,100	2,035.00	8,343,500
東日本旅客鉄道	310,300	7,018.00	2,177,685,400
西日本旅客鉄道	213,700	5,201.00	1,111,453,700
東海旅客鉄道	146,600	16,755.00	2,456,283,000
西武ホールディングス	230,100	1,252.00	288,085,200
鴻池運輸	28,100	1,148.00	32,258,800
西日本鉄道	48,900	2,697.00	131,883,300
ハマキョウレックス	12,500	2,998.00	37,475,000
サカイ引越センター	8,100	4,380.00	35,478,000
近鉄グループホールディングス	167,000	3,435.00	573,645,000
阪急阪神ホールディングス	208,700	3,510.00	732,537,000
南海電気鉄道	74,500	2,201.00	163,974,500
京阪ホールディングス	74,300	2,816.00	209,228,800

神戸電鉄	4,000	3,435.00	13,740,000
名古屋鉄道	137,300	1,832.00	251,533,600
山陽電気鉄道	12,800	1,965.00	25,152,000
アルプス物流	11,600	984.00	11,414,400
日本通運	57,800	6,830.00	394,774,000
ヤマトホールディングス	233,900	2,620.00	612,818,000
山九	46,400	4,685.00	217,384,000
丸運	9,500	262.00	2,489,000
丸全昭和運輸	13,500	3,310.00	44,685,000
センコーグループホールディングス	83,700	940.00	78,678,000
トナミホールディングス	4,000	3,655.00	14,620,000
ニッコンホールディングス	56,000	2,118.00	118,608,000
日本石油輸送	1,800	2,687.00	4,836,600
福山通運	27,500	4,095.00	112,612,500
セイノーホールディングス	113,700	1,222.00	138,941,400
エスライン	5,000	914.00	4,570,000
神奈川中央交通	4,100	3,370.00	13,817,000
日立物流	32,200	4,560.00	146,832,000
丸和運輸機関	35,300	1,483.00	52,349,900
C & F ロジホールディングス	16,900	1,600.00	27,040,000
九州旅客鉄道	129,100	2,582.00	333,336,200
S Gホールディングス	315,400	2,653.00	836,756,200
日本郵船	140,000	7,280.00	1,019,200,000
商船三井	92,900	6,290.00	584,341,000
川崎汽船	51,400	4,670.00	240,038,000
N S ユナイテッド海運	10,000	3,135.00	31,350,000
飯野海運	83,400	507.00	42,283,800
共栄タンカー	6,100	841.00	5,130,100
乾汽船	11,400	2,031.00	23,153,400
日本航空	382,800	2,388.00	914,126,400
A N Aホールディングス	424,100	2,671.50	1,132,983,150
パスコ	3,200	1,404.00	4,492,800
トランコム	4,700	8,470.00	39,809,000
日新	13,300	1,694.00	22,530,200
三菱倉庫	53,000	2,936.00	155,608,000
三井倉庫ホールディングス	17,700	2,341.00	41,435,700
住友倉庫	59,000	1,913.00	112,867,000
澁澤倉庫	10,000	2,142.00	21,420,000
東陽倉庫	28,000	327.00	9,156,000
日本トランスシティ	36,700	589.00	21,616,300
ケイヒン	3,000	1,341.00	4,023,000
中央倉庫	10,200	973.00	9,924,600

川西倉庫	3,100	1,205.00	3,735,500
安田倉庫	13,700	959.00	13,138,300
ファイブホールディングス	3,600	609.00	2,192,400
東洋埠頭	5,100	1,417.00	7,226,700
宇徳	11,900	520.00	6,188,000
上組	91,800	2,189.00	200,950,200
サンリツ	4,600	844.00	3,882,400
キムラユニティー	4,500	1,280.00	5,760,000
キューソー流通システム	4,200	1,996.00	8,383,200
近鉄エクスプレス	31,500	2,775.00	87,412,500
東海運	9,500	300.00	2,850,000
エーアイティー	10,500	1,189.00	12,484,500
内外トランスライン	6,400	1,891.00	12,102,400
日本コンセプト	5,300	1,917.00	10,160,100
NEC ネットズエスアイ	57,300	1,929.00	110,531,700
クロスキャット	4,700	1,566.00	7,360,200
システナ	61,800	2,078.00	128,420,400
デジタルアーツ	9,300	10,370.00	96,441,000
日鉄ソリューションズ	25,100	3,545.00	88,979,500
キューブシステム	8,900	987.00	8,784,300
WOW WORLD	2,600	1,567.00	4,074,200
コア	7,400	1,650.00	12,210,000
ラクーンホールディングス	12,400	1,691.00	20,968,400
ソリトンシステムズ	8,800	1,269.00	11,167,200
ソフトクリエイイトホールディングス	7,600	4,300.00	32,680,000
T I S	165,000	3,480.00	574,200,000
J N Sホールディングス	8,000	479.00	3,832,000
グリー	106,300	1,015.00	107,894,500
G M Oペパボ	1,900	2,691.00	5,112,900
コーエーテクモホールディングス	55,200	5,120.00	282,624,000
三菱総合研究所	7,500	3,905.00	29,287,500
電算	2,000	2,381.00	4,762,000
A G S	9,000	869.00	7,821,000
ファインデックス	14,800	1,097.00	16,235,600
ブレインパッド	4,500	6,360.00	28,620,000
K L a b	31,700	666.00	21,112,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	25,200	1,010.00	25,452,000
ネクソン	389,800	2,545.00	992,041,000
アイスタイル	53,200	319.00	16,970,800
エムアップホールディングス	5,000	4,740.00	23,700,000
エイチーム	12,000	1,324.00	15,888,000
エニグモ	18,900	1,045.00	19,750,500

テクノスジャパン	13,700	569.00	7,795,300
コロプラ	57,100	754.00	43,053,400
ブロードリーフ	86,100	547.00	47,096,700
クロス・マーケティンググループ	6,800	1,229.00	8,357,200
デジタルハーツホールディングス	8,000	2,444.00	19,552,000
システム情報	13,200	1,027.00	13,556,400
メディアドゥ	6,100	4,810.00	29,341,000
じげん	49,400	345.00	17,043,000
ブイキューブ	17,600	1,247.00	21,947,200
エンカレッジ・テクノロジー	4,100	653.00	2,677,300
サイバーリンクス	5,900	1,211.00	7,144,900
フィックスターズ	18,700	952.00	17,802,400
CARTA HOLDINGS	7,000	2,315.00	16,205,000
オブティム	12,200	1,619.00	19,751,800
セレス	6,400	2,468.00	15,795,200
SHIFT	8,700	28,680.00	249,516,000
ティーガイア	15,400	1,773.00	27,304,200
セック	2,600	2,408.00	6,260,800
テクマトリックス	29,300	2,041.00	59,801,300
プロシップ	5,800	1,665.00	9,657,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,000	2,854.00	134,138,000
GMOペイメントゲートウェイ	33,500	16,160.00	541,360,000
ザッパラス	7,100	577.00	4,096,700
システムリサーチ	5,100	1,961.00	10,001,100
インターネットイニシアティブ	46,100	4,800.00	221,280,000
さくらインターネット	18,900	571.00	10,791,900
ヴィンクス	5,000	920.00	4,600,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,330.00	16,887,000
SRAホールディングス	8,400	2,952.00	24,796,800
システムインテグレータ	5,800	599.00	3,474,200
朝日ネット	16,000	662.00	10,592,000
eBASE	20,900	680.00	14,212,000
アバント	18,600	1,460.00	27,156,000
アドソル日進	6,300	1,949.00	12,278,700
ODKソリューションズ	3,900	678.00	2,644,200
フリービット	10,400	1,291.00	13,426,400
コムチュア	19,500	3,405.00	66,397,500
サイバーコム	2,800	1,270.00	3,556,000
アステリア	12,700	929.00	11,798,300
アイル	9,700	1,623.00	15,743,100
マークラインズ	8,700	3,190.00	27,753,000
メディカル・データ・ビジョン	22,000	1,502.00	33,044,000

g u m i	24,200	931.00	22,530,200
ショーケース	4,100	584.00	2,394,400
モバイルファクトリー	4,100	1,122.00	4,600,200
テラスカイ	6,400	2,377.00	15,212,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,551.00	12,097,800
P C Iホールディングス	7,900	1,193.00	9,424,700
パイプドHD	3,200	2,636.00	8,435,200
アイビーシー	3,000	793.00	2,379,000
ネオジャパン	5,000	1,385.00	6,925,000
P R T I M E S	3,700	3,575.00	13,227,500
ラクス	59,600	3,465.00	206,514,000
ランドコンピュータ	4,200	863.00	3,624,600
ダブルスタンダード	5,300	4,485.00	23,770,500
オープンドア	10,300	2,200.00	22,660,000
マイネット	6,200	729.00	4,519,800
アカツキ	7,800	2,995.00	23,361,000
ベネフィットジャパン	1,400	2,879.00	4,030,600
U b i c o mホールディングス	4,600	3,070.00	14,122,000
カナミックネットワーク	18,800	551.00	10,358,800
ノムラシステムコーポレーション	9,500	265.00	2,517,500
チェンジ	31,900	2,370.00	75,603,000
シンクロ・フード	9,300	405.00	3,766,500
オークネット	9,300	1,785.00	16,600,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	807.00	2,985,900
セグエグループ	4,700	800.00	3,760,000
エイトレッド	2,500	2,363.00	5,907,500
マクロミル	35,600	916.00	32,609,600
ビーグリー	4,200	1,795.00	7,539,000
オロ	5,500	3,600.00	19,800,000
ユーザーローカル	5,300	1,900.00	10,070,000
テモナ	4,000	543.00	2,172,000
ニーズウェル	4,200	615.00	2,583,000
マネーフォワード	26,300	8,240.00	216,712,000
サインポスト	5,500	1,594.00	8,767,000
電算システムホールディングス	7,200	2,455.00	17,676,000
ソルクシーズ	15,000	498.00	7,470,000
フェイス	5,200	648.00	3,369,600
プロトコーポレーション	18,500	1,367.00	25,289,500
ハイマックス	4,800	1,150.00	5,520,000
野村総合研究所	334,300	4,995.00	1,669,828,500
サイバネットシステム	12,600	717.00	9,034,200
C Eホールディングス	9,500	505.00	4,797,500

日本システム技術	3,500	2,919.00	10,216,500
インテージホールディングス	21,700	1,977.00	42,900,900
東邦システムサイエンス	4,700	993.00	4,667,100
ソースネクスト	75,500	209.00	15,779,500
インフォコム	19,000	2,089.00	39,691,000
シンプレクス・ホールディングス	18,000	2,970.00	53,460,000
HEROZ	5,000	1,635.00	8,175,000
ラクスル	18,900	7,040.00	133,056,000
I P S	4,900	2,180.00	10,682,000
F I G	19,400	350.00	6,790,000
システムサポート	5,300	1,315.00	6,969,500
イーソル	10,800	754.00	8,143,200
アルテリア・ネットワークス	22,000	1,633.00	35,926,000
E d u L a b	1,600	1,396.00	2,233,600
東海ソフト	2,900	1,113.00	3,227,700
ウイングアーク1 s t	9,900	2,126.00	21,047,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,718.00	10,872,000
サーバーワークス	3,000	4,075.00	12,225,000
東名	1,800	1,167.00	2,100,600
ヴィッツ	1,700	1,521.00	2,585,700
トピラシステムズ	3,600	985.00	3,546,000
S a n s a n	15,400	13,270.00	204,358,000
L i n k - U	3,200	1,185.00	3,792,000
ギフトィ	15,100	3,425.00	51,717,500
ベース	3,000	4,675.00	14,025,000
フォーカスシステムズ	11,800	1,112.00	13,121,600
クレスコ	12,700	2,055.00	26,098,500
フジ・メディア・ホールディングス	166,800	1,245.00	207,666,000
オービック	54,500	21,620.00	1,178,290,000
ジャストシステム	24,600	5,710.00	140,466,000
T D C ソフト	15,300	1,267.00	19,385,100
Zホールディングス	2,514,400	825.50	2,075,637,200
トレンドマイクロ	92,500	6,780.00	627,150,000
I Dホールディングス	11,100	882.00	9,790,200
日本オラクル	35,100	10,750.00	377,325,000
アルファシステムズ	4,700	4,000.00	18,800,000
フューチャー	18,300	4,145.00	75,853,500
C A C H o l d i n g s	10,200	1,597.00	16,289,400
S B テクノロジー	7,500	2,907.00	21,802,500
トーセ	4,900	746.00	3,655,400
オービックビジネスコンサルタント	16,500	5,290.00	87,285,000
伊藤忠テクノソリューションズ	78,900	3,760.00	296,664,000

アイティフォー	21,200	833.00	17,659,600
東計電算	2,100	4,935.00	10,363,500
エクスネット	2,900	1,004.00	2,911,600
大塚商会	93,600	5,460.00	511,056,000
サイボウズ	23,200	2,343.00	54,357,600
電通国際情報サービス	25,000	3,865.00	96,625,000
A C C E S S	19,700	845.00	16,646,500
デジタルガレージ	28,600	5,280.00	151,008,000
E Mシステムズ	28,800	771.00	22,204,800
ウェザーニューズ	5,200	9,730.00	50,596,000
C I J	11,400	835.00	9,519,000
ビジネスエンジニアリング	2,000	3,485.00	6,970,000
日本エンタープライズ	18,500	195.00	3,607,500
WOWOW	8,400	2,117.00	17,782,800
スカラ	15,700	632.00	9,922,400
インテリジェント ウェイブ	10,400	547.00	5,688,800
I M A G I C A G R O U P	15,000	817.00	12,255,000
ネットワンシステムズ	65,900	3,585.00	236,251,500
システムソフト	38,200	130.00	4,966,000
アルゴグラフィックス	13,500	3,030.00	40,905,000
マーベラス	27,500	758.00	20,845,000
エイベックス	30,000	1,840.00	55,200,000
日本ユニシス	54,100	3,490.00	188,809,000
兼松エレクトロニクス	9,500	3,715.00	35,292,500
都築電気	8,900	1,874.00	16,678,600
T B S ホールディングス	105,300	1,930.00	203,229,000
日本テレビホールディングス	144,500	1,266.00	182,937,000
朝日放送グループホールディングス	17,400	703.00	12,232,200
テレビ朝日ホールディングス	41,700	1,664.00	69,388,800
スカパーJ S A Tホールディングス	146,900	425.00	62,432,500
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,145.00	26,812,500
日本BS放送	6,000	1,116.00	6,696,000
ビジョン	29,700	1,480.00	43,956,000
スマートバリュー	4,800	569.00	2,731,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,500	3,490.00	57,585,000
ワイヤレスゲート	7,600	340.00	2,584,000
コネクシオ	12,400	1,486.00	18,426,400
クロップス	3,400	1,107.00	3,763,800
日本電信電話	2,023,200	3,184.00	6,441,868,800
K D D I	1,261,100	3,410.00	4,300,351,000
ソフトバンク	2,620,100	1,589.50	4,164,648,950
光通信	20,400	18,600.00	379,440,000



エムティーアイ	17,000	641.00	10,897,000
GMOインターネット	61,300	3,125.00	191,562,500
ファイバーゲート	5,700	1,224.00	6,976,800
アйдママーケティングコミュニケーション	4,200	331.00	1,390,200
KADOKAWA	50,500	6,580.00	332,290,000
学研ホールディングス	24,600	1,055.00	25,953,000
ゼンリン	28,400	1,010.00	28,684,000
昭文社ホールディングス	7,400	492.00	3,640,800
インプレスホールディングス	14,300	221.00	3,160,300
アイネット	9,000	1,398.00	12,582,000
松竹	11,500	11,820.00	135,930,000
東宝	102,100	5,300.00	541,130,000
東映	5,700	20,310.00	115,767,000
エヌ・ティ・ティ・データ	460,600	2,532.00	1,166,239,200
ピー・シー・エー	10,200	1,599.00	16,309,800
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,841.00	11,046,000
D T S	33,200	2,408.00	79,945,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,500	6,560.00	528,080,000
シーイーシー	18,700	1,323.00	24,740,100
カブコン	163,100	3,060.00	499,086,000
アイ・エス・ビー	8,200	1,111.00	9,110,200
ジャステック	10,200	1,268.00	12,933,600
S C S K	119,800	2,215.00	265,357,000
日本システムウエア	6,600	2,362.00	15,589,200
アイネス	15,800	1,473.00	23,273,400
T K C	29,300	3,405.00	99,766,500
富士ソフト	18,500	5,570.00	103,045,000
N S D	55,700	2,193.00	122,150,100
コナミホールディングス	62,900	6,280.00	395,012,000
福井コンピュータホールディングス	8,000	3,950.00	31,600,000
J B C Cホールディングス	11,800	1,846.00	21,782,800
ミロク情報サービス	15,300	1,690.00	25,857,000
ソフトバンクグループ	1,037,300	6,856.00	7,111,728,800
ハウスイ	1,400	919.00	1,286,600
高千穂交易	6,700	1,269.00	8,502,300
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,570.00	4,396,000
伊藤忠食品	4,200	5,100.00	21,420,000
エレマテック	13,900	1,027.00	14,275,300
J A L U X	4,900	2,554.00	12,514,600
あらた	13,800	4,120.00	56,856,000
トーメンデバイス	2,600	6,810.00	17,706,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	7,300.00	37,960,000

フィールズ	15,200	532.00	8,086,400
双日	191,800	1,686.00	323,374,800
アルフレッサ ホールディングス	193,000	1,588.00	306,484,000
横浜冷凍	48,700	844.00	41,102,800
ラサ商事	9,200	919.00	8,454,800
アルコニックス	18,500	1,614.00	29,859,000
神戸物産	134,800	4,465.00	601,882,000
ハイパー	4,400	553.00	2,433,200
あい ホールディングス	24,800	2,082.00	51,633,600
ディーブイエックス	5,900	1,080.00	6,372,000
ダイワボウホールディングス	84,400	1,999.00	168,715,600
マクニカ・富士エレホールディングス	41,400	2,775.00	114,885,000
ラクト・ジャパン	6,000	2,585.00	15,510,000
グリムス	7,700	2,878.00	22,160,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,200	810.00	24,462,000
八洲電機	12,600	911.00	11,478,600
メディアスホールディングス	9,900	945.00	9,355,500
レスターホールディングス	16,500	1,933.00	31,894,500
ジューテックホールディングス	4,000	1,116.00	4,464,000
大光	6,700	704.00	4,716,800
OCHIホールディングス	5,100	1,285.00	6,553,500
TOKAIホールディングス	84,100	877.00	73,755,700
黒谷	4,800	632.00	3,033,600
Cominix	3,100	724.00	2,244,400
三洋貿易	17,500	998.00	17,465,000
ビューティガレージ	2,800	4,220.00	11,816,000
ウイン・パートナーズ	12,600	930.00	11,718,000
ミタチ産業	4,800	921.00	4,420,800
シップヘルスケアホールディングス	55,700	2,688.00	149,721,600
明治電機工業	5,600	1,296.00	7,257,600
デリカフーズホールディングス	6,800	611.00	4,154,800
スターティアホールディングス	4,000	1,284.00	5,136,000
コメダホールディングス	37,900	2,017.00	76,444,300
ピーバンドットコム	2,400	624.00	1,497,600
アセンテック	6,000	1,236.00	7,416,000
富士興産	4,300	1,076.00	4,626,800
協栄産業	1,800	1,525.00	2,745,000
フルサト・マルカホールディングス	16,700	2,070.00	34,569,000
ヤマエグループホールディングス	11,700	1,071.00	12,530,700
小野建	16,800	1,613.00	27,098,400
南陽	3,500	1,956.00	6,846,000
佐島電機	10,800	1,069.00	11,545,200

エコトレーディング	3,700	621.00	2,297,700
伯東	10,600	2,241.00	23,754,600
コンドーテック	13,400	993.00	13,306,200
中山福	9,200	375.00	3,450,000
ナガイレーベン	23,000	2,438.00	56,074,000
三菱食品	16,700	2,815.00	47,010,500
松田産業	12,700	2,997.00	38,061,900
第一興商	33,000	4,080.00	134,640,000
メディカルホールディングス	187,400	2,029.00	380,234,600
S P K	6,900	1,360.00	9,384,000
萩原電気ホールディングス	6,400	2,085.00	13,344,000
アズワン	12,500	15,040.00	188,000,000
スズデン	6,000	1,703.00	10,218,000
尾家産業	4,900	1,065.00	5,218,500
シモジマ	10,700	1,120.00	11,984,000
ドウシシャ	16,400	1,605.00	26,322,000
小津産業	3,800	1,903.00	7,231,400
高速	10,400	1,554.00	16,161,600
たけびし	6,500	1,472.00	9,568,000
リックス	3,900	1,502.00	5,857,800
丸文	15,400	938.00	14,445,200
ハピネット	14,500	1,494.00	21,663,000
橋本総業ホールディングス	3,500	2,071.00	7,248,500
日本ライフライン	51,500	1,145.00	58,967,500
タカショー	13,200	860.00	11,352,000
I D O M	52,700	717.00	37,785,900
進和	10,300	2,050.00	21,115,000
エスケイジャパン	4,300	480.00	2,064,000
ダイトロン	7,300	2,117.00	15,454,100
シークス	24,900	1,363.00	33,938,700
田中商事	5,400	648.00	3,499,200
オーハシテクニカ	9,700	1,553.00	15,064,100
白銅	5,600	2,450.00	13,720,000
ダイコー通産	2,100	1,288.00	2,704,800
伊藤忠商事	1,214,400	3,386.00	4,111,958,400
丸紅	1,712,600	1,034.50	1,771,684,700
高島	2,700	2,205.00	5,953,500
長瀬産業	95,300	1,747.00	166,489,100
蝶理	9,700	1,807.00	17,527,900
豊田通商	174,400	5,470.00	953,968,000
三共生興	23,100	555.00	12,820,500
兼松	64,700	1,293.00	83,657,100

ツカモトコーポレーション	2,900	1,348.00	3,909,200
三井物産	1,348,300	2,698.50	3,638,387,550
日本紙パルプ商事	9,100	3,880.00	35,308,000
カメイ	20,600	1,018.00	20,970,800
東都水産	900	4,705.00	4,234,500
OUGホールディングス	2,500	2,530.00	6,325,000
スターゼン	12,800	1,945.00	24,896,000
山善	73,100	1,029.00	75,219,900
椿本興業	3,600	3,795.00	13,662,000
住友商事	1,095,800	1,668.50	1,828,342,300
内田洋行	7,400	4,775.00	35,335,000
三菱商事	1,301,000	3,492.00	4,543,092,000
第一実業	7,900	5,130.00	40,527,000
キャノンマーケティングジャパン	43,100	2,349.00	101,241,900
西華産業	9,100	1,645.00	14,969,500
佐藤商事	14,400	1,174.00	16,905,600
菱洋エレクトロ	10,300	2,393.00	24,647,900
東京産業	15,800	785.00	12,403,000
ユアサ商事	16,500	2,969.00	48,988,500
神鋼商事	3,900	3,315.00	12,928,500
トルク	9,400	218.00	2,049,200
阪和興業	34,800	3,275.00	113,970,000
正栄食品工業	11,200	4,065.00	45,528,000
カナデン	14,100	1,055.00	14,875,500
菱電商事	13,800	1,750.00	24,150,000
岩谷産業	41,700	6,240.00	260,208,000
ナイス	6,000	1,741.00	10,446,000
ニチモウ	2,600	2,155.00	5,603,000
極東貿易	5,000	2,504.00	12,520,000
アステナホールディングス	24,500	565.00	13,842,500
三愛石油	42,800	1,217.00	52,087,600
稲畑産業	38,300	1,606.00	61,509,800
G S I クレオス	8,300	893.00	7,411,900
明和産業	16,100	831.00	13,379,100
クワザワホールディングス	6,900	596.00	4,112,400
ワキタ	37,100	1,037.00	38,472,700
東邦ホールディングス	55,700	1,725.00	96,082,500
サンゲツ	46,300	1,576.00	72,968,800
ミツウロコグループホールディングス	25,600	1,264.00	32,358,400
シナネンホールディングス	6,400	3,395.00	21,728,000
伊藤忠エネクス	38,400	976.00	37,478,400
サンリオ	53,600	2,799.00	150,026,400

サンワテクノス	10,600	1,723.00	18,263,800
リョーサン	19,200	2,261.00	43,411,200
新光商事	26,000	903.00	23,478,000
トーホー	7,900	1,493.00	11,794,700
三信電気	8,000	1,522.00	12,176,000
東陽テクニカ	17,200	1,157.00	19,900,400
モスフードサービス	22,800	3,125.00	71,250,000
加賀電子	15,700	3,040.00	47,728,000
ソーダニッカ	18,000	663.00	11,934,000
立花エレテック	13,900	1,595.00	22,170,500
フォーバル	7,600	1,041.00	7,911,600
PALTAC	24,400	4,830.00	117,852,000
三谷産業	20,400	312.00	6,364,800
西本Wismettacホールディングス	3,900	3,500.00	13,650,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,982.00	3,171,200
コア商事ホールディングス	13,100	628.00	8,226,800
国際紙パルプ商事	37,100	437.00	16,212,700
ヤマタネ	8,100	1,578.00	12,781,800
丸紅建材リース	1,600	1,833.00	2,932,800
日鉄物産	12,400	4,820.00	59,768,000
泉州電業	4,900	4,585.00	22,466,500
トラスコ中山	36,100	2,836.00	102,379,600
オートバックスセブン	58,400	1,378.00	80,475,200
モリト	12,700	687.00	8,724,900
加藤産業	25,100	3,185.00	79,943,500
北恵	4,400	932.00	4,100,800
イノテック	10,500	1,469.00	15,424,500
イエローハット	30,100	1,640.00	49,364,000
JKホールディングス	14,000	1,066.00	14,924,000
日伝	14,400	2,292.00	33,004,800
北沢産業	11,900	251.00	2,986,900
杉本商事	8,100	2,260.00	18,306,000
因幡電機産業	46,300	2,605.00	120,611,500
東テク	5,800	2,500.00	14,500,000
ミスミグループ本社	217,800	5,130.00	1,117,314,000
アルテック	11,800	308.00	3,634,400
タキヒヨー	5,200	1,738.00	9,037,600
蔵王産業	3,400	1,857.00	6,313,800
スズケン	67,900	3,055.00	207,434,500
ジェコス	12,000	792.00	9,504,000
グローセル	20,300	412.00	8,363,600
ローソン	38,500	5,740.00	220,990,000

サンエー	13,200	4,290.00	56,628,000
カワチ薬品	13,600	2,246.00	30,545,600
エービーシー・マート	27,200	5,560.00	151,232,000
ハードオフコーポレーション	8,200	742.00	6,084,400
アスクル	28,300	1,540.00	43,582,000
ゲオホールディングス	23,600	1,185.00	27,966,000
アダストリア	18,900	1,990.00	37,611,000
くら寿司	18,200	4,060.00	73,892,000
キャンドウ	8,400	2,559.00	21,495,600
アイケイ	5,800	468.00	2,714,400
パルグループホールディングス	15,500	1,600.00	24,800,000
エディオン	80,100	1,030.00	82,503,000
サーラコーポレーション	35,900	625.00	22,437,500
ワッツ	9,000	752.00	6,768,000
ハローズ	8,100	2,734.00	22,145,400
フジオフードグループ本社	14,600	1,401.00	20,454,600
あみやき亭	4,300	2,998.00	12,891,400
大黒天物産	5,600	6,400.00	35,840,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,093.00	15,411,300
ファーマライズホールディングス	4,700	767.00	3,604,900
アルペン	13,400	2,336.00	31,302,400
ハブ	6,200	709.00	4,395,800
クオールホールディングス	21,500	1,436.00	30,874,000
ジーンズホールディングス	11,900	7,010.00	83,419,000
ビックカメラ	103,400	998.00	103,193,200
D C Mホールディングス	107,500	1,093.00	117,497,500
Monotaro	219,600	2,361.00	518,475,600
東京一番フーズ	5,100	595.00	3,034,500
きちりホールディングス	4,600	533.00	2,451,800
アークランドサービスホールディングス	12,900	2,292.00	29,566,800
J.フロント リテイリング	207,700	1,000.00	207,700,000
ドトール・日レスホールディングス	30,200	1,619.00	48,893,800
マツキヨココカラ&カンパニー	106,900	4,645.00	496,550,500
ブロンコビリー	10,100	2,430.00	24,543,000
Z O Z O	119,500	3,805.00	454,697,500
トレジャー・ファクトリー	5,500	963.00	5,296,500
物語コーポレーション	9,300	7,730.00	71,889,000
三越伊勢丹ホールディングス	304,400	813.00	247,477,200
Hamee	4,800	1,239.00	5,947,200
マーケットエンタープライズ	1,700	866.00	1,472,200
ウエルシアホールディングス	91,900	4,220.00	387,818,000
クリエイトSDホールディングス	25,700	3,390.00	87,123,000

丸善C H Iホールディングス	20,300	375.00	7,612,500
ミサワ	4,100	697.00	2,857,700
ティーライフ	2,600	1,473.00	3,829,800
チムニー	5,300	1,384.00	7,335,200
シュッピン	14,800	1,045.00	15,466,000
オイシックス・ラ・大地	25,100	3,590.00	90,109,000
ネクステージ	35,300	2,248.00	79,354,400
ジョイフル本田	51,100	1,646.00	84,110,600
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,877.00	12,388,200
ホットランド	13,300	1,352.00	17,981,600
すかいらーくホールディングス	224,400	1,532.00	343,780,800
S F Pホールディングス	8,500	1,462.00	12,427,000
綿半ホールディングス	13,400	1,236.00	16,562,400
ヨシックスホールディングス	3,600	2,126.00	7,653,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,800	1,035.00	52,578,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,047.00	9,737,100
B E E N O S	8,900	3,125.00	27,812,500
あさひ	14,700	1,349.00	19,830,300
日本調剤	10,800	1,400.00	15,120,000
コスモス薬品	17,500	19,050.00	333,375,000
トーエル	8,900	802.00	7,137,800
セブン&アイ・ホールディングス	679,200	4,821.00	3,274,423,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	82,900	702.00	58,195,800
ツルハホールディングス	37,900	13,970.00	529,463,000
サンマルクホールディングス	14,000	1,456.00	20,384,000
フェリシモ	4,100	1,488.00	6,100,800
トリドールホールディングス	43,300	2,438.00	105,565,400
T O K Y O B A S E	16,500	779.00	12,853,500
ウイルプラスホールディングス	3,100	976.00	3,025,600
J Mホールディングス	11,900	1,840.00	21,896,000
サツドラホールディングス	8,400	725.00	6,090,000
アレンザホールディングス	13,600	1,107.00	15,055,200
串カツ田中ホールディングス	4,800	2,307.00	11,073,600
パロックジャパンリミテッド	12,500	877.00	10,962,500
クスリのアオキホールディングス	17,300	7,460.00	129,058,000
力の源ホールディングス	8,900	617.00	5,491,300
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,700	5,240.00	532,908,000
メディカルシステムネットワーク	17,400	617.00	10,735,800
はるやまホールディングス	8,800	569.00	5,007,200
ノジマ	28,200	2,275.00	64,155,000

カップ・クリエイト	24,300	1,405.00	34,141,500
ライトオン	13,000	712.00	9,256,000
良品計画	200,000	2,017.00	403,400,000
三城ホールディングス	23,100	255.00	5,890,500
アドヴァングループ	18,100	953.00	17,249,300
アルビス	5,800	2,271.00	13,171,800
コナカ	20,500	337.00	6,908,500
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,660.00	3,984,000
G - 7ホールディングス	19,500	1,727.00	33,676,500
イオン北海道	30,700	1,449.00	44,484,300
コジマ	30,600	556.00	17,013,600
ヒマラヤ	6,500	986.00	6,409,000
コーナン商事	24,800	3,550.00	88,040,000
エコス	6,600	1,849.00	12,203,400
ワタミ	21,000	930.00	19,530,000
マルシェ	4,200	433.00	1,818,600
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	347,200	2,198.00	763,145,600
西松屋チェーン	38,400	1,505.00	57,792,000
ゼンショーホールディングス	84,900	2,676.00	227,192,400
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,455.00	16,005,000
ハークスレイ	8,100	464.00	3,758,400
サイゼリヤ	25,900	2,966.00	76,819,400
V Tホールディングス	66,200	461.00	30,518,200
魚力	5,100	2,001.00	10,205,100
フジ・コーポレーション	9,500	1,209.00	11,485,500
ユナイテッドアローズ	18,400	1,963.00	36,119,200
ハイデイ日高	25,300	1,640.00	41,492,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,000	212.00	2,544,000
コロワイド	71,300	1,660.00	118,358,000
ピーシーデボコーポレーション	21,100	371.00	7,828,100
壱番屋	12,300	4,605.00	56,641,500
P L A N T	5,000	716.00	3,580,000
スギホールディングス	34,700	7,600.00	263,720,000
薬王堂ホールディングス	8,800	2,250.00	19,800,000
スクロール	27,200	831.00	22,603,200
ヨンドシーホールディングス	16,200	1,630.00	26,406,000
木曽路	23,000	2,203.00	50,669,000
S R Sホールディングス	24,000	774.00	18,576,000
リテールパートナーズ	21,400	1,266.00	27,092,400
ケーヨー	32,300	820.00	26,486,000
上新電機	20,100	2,151.00	43,235,100



日本瓦斯	84,700	1,518.00	128,574,600
ロイヤルホールディングス	29,800	1,920.00	57,216,000
いなげや	21,600	1,388.00	29,980,800
チヨダ	17,500	764.00	13,370,000
ライフコーポレーション	16,300	3,565.00	58,109,500
リンガーハット	21,400	2,223.00	47,572,200
MrMaxHD	22,400	570.00	12,768,000
AOKIホールディングス	34,200	652.00	22,298,400
オークワ	27,400	999.00	27,372,600
コメリ	27,000	2,591.00	69,957,000
青山商事	36,400	761.00	27,700,400
しまむら	20,200	9,710.00	196,142,000
はせがわ	10,800	253.00	2,732,400
高島屋	126,700	1,060.00	134,302,000
松屋	35,200	913.00	32,137,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,400	839.00	69,133,600
近鉄百貨店	6,800	2,603.00	17,700,400
丸井グループ	147,000	2,288.00	336,336,000
アクシアル リテイリング	13,600	3,395.00	46,172,000
イオン	668,100	2,708.00	1,809,214,800
イズミ	31,400	3,460.00	108,644,000
平和堂	32,100	1,926.00	61,824,600
フジ	21,100	1,968.00	41,524,800
ヤオコー	19,700	7,050.00	138,885,000
ゼビオホールディングス	24,000	919.00	22,056,000
ケーズホールディングス	160,400	1,211.00	194,244,400
Olympicグループ	9,500	705.00	6,697,500
日産東京販売ホールディングス	27,200	235.00	6,392,000
シルバーライフ	3,800	1,325.00	5,035,000
Genky DrugStores	7,700	5,310.00	40,887,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,200	1,153.00	4,842,600
ブックオフグループホールディングス	10,100	996.00	10,059,600
ギフト	2,900	3,030.00	8,787,000
アインホールディングス	25,300	6,030.00	152,559,000
元気寿司	5,000	2,638.00	13,190,000
ヤマダホールディングス	635,800	414.00	263,221,200
アークランドサカモト	27,400	1,781.00	48,799,400
ニトリホールディングス	68,900	20,630.00	1,421,407,000
グルメ杵屋	14,200	1,000.00	14,200,000
愛眼	12,700	199.00	2,527,300
ケーユーホールディングス	9,400	1,019.00	9,578,600
吉野家ホールディングス	60,800	2,294.00	139,475,200

松屋フーズホールディングス	8,500	3,520.00	29,920,000
サガミホールディングス	26,900	1,052.00	28,298,800
関西スーパーマーケット	13,300	1,561.00	20,761,300
王将フードサービス	11,500	6,140.00	70,610,000
プレナス	19,600	1,982.00	38,847,200
ミニストップ	13,000	1,391.00	18,083,000
アークス	33,300	2,166.00	72,127,800
パローホールディングス	38,600	2,289.00	88,355,400
ベルク	7,800	5,350.00	41,730,000
大庄	9,700	999.00	9,690,300
ファーストリテイリング	23,200	73,770.00	1,711,464,000
サンドラッグ	65,400	3,145.00	205,683,000
サックスパー ホールディングス	17,100	564.00	9,644,400
ヤマザワ	4,300	1,725.00	7,417,500
やまや	3,600	2,387.00	8,593,200
ベルーナ	37,800	716.00	27,064,800
島根銀行	5,800	561.00	3,253,800
じもとホールディングス	12,400	644.00	7,985,600
めぶきフィナンシャルグループ	903,400	230.00	207,782,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	1,411.00	30,759,800
九州フィナンシャルグループ	355,000	397.00	140,935,000
ゆうちょ銀行	410,400	938.00	384,955,200
富山第一銀行	41,400	282.00	11,674,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	993,000	439.00	435,927,000
西日本フィナンシャルホールディングス	113,500	743.00	84,330,500
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,387.00	22,330,700
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,449.00	69,306,700
ひろぎんホールディングス	256,400	636.00	163,070,400
おきなわフィナンシャルグループ	15,700	2,079.00	32,640,300
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,035.00	47,415,500
北國フィナンシャルホールディングス	16,200	1,981.00	32,092,200
新生銀行	113,400	1,833.00	207,862,200
あおぞら銀行	97,100	2,575.00	250,032,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,149,900	637.20	7,104,716,280
りそなホールディングス	1,990,000	426.90	849,531,000
三井住友トラスト・ホールディングス	328,600	3,626.00	1,191,503,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,203,500	3,887.00	4,678,004,500
千葉銀行	580,200	675.00	391,635,000
群馬銀行	334,000	343.00	114,562,000
武蔵野銀行	25,900	1,643.00	42,553,700
千葉興業銀行	40,900	259.00	10,593,100
筑波銀行	67,800	165.00	11,187,000

七十七銀行	54,500	1,219.00	66,435,500
青森銀行	13,500	1,753.00	23,665,500
秋田銀行	11,100	1,475.00	16,372,500
山形銀行	19,500	834.00	16,263,000
岩手銀行	11,400	1,628.00	18,559,200
東邦銀行	145,100	201.00	29,165,100
東北銀行	8,300	998.00	8,283,400
みちのく銀行	11,200	820.00	9,184,000
ふくおかフィナンシャルグループ	146,500	1,943.00	284,649,500
静岡銀行	423,400	852.00	360,736,800
スルガ銀行	152,500	455.00	69,387,500
八十二銀行	391,600	373.00	146,066,800
山梨中央銀行	18,800	813.00	15,284,400
大垣共立銀行	34,300	1,859.00	63,763,700
福井銀行	14,900	1,444.00	21,515,600
清水銀行	7,200	1,541.00	11,095,200
富山銀行	3,100	1,880.00	5,828,000
滋賀銀行	32,700	1,836.00	60,037,200
南都銀行	27,100	1,884.00	51,056,400
百五銀行	166,900	326.00	54,409,400
京都銀行	62,300	4,965.00	309,319,500
紀陽銀行	61,600	1,418.00	87,348,800
ほくほくフィナンシャルグループ	108,500	815.00	88,427,500
山陰合同銀行	103,100	590.00	60,829,000
中国銀行	138,900	859.00	119,315,100
鳥取銀行	5,500	1,111.00	6,110,500
伊予銀行	230,400	553.00	127,411,200
百十四銀行	18,500	1,386.00	25,641,000
四国銀行	26,400	719.00	18,981,600
阿波銀行	26,600	2,118.00	56,338,800
大分銀行	10,000	1,788.00	17,880,000
宮崎銀行	10,900	1,998.00	21,778,200
佐賀銀行	9,800	1,398.00	13,700,400
琉球銀行	37,700	742.00	27,973,400
セブン銀行	516,300	233.00	120,297,900
みずほフィナンシャルグループ	2,223,500	1,458.50	3,242,974,750
高知銀行	6,300	744.00	4,687,200
山口フィナンシャルグループ	202,500	662.00	134,055,000
長野銀行	5,700	1,078.00	6,144,600
名古屋銀行	13,000	2,201.00	28,613,000
北洋銀行	262,100	228.00	59,758,800
愛知銀行	6,300	3,535.00	22,270,500

中京銀行	6,300	1,277.00	8,045,100
大光銀行	6,000	1,314.00	7,884,000
愛媛銀行	24,300	755.00	18,346,500
トマト銀行	6,300	1,045.00	6,583,500
京葉銀行	74,100	442.00	32,752,200
栃木銀行	84,000	175.00	14,700,000
北日本銀行	5,400	1,501.00	8,105,400
東和銀行	30,500	497.00	15,158,500
福島銀行	19,900	218.00	4,338,200
大東銀行	8,300	673.00	5,585,900
トモニホールディングス	134,400	298.00	40,051,200
フィデアホールディングス	15,900	1,217.00	19,350,300
池田泉州ホールディングス	199,900	152.00	30,384,800
F P G	58,800	579.00	34,045,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,210.00	16,456,000
マーキュリアホールディングス	6,100	745.00	4,544,500
S B Iホールディングス	214,500	2,935.00	629,557,500
ジャフコ グループ	22,200	7,460.00	165,612,000
大和証券グループ本社	1,302,400	637.90	830,800,960
野村ホールディングス	2,654,900	489.60	1,299,839,040
岡三証券グループ	137,300	386.00	52,997,800
丸三証券	52,000	535.00	27,820,000
東洋証券	58,700	150.00	8,805,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	200,200	390.00	78,078,000
光世証券	4,000	536.00	2,144,000
水戸証券	47,100	282.00	13,282,200
いちよし証券	32,800	634.00	20,795,200
松井証券	85,400	810.00	69,174,000
マネックスグループ	142,000	809.00	114,878,000
極東証券	23,600	755.00	17,818,000
岩井コスモホールディングス	16,600	1,347.00	22,360,200
アイザワ証券グループ	28,800	1,040.00	29,952,000
マネーパートナーズグループ	19,400	240.00	4,656,000
スパークス・グループ	81,000	324.00	26,244,000
かんぽ生命保険	175,000	1,801.00	315,175,000
S O M P Oホールディングス	306,500	4,860.00	1,489,590,000
アニコム ホールディングス	53,400	814.00	43,467,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	389,900	3,547.00	1,382,975,300
第一生命ホールディングス	855,800	2,316.50	1,982,460,700
東京海上ホールディングス	572,600	5,910.00	3,384,066,000
T & Dホールディングス	451,300	1,414.00	638,138,200
アドバンスクリエイト	8,300	1,031.00	8,557,300

全国保証	41,600	5,140.00	213,824,000
あんしん保証	6,900	326.00	2,249,400
イントラスト	8,000	771.00	6,168,000
日本モーゲージサービス	10,200	1,076.00	10,975,200
C a s a	6,700	910.00	6,097,000
アルヒ	26,100	1,025.00	26,752,500
プレミアグループ	8,900	3,615.00	32,173,500
クレディセゾン	112,000	1,229.00	137,648,000
芙蓉総合リース	18,300	7,740.00	141,642,000
みずほリース	27,000	3,140.00	84,780,000
東京センチュリー	33,700	5,840.00	196,808,000
日本証券金融	68,900	844.00	58,151,600
アイフル	293,200	395.00	115,814,000
リコーリース	15,500	3,655.00	56,652,500
イオンフィナンシャルサービス	94,900	1,345.00	127,640,500
アコム	344,400	363.00	125,017,200
ジャックス	19,400	2,888.00	56,027,200
オリエントコーポレーション	473,800	133.00	63,015,400
オリックス	1,055,700	2,343.00	2,473,505,100
三菱HCキャピタル	643,200	555.00	356,976,000
九州リースサービス	9,400	582.00	5,470,800
日本取引所グループ	440,500	2,423.50	1,067,551,750
イー・ギャランティ	25,700	2,585.00	66,434,500
アサックス	9,800	699.00	6,850,200
NECキャピタルソリューション	7,300	1,982.00	14,468,600
いちご	201,200	313.00	62,975,600
日本駐車場開発	208,400	142.00	29,592,800
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,421.00	15,773,100
SREホールディングス	4,600	9,470.00	43,562,000
ADワークスグループ	34,700	160.00	5,552,000
ヒューリック	417,600	1,121.00	468,129,600
三栄建築設計	8,400	1,743.00	14,641,200
野村不動産ホールディングス	90,800	2,677.00	243,071,600
三重交通グループホールディングス	40,400	475.00	19,190,000
サムティ	29,000	2,526.00	73,254,000
ディア・ライフ	26,800	610.00	16,348,000
日本商業開発	12,500	1,765.00	22,062,500
プレサンスコーポレーション	24,000	1,712.00	41,088,000
ハウスコム	5,000	1,286.00	6,430,000
日本管理センター	10,600	1,126.00	11,935,600
サンセイランディック	8,200	813.00	6,666,600
フージャースホールディングス	23,300	666.00	15,517,800

オープンハウス	55,600	7,020.00	390,312,000
東急不動産ホールディングス	516,000	647.00	333,852,000
飯田グループホールディングス	145,900	2,535.00	369,856,500
イーランド	4,400	1,673.00	7,361,200
ムゲンエステート	15,900	504.00	8,013,600
ハウスドゥ	8,600	1,023.00	8,797,800
シーアールイー	6,200	1,756.00	10,887,200
ケイアイスター不動産	8,000	9,320.00	74,560,000
グッドコムアセット	9,500	1,370.00	13,015,000
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,900.00	12,760,000
テンポイノベーション	7,600	905.00	6,878,000
フェイスネットワーク	3,600	1,252.00	4,507,200
パーク24	94,800	1,852.00	175,569,600
パラカ	6,100	1,596.00	9,735,600
三井不動産	793,600	2,540.50	2,016,140,800
三菱地所	1,143,800	1,654.50	1,892,417,100
平和不動産	30,500	3,385.00	103,242,500
東京建物	173,200	1,670.00	289,244,000
ダイビル	45,700	1,533.00	70,058,100
京阪神ビルディング	29,700	1,420.00	42,174,000
住友不動産	365,400	3,884.00	1,419,213,600
テオーシー	35,400	606.00	21,452,400
東京楽天地	3,500	4,060.00	14,210,000
スターツコーポレーション	24,600	2,652.00	65,239,200
フジ住宅	23,900	672.00	16,060,800
空港施設	22,100	556.00	12,287,600
明和地所	12,400	592.00	7,340,800
ゴールドクレスト	15,300	1,535.00	23,485,500
エスリード	8,300	1,656.00	13,744,800
日神グループホールディングス	33,300	488.00	16,250,400
日本エスコン	32,400	822.00	26,632,800
タカラレーベン	72,800	280.00	20,384,000
A V A N T I A	12,000	856.00	10,272,000
イオンモール	88,700	1,712.00	151,854,400
毎日コムネット	9,200	782.00	7,194,400
ファースト住建	8,600	1,233.00	10,603,800
カチタス	43,700	4,705.00	205,608,500
トーセイ	26,300	1,054.00	27,720,200
穴吹興産	5,000	2,005.00	10,025,000
サンフロンティア不動産	26,400	1,011.00	26,690,400
FJネクストホールディングス	19,600	1,040.00	20,384,000
インテリックス	3,900	720.00	2,808,000

ランドビジネス	7,300	264.00	1,927,200
サンネクスタグループ	8,000	988.00	7,904,000
グランディハウス	17,100	492.00	8,413,200
日本空港ビルデング	66,700	5,850.00	390,195,000
明豊ファシリティワークス	8,100	894.00	7,241,400
日本工営	10,000	3,485.00	34,850,000
L I F U L L	52,500	276.00	14,490,000
ミクシィ	38,700	2,283.00	88,352,100
ジェイエイシーリクルートメント	13,800	2,266.00	31,270,800
日本M&Aセンターホールディングス	276,400	3,700.00	1,022,680,000
メンバーズ	5,100	2,545.00	12,979,500
中広	3,600	403.00	1,450,800
UTグループ	24,400	4,475.00	109,190,000
アイティメディア	8,100	2,183.00	17,682,300
E・Jホールディングス	9,100	1,281.00	11,657,100
夢真ビーネックスグループ	45,100	1,709.00	77,075,900
コシダカホールディングス	45,600	665.00	30,324,000
アルトナー	4,500	851.00	3,829,500
パソナグループ	18,400	3,730.00	68,632,000
C D S	4,400	1,607.00	7,070,800
リンクアンドモチベーション	37,100	895.00	33,204,500
エス・エム・エス	57,300	4,565.00	261,574,500
サニーサイドアップグループ	6,300	778.00	4,901,400
パーソルホールディングス	168,500	3,600.00	606,600,000
リニカル	9,900	917.00	9,078,300
クックパッド	54,500	243.00	13,243,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,700	665.00	5,785,500
学情	7,100	1,279.00	9,080,900
スタジオアリス	7,700	2,169.00	16,701,300
シミックホールディングス	9,600	1,564.00	15,014,400
エプコ	4,000	839.00	3,356,000
N J S	3,900	1,978.00	7,714,200
総合警備保障	67,100	5,140.00	344,894,000
カカクコム	124,500	3,650.00	454,425,000
アイロムグループ	6,100	1,818.00	11,089,800
セントケア・ホールディング	11,300	824.00	9,311,200
サイネックス	3,400	672.00	2,284,800
ルネサンス	12,000	1,288.00	15,456,000
ディップ	29,700	4,665.00	138,550,500
デジタルホールディングス	11,900	1,520.00	18,088,000
新日本科学	20,800	1,780.00	37,024,000
キャリアデザインセンター	4,600	1,079.00	4,963,400

ベネフィット・ワン	61,300	5,630.00	345,119,000
エムスリー	297,300	6,408.00	1,905,098,400
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	321.00	3,434,700
アウトソーシング	96,700	1,556.00	150,465,200
ウェルネット	17,700	499.00	8,832,300
ワールドホールディングス	6,900	2,691.00	18,567,900
ディー・エヌ・エー	64,300	1,798.00	115,611,400
博報堂D Yホールディングス	234,700	1,774.00	416,357,800
ぐるなび	28,300	557.00	15,763,100
タカミヤ	21,200	442.00	9,370,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	1,042.00	11,878,800
ファンコミュニケーションズ	42,900	425.00	18,232,500
ライク	4,700	1,808.00	8,497,600
ビジネス・ブレークスルー	7,100	460.00	3,266,000
エスプール	47,900	1,301.00	62,317,900
WDBホールディングス	7,800	3,390.00	26,442,000
手間いらず	2,200	6,130.00	13,486,000
ティア	10,600	445.00	4,717,000
C D G	2,000	1,469.00	2,938,000
アドウェイズ	25,500	888.00	22,644,000
バリューコマース	13,300	4,755.00	63,241,500
インフォマート	184,900	1,071.00	198,027,900
J Pホールディングス	44,700	260.00	11,622,000
エコナックホールディングス	34,300	101.00	3,464,300
レッグス	3,800	1,513.00	5,749,400
プレステージ・インターナショナル	63,600	731.00	46,491,600
アミューズ	9,300	2,021.00	18,795,300
ドリームインキュベータ	5,000	829.00	4,145,000
クイック	11,800	1,460.00	17,228,000
T A C	10,700	239.00	2,557,300
電通グループ	173,700	4,015.00	697,405,500
イオンファンタジー	6,700	1,900.00	12,730,000
シーティーエス	19,500	832.00	16,224,000
ネクシィーズグループ	6,300	826.00	5,203,800
H . U . グループホールディングス	44,100	2,677.00	118,055,700
アルプス技研	15,100	2,012.00	30,381,200
ダイオーズ	3,700	1,074.00	3,973,800
日本空調サービス	18,100	786.00	14,226,600
オリエンタルランド	199,100	19,230.00	3,828,693,000
ダスキン	39,200	2,670.00	104,664,000
明光ネットワークジャパン	20,400	555.00	11,322,000
ファルコホールディングス	8,200	1,734.00	14,218,800



ラウンドワン	47,300	1,460.00	69,058,000
リゾートトラスト	77,400	2,078.00	160,837,200
ビー・エム・エル	21,800	3,670.00	80,006,000
りらいあコミュニケーションズ	25,900	1,107.00	28,671,300
リソー教育	77,700	434.00	33,721,800
早稲田アカデミー	9,700	1,003.00	9,729,100
ユー・エス・エス	188,800	1,803.00	340,406,400
東京個別指導学院	15,400	656.00	10,102,400
サイバーエージェント	415,300	2,160.00	897,048,000
楽天グループ	865,200	1,247.00	1,078,904,400
クリーク・アンド・リバー社	9,000	2,184.00	19,656,000
モーニングスター	30,200	569.00	17,183,800
テー・オー・ダブリュー	30,600	348.00	10,648,800
山田コンサルティンググループ	9,000	1,185.00	10,665,000
セントラルスポーツ	6,400	2,583.00	16,531,200
フルキャストホールディングス	14,500	2,941.00	42,644,500
エン・ジャパン	27,300	3,935.00	107,425,500
リソルホールディングス	1,900	4,135.00	7,856,500
テクノプロ・ホールディングス	101,000	3,675.00	371,175,000
アトラグループ	3,700	300.00	1,110,000
インターワークス	5,700	411.00	2,342,700
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	7,880.00	61,464,000
Keeper 技研	10,900	2,855.00	31,119,500
ファーストロジック	3,700	732.00	2,708,400
三機サービス	3,600	999.00	3,596,400
Gunosy	11,100	632.00	7,015,200
デザインワン・ジャパン	5,700	216.00	1,231,200
イー・ガーディアン	7,000	3,710.00	25,970,000
リブセンス	10,800	211.00	2,278,800
ジャパンマテリアル	52,000	1,514.00	78,728,000
ベクトル	23,900	1,361.00	32,527,900
ウチヤマホールディングス	9,300	345.00	3,208,500
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,551.00	19,697,700
キャリアリンク	6,400	1,365.00	8,736,000
I B J	14,100	1,130.00	15,933,000
アサンテ	7,600	1,720.00	13,072,000
バリューHR	6,900	2,309.00	15,932,100
M&Aキャピタルパートナーズ	13,900	6,030.00	83,817,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,513.00	10,288,400
E R Iホールディングス	4,900	1,444.00	7,075,600
アビスト	2,700	2,849.00	7,692,300
シグマクシス・ホールディングス	10,300	3,150.00	32,445,000

ウィルグループ	12,700	1,583.00	20,104,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,300	180.00	4,374,000
メドピア	13,100	3,785.00	49,583,500
レアジョブ	3,500	1,027.00	3,594,500
リクルートホールディングス	1,299,500	7,593.00	9,867,103,500
エラン	23,500	1,230.00	28,905,000
土木管理総合試験所	8,800	341.00	3,000,800
ネットマーケティング	8,900	504.00	4,485,600
日本郵政	2,200,000	868.60	1,910,920,000
ベルシステム24ホールディングス	24,400	1,403.00	34,233,200
鎌倉新書	19,600	905.00	17,738,000
S MN	4,100	660.00	2,706,000
グローバルキッズCOMPANY	3,500	856.00	2,996,000
エアトリ	11,000	3,625.00	39,875,000
アトラエ	11,900	2,702.00	32,153,800
ストライク	6,400	5,900.00	37,760,000
ソラスト	41,600	1,294.00	53,830,400
セラク	5,500	1,934.00	10,637,000
インソース	16,500	2,630.00	43,395,000
バイカレント・コンサルティング	11,900	53,100.00	631,890,000
Orchestra Holdings	3,300	4,890.00	16,137,000
アイモバイル	5,000	1,420.00	7,100,000
キャリアインデックス	6,100	1,199.00	7,313,900
MS - Japan	7,200	1,009.00	7,264,800
船場	3,800	797.00	3,028,600
グレイステクノロジー	22,100	486.00	10,740,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	53,600	2,283.00	122,368,800
フルテック	2,600	1,470.00	3,822,000
GameWith	5,700	527.00	3,003,900
ソウルドアウト	4,300	1,209.00	5,198,700
MS&Consulting	3,000	721.00	2,163,000
ウェルビー	11,300	1,505.00	17,006,500
エル・ティー・エス	2,300	2,980.00	6,854,000
ミダックホールディングス	7,400	5,400.00	39,960,000
日総工産	13,700	822.00	11,261,400
キュービーネットホールディングス	7,900	1,908.00	15,073,200
RPAホールディングス	24,500	422.00	10,339,000
スプリックス	5,100	1,532.00	7,813,200
マネジメントソリューションズ	8,300	3,440.00	28,552,000
プロレド・パートナーズ	4,000	1,288.00	5,152,000
テノ・ホールディングス	2,500	743.00	1,857,500
フロンティア・マネジメント	4,800	895.00	4,296,000

ピアラ	3,200	712.00	2,278,400
コプロ・ホールディングス	3,600	1,346.00	4,845,600
ギークス	3,100	2,162.00	6,702,200
カーブスホールディングス	46,700	883.00	41,236,100
フォーラムエンジニアリング	12,100	853.00	10,321,300
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	3,995.00	36,354,500
ポピンズホールディングス	4,000	3,610.00	14,440,000
L I T A L I C O	13,700	4,135.00	56,649,500
アドバンテッジリスクマネジメント	8,900	752.00	6,692,800
リログループ	92,200	2,402.00	221,464,400
東祥	12,800	1,980.00	25,344,000
T R Eホールディングス	23,200	1,847.00	42,850,400
人・夢・技術グループ	6,900	1,905.00	13,144,500
エイチ・アイ・エス	37,600	2,294.00	86,254,400
ラックランド	4,900	2,980.00	14,602,000
共立メンテナンス	30,100	4,510.00	135,751,000
イチネンホールディングス	17,500	1,415.00	24,762,500
建設技術研究所	10,200	2,622.00	26,744,400
スペース	12,400	966.00	11,978,400
燦ホールディングス	7,600	1,460.00	11,096,000
スバル興業	1,100	8,190.00	9,009,000
東京テアトル	6,600	1,237.00	8,164,200
タナベ経営	7,000	746.00	5,222,000
ナガワ	5,400	11,760.00	63,504,000
東京都競馬	12,700	4,250.00	53,975,000
カナモト	29,800	2,385.00	71,073,000
西尾レントオール	15,700	2,753.00	43,222,100
トランス・コスモス	21,500	3,195.00	68,692,500
乃村工藝社	72,500	1,061.00	76,922,500
藤田観光	7,300	2,466.00	18,001,800
K N T - C Tホールディングス	10,500	1,663.00	17,461,500
日本管財	18,200	2,903.00	52,834,600
トーカイ	15,000	2,097.00	31,455,000
セコム	166,000	7,959.00	1,321,194,000
セントラル警備保障	8,200	2,616.00	21,451,200
丹青社	34,900	894.00	31,200,600
メイテック	20,400	7,020.00	143,208,000
応用地質	19,200	1,986.00	38,131,200
船井総研ホールディングス	34,600	2,632.00	91,067,200
進学会ホールディングス	6,700	375.00	2,512,500
オオバ	12,300	800.00	9,840,000
いであ	4,700	1,932.00	9,080,400

学究社	5,700	1,487.00	8,475,900	
ベネッセホールディングス	56,300	2,325.00	130,897,500	
イオンデイライト	20,900	3,725.00	77,852,500	
ナック	8,400	930.00	7,812,000	
ダイセキ	31,100	5,290.00	164,519,000	
ステップ	6,400	1,844.00	11,801,600	
合 計	191,570,100		493,838,945,770	

## (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】

（2021年12月30日現在）

資産総額	2,683,366,265円
負債総額	971,754円
純資産総額（ - ）	2,682,394,511円
発行済口数	2,673,114,253口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0035円
（1万口当たり純資産額）	（10,035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

（2021年12月30日現在）

資産総額	308,621,000,500円
負債総額	164,345,642円
純資産総額（ - ）	308,456,654,858円
発行済口数	99,014,674,085口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1153円
（1万口当たり純資産額）	（31,153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

（2021年12月30日現在）

資産総額	495,132,132,511円
負債総額	273,587,918円
純資産総額（ - ）	494,858,544,593円
発行済口数	254,643,038,695口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9433円
（1万口当たり純資産額）	（19,433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（2021年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 2月18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。

2021年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	15,077,635
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	73	253,073
単位型公社債投資信託	54	309,924
合計	659	15,640,633

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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



る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：百万円)	
		前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		24,869	21,589
金銭の信託		5,823	10,857
前払費用		348	397
未収委託者報酬		7,284	8,471
未収運用受託報酬		5,842	6,151
未収収益		190	177
その他		4,624	3,428
流動資産合計		48,983	51,072
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	256	301
器具備品	1	576	692
その他	1	0	0
有形固定資産合計		832	993
無形固定資産			
ソフトウェア		3,030	4,104
その他		40	41
無形固定資産合計		3,070	4,145
投資その他の資産			
投資有価証券		8,469	9,950
関係会社株式		5,636	5,636
繰延税金資産		700	311
その他		35	39
投資その他の資産合計		14,842	15,937
固定資産合計		18,745	21,077
資産合計		67,729	72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	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	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
金		
その他有価証券評価差額	587	791
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、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

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
	建物	77	百万円	106
器具備品	285	"	391	"
その他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの



軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	24,869	24,869	-
（2）金銭の信託	5,823	5,823	-
（3）未収委託者報酬	7,284	7,284	-
（4）未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
（6）未払金	(7,988)	(7,988)	-
（7）デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
（1）現金及び預金	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-

(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
	合計		5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
合計	13,711	-	315	315	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(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	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売 代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）



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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(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（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

### 資産の部

#### 流動資産

現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		39,182
利益剰余金合計		41,782
株主資本合計		61,022
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		995
繰延ヘッジ損益		78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第36期中間会計期間		
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

## 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

#### 重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
市場価格のない株式等以外のもの	時価法によっております。
	(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
市場価格のない株式等	移動平均法による原価法によっております。
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）に基づく定額法

によっております。

## 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 6. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期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」）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、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

## 2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

## （追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## （中間損益計算書関係）

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	90百万円
無形固定資産	376百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	738百万円
投資有価証券償還益	219百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,012百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(\*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

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

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

### デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

## (有価証券関係)

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

### 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

### 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額



貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計		5,729	-	103	103

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
合計		7,900	-	79	

## （収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針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中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

## （関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

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

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

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年2月18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(2021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) (2021年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021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。）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**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2022年1月19日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2021年5月20日から2021年11月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2021年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。