

グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書 (請求目論見書)

2024年2月21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を 2024 年 2 月 20 日に関東財務局長に提出しており、2024 年 2 月 21 日にその届出の効力が生じております。

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

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	2
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	15
3【投資リスク】	24
4【手数料等及び税金】	27
5【運用状況】	30
第2【管理及び運営】	41
1【申込(販売)手続等】	41
2【換金(解約)手続等】	42
3【資産管理等の概要】	43
4【受益者の権利等】	47
第3【ファンドの経理状況】	48
1【財務諸表】	51
2【ファンドの現況】	151
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	152
第三部【委託会社等の情報】	153
第1【委託会社等の概況】	153
1【委託会社等の概況】	153
2【事業の内容及び営業の概況】	154
3【委託会社等の経理状況】	155
4【利害関係人との取引制限】	189
5【その他】	189
約款	

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】

- ①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。
- ②三井住友トラスト・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」といいます。）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。
- ③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

(5)【申込手数料】

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

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

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

(6)【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2024年2月21日から2024年8月20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
追加型	海外	債券	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリーフ	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	ファンド	()		
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株	年4回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ショート型/絶対 収益追求型
債券						
一般	年6回	北米				その他
公債	(隔月)	欧州				()
社債						
その他債券	年12回					
クレジット属性	(毎月)	アジア				
()	日々	オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
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))		アフリカ				
		中近東 (中東)				
		エマージン グ				
資産複合 ()						
資産配分 固定型						
資産配分 変更型						

(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の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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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①から④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①から④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。

- ① 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。
- ② 資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1) 年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1) 日経 225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

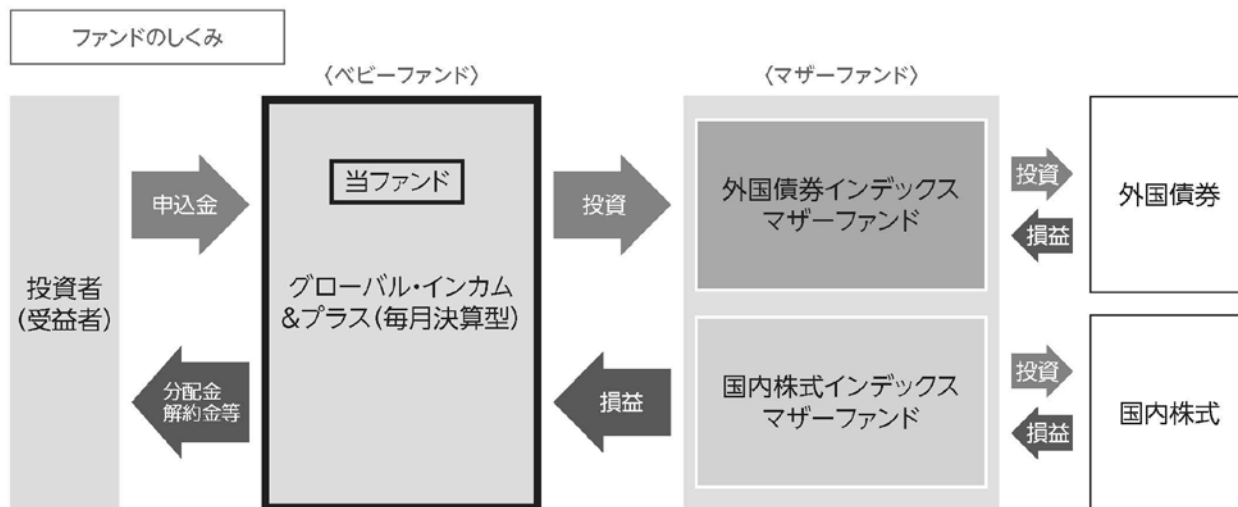
- (1) ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

<ファンドの特色>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
外国債券	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ※1
国内株式	TOPIX (東証株価指数) (配当込み) ※2

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

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

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

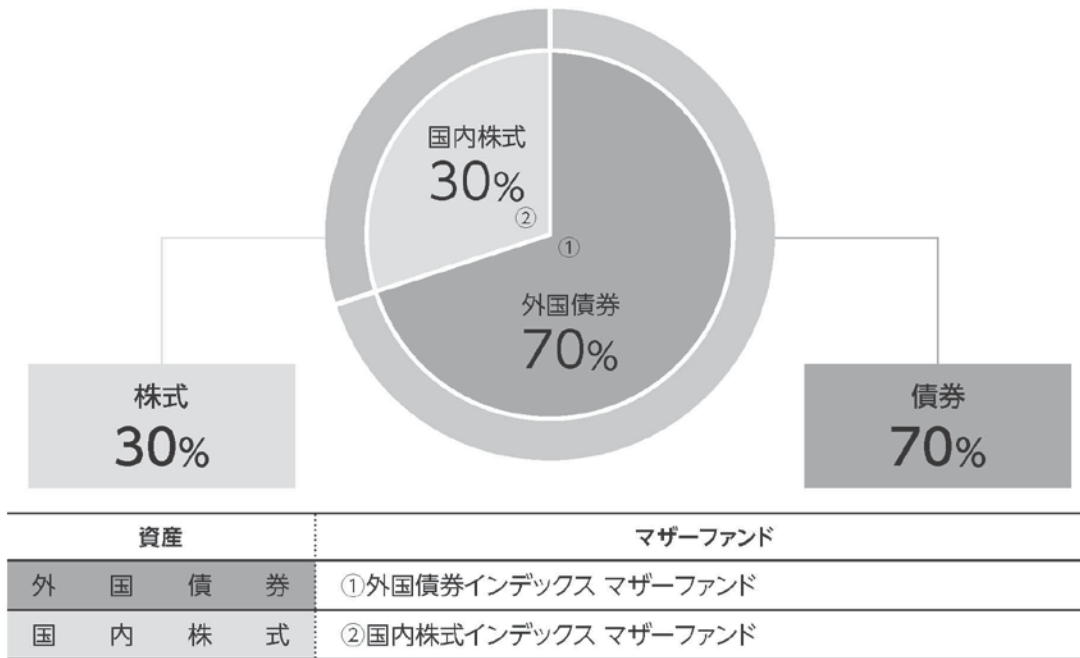
FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

3. 債券70%、株式30%を基本資産配分比率として運用します。

基本資産配分比率



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

ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本資産配分比率に従って、各マザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●各マザーファンドの組入比率が基本資産配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

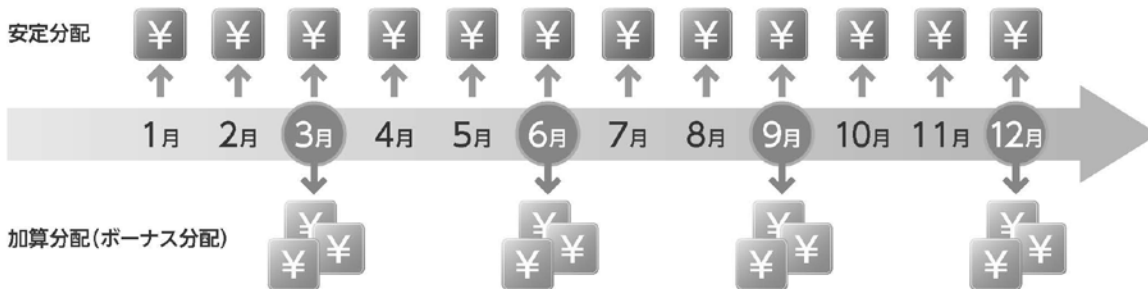
※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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」ということがあります。)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

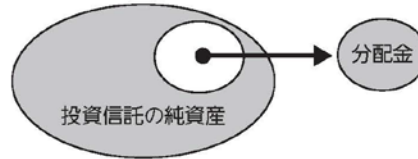
- 株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

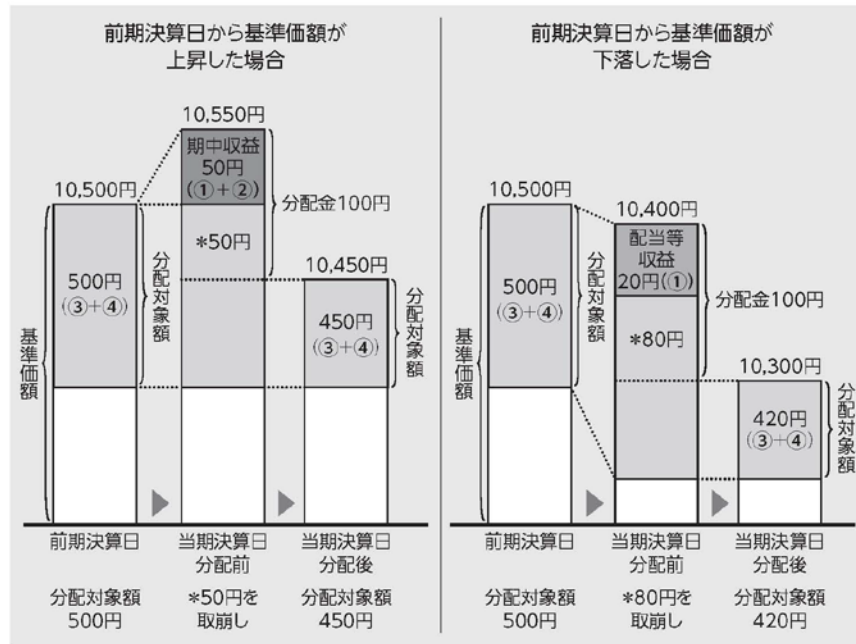
分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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



※分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

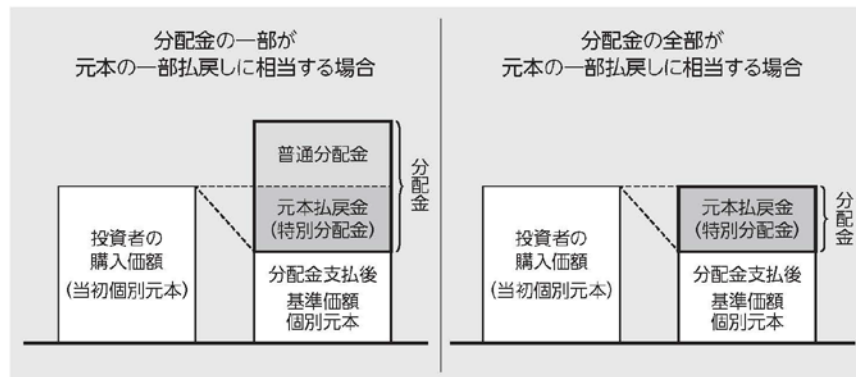
分配対象額とは、

- ① 経費控除後の配当等収益
- ② 経費控除後の評価益を含む売買益
- ③ 分配準備積立金
- ④ 収益調整金

です。

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

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



普通分配金

個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

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

元本払戻金 (特別分配金)

個別元本を下回る部分からの分配金です。元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、分配後はその金額だけ個別元本が減少します。

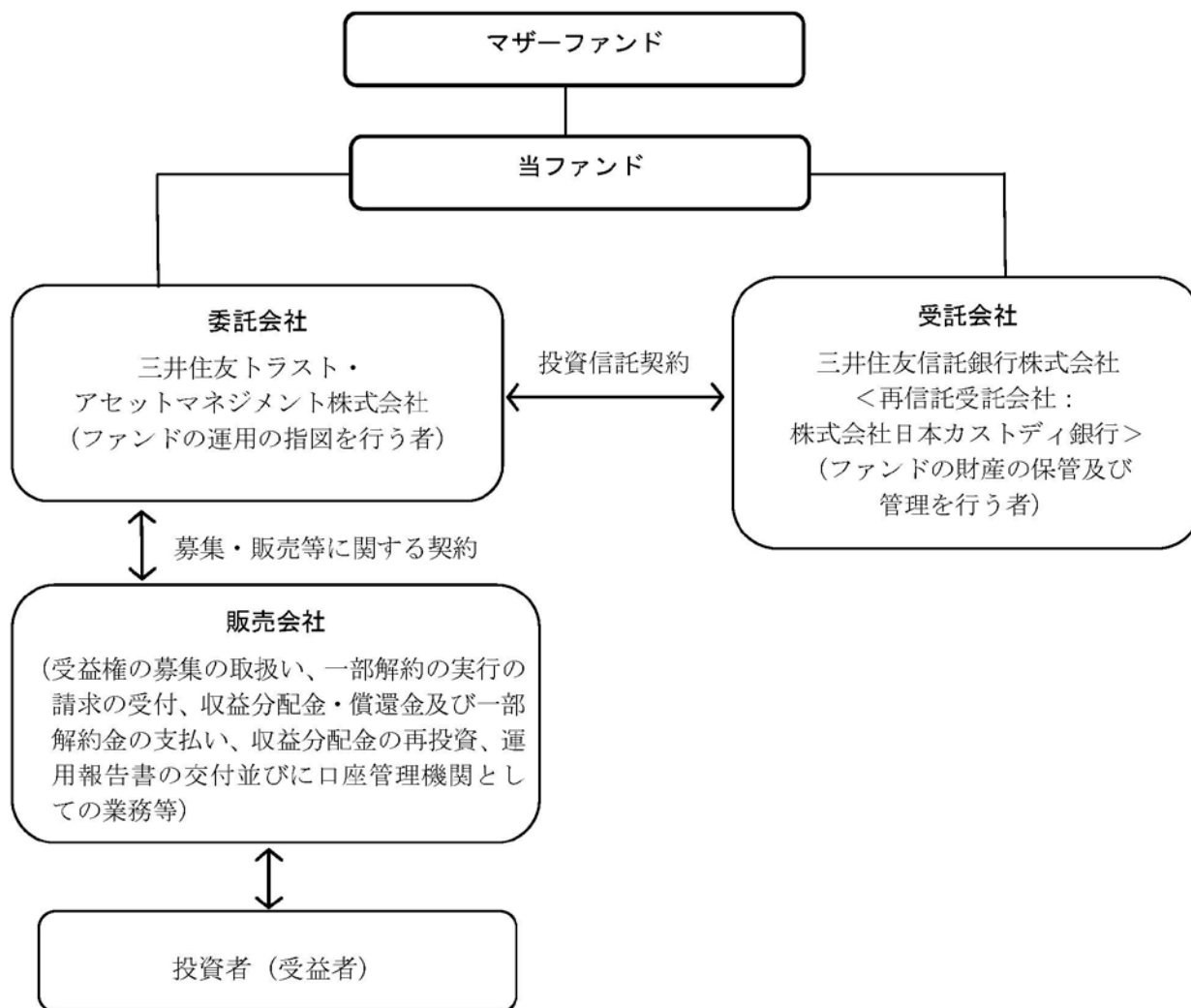
※元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

(2) 【ファンドの沿革】

2004年12月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	本ファンドの名称を「住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」から「グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 外国債券インデックス マザーファンド」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」および「国内株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2023年12月29日現在）

イ. 資本金の額：20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ. 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

①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。

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

益証券に限ります。)

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

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

(ハ) 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

(ニ) 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(ハ)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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

- ⑤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。
- ⑥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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①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。
- ②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。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④一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。
- ⑤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）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②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。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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

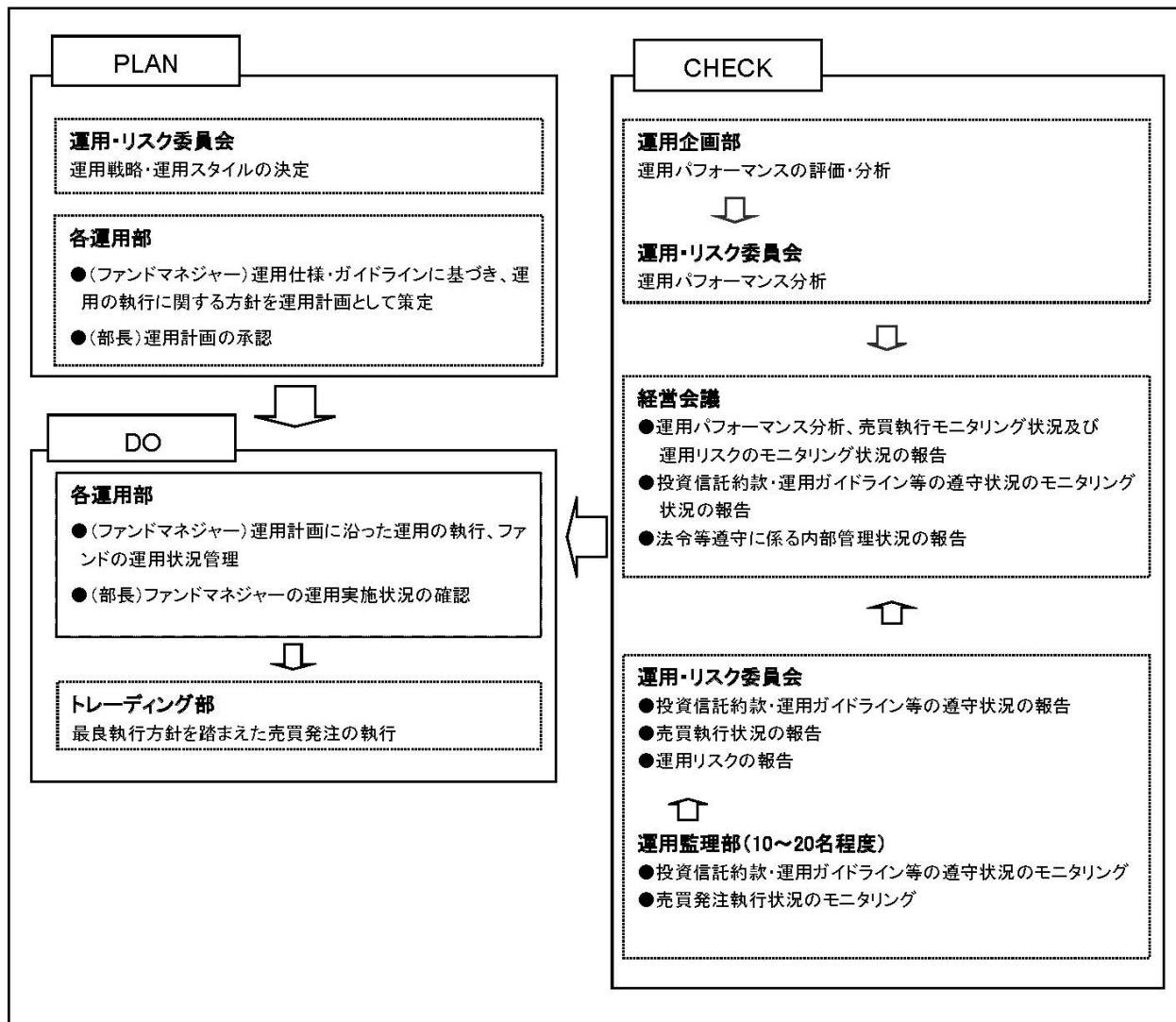
数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③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。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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。
- ⑧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。
- ⑨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>

- ①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」）
- ②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」）
- ③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」）
- ④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」）
- ⑤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」）
- ⑥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」）
- ⑦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」）
- ⑧委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図すること

ができるものとします。(投資信託約款第 22 条)

- ⑨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)
- ⑩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 号ハ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)
- ⑪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)
- ⑫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)
- ⑬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。
- ⑭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）
- ⑮委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第 31 条）
- ⑯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）
- ⑰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）
- ⑱一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いが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」）
- ⑲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①から⑦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①から⑦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⑨、⑩、⑫および⑬における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

<関連法令に基づく投資制限>

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

3 【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 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。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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>

- ①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。
- ②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。
- ③ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

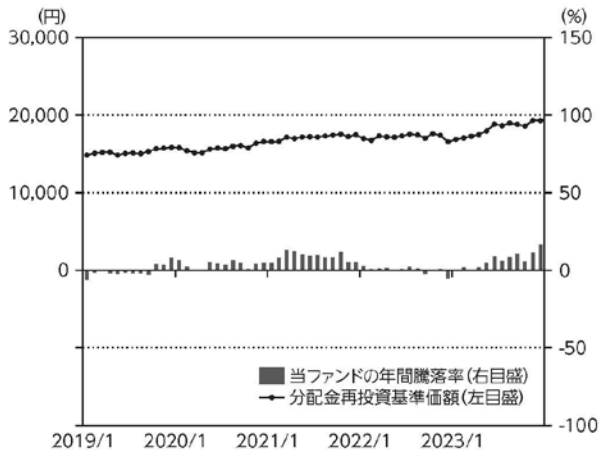
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

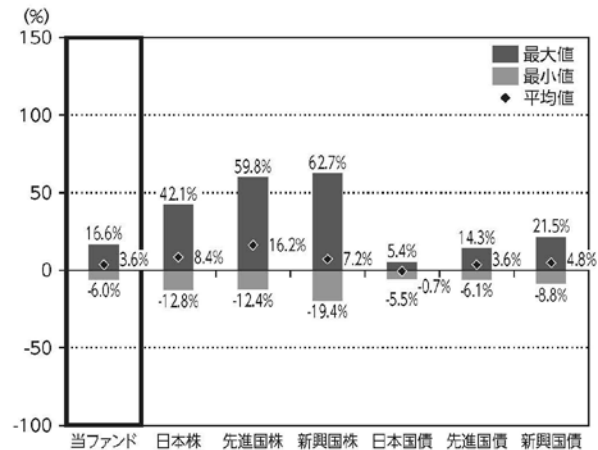
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
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権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(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】

①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。）。

②「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。

③上記①及び②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

①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

②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。

③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】

- ①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を含みます。）。
- ②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。
- ③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を含みます。）。
- ④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。
- ⑤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。

①個人の受益者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

②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。)

③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「④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。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

※上記は、2024年1月1日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

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

※対象期間は2023年5月20日～2023年11月20日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

以下は、2023年12月29日現在の状況について記載してあります。

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,486,338,647	97.97
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	51,586,333	2.03
合計（純資産総額）		2,537,924,980	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額（円） 単価	帳簿価額（円） 金額	評価額（円） 単価	評価額（円） 金額	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	512,372,069	3.3600	1,721,570,152	3.3905	1,737,197,499	68.45
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	308,161,723	2.3942	737,800,798	2.4310	749,141,148	29.52

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.97
合計	97.97

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

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの純資産額（円）
--	----------	----------------

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 19 特定期間末	(2014 年 5 月 19 日)	6, 225, 643, 060	6, 233, 124, 547	8, 321	8, 331
第 20 特定期間末	(2014 年 11 月 19 日)	6, 141, 678, 470	6, 148, 136, 758	9, 510	9, 520
第 21 特定期間末	(2015 年 5 月 19 日)	5, 510, 603, 193	5, 516, 194, 852	9, 855	9, 865
第 22 特定期間末	(2015 年 11 月 19 日)	4, 914, 724, 750	4, 919, 765, 815	9, 749	9, 759
第 23 特定期間末	(2016 年 5 月 19 日)	4, 141, 974, 161	4, 146, 719, 038	8, 729	8, 739
第 24 特定期間末	(2016 年 11 月 21 日)	3, 774, 731, 381	3, 779, 110, 340	8, 620	8, 630
第 25 特定期間末	(2017 年 5 月 19 日)	3, 631, 064, 374	3, 635, 099, 419	8, 999	9, 009
第 26 特定期間末	(2017 年 11 月 20 日)	3, 542, 257, 330	3, 545, 979, 493	9, 517	9, 527
第 27 特定期間末	(2018 年 5 月 21 日)	3, 521, 297, 931	3, 525, 050, 764	9, 383	9, 393
第 28 特定期間末	(2018 年 11 月 19 日)	3, 128, 759, 601	3, 132, 233, 675	9, 006	9, 016
第 29 特定期間末	(2019 年 5 月 20 日)	2, 950, 960, 395	2, 954, 274, 243	8, 905	8, 915
第 30 特定期間末	(2019 年 11 月 19 日)	2, 913, 847, 466	2, 917, 008, 272	9, 219	9, 229
第 31 特定期間末	(2020 年 5 月 19 日)	2, 657, 035, 815	2, 660, 011, 967	8, 928	8, 938
第 32 特定期間末	(2020 年 11 月 19 日)	2, 687, 460, 239	2, 690, 308, 087	9, 437	9, 447
第 33 特定期間末	(2021 年 5 月 19 日)	2, 696, 502, 691	2, 699, 247, 639	9, 824	9, 834
第 34 特定期間末	(2021 年 11 月 19 日)	2, 723, 112, 041	2, 725, 798, 345	10, 137	10, 147
第 35 特定期間末	(2022 年 5 月 19 日)	2, 533, 303, 733	2, 535, 929, 352	9, 648	9, 658
第 36 特定期間末	(2022 年 11 月 21 日)	2, 544, 018, 682	2, 546, 592, 677	9, 884	9, 894
第 37 特定期間末	(2023 年 5 月 19 日)	2, 536, 440, 309	2, 538, 941, 288	10, 142	10, 152
第 38 特定期間末	(2023 年 11 月 20 日)	2, 592, 843, 640	2, 595, 259, 115	10, 734	10, 744
	2022 年 12 月末日	2, 384, 876, 882	—	9, 398	—
	2023 年 1 月末日	2, 417, 825, 682	—	9, 578	—
	2 月末日	2, 434, 000, 122	—	9, 665	—
	3 月末日	2, 458, 310, 856	—	9, 776	—
	4 月末日	2, 480, 800, 587	—	9, 884	—
	5 月末日	2, 528, 174, 559	—	10, 144	—
	6 月末日	2, 628, 982, 993	—	10, 636	—
	7 月末日	2, 586, 868, 876	—	10, 504	—
	8 月末日	2, 618, 402, 606	—	10, 690	—
	9 月末日	2, 546, 094, 406	—	10, 433	—
	10 月末日	2, 502, 601, 044	—	10, 310	—
	11 月末日	2, 566, 198, 801	—	10, 699	—
	12 月末日	2, 537, 924, 980	—	10, 629	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 19 特定期間	2013 年 11 月 20 日～2014 年 5 月 19 日	60

第20 特定期間	2014年5月20日～2014年11月19日	60
第21 特定期間	2014年11月20日～2015年5月19日	60
第22 特定期間	2015年5月20日～2015年11月19日	60
第23 特定期間	2015年11月20日～2016年5月19日	60
第24 特定期間	2016年5月20日～2016年11月21日	60
第25 特定期間	2016年11月22日～2017年5月19日	60
第26 特定期間	2017年5月20日～2017年11月20日	60
第27 特定期間	2017年11月21日～2018年5月21日	60
第28 特定期間	2018年5月22日～2018年11月19日	60
第29 特定期間	2018年11月20日～2019年5月20日	60
第30 特定期間	2019年5月21日～2019年11月19日	60
第31 特定期間	2019年11月20日～2020年5月19日	60
第32 特定期間	2020年5月20日～2020年11月19日	60
第33 特定期間	2020年11月20日～2021年5月19日	60
第34 特定期間	2021年5月20日～2021年11月19日	60
第35 特定期間	2021年11月20日～2022年5月19日	60
第36 特定期間	2022年5月20日～2022年11月21日	60
第37 特定期間	2022年11月22日～2023年5月19日	60
第38 特定期間	2023年5月20日～2023年11月20日	210

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第19 特定期間	2013年11月20日～2014年5月19日	1.5
第20 特定期間	2014年5月20日～2014年11月19日	15.0
第21 特定期間	2014年11月20日～2015年5月19日	4.3
第22 特定期間	2015年5月20日～2015年11月19日	△0.5
第23 特定期間	2015年11月20日～2016年5月19日	△9.8
第24 特定期間	2016年5月20日～2016年11月21日	△0.6
第25 特定期間	2016年11月22日～2017年5月19日	5.1
第26 特定期間	2017年5月20日～2017年11月20日	6.4
第27 特定期間	2017年11月21日～2018年5月21日	△0.8
第28 特定期間	2018年5月22日～2018年11月19日	△3.4
第29 特定期間	2018年11月20日～2019年5月20日	△0.5
第30 特定期間	2019年5月21日～2019年11月19日	4.2
第31 特定期間	2019年11月20日～2020年5月19日	△2.5
第32 特定期間	2020年5月20日～2020年11月19日	6.4
第33 特定期間	2020年11月20日～2021年5月19日	4.7
第34 特定期間	2021年5月20日～2021年11月19日	3.8
第35 特定期間	2021年11月20日～2022年5月19日	△4.2
第36 特定期間	2022年5月20日～2022年11月21日	3.1

第 37 特定期間	2022 年 11 月 22 日～2023 年 5 月 19 日	3.2
第 38 特定期間	2023 年 5 月 20 日～2023 年 11 月 20 日	7.9

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

(注 2) 小数第 2 位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第 19 特定期間	2013 年 11 月 20 日～2014 年 5 月 19 日	19,874,914	1,123,227,709	7,481,487,561
第 20 特定期間	2014 年 5 月 20 日～2014 年 11 月 19 日	16,229,854	1,039,428,546	6,458,288,869
第 21 特定期間	2014 年 11 月 20 日～2015 年 5 月 19 日	26,204,502	892,833,400	5,591,659,971
第 22 特定期間	2015 年 5 月 20 日～2015 年 11 月 19 日	14,940,340	565,534,341	5,041,065,970
第 23 特定期間	2015 年 11 月 20 日～2016 年 5 月 19 日	11,974,884	308,163,096	4,744,877,758
第 24 特定期間	2016 年 5 月 20 日～2016 年 11 月 21 日	10,418,827	376,336,749	4,378,959,836
第 25 特定期間	2016 年 11 月 22 日～2017 年 5 月 19 日	8,607,056	352,521,557	4,035,045,335
第 26 特定期間	2017 年 5 月 20 日～2017 年 11 月 20 日	10,872,907	323,754,271	3,722,163,971
第 27 特定期間	2017 年 11 月 21 日～2018 年 5 月 21 日	246,694,847	216,025,727	3,752,833,091
第 28 特定期間	2018 年 5 月 22 日～2018 年 11 月 19 日	8,083,059	286,841,845	3,474,074,305
第 29 特定期間	2018 年 11 月 20 日～2019 年 5 月 20 日	8,367,199	168,593,378	3,313,848,126
第 30 特定期間	2019 年 5 月 21 日～2019 年 11 月 19 日	8,156,132	161,198,091	3,160,806,167
第 31 特定期間	2019 年 11 月 20 日～2020 年 5 月 19 日	7,421,919	192,075,711	2,976,152,375
第 32 特定期間	2020 年 5 月 20 日～2020 年 11 月 19 日	10,530,677	138,834,428	2,847,848,624
第 33 特定期間	2020 年 11 月 20 日～2021 年 5 月 19 日	7,356,311	110,256,289	2,744,948,646
第 34 特定期間	2021 年 5 月 20 日～2021 年 11 月 19 日	5,525,447	64,169,612	2,686,304,481
第 35 特定期間	2021 年 11 月 20 日～2022 年 5 月 19 日	9,600,230	70,285,124	2,625,619,587
第 36 特定期間	2022 年 5 月 20 日～2022 年 11 月 21 日	17,708,067	69,332,181	2,573,995,473
第 37 特定期間	2022 年 11 月 22 日～2023 年 5 月 19 日	5,081,944	78,097,694	2,500,979,723
第 38 特定期間	2023 年 5 月 20 日～2023 年 11 月 20 日	13,193,122	98,697,457	2,415,475,388

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

(参考)

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	138,828,155,278	45.99
	フランス	25,137,414,172	8.33
	イタリア	22,555,698,209	7.47
	中国	22,192,630,962	7.35
	ドイツ	19,616,876,170	6.50

	イギリス	15,617,157,420	5.17
	スペイン	14,722,033,558	4.88
	カナダ	5,945,031,157	1.97
	ベルギー	5,358,708,128	1.78
	オランダ	4,549,218,529	1.51
	オーストラリア	4,245,766,262	1.41
	オーストリア	3,582,221,297	1.19
	メキシコ	2,700,465,553	0.89
	アイルランド	1,759,172,154	0.58
	フィンランド	1,583,609,641	0.52
	ポーランド	1,522,256,383	0.50
	マレーシア	1,491,873,985	0.49
	シンガポール	1,266,874,133	0.42
	イスラエル	888,889,820	0.29
	デンマーク	844,917,398	0.28
	ニュージーランド	730,448,334	0.24
	スウェーデン	637,896,631	0.21
	ノルウェー	539,822,201	0.18
	小計	296,317,137,375	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,551,829,720	1.84
合計(純資産総額)		301,868,967,095	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

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

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

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

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

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	14,370.29	2,011,841,580	14,462.78	2,024,789,452	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,524.72	1,843,419,967	13,657.78	1,861,556,202	3.375	2033/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,024.24	1,680,128,108	13,029.52	1,680,808,502	2.750	2032/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,309.58	1,555,890,143	13,470.80	1,574,736,862	2.375	2027/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,457.94	1,507,289,389	13,799.33	1,545,525,943	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,722.99	1,474,752,411	11,810.39	1,485,747,637	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,091.00	1,409,900,981	13,375.78	1,440,572,355	1.625	2026/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,174.94	1,426,903,209	12,229.51	1,433,298,956	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,176.54	1,417,654,589	14,313.47	1,431,347,254	4.500	2026/7/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	13,706.58	1,398,071,810	13,894.63	1,417,252,343	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,348.89	1,356,192,724	11,521.74	1,376,848,933	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,491.33	1,357,228,616	13,600.72	1,368,232,565	2.875	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,181.32	1,331,313,889	13,182.71	1,331,453,784	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,531.43	1,244,892,265	14,388.81	1,323,771,414	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,528.95	1,285,477,999	11,675.21	1,301,786,232	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,832.84	1,219,120,267	13,107.64	1,245,225,851	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	13,583.85	1,222,547,120	13,811.25	1,243,012,521	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,087.07	1,197,403,879	11,400.69	1,231,274,976	2.875	2052/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,493.24	1,187,405,195	13,747.59	1,209,788,742	1.500	2024/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,187.68	1,170,017,725	12,467.46	1,196,876,778	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,348.35	1,173,093,379	12,568.02	1,193,962,055	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,548.08	1,146,168,347	13,760.83	1,164,166,574	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,332.29	1,133,245,244	13,620.11	1,157,709,536	1.125	2025/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,060.15	1,143,090,457	14,175.24	1,152,447,304	3.875	2029/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,607.64	1,143,042,314	13,702.93	1,151,046,845	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,379.87	1,114,189,028	12,645.86	1,138,127,573	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,270.89	1,090,867,305	13,570.80	1,115,520,099	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	8,350,000	13,545.82	1,131,076,740	13,226.20	1,104,387,824	3.625	2053/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	11,662.47	1,076,446,019	11,768.56	1,086,238,622	1.250	2031/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000	17,871.22	1,057,976,319	18,272.36	1,081,723,989	5.500	2029/4/25	0.36

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.16
合計	98.16

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,019,726.92	428,287,869	3,043,250	431,624,147	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	18	アメリカドル	2,005,495.72	284,439,458	2,032,031.34	288,203,005	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカドル	2,297,490.69	325,853,104	2,377,375	337,183,096	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,169,788.1	183,797,106	1,172,710	184,256,195	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,782,261.5	280,028,927	1,794,900	282,014,688	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	26	ユーロ	3,549,464.6	557,691,878	3,596,060	565,012,947	0.19

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,820,000.00	1,120,056,741	1,105,931,770	0.37
	カナダドル	買建	860,000.00	91,810,503	91,986,718	0.03
	ユーロ	買建	4,800,000.00	751,781,098	752,531,520	0.25
	イギリスポンド	買建	740,000.00	134,213,963	133,329,352	0.04
	オフショア人民元	買建	9,560,000.00	191,600,350	190,124,500	0.06

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

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

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	100.00

(注 1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率

	売建			(%)
株価指数先物取引	買建	日本	7,168,980,000	1.21

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,585,900	1,944.31	18,637,971,918	2,590.50	24,832,273,950	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,234,900	13,262.64	16,378,034,785	13,410.00	16,560,009,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,476,900	935.07	9,796,634,883	1,211.50	12,692,764,350	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,700	68,435.49	11,955,681,814	62,120.00	10,852,364,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1,585,700	4,415.41	7,001,522,280	5,917.00	9,382,586,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,500	19,749.13	7,297,307,208	25,255.00	9,331,722,500	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,081,600	162.92	8,485,138,853	172.30	8,973,659,680	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,400	8,161.66	6,916,194,878	10,170.00	8,618,058,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,222,500	5,682.91	6,947,368,917	6,880.00	8,410,800,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,660,000	2,002.89	7,330,597,902	2,253.50	8,247,810,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,200	5,922.79	6,528,102,549	7,359.00	8,111,089,800	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,328,700	4,450.16	5,912,928,191	5,963.00	7,923,038,100	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,700	4,702.71	6,544,769,731	5,298.00	7,373,226,600	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,241,600	4,993.91	6,200,440,714	5,767.00	7,160,307,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,549,600	4,531.81	7,022,503,107	4,054.00	6,282,078,400	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,257,300	1,346.23	5,731,320,672	1,466.00	6,241,201,800	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,000	4,358.82	5,897,485,430	4,486.00	6,069,558,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,130.60	5,891,213,340	17,625.00	6,061,237,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,699,500	3,118.90	5,300,580,579	3,529.00	5,997,535,500	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,525,300	4,533.12	6,914,370,121	3,872.00	5,905,961,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,320,800	2,084.61	4,837,983,290	2,412.50	5,598,930,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	863,700	5,563.87	4,805,515,260	6,293.00	5,435,264,100	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	949,800	5,369.03	5,099,512,290	5,251.00	4,987,399,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,817,100	1,514.97	4,267,827,507	1,759.50	4,956,687,450	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,500	26,686.15	5,617,435,672	22,985.00	4,838,342,500	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,588,400	2,751.28	4,370,145,617	2,993.00	4,754,081,200	0.80
日本	株式	SMC	機械	52,800	74,470.94	3,932,065,937	75,760.00	4,000,128,000	0.67

日本	株式	三菱電機	電気機器	1,962,500	1,824.24	3,580,089,531	1,999.00	3,923,037,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,044,500	3,091.13	3,228,692,742	3,645.00	3,807,202,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	636,600	6,139.85	3,908,633,900	5,595.00	3,561,777,000	0.60

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.33
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.12
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.27
		電気機器	17.33
		輸送用機器	8.09
		精密機器	2.34
		その他製品	2.35
		電気・ガス業	1.39
		陸運業	2.81
		海運業	0.83
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.63
		卸売業	6.92
		小売業	4.25
銀行業	6.79		
証券、商品先物取引業	0.80		
保険業	2.35		
その他金融業	1.14		

	不動産業	1.93
	サービス業	4.94
	小計	98.78
合計		98.78

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	303	円	7,109,275,050	7,168,980,000	1.21

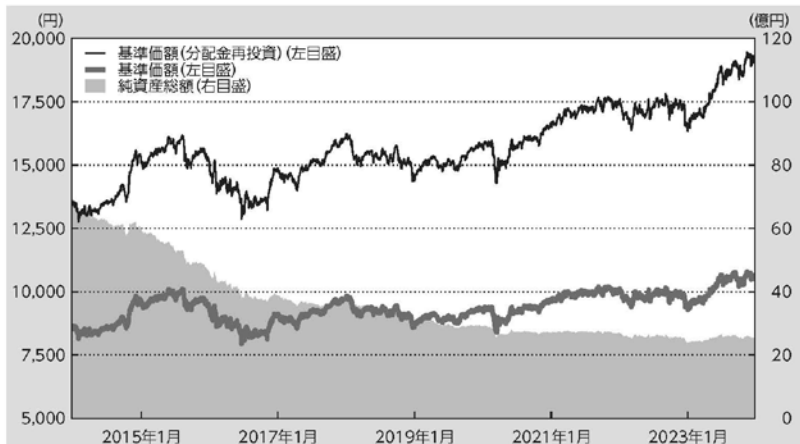
(注 1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

運用実績

当初設定日：2004年12月1日
作成基準日：2023年12月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,629円
純資産総額	25.38億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

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

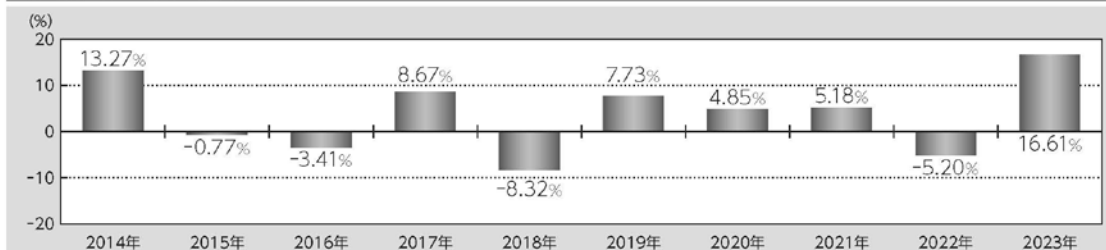
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	68.4%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.5%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.4%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.4%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.4%
		T 3.5% 02/15/33	アメリカ	国債	-	3.500%	2033/02/15	0.4%
国内株式 インデックス マザーファンド	29.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.8%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.5%
		信越化学工業	日本	株式	化学	-	-	0.5%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

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

<申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

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

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

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

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<申込受付の中止等>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

①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。

②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。）

③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）

- ①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
- ②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。
- ③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。
- ④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)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。

- ①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。
- ②上記①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。
- ③上記②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。
- ④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。
- ⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④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②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。

- ①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。
- ②上記①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。
- ③上記②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ときは、当該約款変更を行いません。
- ④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>

- ①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。
- ②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スシャル・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>

- ①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。
- ②上記①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。
- ③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。
- ④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

- ①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。
- ②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。
- ③上記②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。
- ④上記②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。
- ⑤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

- ①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。
- ②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。
- ③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。
- ④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38特定期間(2023年5月20日から2023年11月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年1月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2023年5月20日から2023年11月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の2023年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 37 特定期間 自 2022 年 11 月 22 日 至 2023 年 5 月 19 日	第 38 特定期間 自 2023 年 5 月 20 日 至 2023 年 11 月 20 日
営業収益		
受取利息	115	142
有価証券売買等損益	94,279,523	214,097,350
営業収益合計	94,279,638	214,097,492
営業費用		
支払利息	9,925	15,551
受託者報酬	925,403	1,000,397
委託者報酬	14,938,563	16,149,225
その他費用	66,040	71,393
営業費用合計	15,939,931	17,236,566
営業利益又は営業損失(△)	78,339,707	196,860,926
経常利益又は経常損失(△)	78,339,707	196,860,926
当期純利益又は当期純損失(△)	78,339,707	196,860,926
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	△382,626	694,575
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△29,976,791	35,460,586
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,984,715	642,831
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,984,715	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	642,831
剰余金減少額又は欠損金増加額	145,740	3,622,773
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	3,622,773
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	145,740	-
分配金	15,123,931	51,278,743
期末剰余金又は期末欠損金(△)	35,460,586	177,368,252

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第 38 特定期間は当特定期間末日が休業日のため、2023 年 5 月 20 日から 2023 年 11 月 20 日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 37 特定期間 自 2022 年 11 月 22 日 至 2023 年 5 月 19 日			第 38 特定期間 自 2023 年 5 月 20 日 至 2023 年 11 月 20 日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
第 215 期 自 2022 年 11 月 22 日 至 2022 年 12 月 19 日			第 221 期 自 2023 年 5 月 20 日 至 2023 年 6 月 19 日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	116,927 円	費用控除後の配当等収益額	A	3,248,540 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	65,194,932 円
収益調整金額	C	9,342,919 円	収益調整金額	C	9,247,515 円
分配準備積立金額	D	85,504,902 円	分配準備積立金額	D	87,027,019 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,964,748 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,718,006 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,552,773,086 口	当ファンドの期末残存口数	F	2,475,647,157 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	372 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	665 円
1 万口当たり分配金額	H	10 円	1 万口当たり分配金額	H	10 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,552,773 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,475,647 円
第 216 期 自 2022 年 12 月 20 日 至 2023 年 1 月 19 日			第 222 期 自 2023 年 6 月 20 日 至 2023 年 7 月 19 日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,337,274 円	費用控除後の配当等収益額	A	1,487,928 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,278,727 円	収益調整金額	C	9,278,715 円
分配準備積立金額	D	82,212,601 円	分配準備積立金額	D	152,341,305 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,828,602 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	163,107,948 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,527,332,192 口	当ファンドの期末残存口数	F	2,466,143,436 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	367 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	661 円
1 万口当たり分配金額	H	10 円	1 万口当たり分配金額	H	10 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,527,332 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,466,143 円
第 217 期 自 2023 年 1 月 20 日 至 2023 年 2 月 20 日			第 223 期 自 2023 年 7 月 20 日 至 2023 年 8 月 21 日		
項目			項目		

費用控除後の配当等収益額	A	2,922,696円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,268,067円
分配準備積立金額	D	80,731,097円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,921,860円
当ファンドの期末残存口数	F	2,518,874,943口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	368円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,518,874円

第218期

自 2023年 2月 21日

至 2023年 3月 20日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	516,600円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,277,250円
分配準備積立金額	D	80,951,814円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	90,745,664円
当ファンドの期末残存口数	F	2,514,022,011口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	360円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,514,022円

第219期

自 2023年 3月 21日

至 2023年 4月 19日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,132,012円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,294,166円
分配準備積立金額	D	78,797,366円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,223,544円
当ファンドの期末残存口数	F	2,509,951,195口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	395円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,509,951円

第220期

自 2023年 4月 20日

至 2023年 5月 19日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,392,321円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,299,275円
分配準備積立金額	D	87,068,806円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,760,402円
当ファンドの期末残存口数	F	2,500,979,723口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	398円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,500,979円

費用控除後の配当等収益額	A	2,164,422円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,287,261円
分配準備積立金額	D	150,738,400円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	162,190,083円
当ファンドの期末残存口数	F	2,456,679,525口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	660円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,456,679円

第224期

自 2023年 8月 22日

至 2023年 9月 19日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,415,051円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	52,608,872円
収益調整金額	C	9,292,438円
分配準備積立金額	D	149,321,537円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	214,637,898円
当ファンドの期末残存口数	F	2,439,458,858口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	879円
1万口当たり分配金額	H	160円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	39,031,341円

第225期

自 2023年 9月 20日

至 2023年 10月 19日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,429,489円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	9,859,784円
分配準備積立金額	D	165,335,157円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	182,624,430円
当ファンドの期末残存口数	F	2,433,458,342口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	750円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,433,458円

第226期

自 2023年 10月 20日

至 2023年 11月 20日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,903,756円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	27,303,723円
収益調整金額	C	9,831,990円
分配準備積立金額	D	169,027,456円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	210,066,925円
当ファンドの期末残存口数	F	2,415,475,388口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	869円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,415,475円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第 38 特定期間 自 2023 年 5 月 20 日 至 2023 年 11 月 20 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 38 特定期間 (2023 年 11 月 20 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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 37 特定期間 自 2022 年 11 月 22 日 至 2023 年 5 月 19 日	第 38 特定期間 自 2023 年 5 月 20 日 至 2023 年 11 月 20 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,573,995,473 円	2,500,979,723 円
期中追加設定元本額	5,081,944 円	13,193,122 円
期中一部解約元本額	78,097,694 円	98,697,457 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 37 特定期間 (2023 年 5 月 19 日現在)	第 38 特定期間 (2023 年 11 月 20 日現在)
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	80,593,012	112,692,510
合計	80,593,012	112,692,510

(デリバティブ取引に関する注記)
該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	312,133,505	759,639,311	
	外国債券インデックス マザーファンド	523,477,998	1,781,238,583	
合計		835,611,503	2,540,877,894	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023 年 11 月 20 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,056,853,181

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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	<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</p>

算基準	計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年11月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,713,199,804口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.4027円 (1万口当たり純資産額) (34,027円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年11月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <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	2023年11月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年5月20日
期首元本額	88,603,428,553円
期中追加設定元本額	7,443,506,872円
期中一部解約元本額	7,333,735,621円
期末元本額	88,713,199,804円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,154,181,349円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	523,477,998円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,473,867,702円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,224,653円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,556,473,270円
世界経済インデックスファンド	18,888,613,837円
DCマイセレクション25	1,971,950,768円
DCマイセレクション50	1,772,032,620円
DCマイセレクション75	1,361,809,610円
DC外国債券インデックス・オープン	2,249,932,928円
DCマイセレクションS25	1,059,352,606円
DCマイセレクションS50	965,293,822円
DCマイセレクションS75	533,410,849円
DCターゲット・イヤーフンド2025	16,278,397円
DCターゲット・イヤーフンド2035	99,598,939円
DCターゲット・イヤーフンド2045	53,645,237円
DC世界経済インデックスファンド	13,757,438,586円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	645,157,684円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	913,708円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,011,151円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	15,969,072円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	29,577,182円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	51,554,161円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	54,953,177円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,048,914円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	854,525,624円

バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	382,867,468 円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	1,560,437,846 円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	52,388,370 円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	31,095,201 円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	365,159,019 円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	132,919,969 円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	180,852,899 円
FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	641,969,049 円
グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	1,501,552,460 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705 円
外国債券ファンド・シリーズ1	781,076,246 円
分散投資コア戦略ファンドA	502,636,014 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,323,423,963 円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	693,068,215 円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,384,054,415 円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	233,164,889 円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	105,733,809 円
SMT グローバル債券インデックス・オープン (為替ヘッジあり)	1,298,039,218 円
SMT インデックスバランス・オープン	174,786,219 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	367,654,965 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	485,452,655 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	774,450,708 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,704,630 円
グローバル経済コア	793,386,734 円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	21,525,711 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,595,310 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	53,215,137 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	71,480,505 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	35,254,649 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	43,178,033 円
My SMT グローバル債券インデックス (ノーロード)	387,549,423 円
10資産分散投資ファンド	26,122,257 円
グローバル10資産バランスファンド	2,037,588 円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	12,245,769,215 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	183,039,272 円
SMT AM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	488,925,566 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	125,551,870 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	128,036,027 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2023年11月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
----	----	---------	----	------

			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,493,810,476	—	1,500,875,726	7,065,250
合計		1,493,810,476	—	1,500,875,726	7,065,250

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年11月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	1,631,771,343	—	1,631,074,110	△697,233
	アメリカドル	812,409,367	—	811,061,181	△1,348,186
	カナダドル	66,484,120	—	66,408,687	△75,433
	ユーロ	527,695,632	—	528,276,492	580,860
	イギリスポンド	92,820,416	—	92,990,850	170,434
	オフショア人民 元	132,361,808	—	132,336,900	△24,908
	売建	994,308,660	—	994,351,966	△43,306
	アメリカドル	494,670,000	—	494,680,890	△10,890
	カナダドル	19,660,860	—	19,659,474	1,386
	ユーロ	341,675,290	—	341,716,463	△41,173
	イギリスポンド	52,255,280	—	52,257,324	△2,044
	オーストラリア ドル	16,584,180	—	16,582,820	1,360
	イスラエルシェ ケル	2,014,500	—	2,015,870	△1,370
	オフショア人民 元	67,448,550	—	67,439,125	9,425
	合計		2,626,080,003	—	2,625,426,076

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,626,923.83	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,522,050.78	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,802,789.05	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,832,563.47	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,753,906.25	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,292,804.69	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,268,593.76	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,479,843.76	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,727,744.12	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,619,859.75	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,742,597.66	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,648,359.36	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,088,671.87	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,785,248.85	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,562,738.28	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,041,376.94	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,030,187.50	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,012,969.90	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,419,091.82	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,585,937.50	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,142,433.57	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,187,812.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,301,861.35	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,144,726.55	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,212,312.51	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,291,406.25	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,473,945.32	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,637,949.19			
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,625,468.76			

T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,645,355.85
T 0.75% 11/15/24	2,750,000.00	2,631,425.00
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,263,906.24
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,612,888.66
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,793,691.46
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,492,007.80
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,262,007.81
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,079,150.38
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,958,750.00
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,001,351.95
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,018,640.61
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,348,720.08
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,397,475.00
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,963,750.00
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,675,381.82
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,209,921.86
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,795,898.46
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,316,217.18
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,169,072.23
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,341,289.08
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,450,282.62
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,824,375.00
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,842,318.33
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,039,162.50
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,001,100.00
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,630,703.14
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,210,267.57
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,455,546.86
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,433,789.06
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,893,261.70
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,469,047.13
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,503,173.80
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,228,453.10
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	9,994,433.77
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,901,517.94
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,799,990.21

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

	T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,844,824.20	
	T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,944,058.99	
	T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,673,608.40	
	T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,650,287.13	
	T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	987,585.93	
	T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,478,766.80	
	T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,051,598.81	
	T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,013,525.37	
	T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,250,000.00	
	T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,563,783.57	
	T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,110,305.63	
	T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,217,949.23	
	T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,310,185.54	
	T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,303,876.93	
	T 2.75% 08/15/42	7,600,000.00	5,679,218.71	
	T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,870,041.97	
	T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,641,250.00	
	T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,484,076.94	
	T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,160,198.24	
	T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,877,421.88	
	T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,044,572.27	
	T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,402,563.30	
	T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	8,968,089.86	
	T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,076,303.70	
	T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,397,550.00	
	T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,803,000.00	
	T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,700,177.33	
	T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,274,232.01	
	T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,658,085.89	
	T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,696,115.24	
	T 2.875% 11/15/46	940,000.00	686,420.31	
	T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,656,875.00	
	T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,140,601.92	
	T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,634,047.85	
	T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,280,734.37	
	T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,620,614.24	

	T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,985,417.97	
	T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,111,253.91	
	T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	839,323.24	
	T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	2,996,359.35	
	T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,238,620.34	
	T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,888,421.82	
	T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,430,492.19	
	T 3.125% 08/31/27	8,850,000.00	8,419,081.02	
	T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,654,806.65	
	T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,894,687.50	
	T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,359,068.34	
	T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,815,605.48	
	T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,152,843.75	
	T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,443,097.08	
	T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,892,738.28	
	T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,213,810.52	
	T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,785,625.00	
	T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,388,000.00	
	T 3.5% 02/15/39	770,000.00	675,283.98	
	T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,827,330.08	
	T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,029,781.25	
	T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,020,686.51	
	T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,093,828.12	
	T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	3,988,757.83	
	T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,737,328.13	
	T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,589,726.57	
	T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,374,443.33	
	T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,677,492.17	
	T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,306,727.54	
	T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,426,194.52	
	T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,862,599.25	
	T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,193,000.00	
	T 3% 02/15/48	1,000,000.00	742,207.03	
	T 3% 02/15/49	1,000,000.00	740,878.91	
	T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,912,483.40	
	T 3% 05/15/45	700,000.00	529,238.28	

T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,391,387.30
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,683,431.63
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,408,935.55
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,858,359.38
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,056,855.47
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,825,000.00
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,126,304.68
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,731,333.99
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,005,937.50
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,055,437.50
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,640,703.16
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	860,308.59
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,816,714.86
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	698,403.90
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	982,265.62
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,827,859.37
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	621,714.84
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,952,187.50
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	927,562.50
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,099,282.02
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	545,703.12
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,669,054.69
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,370,701.17
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	752,182.62
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,391,201.18
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,031,921.84
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,380,621.06
T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,024,265.66
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	420,750.00
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,343,417.97
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,063,115.22
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,741,769.52
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,533,714.85
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,152,251.95
アメリカドル 小計	1,091,200,000.00	946,716,978.28 (141,960,210,893)

カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,082,034.66
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,806,539.68
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,530,398.21
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,378,950.76
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,720,594.40
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,101,397.27
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,398,648.68
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	851,887.57
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,222,068.65
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,067,076.41
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,959,102.90
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	733,234.01
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,404,940.20
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,236,314.07
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	222,656.70
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,087,889.58
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	295,984.74
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,533,099.85
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	913,529.35
	CAN 2.75% 12/01/55	620,000.00	528,793.64
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	522,291.86
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	380,027.05
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,330,800.61
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,666,410.98
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,018,851.02
	CAN 3.25% 12/01/33	760,000.00	733,079.36
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,142,592.69
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,036,061.14
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,005,465.84
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,301,159.09
	CAN 3% 10/01/25	960,000.00	934,412.13
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,122,973.15
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	774,091.96
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,638,697.72
CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,883,579.46	
CAN 5% 06/01/37	630,000.00	714,595.16	

カナダドル 小計		58,750,000.00	53,280,230.55 (5,820,865,187)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,920,044.00
	MBONO 10% 12/05/24	21,760,000.00	21,587,281.52
	MBONO 5.5% 03/04/27	30,850,000.00	27,397,885.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,034,201.95
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,423,508.80
	MBONO 7.5% 05/26/33	20,330,000.00	17,920,285.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,603,014.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	39,030,000.00	35,650,392.30
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,157,711.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,861,543.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	26,700,000.00	25,774,845.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,687,526.70
	MBONO 8% 07/31/53	16,550,000.00	14,110,364.50
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,094,254.00
メキシコペソ 小計		343,100,000.00	313,222,858.97 (2,726,417,053)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,048,610.29
	BGB 0.35% 06/22/32	1,370,000.00	1,087,436.13
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	309,633.91
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	168,047.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,060,000.00	1,985,397.10
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,405,846.24
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,463,119.04
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,467,114.10
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	698,596.86
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,314,970.52
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	738,569.97
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	621,650.40
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	629,568.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	731,207.52
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	732,847.87
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	532,829.05
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,390,289.74
BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,348,055.28	

	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	613,959.28
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	489,992.44
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	363,717.52
	BGB 3.3% 06/22/54	810,000.00	743,884.87
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	427,430.96
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	943,326.99
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,102,851.00
	BGB 3% 06/22/34	950,000.00	929,231.10
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,010,043.50
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,178,734.92
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,153,005.84
	BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,262,782.28
	BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,093,931.08
	BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,372,909.95
	BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,614,633.99
	BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	795,548.00
	BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,361,006.94
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,457,060.64
	BTPS 0.35% 02/01/25	1,260,000.00	1,212,701.24
	BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,751,427.00
	BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,790,237.27
	BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,127,785.10
	BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,456,426.00
	BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,170,651.71
	BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,354,670.48
	BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	663,963.90
	BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,802,988.00
	BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,845,715.60
	BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,353,404.35
	BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,692,410.22
	BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,064,697.60
	BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,943,240.60
	BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	722,153.25
	BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,357,151.40
	BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	816,850.28
	BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,563,719.53

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

	BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,500,728.32
	BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	910,606.06
	BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,318,310.60
	BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	296,413.39
	BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,359,865.26
	BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,282,613.22
	BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,861,251.24
	BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,106,012.50
	BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	238,029.60
	BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	473,811.23
	BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	406,709.60
	BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	818,808.40
	BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,124,404.04
	BTPS 4.5% 10/01/53	860,000.00	820,214.68
	BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,756,634.50
	BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,505,202.00
	BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,715,322.56
	BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	851,053.47
	BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,248,933.72
	BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,787,602.00
	BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,920,745.86
	BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,554,890.02
	BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,184,305.50
	BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	3,982,586.53
	BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,347,064.24
	BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,989,210.50
	BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,291,081.92
	BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,544,926.60
	DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,798,639.96
	DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,705,238.54
	DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,884,166.35
	DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,979,022.20
	DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,849,010.00
	DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,251,384.96
	DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	324,766.40
	DBR 0% 02/15/30	970,000.00	834,018.61

	DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	947,115.15
	DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,986,468.50
	DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,756,854.12
	DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,594,592.72
	DBR 0% 08/15/26	1,550,000.00	1,440,566.90
	DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,566,786.15
	DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,996,362.60
	DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,258,932.94
	DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,755,975.92
	DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,124,006.54
	DBR 0% 08/15/52	3,100,000.00	1,422,419.50
	DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,190,547.70
	DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,762,027.59
	DBR 1.25% 08/15/48	3,330,000.00	2,428,485.75
	DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,958,916.56
	DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,905,066.24
	DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,505,483.01
	DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,347,170.19
	DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,766,449.61
	DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,537,668.54
	DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,637,803.00
	DBR 2.5% 08/15/46	2,820,000.00	2,672,176.30
	DBR 2.6% 08/15/33	1,440,000.00	1,441,957.52
	DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,936,566.75
	DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,772,520.76
	DBR 4.25% 07/04/39	1,590,000.00	1,876,048.95
	DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,568,016.45
	DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,544,527.82
	DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,484,595.08
	DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,701,015.60
	DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,641,433.54
	DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,515,427.62
	DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,042,189.85
	FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	3,965,839.02
	FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,450,794.12
	FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,235,053.50

	FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,480,325.25
	FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,695,224.55
	FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	345,180.92
	FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	829,642.71
	FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,304,878.52
	FRTR 0.75% 05/25/28	6,010,000.00	5,479,930.02
	FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,467,148.20
	FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,540,885.52
	FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,911,343.52
	FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,150,068.03
	FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,761,232.94
	FRTR 0% 02/25/27	3,040,000.00	2,770,093.60
	FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,589,283.80
	FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,545,404.64
	FRTR 0% 11/25/29	4,450,000.00	3,752,373.50
	FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,308,108.00
	FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,861,667.23
	FRTR 1.25% 05/25/34	3,860,000.00	3,201,875.89
	FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,518,218.95
	FRTR 1.25% 05/25/38	1,800,000.00	1,355,794.92
	FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,675,199.98
	FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,854,123.32
	FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	921,715.88
	FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,343,679.60
	FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,088,448.00
	FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,662,083.65
	FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,487,024.73
	FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,439,641.49
	FRTR 2.5% 05/25/43	1,020,000.00	868,532.04
	FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,101,110.47
	FRTR 2.75% 02/25/29	970,000.00	962,948.10
	FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,315,864.15
	FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,128,383.40
	FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,660,950.68
	FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,939,207.04
	FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,787,824.25

	FRTR 3% 05/25/33	3,690,000.00	3,659,764.14
	FRTR 3% 05/25/54	1,650,000.00	1,452,543.16
	FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,894,117.84
	FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,786,843.56
	FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,068,278.81
	FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,911,194.18
	FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,940,313.75
	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,681,803.36
	FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,335,039.88
	FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,003,403.70
	IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	611,862.09
	IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	649,662.78
	IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	375,151.55
	IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	511,588.08
	IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	227,969.28
	IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	708,916.97
	IRISH 0% 10/18/31	950,000.00	757,423.60
	IRISH 1.1% 05/15/29	940,000.00	857,893.82
	IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	370,426.94
	IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	422,884.00
	IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	528,221.60
	IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	480,798.54
	IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	954,175.40
	IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	767,058.40
	IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	765,478.00
	IRISH 3% 10/18/43	420,000.00	403,161.25
	IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,193,274.83
	NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,823,694.74
	NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	827,893.65
	NETHER 0.5% 01/15/40	1,560,000.00	1,058,268.12
	NETHER 0.5% 07/15/26	1,830,000.00	1,720,763.26
	NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	838,911.91
	NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	837,972.54
	NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,554,419.14
	NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,117,415.95
	NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,687,250.56

	NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,400,654.92
	NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	625,569.60
	NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	770,920.92
	NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,126,833.38
	NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,271,623.50
	NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	393,818.00
	NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,506,523.11
	NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	714,884.69
	NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,757,071.20
	NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	576,014.40
	NETHER 3.25% 01/15/44	510,000.00	525,313.77
	NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,859,584.10
	NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,832,132.04
	NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,691,646.03
	OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,874,622.13
	OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,196,767.81
	OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,335,501.65
	OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,378,998.45
	OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,784,030.99
	OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,388,965.61
	OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,366,079.60
	OBL 2.4% 10/19/28	2,970,000.00	2,952,978.93
	RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	491,127.12
	RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,245,199.20
	RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,125,801.36
	RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	115,115.37
	RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	805,639.12
	RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	398,036.38
	RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,324,389.49
	RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	95,651.25
	RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,035,348.81
	RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,064,115.20
	RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,343,329.63
	RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	984,552.52
	RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	633,247.99
	RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	331,906.74

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

	RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	455,009.92
	RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	587,119.32
	SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,737,736.88
	SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,703,818.31
	SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,060,872.72
	SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,048,966.98
	SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,766,428.40
	SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,242,286.80
	SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,407,561.75
	SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	996,158.00
	SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,189,376.47
	SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,481,194.80
	SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,633,929.09
	SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,133,401.49
	SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,907,985.32
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,386,658.24
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,741,009.09
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,963,535.76
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,014,465.25
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,895,553.00
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,459,623.02
	SPGB 1.45% 10/31/27	3,160,000.00	2,963,776.64
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	290,493.72
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,420,194.00
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,413,597.75
	SPGB 1.85% 07/30/35	1,850,000.00	1,527,694.42
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,610,000.00	995,496.81
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,233,728.51
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,861,714.82
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	538,895.00
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	935,920.40
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,539,503.75
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,550,000.00	1,400,702.00
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,841,063.40
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,332,443.67
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,339,166.25

	SPGB 2.8% 05/31/26	1,270,000.00	1,257,233.96
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,611,594.32
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,647,992.96
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	665,856.36
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,159,353.18
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,090,000.00	2,083,614.21
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,018,510.58
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,029,530.75
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,901,038.70
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,043,278.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,914,841.85
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,421,598.34
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,632,077.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,354,894.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,467,412.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,031,698.85
	ユーロ 小計	659,150,000.00	599,491,686.16 (98,040,870,354)
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,153,969.99
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,284,967.11
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,809,812.56
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,041,172.00
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,312,584.03
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,514,664.00
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,824,276.32
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	524,001.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,321,011.72
	UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	1,636,257.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	428,160.50
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	795,637.72
	UKT 0.875% 07/31/33	2,190,000.00	1,625,702.70
	UKT 0.875% 10/22/29	1,110,000.00	931,557.73
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,304,311.68
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	390,625.62
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	860,369.40
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,182,170.00

	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,225,714.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,493,072.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	955,825.00	
	UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	582,882.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	959,446.74	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	702,843.40	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	556,719.28	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	632,691.21	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	835,848.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,380,456.00	
	UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,110,937.32	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	915,320.64	
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,279,578.28	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,584,161.64	
	UKT 3.25% 01/31/33	3,260,000.00	3,049,606.12	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,660,000.00	1,422,288.99	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,275,195.63	
	UKT 3.5% 10/22/25	1,520,000.00	1,491,348.00	
	UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,310,205.84	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,156,280.40	
	UKT 3.75% 10/22/53	2,070,000.00	1,804,212.00	
	UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,330,481.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,886,598.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,526,145.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,240,549.20	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,194,882.42	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,409,484.68	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,692,219.12	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,536,146.08	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,628,069.60	
	UKT 4.5% 06/07/28	660,000.00	670,717.34	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,425,726.33	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,795,826.88	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,529,495.70	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,451,358.44	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,153,356.50	

	UKT 4% 10/22/63	1,000,000.00	919,700.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,185,428.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,471,243.50	
	イギリスポンド 小計	98,390,000.00	80,713,311.36 (15,068,368,097)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,723,693.27	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,911,110.50	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,540,000.00	4,974,139.19	
	SGB 1.75% 11/11/33	3,260,000.00	3,007,168.22	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,557,874.43	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,346,554.44	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,635,776.40	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,681,883.00	
	スウェーデンクローナ 小計	45,220,000.00	42,838,199.45 (610,444,342)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,091,200.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,505,373.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,882,964.20	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,969,795.78	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,076,425.50	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,836,900.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,222,788.26	
	NGB 2% 04/26/28	3,070,000.00	2,860,779.50	
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,888,863.48	
	NGB 3% 08/15/33	4,460,000.00	4,222,505.00	
	ノルウェークローネ 小計	40,720,000.00	37,557,595.32 (520,923,847)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,526,589.34	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,299,809.37	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,379,065.40	
	DGB 0% 11/15/24	4,050,000.00	3,920,169.15	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,279,415.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,408,142.56	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,810,000.00	1,720,405.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,900,000.00	11,804,342.22	
	デンマーククローネ 小計	46,980,000.00	43,337,938.04	

			(950,400,981)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,964,166.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,344,979.56
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,210,855.00
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,350,690.39
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,576,737.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,042,159.99
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,899,471.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,261,292.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,901,926.60
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,348,783.40
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	611,866.80
	POLGB 6% 10/25/33	2,380,000.00	2,474,467.91
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,932,829.66
	ポーランドズロチ 小計	44,690,000.00	40,920,225.51 (1,524,875,835)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,689,860.46
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,943,963.80
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,094,900.50
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,897,264.50
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,961,110.27
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	914,932.19
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,459,355.98
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,150,186.60
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,366,948.58
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,367,640.90
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,107,303.72
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,014,268.83
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,010,098.59
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,834,899.53
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,556,575.40
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,347,235.10
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,041,970.19
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,605,127.84
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	942,871.09
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,325,075.74

	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,062,231.39
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,800,000.00	1,691,520.45
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,007,005.05
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,624,258.34
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,660,000.00	1,666,003.55
	ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,021,673.38
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,052,187.08
	ACGB 4.75% 06/21/54	670,000.00	665,672.53
	オーストラリアドル 小計	50,190,000.00	44,422,141.58 (4,334,268,353)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	533,967.02
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	603,031.55
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	793,525.84
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	281,442.49
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	822,970.39
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	489,168.71
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	393,451.82
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	426,150.85
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,040,496.89
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	597,038.01
	NZGB 4.25% 05/15/34	380,000.00	359,424.71
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	834,027.03
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	482,609.31
	ニュージーランドドル 小計	8,910,000.00	7,657,304.62 (688,851,123)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	748,240.60
	SIGB 1.25% 11/01/26	760,000.00	720,100.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	509,040.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	616,000.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	338,979.90
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	613,620.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	600,600.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	884,970.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	435,396.25
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	710,280.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	350,640.00

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

	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,816,310.66	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,118,123.40	
	マレーシアリングgit 小計	47,410,000.00	48,004,722.78 (1,536,904,803)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,992,605.67	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,399,120.54	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,306,394.31	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,228,815.65	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,218,185.50	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,194,636.33	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,720,000.00	2,251,722.08	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,496,135.15	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	740,000.00	496,552.65	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,507,964.96	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,630,000.00	2,219,743.40	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,056,342.68	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,426,396.90	
		イスラエルシェケル 小計	25,190,000.00	22,794,615.82 (919,272,664)
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	52,570,000.00	52,298,282.49	
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,059,670.84	
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,060,610.94	
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	31,968,362.88	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,168,048.49	
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,351,669.90	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,066,485.52	
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,901,798.29	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,443,733.64	
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,288,590.29	
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,553,766.75	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,011,520.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,466,762.64	
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,095,484.72	
	CGB 2.52% 08/25/33	11,500,000.00	11,381,698.12	
	CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	31,846,491.79	
	CGB 2.6% 09/15/30	10,500,000.00	10,473,554.28	

	CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,140,631.10	
	CGB 2.62% 06/25/30	21,400,000.00	21,382,842.97	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,008,536.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,598,574.93	
	CGB 2.67% 05/25/33	13,000,000.00	12,999,524.46	
	CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,594,327.30	
	CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,179,873.72	
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,254,297.16	
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,577,624.30	
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,693,830.78	
	CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,779,848.75	
	CGB 2.79% 12/15/29	15,000,000.00	15,139,369.50	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,375,230.12	
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,192,466.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,651,333.24	
	CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,448,014.43	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,539,589.38	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,604,911.09	
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,731,136.32	
	CGB 2% 06/15/25	16,600,000.00	16,514,593.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	12,888,952.06	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,313,474.71	
	CGB 3.02% 10/22/25	4,270,000.00	4,335,652.53	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,135,061.12	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,526,366.24	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,600,000.00	6,903,180.24	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,174,535.19	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,615,128.12	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,506,988.90	
	CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	17,911,450.35	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,165,025.96	
	CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	15,256,023.04	
	CGB 3.81% 09/14/50	18,020,000.00	20,607,724.25	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,752,880.66	
	CGB 4.08% 10/22/48	13,110,000.00	15,528,464.62	
	オフショア人民元 小計	1,012,830,000.00	1,028,463,994.12	

		(21,349,061,282)
	合計	297,342,136,793 (297,342,136,793)

有価証券明細表注記

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 207 銘柄	100.0%	47.7%
カナダドル	国債証券 36 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 358 銘柄	100.0%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 57 銘柄	100.0%	5.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 28 銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28 銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 52 銘柄	100.0%	7.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年11月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		243,768,698,223口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4337円 (24,337円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

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

コア投資戦略ファンド（成長型）	2,631,424,283 円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367 円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443 円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	591,424,139 円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	406,077,221 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,225,158,969 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	200,832,770 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,778,514 円
SMT インデックスバランス・オープン	49,352,178 円
国内株式SMT Bセレクション（SMA専用）	19,637,402,945 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,816,957 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,063,098 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	214,549,267 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,996,916 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,089,128 円
グローバル経済コア	217,494,160 円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,720,100 円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,229,953,422 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	30,773,557 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	964,175,269 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	240,247,924 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	52,466,000 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	49,982,774 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	21,517,346 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	24,205,054 円
10資産分散投資ファンド	92,848,595 円
グローバル10資産バランスファンド	2,856,307 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,174,446,024 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	496,310,076 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,088,835 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,124,196 円
SMT AM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	437,099,410 円
SMT AM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	47,038,358,652 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,860,409 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	210,824,141 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年11月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,658,684,200	—	6,941,170,000	282,485,800

合計	6,658,684,200	—	6,941,170,000	282,485,800
----	---------------	---	---------------	-------------

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,200	3,730.00	34,316,000	
ニッスイ	243,200	705.80	171,650,560	
マルハニチロ	36,100	2,733.50	98,679,350	
雪国まいたけ	20,700	934.00	19,333,800	
カネコ種苗	7,400	1,415.00	10,471,000	
サカタのタネ	27,700	4,015.00	111,215,500	
ホクト	19,500	1,736.00	33,852,000	
ホクリヨウ	2,300	1,116.00	2,566,800	
住石ホールディングス	25,100	632.00	15,863,200	
日鉄鉱業	9,800	5,370.00	52,626,000	
三井松島ホールディングス	14,400	2,760.00	39,744,000	
I N P E X	899,300	2,097.00	1,885,832,100	
石油資源開発	28,200	5,590.00	157,638,000	
K&Oエナジーグループ	11,000	2,177.00	23,947,000	
ショーボンドホールディングス	33,100	5,974.00	197,739,400	
ミライト・ワン	80,400	1,830.00	147,132,000	
タマホーム	15,300	3,630.00	55,539,000	
サンヨーホームズ	2,000	717.00	1,434,000	
日本アクア	6,700	905.00	6,063,500	
ファーストコーポレーション	4,100	753.00	3,087,300	
ベステラ	3,500	1,039.00	3,636,500	
キャンディル	2,900	579.00	1,679,100	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	999.00	3,296,700	
第一カッター興業	6,200	1,290.00	7,998,000	
安藤・間	140,900	1,084.00	152,735,600	

東急建設	76,200	785.00	59,817,000	
コムシスホールディングス	77,600	3,184.00	247,078,400	
ビーアールホールディングス	38,500	352.00	13,552,000	
高松コンストラクショングループ	18,100	2,666.00	48,254,600	
東建コーポレーション	7,000	8,040.00	56,280,000	
ソネック	1,700	953.00	1,620,100	
ヤマウラ	12,300	1,424.00	17,515,200	
オリエンタル白石	90,000	327.00	29,430,000	
大成建設	159,200	5,375.00	855,700,000	
大林組	608,300	1,276.00	776,190,800	
清水建設	482,300	977.50	471,448,250	
飛鳥建設	18,700	1,288.00	24,085,600	
長谷工コーポレーション	156,100	1,811.50	282,775,150	
松井建設	15,900	768.00	12,211,200	
銭高組	1,400	3,525.00	4,935,000	
鹿島建設	377,200	2,284.50	861,713,400	
不動テトラ	11,800	2,063.00	24,343,400	
大末建設	4,100	1,304.00	5,346,400	
鉄建建設	12,200	1,981.00	24,168,200	
西松建設	32,400	3,686.00	119,426,400	
三井住友建設	126,600	399.00	50,513,400	
大豊建設	5,900	3,695.00	21,800,500	
佐田建設	7,200	615.00	4,428,000	
ナカノフドー建設	8,000	391.00	3,128,000	
奥村組	27,600	4,495.00	124,062,000	
東鉄工業	21,100	2,864.00	60,430,400	
イチケン	2,500	2,259.00	5,647,500	
富士ピー・エス	5,100	445.00	2,269,500	
浅沼組	12,600	3,650.00	45,990,000	
戸田建設	230,200	872.00	200,734,400	
熊谷組	28,500	3,460.00	98,610,000	
北野建設	2,100	3,110.00	6,531,000	
植木組	3,200	1,430.00	4,576,000	
矢作建設工業	23,100	1,268.00	29,290,800	
ピーエス三菱	21,600	932.00	20,131,200	
日本ハウスホールディングス	36,300	334.00	12,124,200	

新日本建設	23,900	1,102.00	26,337,800	
東亜道路工業	6,800	6,610.00	44,948,000	
日本道路	20,000	1,884.00	37,680,000	
東亜建設工業	13,100	3,690.00	48,339,000	
日本国土開発	48,400	600.00	29,040,000	
若築建設	5,900	2,929.00	17,281,100	
東洋建設	42,800	1,246.00	53,328,800	
五洋建設	241,100	798.70	192,566,570	
世紀東急工業	21,800	1,587.00	34,596,600	
福田組	6,400	5,150.00	32,960,000	
住友林業	147,000	3,804.00	559,188,000	
日本基礎技術	6,800	449.00	3,053,200	
巴コーポレーション	12,700	560.00	7,112,000	
大和ハウス工業	470,400	4,244.00	1,996,377,600	
ライト工業	35,000	1,961.00	68,635,000	
積水ハウス	515,900	3,021.00	1,558,533,900	
日特建設	16,200	1,025.00	16,605,000	
北陸電気工事	11,700	945.00	11,056,500	
ユアテック	37,500	965.00	36,187,500	
日本リーテック	14,900	1,259.00	18,759,100	
四電工	7,100	2,839.00	20,156,900	
中電工	26,400	2,397.00	63,280,800	
関電工	106,500	1,314.00	139,941,000	
きんでん	119,700	2,217.00	265,374,900	
東京エネシス	16,900	953.00	16,105,700	
トーエネック	5,600	4,035.00	22,596,000	
住友電設	16,200	2,527.00	40,937,400	
日本電設工業	31,900	1,979.00	63,130,100	
エクシオグループ	85,500	3,143.00	268,726,500	
新日本空調	11,000	2,175.00	23,925,000	
九電工	36,800	4,401.00	161,956,800	
三機工業	37,500	1,735.00	65,062,500	
日揮ホールディングス	168,300	1,660.50	279,462,150	
中外炉工業	5,600	2,150.00	12,040,000	
ヤマト	9,400	924.00	8,685,600	
太平電業	10,600	3,835.00	40,651,000	

高砂熱学工業	45,600	2,975.00	135,660,000
三晃金属工業	1,400	4,675.00	6,545,000
朝日工業社	7,900	2,719.00	21,480,100
明星工業	32,900	1,113.00	36,617,700
大氣社	19,600	4,240.00	83,104,000
ダイダン	22,400	1,441.00	32,278,400
日比谷総合設備	12,300	2,246.00	27,625,800
フィル・カンパニー	2,600	530.00	1,378,000
テスホールディングス	36,600	445.00	16,287,000
インフロニア・ホールディングス	196,100	1,612.00	316,113,200
東洋エンジニアリング	25,000	674.00	16,850,000
レイズネクスト	24,600	1,356.00	33,357,600
ニッポン	51,100	2,208.00	112,828,800
日清製粉グループ本社	157,900	2,098.50	331,353,150
日東富士製粉	3,000	4,690.00	14,070,000
昭和産業	16,500	3,040.00	50,160,000
鳥越製粉	10,100	698.00	7,049,800
中部飼料	23,600	1,054.00	24,874,400
フィード・ワン	25,000	773.00	19,325,000
東洋精糖	2,100	1,997.00	4,193,700
日本甜菜製糖	9,900	1,972.00	19,522,800
DM三井製糖ホールディングス	16,900	3,005.00	50,784,500
塩水港精糖	13,600	235.00	3,196,000
ウェルネオシュガー	8,800	2,044.00	17,987,200
森永製菓	36,500	5,373.00	196,114,500
中村屋	4,300	3,065.00	13,179,500
江崎グリコ	48,800	4,080.00	199,104,000
名糖産業	6,700	1,613.00	10,807,100
井村屋グループ	10,200	2,291.00	23,368,200
不二家	11,700	2,538.00	29,694,600
山崎製パン	114,300	3,153.00	360,387,900
第一屋製パン	2,200	682.00	1,500,400
モロゾフ	5,500	3,820.00	21,010,000
亀田製菓	9,800	3,845.00	37,681,000
寿スピリッツ	80,700	2,372.00	191,420,400
カルビー	78,200	2,717.50	212,508,500

森永乳業	31,000	5,456.00	169,136,000	
六甲バター	12,500	1,391.00	17,387,500	
ヤクルト本社	244,100	3,385.00	826,278,500	
明治ホールディングス	209,400	3,417.00	715,519,800	
雪印メグミルク	41,300	2,203.00	90,983,900	
プリマハム	22,900	2,214.00	50,700,600	
日本ハム	73,500	4,322.00	317,667,000	
林兼産業	3,500	586.00	2,051,000	
丸大食品	17,200	1,591.00	27,365,200	
S Foods	18,800	3,185.00	59,878,000	
柿安本店	6,700	2,457.00	16,461,900	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,100	3,895.00	101,659,500	
サッポロホールディングス	56,200	5,673.00	318,822,600	
アサヒグループホールディングス	394,600	5,525.00	2,180,165,000	
キリンホールディングス	711,300	2,167.00	1,541,387,100	
宝ホールディングス	116,600	1,163.00	135,605,800	
オエノンホールディングス	51,000	386.00	19,686,000	
養命酒製造	5,600	1,830.00	10,248,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,800	1,919.50	256,829,100	
ライフドリンク カンパニー	2,500	3,925.00	9,812,500	
サントリー食品インターナショナル	120,200	4,728.00	568,305,600	
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,940.00	57,618,000	
伊藤園	57,900	4,830.00	279,657,000	
キーコーヒー	19,100	2,064.00	39,422,400	
ユニカフェ	3,800	961.00	3,651,800	
ジャパンフーズ	1,800	1,156.00	2,080,800	
日清オイリオグループ	24,100	4,285.00	103,268,500	
不二製油グループ本社	39,800	2,426.00	96,554,800	
かどや製油	1,400	3,570.00	4,998,000	
J-オイルミルズ	19,600	1,931.00	37,847,600	
キッコーマン	113,200	9,438.00	1,068,381,600	
味の素	405,800	5,633.00	2,285,871,400	
ブルドックソース	9,100	2,069.00	18,827,900	
キュービー	91,800	2,522.00	231,519,600	
ハウス食品グループ本社	58,800	3,350.00	196,980,000	

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

帝国繊維	19,800	2,001.00	39,619,800
帝人	167,300	1,341.50	224,432,950
東レ	1,164,600	785.00	914,211,000
住江織物	2,500	2,203.00	5,507,500
日本フェルト	7,600	416.00	3,161,600
イチカワ	1,800	1,661.00	2,989,800
日東製網	1,200	1,432.00	1,718,400
アツギ	7,100	447.00	3,173,700
ダイニック	3,000	750.00	2,250,000
セーレン	33,800	2,271.00	76,759,800
ソトー	3,800	693.00	2,633,400
東海染工	1,300	941.00	1,223,300
小松マテーレ	25,400	808.00	20,523,200
ワコールホールディングス	35,600	3,296.00	117,337,600
ホギメディカル	23,300	3,400.00	79,220,000
T S I ホールディングス	58,600	842.00	49,341,200
マツオカコーポレーション	3,200	1,554.00	4,972,800
ワールド	24,600	1,568.00	38,572,800
三陽商会	5,700	2,653.00	15,122,100
ナイガイ	4,400	268.00	1,179,200
オンワードホールディングス	102,700	491.00	50,425,700
ルックホールディングス	4,300	2,382.00	10,242,600
ゴールドウイン	30,800	10,885.00	335,258,000
デサント	30,000	4,450.00	133,500,000
キング	5,300	664.00	3,519,200
ヤマトインターナショナル	9,600	297.00	2,851,200
特種東海製紙	9,500	3,555.00	33,772,500
王子ホールディングス	723,700	573.30	414,897,210
日本製紙	98,000	1,291.00	126,518,000
三菱製紙	13,900	528.00	7,339,200
北越コーポレーション	85,400	1,319.00	112,642,600
中越パルプ工業	4,700	1,535.00	7,214,500
大王製紙	76,700	1,057.50	81,110,250
阿波製紙	2,800	403.00	1,128,400
レンゴー	158,200	946.70	149,767,940
トーモク	10,000	2,141.00	21,410,000

ザ・パック	12,900	3,160.00	40,764,000	
北の達人コーポレーション	73,200	194.00	14,200,800	
クラレ	253,200	1,550.50	392,586,600	
旭化成	1,175,300	1,007.00	1,183,527,100	
共和レザー	6,700	750.00	5,025,000	
巴川製紙所	3,600	656.00	2,361,600	
レゾナック・ホールディングス	167,900	2,693.50	452,238,650	
住友化学	1,289,200	387.20	499,178,240	
住友精化	8,200	4,990.00	40,918,000	
日産化学	81,600	5,600.00	456,960,000	
ラサ工業	6,700	2,086.00	13,976,200	
クレハ	12,700	8,170.00	103,759,000	
多木化学	6,700	3,130.00	20,971,000	
テイカ	15,000	1,329.00	19,935,000	
石原産業	28,800	1,357.00	39,081,600	
片倉コープアグリ	2,400	1,140.00	2,736,000	
日本曹達	20,500	5,250.00	107,625,000	
東ソー	231,900	1,913.00	443,624,700	
トクヤマ	56,100	2,356.50	132,199,650	
セントラル硝子	18,500	2,670.00	49,395,000	
東亜合成	87,100	1,347.00	117,323,700	
大阪ソーダ	12,100	9,080.00	109,868,000	
関東電化工業	33,600	792.00	26,611,200	
デンカ	63,200	2,597.00	164,130,400	
信越化学工業	1,575,300	5,160.00	8,128,548,000	
日本カーバイド工業	6,400	1,491.00	9,542,400	
堺化学工業	13,200	1,835.00	24,222,000	
第一稀元素化学工業	19,000	968.00	18,392,000	
エア・ウォーター	163,900	1,953.50	320,178,650	
日本酸素ホールディングス	168,500	4,059.00	683,941,500	
日本化学工業	6,400	1,978.00	12,659,200	
東邦アセチレン	2,400	1,784.00	4,281,600	
日本パーカライジング	77,400	1,126.00	87,152,400	
高压ガス工業	25,200	798.00	20,109,600	
チタン工業	1,400	1,302.00	1,822,800	
四国化成ホールディングス	22,300	1,791.00	39,939,300	

戸田工業	4,000	1,652.00	6,608,000
ステラ ケミファ	9,400	3,110.00	29,234,000
保土谷化学工業	5,500	3,230.00	17,765,000
日本触媒	26,500	5,305.00	140,582,500
大日精化工業	12,100	2,153.00	26,051,300
カネカ	44,100	3,758.00	165,727,800
三菱瓦斯化学	129,700	2,284.00	296,234,800
三井化学	143,300	4,090.00	586,097,000
J S R	189,200	3,946.00	746,583,200
東京応化工業	27,600	9,137.00	252,181,200
大阪有機化学工業	14,500	2,685.00	38,932,500
三菱ケミカルグループ	1,270,000	957.00	1,215,390,000
KHネオケム	26,500	2,295.00	60,817,500
ダイセル	223,300	1,422.50	317,644,250
住友ベークライト	25,700	6,858.00	176,250,600
積水化学工業	352,200	2,120.00	746,664,000
日本ゼオン	119,100	1,355.50	161,440,050
アイカ工業	43,800	3,410.00	149,358,000
UBE	82,700	2,317.00	191,615,900
積水樹脂	25,900	2,475.00	64,102,500
タキロンシーアイ	44,300	585.00	25,915,500
旭有機材	11,600	4,125.00	47,850,000
ニチバン	9,400	1,745.00	16,403,000
リケンテクノス	37,300	826.00	30,809,800
大倉工業	8,100	2,730.00	22,113,000
積水化成品工業	24,400	467.00	11,394,800
群栄化学工業	4,100	3,090.00	12,669,000
タイガースポリマー	5,300	864.00	4,579,200
ミライアル	3,500	1,477.00	5,169,500
ダイキアクシス	4,800	755.00	3,624,000
ダイキョーニシカワ	38,300	745.00	28,533,500
竹本容器	4,400	780.00	3,432,000
森六ホールディングス	9,900	2,672.00	26,452,800
恵和	12,500	1,317.00	16,462,500
日本化薬	132,700	1,339.00	177,685,300
カーリットホールディングス	18,700	940.00	17,578,000

日本精化	11,500	2,654.00	30,521,000
扶桑化学工業	18,400	4,090.00	75,256,000
トリケミカル研究所	21,100	3,440.00	72,584,000
ADEKA	60,600	2,823.00	171,073,800
日油	53,700	6,813.00	365,858,100
新日本理化	15,900	190.00	3,021,000
ハリマ化成グループ	9,500	795.00	7,552,500
花王	392,800	5,519.00	2,167,863,200
第一工業製薬	6,900	1,784.00	12,309,600
石原ケミカル	7,900	1,859.00	14,686,100
日華化学	4,600	959.00	4,411,400
ニイタカ	2,100	2,078.00	4,363,800
三洋化成工業	10,700	4,285.00	45,849,500
有機合成薬品工業	8,500	282.00	2,397,000
大日本塗料	21,100	941.00	19,855,100
日本ペイントホールディングス	922,500	1,141.00	1,052,572,500
関西ペイント	170,200	2,361.50	401,927,300
神東塗料	9,600	125.00	1,200,000
中国塗料	35,700	1,427.00	50,943,900
日本特殊塗料	7,300	1,187.00	8,665,100
藤倉化成	23,300	445.00	10,368,500
太陽ホールディングス	30,200	2,955.00	89,241,000
DIC	67,900	2,395.50	162,654,450
サカタインクス	38,600	1,316.00	50,797,600
東洋インキSCホールディングス	37,800	2,575.00	97,335,000
T&K TOKA	16,600	1,419.00	23,555,400
富士フイルムホールディングス	322,700	8,698.00	2,806,844,600
資生堂	363,200	4,320.00	1,569,024,000
ライオン	227,700	1,341.00	305,345,700
高砂香料工業	13,100	3,400.00	44,540,000
マンダム	37,600	1,271.00	47,789,600
ミルボン	23,600	3,919.00	92,488,400
ファンケル	76,100	2,312.50	175,981,250
コーセー	35,400	10,570.00	374,178,000
コタ	16,000	1,570.00	25,120,000
シーボン	1,500	1,493.00	2,239,500

ポーラ・オルビスホールディングス	89,200	1,539.50	137,323,400	
ノエビアホールディングス	15,500	5,120.00	79,360,000	
アジュバンホールディングス	2,800	922.00	2,581,600	
新日本製薬	9,900	1,559.00	15,434,100	
I - n e	3,400	2,734.00	9,295,600	
アクシージア	8,800	977.00	8,597,600	
エステー	13,400	1,491.00	19,979,400	
アグロ カネショウ	7,000	1,325.00	9,275,000	
コニシ	29,000	2,479.00	71,891,000	
長谷川香料	33,200	3,270.00	108,564,000	
小林製薬	50,600	6,787.00	343,422,200	
荒川化学工業	14,700	1,010.00	14,847,000	
メック	14,300	4,050.00	57,915,000	
日本高純度化学	4,300	2,532.00	10,887,600	
タカラバイオ	46,900	1,201.00	56,326,900	
J C U	19,400	3,720.00	72,168,000	
新田ゼラチン	7,100	795.00	5,644,500	
O A Tアグリオ	5,000	1,929.00	9,645,000	
デクセリアルズ	43,600	4,342.00	189,311,200	
アース製薬	15,800	4,785.00	75,603,000	
北興化学工業	17,500	932.00	16,310,000	
大成ラミック	5,500	2,943.00	16,186,500	
クミアイ化学工業	69,100	1,102.00	76,148,200	
日本農薬	31,900	594.00	18,948,600	
アキレス	11,000	1,574.00	17,314,000	
有沢製作所	30,500	1,048.00	31,964,000	
日東電工	111,700	10,615.00	1,185,695,500	
レック	22,300	908.00	20,248,400	
三光合成	21,900	556.00	12,176,400	
きもと	17,000	187.00	3,179,000	
藤森工業	13,700	3,805.00	52,128,500	
前澤化成工業	11,200	1,560.00	17,472,000	
未来工業	6,200	3,325.00	20,615,000	
ウェーブロックホールディングス	3,600	619.00	2,228,400	
J S P	12,200	1,769.00	21,581,800	
エフピコ	32,900	2,819.50	92,761,550	

天馬	12,600	2,376.00	29,937,600
信越ポリマー	37,500	1,418.00	53,175,000
東リ	25,900	362.00	9,375,800
ニフコ	52,000	3,845.00	199,940,000
バルカー	14,500	3,775.00	54,737,500
ユニ・チャーム	362,400	4,733.00	1,715,239,200
ショーエイコーポレーション	3,400	585.00	1,989,000
協和キリン	210,100	2,441.00	512,854,100
武田薬品工業	1,539,400	4,190.00	6,450,086,000
アステラス製薬	1,525,800	1,808.50	2,759,409,300
住友ファーマ	129,000	480.00	61,920,000
塩野義製薬	219,300	7,097.00	1,556,372,100
わかもと製薬	10,800	200.00	2,160,000
日本新薬	45,600	5,367.00	244,735,200
中外製薬	544,500	4,880.00	2,657,160,000
科研製薬	29,800	3,225.00	96,105,000
エーザイ	211,600	7,721.00	1,633,763,600
ロート製薬	168,500	3,123.00	526,225,500
小野薬品工業	369,100	2,751.50	1,015,578,650
久光製薬	38,700	4,540.00	175,698,000
持田製薬	20,000	3,195.00	63,900,000
参天製薬	317,000	1,332.50	422,402,500
扶桑薬品工業	6,100	1,893.00	11,547,300
日本ケミファ	1,200	1,617.00	1,940,400
ツムラ	54,800	2,695.50	147,713,400
キッセイ薬品工業	28,800	3,005.00	86,544,000
生化学工業	29,500	757.00	22,331,500
栄研化学	33,900	1,584.00	53,697,600
鳥居薬品	9,300	3,615.00	33,619,500
JCRファーマ	58,900	1,270.00	74,803,000
東和薬品	26,700	2,444.00	65,254,800
富士製薬工業	12,800	1,414.00	18,099,200
ゼリア新薬工業	24,100	1,921.00	46,296,100
そーせいグループ	56,100	1,403.00	78,708,300
第一三共	1,515,300	3,947.00	5,980,889,100
杏林製薬	37,700	1,789.00	67,445,300

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

日本ヒューム	15,400	906.00	13,952,400	
日本コンクリート工業	34,300	328.00	11,250,400	
三谷セキサン	7,300	4,325.00	31,572,500	
アジアパイルホールディングス	27,400	682.00	18,686,800	
東海カーボン	160,600	1,087.50	174,652,500	
日本カーボン	9,200	4,585.00	42,182,000	
東洋炭素	12,300	4,410.00	54,243,000	
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	6,580.00	63,826,000	
TOTO	114,800	3,910.00	448,868,000	
日本碍子	202,400	1,789.50	362,194,800	
日本特殊陶業	145,700	3,357.00	489,114,900	
MARUWA	6,400	28,200.00	180,480,000	
品川リフクトリーズ	21,500	1,647.00	35,410,500	
黒崎播磨	3,600	9,940.00	35,784,000	
ヨータイ	10,800	1,424.00	15,379,200	
東京窯業	11,200	399.00	4,468,800	
ニッカトー	5,500	560.00	3,080,000	
フジインコーポレーテッド	46,800	3,015.00	141,102,000	
クニミネ工業	3,600	993.00	3,574,800	
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,211.00	2,785,300	
ニチアス	44,000	3,045.00	133,980,000	
ニチハ	21,800	2,774.00	60,473,200	
日本製鉄	801,300	3,401.00	2,725,221,300	
神戸製鋼所	359,900	1,740.50	626,405,950	
中山製鋼所	41,000	818.00	33,538,000	
合同製鐵	10,000	4,320.00	43,200,000	
JFEホールディングス	497,700	2,228.00	1,108,875,600	
東京製鐵	50,300	1,794.00	90,238,200	
共英製鋼	20,400	2,038.00	41,575,200	
大和工業	33,700	7,314.00	246,481,800	
東京鐵鋼	8,500	3,775.00	32,087,500	
大阪製鐵	8,200	1,896.00	15,547,200	
淀川製鋼所	20,300	3,740.00	75,922,000	
中部鋼板	11,800	1,947.00	22,974,600	
丸一鋼管	54,500	3,796.00	206,882,000	
モリ工業	3,200	4,240.00	13,568,000	

大同特殊鋼	22,600	6,337.00	143,216,200	
日本高周波鋼業	4,100	523.00	2,144,300	
日本冶金工業	13,100	4,125.00	54,037,500	
山陽特殊製鋼	17,700	2,562.00	45,347,400	
愛知製鋼	10,300	3,395.00	34,968,500	
日本金属	2,600	797.00	2,072,200	
大平洋金属	15,300	1,333.00	20,394,900	
新日本電工	89,100	296.00	26,373,600	
栗本鐵工所	8,500	3,195.00	27,157,500	
虹技	1,500	1,149.00	1,723,500	
三菱製鋼	13,300	1,470.00	19,551,000	
日亜鋼業	12,200	305.00	3,721,000	
日本精線	2,800	4,700.00	13,160,000	
エンビプロ・ホールディングス	9,600	650.00	6,240,000	
シンニッタン	13,000	246.00	3,198,000	
新家工業	2,600	2,915.00	7,579,000	
大紀アルミニウム工業所	22,700	1,196.00	27,149,200	
日本軽金属ホールディングス	52,300	1,673.00	87,497,900	
三井金属鉱業	52,100	4,282.00	223,092,200	
東邦亜鉛	11,500	1,193.00	13,719,500	
三菱マテリアル	127,900	2,431.50	310,988,850	
住友金属鉱山	207,500	4,365.00	905,737,500	
DOWAホールディングス	44,200	5,121.00	226,348,200	
古河機械金属	23,600	1,945.00	45,902,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,000	3,005.00	93,155,000	
東邦チタニウム	37,000	1,916.00	70,892,000	
UACJ	25,100	3,160.00	79,316,000	
CKサンエツ	4,300	3,615.00	15,544,500	
古河電気工業	59,600	2,391.50	142,533,400	
住友電気工業	669,400	1,828.00	1,223,663,200	
フジクラ	211,100	1,126.00	237,698,600	
SWCC	20,000	2,614.00	52,280,000	
タツタ電線	31,900	685.00	21,851,500	
カナレ電気	2,100	1,507.00	3,164,700	
平河ヒューテック	11,500	1,382.00	15,893,000	
リョービ	19,100	3,125.00	59,687,500	

アーレスティ	13,200	823.00	10,863,600	
AREホールディングス	67,200	1,929.00	129,628,800	
稲葉製作所	9,300	1,514.00	14,080,200	
宮地エンジニアリンググループ	9,000	3,135.00	28,215,000	
トーカロ	51,600	1,436.00	74,097,600	
アルファCo	4,400	1,423.00	6,261,200	
SUMCO	318,000	2,137.00	679,566,000	
川田テクノロジーズ	4,200	6,560.00	27,552,000	
RS Technologies	12,000	2,448.00	29,376,000	
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,088.00	3,340,800	
信和	6,600	734.00	4,844,400	
東洋製罐グループホールディングス	106,700	2,373.50	253,252,450	
ホッカンホールディングス	9,600	1,592.00	15,283,200	
コロナ	10,000	897.00	8,970,000	
横河ブリッジホールディングス	28,000	2,617.00	73,276,000	
駒井ハルテック	1,900	2,203.00	4,185,700	
高田機工	1,000	3,255.00	3,255,000	
三和ホールディングス	179,800	2,064.00	371,107,200	
文化シャッター	46,800	1,358.00	63,554,400	
三協立山	20,500	830.00	17,015,000	
アルインコ	13,600	1,005.00	13,668,000	
東洋シャッター	2,700	706.00	1,906,200	
LIXIL	279,400	1,782.00	497,890,800	
日本フィルコン	7,700	484.00	3,726,800	
ノーリツ	29,700	1,520.00	45,144,000	
長府製作所	17,800	2,062.00	36,703,600	
リンナイ	87,600	2,984.50	261,442,200	
ダイニチ工業	5,900	713.00	4,206,700	
日東精工	25,900	559.00	14,478,100	
三洋工業	1,400	2,215.00	3,101,000	
岡部	32,000	695.00	22,240,000	
ジーテクト	22,800	1,723.00	39,284,400	
東プレ	31,500	1,893.00	59,629,500	
高周波熱錬	27,600	984.00	27,158,400	
東京製綱	11,600	1,373.00	15,926,800	
サンコール	13,900	469.00	6,519,100	

モリテック スチール	8,800	301.00	2,648,800	
パイオラックス	22,200	2,281.00	50,638,200	
エイチワン	18,400	750.00	13,800,000	
日本発條	158,300	1,116.50	176,741,950	
中央発條	13,300	711.00	9,456,300	
アドバネクス	1,500	909.00	1,363,500	
立川ブラインド工業	8,100	1,465.00	11,866,500	
三益半導体工業	13,800	2,696.00	37,204,800	
日本ドライケミカル	2,800	2,331.00	6,526,800	
日本製鋼所	48,300	2,576.00	124,420,800	
三浦工業	73,200	2,843.50	208,144,200	
タクマ	59,300	1,562.00	92,626,600	
ツガミ	39,000	1,205.00	46,995,000	
オークマ	15,300	6,291.00	96,252,300	
芝浦機械	17,500	3,525.00	61,687,500	
アマダ	279,600	1,457.50	407,517,000	
アイダエンジニアリング	40,600	887.00	36,012,200	
F U J I	82,500	2,418.00	199,485,000	
牧野フライス製作所	19,400	5,770.00	111,938,000	
オーエスジー	77,200	1,792.50	138,381,000	
ダイジェット工業	1,300	884.00	1,149,200	
旭ダイヤモンド工業	42,100	897.00	37,763,700	
DMG森精機	106,200	2,663.50	282,863,700	
ソディック	42,700	776.00	33,135,200	
ディスコ	84,300	31,730.00	2,674,839,000	
日東工器	8,500	1,802.00	15,317,000	
日進工具	16,300	1,019.00	16,609,700	
パンチ工業	10,700	422.00	4,515,400	
富士ダイス	9,200	641.00	5,897,200	
豊和工業	6,500	750.00	4,875,000	
リケンN P R	19,000	2,033.00	38,627,000	
東洋機械金属	8,100	644.00	5,216,400	
エンシュウ	2,600	672.00	1,747,200	
島精機製作所	27,900	1,639.00	45,728,100	
オプトラン	28,800	1,625.00	46,800,000	
NCホールディングス	2,400	1,830.00	4,392,000	

イワキポンプ	11,700	1,975.00	23,107,500	
フリー	16,600	1,275.00	21,165,000	
ヤマシンフィルタ	42,200	322.00	13,588,400	
日阪製作所	19,200	926.00	17,779,200	
やまびこ	28,600	1,433.00	40,983,800	
野村マイクロ・サイエンス	5,900	10,300.00	60,770,000	
平田機工	8,400	6,310.00	53,004,000	
PEGASUS	19,400	484.00	9,389,600	
マルマエ	7,700	1,577.00	12,142,900	
タツモ	10,600	3,820.00	40,492,000	
ナブテスコ	110,000	2,708.50	297,935,000	
三井海洋開発	22,200	2,004.00	44,488,800	
レオン自動機	20,300	1,491.00	30,267,300	
SMC	52,400	75,570.00	3,959,868,000	
ホソカワミクロン	11,200	4,250.00	47,600,000	
ユニオンツール	7,700	3,510.00	27,027,000	
瑞光	12,600	1,360.00	17,136,000	
オイレス工業	24,400	1,936.00	47,238,400	
日精エー・エス・ビー機械	7,000	5,040.00	35,280,000	
サトーホールディングス	24,900	2,000.00	49,800,000	
技研製作所	16,500	1,809.00	29,848,500	
日本エアテック	8,200	1,394.00	11,430,800	
カワタ	3,400	1,085.00	3,689,000	
日精樹脂工業	13,100	1,064.00	13,938,400	
オカダアイヨン	3,600	2,166.00	7,797,600	
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,593.00	15,039,400	
小松製作所	821,100	3,829.00	3,143,991,900	
住友重機械工業	103,700	3,444.00	357,142,800	
日立建機	69,800	4,025.00	280,945,000	
日工	26,100	665.00	17,356,500	
巴工業	6,900	2,835.00	19,561,500	
井関農機	16,500	1,097.00	18,100,500	
TOWA	19,500	6,660.00	129,870,000	
丸山製作所	2,000	2,311.00	4,622,000	
北川鉄工所	7,000	1,281.00	8,967,000	
ローツェ	9,200	13,880.00	127,696,000	

タカキタ	3,400	471.00	1,601,400	
クボタ	919,300	2,129.50	1,957,649,350	
荏原実業	9,300	2,817.00	26,198,100	
三菱化工機	6,200	3,050.00	18,910,000	
月島ホールディングス	23,800	1,294.00	30,797,200	
帝国電機製作所	12,300	2,734.00	33,628,200	
新東工業	35,500	1,099.00	39,014,500	
澁谷工業	16,500	2,500.00	41,250,000	
アイチ コーポレーション	24,500	898.00	22,001,000	
小森コーポレーション	44,400	1,167.00	51,814,800	
鶴見製作所	13,400	3,790.00	50,786,000	
日本ギア工業	4,100	475.00	1,947,500	
酒井重工業	2,400	5,980.00	14,352,000	
荏原製作所	71,900	8,253.00	593,390,700	
石井鐵工所	1,400	2,713.00	3,798,200	
西島製作所	15,100	2,030.00	30,653,000	
北越工業	17,600	2,046.00	36,009,600	
ダイキン工業	209,100	23,850.00	4,987,035,000	
オルガノ	21,100	5,630.00	118,793,000	
トーヨーカネツ	6,700	3,485.00	23,349,500	
栗田工業	98,000	4,960.00	486,080,000	
椿本チェーン	24,900	3,640.00	90,636,000	
大同工業	4,800	723.00	3,470,400	
木村化工機	13,500	724.00	9,774,000	
アネスト岩田	27,100	1,085.00	29,403,500	
ダイフク	295,700	2,728.00	806,669,600	
サムコ	4,700	4,960.00	23,312,000	
加藤製作所	5,600	1,151.00	6,445,600	
油研工業	1,800	2,107.00	3,792,600	
タダノ	100,900	1,190.00	120,071,000	
フジテック	41,000	3,432.00	140,712,000	
C K D	48,500	2,188.00	106,118,000	
平和	51,800	2,019.00	104,584,200	
理想科学工業	14,000	2,650.00	37,100,000	
SANKYO	43,000	6,068.00	260,924,000	
日本金銭機械	21,200	1,154.00	24,464,800	

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

イビデン	91,400	7,198.00	657,897,200	
コニカミノルタ	392,100	470.40	184,443,840	
ブラザー工業	234,200	2,439.50	571,330,900	
ミネベアミツミ	304,900	2,826.00	861,647,400	
日立製作所	851,900	10,215.00	8,702,158,500	
三菱電機	1,949,600	2,052.50	4,001,554,000	
富士電機	106,500	6,049.00	644,218,500	
東洋電機製造	3,800	953.00	3,621,400	
安川電機	190,300	5,612.00	1,067,963,600	
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,948.00	37,596,400	
明電舎	32,500	2,395.00	77,837,500	
オリジン	2,600	1,175.00	3,055,000	
山洋電気	7,600	5,760.00	43,776,000	
デンヨー	13,300	2,245.00	29,858,500	
PHCホールディングス	33,000	1,405.00	46,365,000	
ソシオネクスト	25,400	14,590.00	370,586,000	
東芝テック	22,400	2,950.00	66,080,000	
芝浦メカトロニクス	10,000	7,250.00	72,500,000	
マブチモーター	43,600	4,520.00	197,072,000	
ニデック	386,800	5,789.00	2,239,185,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	395.00	5,372,000	
トレックス・セミコンダクター	9,200	1,771.00	16,293,200	
東光高岳	10,800	2,001.00	21,610,800	
ダブル・スコープ	50,100	970.00	48,597,000	
ダイヘン	17,600	5,500.00	96,800,000	
ヤーマン	30,600	1,053.00	32,221,800	
JVCケンウッド	138,900	686.00	95,285,400	
ミマキエンジニアリング	17,100	926.00	15,834,600	
IPEX	12,400	1,660.00	20,584,000	
大崎電気工業	41,400	621.00	25,709,400	
オムロン	133,800	6,140.00	821,532,000	
日東工業	23,600	3,400.00	80,240,000	
IDEC	25,900	2,824.00	73,141,600	
正興電機製作所	4,200	1,098.00	4,611,600	
不二電機工業	2,600	1,121.00	2,914,600	
ジーエス・ユアサコーポレーション	57,700	2,490.00	143,673,000	

サクサホールディングス	2,400	2,283.00	5,479,200	
メルコホールディングス	5,600	3,305.00	18,508,000	
テクノメディカ	4,400	2,525.00	11,110,000	
日本電気	230,000	8,263.00	1,900,490,000	
富士通	161,200	20,600.00	3,320,720,000	
沖電気工業	79,200	977.00	77,378,400	
岩崎通信機	5,100	750.00	3,825,000	
電気興業	7,800	2,287.00	17,838,600	
サンケン電気	16,300	7,252.00	118,207,600	
ナカヨ	1,900	1,224.00	2,325,600	
アイホン	9,500	2,769.00	26,305,500	
ルネサスエレクトロニクス	1,143,300	2,418.00	2,764,499,400	
セイコーエプソン	224,700	2,152.50	483,666,750	
ワコム	133,900	706.00	94,533,400	
アルバック	41,600	6,368.00	264,908,800	
アクセル	6,300	1,808.00	11,390,400	
E I Z O	12,800	4,645.00	59,456,000	
日本信号	39,900	948.00	37,825,200	
京三製作所	36,700	477.00	17,505,900	
能美防災	23,900	1,852.00	44,262,800	
ホーチキ	13,300	1,680.00	22,344,000	
星和電機	5,900	479.00	2,826,100	
エレコム	42,100	1,628.00	68,538,800	
パナソニック ホールディングス	2,069,300	1,571.50	3,251,904,950	
シャープ	295,300	1,029.50	304,011,350	
アンリツ	123,000	1,233.00	151,659,000	
富士通ゼネラル	49,700	2,796.50	138,986,050	
ソニーグループ	1,226,800	12,930.00	15,862,524,000	
T D K	277,400	6,505.00	1,804,487,000	
帝国通信工業	8,000	1,948.00	15,584,000	
タムラ製作所	69,800	564.00	39,367,200	
アルプスアルパイン	156,800	1,212.00	190,041,600	
池上通信機	3,700	884.00	3,270,800	
日本電波工業	21,300	1,214.00	25,858,200	
鈴木	9,700	1,122.00	10,883,400	
メイコー	17,500	4,195.00	73,412,500	

日本トリム	4,100	3,025.00	12,402,500	
ローランド ディー. ジー.	9,700	3,490.00	33,853,000	
フォスター電機	13,000	1,145.00	14,885,000	
SMK	4,700	2,421.00	11,378,700	
ヨコオ	15,800	1,505.00	23,779,000	
ホシデン	40,800	1,722.00	70,257,600	
ヒロセ電機	25,900	16,135.00	417,896,500	
日本航空電子工業	41,900	2,761.00	115,685,900	
TOA	19,900	1,012.00	20,138,800	
マクセル	38,900	1,641.00	63,834,900	
古野電気	23,000	1,687.00	38,801,000	
スミダコーポレーション	23,700	1,180.00	27,966,000	
アイコム	6,700	3,195.00	21,406,500	
リオン	7,400	2,171.00	16,065,400	
横河電機	191,600	2,799.00	536,288,400	
新電元工業	6,700	2,963.00	19,852,100	
アズビル	121,200	4,927.00	597,152,400	
東亜ディーケーケー	5,800	878.00	5,092,400	
日本光電工業	74,500	3,687.00	274,681,500	
チノー	7,200	2,115.00	15,228,000	
共和電業	10,800	402.00	4,341,600	
日本電子材料	11,400	1,477.00	16,837,800	
堀場製作所	33,100	9,237.00	305,744,700	
アドバンテスト	496,900	4,644.00	2,307,603,600	
小野測器	5,500	437.00	2,403,500	
エスベック	14,100	2,274.00	32,063,400	
キーエンス	173,500	62,280.00	10,805,580,000	
日置電機	8,200	6,560.00	53,792,000	
シスメックス	149,700	7,786.00	1,165,564,200	
日本マイクロニクス	31,300	3,695.00	115,653,500	
メガチップス	14,200	3,740.00	53,108,000	
OBARA GROUP	9,600	3,660.00	35,136,000	
澤藤電機	1,600	1,238.00	1,980,800	
原田工業	5,500	779.00	4,284,500	
コーセル	21,200	1,181.00	25,037,200	
イリソ電子工業	16,100	3,880.00	62,468,000	

オブテックスグループ	32,000	1,761.00	56,352,000	
千代田インテグレ	6,900	2,922.00	20,161,800	
レーザーテック	79,500	31,060.00	2,469,270,000	
スタンレー電気	111,200	2,707.00	301,018,400	
ウシオ電機	88,300	1,915.50	169,138,650	
岡谷電機産業	10,100	275.00	2,777,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	513.00	5,899,500	
エノモト	3,100	1,506.00	4,668,600	
日本セラミック	15,200	2,756.00	41,891,200	
遠藤照明	5,400	1,197.00	6,463,800	
古河電池	13,200	910.00	12,012,000	
双信電機	5,700	327.00	1,863,900	
山一電機	15,800	1,843.00	29,119,400	
図研	15,200	4,005.00	60,876,000	
日本電子	43,500	5,655.00	245,992,500	
カシオ計算機	125,300	1,252.50	156,938,250	
ファナック	845,700	4,044.00	3,420,010,800	
日本シイエムケイ	37,400	709.00	26,516,600	
エンプラス	5,100	11,040.00	56,304,000	
大真空	26,400	735.00	19,404,000	
ローム	320,800	2,664.00	854,611,200	
浜松ホトニクス	139,200	5,868.00	816,825,600	
三井ハイテック	15,400	7,145.00	110,033,000	
新光電気工業	61,400	5,350.00	328,490,000	
京セラ	269,500	8,015.00	2,160,042,500	
太陽誘電	84,600	3,807.00	322,072,200	
村田製作所	1,578,100	2,870.00	4,529,147,000	
双葉電子工業	33,800	520.00	17,576,000	
北陸電気工業	4,600	1,342.00	6,173,200	
ニチコン	45,800	1,389.00	63,616,200	
日本ケミコン	18,700	1,288.00	24,085,600	
KOA	26,500	1,532.00	40,598,000	
市光工業	32,000	519.00	16,608,000	
小糸製作所	187,900	2,303.50	432,827,650	
ミツバ	32,500	852.00	27,690,000	
S C R E E Nホールディングス	59,300	9,508.00	563,824,400	

キヤノン電子	19,400	1,913.00	37,112,200	
キヤノン	865,000	3,693.00	3,194,445,000	
リコー	434,800	1,179.00	512,629,200	
象印マホービン	48,400	1,523.00	73,713,200	
MUTOHホールディングス	1,700	1,902.00	3,233,400	
東京エレクトロン	367,100	23,905.00	8,775,525,500	
イノテック	11,800	1,629.00	19,222,200	
トヨタ紡織	73,100	2,675.50	195,579,050	
芦森工業	2,200	2,178.00	4,791,600	
ユニプレス	31,200	951.00	29,671,200	
豊田自動織機	147,900	12,015.00	1,777,018,500	
モリタホールディングス	30,500	1,511.00	46,085,500	
三櫻工業	26,600	906.00	24,099,600	
デンソー	1,430,900	2,462.00	3,522,875,800	
東海理化電機製作所	48,900	2,389.00	116,822,100	
川崎重工業	141,600	3,332.00	471,811,200	
名村造船所	37,800	1,133.00	42,827,400	
日本車輛製造	6,600	2,091.00	13,800,600	
三菱ロジスネクスト	27,700	1,234.00	34,181,800	
近畿車輛	1,600	1,846.00	2,953,600	
日産自動車	2,463,700	596.20	1,468,857,940	
いすゞ自動車	504,200	1,892.50	954,198,500	
トヨタ自動車	9,523,200	2,780.00	26,474,496,000	
日野自動車	260,900	486.80	127,006,120	
三菱自動車工業	676,600	494.80	334,781,680	
エフテック	8,100	629.00	5,094,900	
レシップホールディングス	4,500	550.00	2,475,000	
GMB	2,300	1,446.00	3,325,800	
ファルテック	2,000	546.00	1,092,000	
武蔵精密工業	42,500	1,602.00	68,085,000	
日産車体	20,400	798.00	16,279,200	
新明和工業	49,900	1,191.00	59,430,900	
極東開発工業	28,600	1,881.00	53,796,600	
トピー工業	14,100	2,715.00	38,281,500	
ティラド	4,400	3,160.00	13,904,000	
曙ブレーキ工業	105,800	121.00	12,801,800	

タチエス	32,100	1,657.00	53,189,700	
NOK	67,400	1,879.50	126,678,300	
フタバ産業	46,600	754.00	35,136,400	
カヤバ	16,700	4,460.00	74,482,000	
大同メタル工業	34,100	556.00	18,959,600	
プレス工業	69,400	610.00	42,334,000	
ミクニ	13,400	438.00	5,869,200	
太平洋工業	39,800	1,378.00	54,844,400	
アイシン	133,800	5,543.00	741,653,400	
マツダ	573,700	1,678.00	962,668,600	
今仙電機製作所	7,400	583.00	4,314,200	
本田技研工業	4,229,400	1,564.50	6,616,896,300	
スズキ	318,500	6,124.00	1,950,494,000	
SUBARU	548,700	2,673.50	1,466,949,450	
安永	5,100	712.00	3,631,200	
ヤマハ発動機	249,900	3,662.00	915,133,800	
TBK	11,700	380.00	4,446,000	
エクセディ	28,400	2,524.00	71,681,600	
豊田合成	50,700	2,988.50	151,516,950	
愛三工業	28,800	1,261.00	36,316,800	
盟和産業	1,700	976.00	1,659,200	
日本プラスト	9,300	572.00	5,319,600	
ヨロズ	16,400	894.00	14,661,600	
エフ・シー・シー	30,800	1,792.00	55,193,600	
シマノ	70,400	22,445.00	1,580,128,000	
テイ・エス テック	61,800	1,758.00	108,644,400	
ジャムコ	7,400	1,469.00	10,870,600	
テルモ	484,900	4,772.00	2,313,942,800	
クリエートメディック	3,800	890.00	3,382,000	
日機装	40,400	962.00	38,864,800	
日本エム・ディ・エム	13,800	691.00	9,535,800	
島津製作所	230,400	3,785.00	872,064,000	
JMS	16,100	516.00	8,307,600	
長野計器	12,600	2,074.00	26,132,400	
ブイ・テクノロジー	9,100	2,218.00	20,183,800	
東京計器	13,300	1,628.00	21,652,400	

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

フランスベッドホールディングス	22,400	1,245.00	27,888,000	
パイロットコーポレーション	24,400	4,508.00	109,995,200	
萩原工業	11,600	1,611.00	18,687,600	
フジシールインターナショナル	35,100	1,681.00	59,003,100	
タカラトミー	78,900	2,042.00	161,113,800	
広済堂ホールディングス	7,800	3,290.00	25,662,000	
エステールホールディングス	2,700	626.00	1,690,200	
タカノ	4,300	830.00	3,569,000	
プロネクサス	18,000	1,148.00	20,664,000	
ホクシン	8,800	116.00	1,020,800	
ウッドワン	3,800	974.00	3,701,200	
TOPPANホールディングス	213,200	3,296.00	702,707,200	
大日本印刷	189,500	4,002.00	758,379,000	
共同印刷	4,900	3,665.00	17,958,500	
NISSHA	29,700	1,477.00	43,866,900	
光村印刷	1,000	1,247.00	1,247,000	
TAKARA & COMPANY	11,100	2,391.00	26,540,100	
アシックス	147,800	5,428.00	802,258,400	
ツツミ	4,100	2,135.00	8,753,500	
ローランド	12,800	4,430.00	56,704,000	
小松ウオール工業	7,100	2,831.00	20,100,100	
ヤマハ	109,300	3,469.00	379,161,700	
河合楽器製作所	5,300	3,175.00	16,827,500	
クリナップ	19,400	672.00	13,036,800	
ピジョン	110,500	1,637.00	180,888,500	
キングジム	15,300	870.00	13,311,000	
リンテック	34,800	2,445.00	85,086,000	
イトーキ	35,500	1,320.00	46,860,000	
任天堂	1,095,000	6,800.00	7,446,000,000	
三菱鉛筆	24,600	1,915.00	47,109,000	
タカラスタンダード	36,500	1,729.00	63,108,500	
コクヨ	74,700	2,354.00	175,843,800	
ナカバヤシ	18,700	525.00	9,817,500	
グローブライド	15,600	1,987.00	30,997,200	
オカムラ	52,200	2,167.00	113,117,400	
美津濃	17,200	3,975.00	68,370,000	

東京電力ホールディングス	1,563,400	665.90	1,041,068,060	
中部電力	639,100	1,807.00	1,154,853,700	
関西電力	669,700	1,953.50	1,308,258,950	
中国電力	301,300	982.20	295,936,860	
北陸電力	177,300	744.60	132,017,580	
東北電力	456,600	939.00	428,747,400	
四国電力	161,500	1,028.50	166,102,750	
九州電力	399,800	1,000.50	399,999,900	
北海道電力	167,600	634.70	106,375,720	
沖縄電力	44,300	1,046.00	46,337,800	
電源開発	142,500	2,292.00	326,610,000	
エフオン	11,200	480.00	5,376,000	
イーレックス	30,800	681.00	20,974,800	
レノバ	46,200	1,134.00	52,390,800	
東京瓦斯	366,700	3,285.00	1,204,609,500	
大阪瓦斯	351,300	2,876.00	1,010,338,800	
東邦瓦斯	75,100	2,614.50	196,348,950	
北海道瓦斯	10,400	2,275.00	23,660,000	
広島ガス	36,600	373.00	13,651,800	
西部ガスホールディングス	18,100	1,879.00	34,009,900	
静岡ガス	36,300	1,008.00	36,590,400	
メタウォーター	20,800	2,042.00	42,473,600	
SBSホールディングス	15,500	2,520.00	39,060,000	
東武鉄道	190,500	3,710.00	706,755,000	
相鉄ホールディングス	62,100	2,659.00	165,123,900	
東急	486,300	1,765.00	858,319,500	
京浜急行電鉄	214,600	1,315.50	282,306,300	
小田急電鉄	286,800	2,171.00	622,642,800	
京王電鉄	83,400	4,105.00	342,357,000	
京成電鉄	111,800	6,220.00	695,396,000	
富士急行	21,400	4,435.00	94,909,000	
東日本旅客鉄道	318,600	7,996.00	2,547,525,600	
西日本旅客鉄道	205,700	5,882.00	1,209,927,400	
東海旅客鉄道	668,000	3,514.00	2,347,352,000	
西武ホールディングス	209,800	1,695.50	355,715,900	
鴻池運輸	29,500	1,977.00	58,321,500	

西日本鉄道	46,300	2,406.50	111,420,950	
ハマキョウレックス	14,800	3,855.00	57,054,000	
サカイ引越センター	19,200	2,545.00	48,864,000	
近鉄グループホールディングス	173,100	4,136.00	715,941,600	
阪急阪神ホールディングス	230,900	4,592.00	1,060,292,800	
南海電気鉄道	77,200	2,940.50	227,006,600	
京阪ホールディングス	95,400	3,850.00	367,290,000	
神戸電鉄	4,700	2,907.00	13,662,900	
名古屋鉄道	178,600	2,107.50	376,399,500	
山陽電気鉄道	13,000	2,120.00	27,560,000	
アルプス物流	13,800	1,612.00	22,245,600	
ヤマトホールディングス	221,700	2,589.50	574,092,150	
山九	44,100	4,950.00	218,295,000	
丸運	5,600	247.00	1,383,200	
丸全昭和運輸	10,700	3,825.00	40,927,500	
センコーグループホールディングス	91,700	1,047.00	96,009,900	
トナミホールディングス	3,800	4,370.00	16,606,000	
ニッコンホールディングス	55,400	3,226.00	178,720,400	
日本石油輸送	1,200	2,892.00	3,470,400	
福山通運	19,800	3,625.00	71,775,000	
セイノーホールディングス	97,400	2,037.50	198,452,500	
エスライングループ本社	3,200	867.00	2,774,400	
神奈川中央交通	4,900	3,055.00	14,969,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	41,800	1,940.00	81,092,000	
C&Fロジホールディングス	16,700	1,430.00	23,881,000	
九州旅客鉄道	122,400	3,062.00	374,788,800	
SGホールディングス	290,700	2,139.00	621,807,300	
NIPPON EXPRESSホールディングス	58,800	7,581.00	445,762,800	
日本郵船	496,600	3,770.00	1,872,182,000	
商船三井	376,000	3,883.00	1,460,008,000	
川崎汽船	146,500	4,784.00	700,856,000	
NSユニテッド海運	9,600	4,565.00	43,824,000	
飯野海運	64,600	1,148.00	74,160,800	
共栄タンカー	3,600	818.00	2,944,800	
乾汽船	23,000	1,103.00	25,369,000	

日本航空	425,300	2,886.50	1,227,628,450
ANAホールディングス	471,100	3,105.00	1,462,765,500
パスコ	2,200	1,576.00	3,467,200
トランコム	5,000	7,500.00	37,500,000
日新	13,100	2,482.00	32,514,200
三菱倉庫	42,500	4,327.00	183,897,500
三井倉庫ホールディングス	16,200	4,630.00	75,006,000
住友倉庫	46,700	2,422.00	113,107,400
澁澤倉庫	7,900	2,746.00	21,693,400
東陽倉庫	3,000	1,495.00	4,485,000
日本トランスシティ	34,800	617.00	21,471,600
ケイヒン	2,000	1,736.00	3,472,000
中央倉庫	9,300	1,086.00	10,099,800
川西倉庫	1,900	1,072.00	2,036,800
安田倉庫	11,800	1,088.00	12,838,400
ファイズホールディングス	2,100	1,022.00	2,146,200
東洋埠頭	3,300	1,360.00	4,488,000
上組	83,000	3,165.00	262,695,000
サンリツ	2,600	729.00	1,895,400
キムラユニティー	5,500	1,350.00	7,425,000
キューソー流通システム	6,900	923.00	6,368,700
東海運	6,700	281.00	1,882,700
エアイテイー	10,900	1,653.00	18,017,700
内外トランスライン	6,900	2,431.00	16,773,900
日本コンセプト	6,300	1,662.00	10,470,600
NEC ネットエスアイ	67,800	2,150.00	145,770,000
クロスキャット	11,100	1,132.00	12,565,200
システナ	263,300	265.00	69,774,500
デジタルアーツ	11,000	4,555.00	50,105,000
日鉄ソリューションズ	29,700	4,625.00	137,362,500
キューブシステム	10,300	1,082.00	11,144,600
コア	7,700	1,726.00	13,290,200
手間いらず	3,000	2,660.00	7,980,000
ラクーンホールディングス	14,500	717.00	10,396,500
ソリトンシステムズ	9,000	1,214.00	10,926,000
ソフトクリエイトホールディングス	14,300	1,710.00	24,453,000

T I S	190,300	3,180.00	605,154,000	
テクミラホールディングス	5,400	453.00	2,446,200	
グリー	46,700	533.00	24,891,100	
GMOペパボ	2,300	1,262.00	2,902,600	
コーエーテクモホールディングス	109,000	1,870.00	203,830,000	
三菱総合研究所	8,500	4,650.00	39,525,000	
電算	1,400	1,501.00	2,101,400	
A G S	4,900	711.00	3,483,900	
ファインデックス	13,800	900.00	12,420,000	
ブレインパッド	13,000	1,022.00	13,286,000	
K L a b	32,000	278.00	8,896,000	
ポールトゥウィンホールディングス	29,800	512.00	15,257,600	
ネクソン	388,500	3,038.00	1,180,263,000	
アイスタイル	51,700	478.00	24,712,600	
エムアップホールディングス	21,300	1,049.00	22,343,700	
エイチーム	10,300	666.00	6,859,800	
エニグモ	22,200	372.00	8,258,400	
テクノスジャパン	9,500	666.00	6,327,000	
コロプラ	67,500	592.00	39,960,000	
ブロードリーフ	94,600	574.00	54,300,400	
クロス・マーケティンググループ	7,000	580.00	4,060,000	
デジタルハーツホールディングス	10,900	901.00	9,820,900	
メディアドゥ	7,900	1,470.00	11,613,000	
じげん	50,800	514.00	26,111,200	
ブイキューブ	20,900	369.00	7,712,100	
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	516.00	1,444,800	
サイバーリンクス	4,500	711.00	3,199,500	
フィックスターズ	19,700	1,206.00	23,758,200	
CARTA HOLDINGS	8,200	1,235.00	10,127,000	
オブティム	17,900	844.00	15,107,600	
セレス	7,000	919.00	6,433,000	
S H I F T	11,600	33,610.00	389,876,000	
ティーガイア	18,200	1,779.00	32,377,800	
セック	1,900	3,975.00	7,552,500	
テクマトリックス	31,800	1,735.00	55,173,000	
プロシップ	8,400	1,271.00	10,676,400	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,300	2,183.50	98,912,550	
GMOペイメントゲートウェイ	34,800	8,114.00	282,367,200	
ザッパラス	3,300	481.00	1,587,300	
システムリサーチ	6,000	3,460.00	20,760,000	
インターネットイニシアティブ	83,200	2,564.00	213,324,800	
さくらインターネット	19,500	1,196.00	23,322,000	
ヴィンクス	2,800	2,015.00	5,642,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,503.00	13,265,900	
SRAホールディングス	8,900	3,545.00	31,550,500	
システムインテグレータ	3,500	402.00	1,407,000	
朝日ネット	18,700	615.00	11,500,500	
eBASE	24,500	768.00	18,816,000	
アバントグループ	22,000	1,471.00	32,362,000	
アドソル日進	7,300	1,650.00	12,045,000	
ODKソリューションズ	2,600	553.00	1,437,800	
フリービット	9,100	1,139.00	10,364,900	
コムチュア	25,100	2,018.00	50,651,800	
サイバーコム	1,900	1,900.00	3,610,000	
アステリア	13,700	713.00	9,768,100	
アイル	8,100	3,960.00	32,076,000	
マークライنز	9,400	2,875.00	27,025,000	
メディカル・データ・ビジョン	20,800	688.00	14,310,400	
gumi	25,700	416.00	10,691,200	
ショーケース	2,800	290.00	812,000	
モバイルファクトリー	2,500	714.00	1,785,000	
テラスカイ	7,500	1,593.00	11,947,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,100	1,609.00	16,250,900	
PCIホールディングス	4,400	1,029.00	4,527,600	
アイビーシー	1,800	500.00	900,000	
ネオジャパン	5,800	1,029.00	5,968,200	
PR TIMES	4,400	1,723.00	7,581,200	
ラクス	82,300	2,605.00	214,391,500	
ランドコンピュータ	5,600	790.00	4,424,000	
ダブルスタンダード	5,300	1,467.00	7,775,100	
オープンドア	12,200	835.00	10,187,000	
アカツキ	8,300	2,144.00	17,795,200	

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

ラクスル	41,900	1,381.00	57,863,900
メルカリ	105,500	3,112.00	328,316,000
I P S	5,600	2,089.00	11,698,400
F I G	13,500	354.00	4,779,000
システムサポート	6,700	1,970.00	13,199,000
イーソル	12,600	623.00	7,849,800
東海ソフト	1,700	1,110.00	1,887,000
ウイングアーク 1 s t	18,000	3,015.00	54,270,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,298.00	6,100,600
サーバーワークス	3,600	3,395.00	12,222,000
東名	900	1,805.00	1,624,500
ヴィッツ	1,200	989.00	1,186,800
トビラシステムズ	3,300	856.00	2,824,800
S a n s a n	57,000	1,454.00	82,878,000
L i n k - U	2,800	748.00	2,094,400
ギフトィ	15,200	1,767.00	26,858,400
メドレー	23,400	4,650.00	108,810,000
ベース	6,000	3,570.00	21,420,000
J M D C	29,700	4,600.00	136,620,000
フォーカスシステムズ	12,700	967.00	12,280,900
クレスコ	14,300	1,902.00	27,198,600
フジ・メディア・ホールディングス	167,100	1,466.00	244,968,600
オービック	58,100	22,090.00	1,283,429,000
ジャストシステム	25,000	3,160.00	79,000,000
T D C ソフト	16,300	1,931.00	31,475,300
L I N E ヤフー	2,476,000	428.00	1,059,728,000
トレンドマイクロ	82,200	7,259.00	596,689,800
I D ホールディングス	11,700	1,456.00	17,035,200
日本オラクル	33,300	11,185.00	372,460,500
アルファシステムズ	4,600	2,823.00	12,985,800
フューチャー	37,100	1,804.00	66,928,400
C A C H o l d i n g s	10,000	1,734.00	17,340,000
S B テクノロジー	7,400	2,377.00	17,589,800
トーセ	3,400	697.00	2,369,800
オービックビジネスコンサルタント	24,500	6,561.00	160,744,500

アイティフォー	22,900	1,056.00	24,182,400	
東計電算	2,400	6,600.00	15,840,000	
エックスネット	1,600	1,083.00	1,732,800	
大塚商会	86,300	5,959.00	514,261,700	
サイボウズ	24,000	2,131.00	51,144,000	
電通国際情報サービス	21,100	4,625.00	97,587,500	
ACCESS	20,600	813.00	16,747,800	
デジタルガレージ	27,800	3,120.00	86,736,000	
EMシステムズ	29,000	671.00	19,459,000	
ウェザーニューズ	5,400	5,880.00	31,752,000	
C I J	28,900	611.00	17,657,900	
ビジネスエンジニアリング	2,900	3,945.00	11,440,500	
日本エンタープライズ	12,200	120.00	1,464,000	
WOWOW	13,100	1,048.00	13,728,800	
スカラ	16,100	742.00	11,946,200	
インテリジェント ウェイブ	6,200	1,038.00	6,435,600	
ANYCOLOR	6,100	3,745.00	22,844,500	
IMAGICA GROUP	17,500	649.00	11,357,500	
ネットワンシステムズ	70,200	2,065.00	144,963,000	
システムソフト	60,900	66.00	4,019,400	
アルゴグラフィックス	16,000	3,455.00	55,280,000	
マーベラス	28,300	686.00	19,413,800	
エイベックス	29,600	1,341.00	39,693,600	
B I P R O G Y	56,900	4,103.00	233,460,700	
都築電気	9,200	2,096.00	19,283,200	
T B S ホールディングス	89,000	2,565.50	228,329,500	
日本テレビホールディングス	154,000	1,411.50	217,371,000	
朝日放送グループホールディングス	16,300	633.00	10,317,900	
テレビ朝日ホールディングス	42,200	1,595.00	67,309,000	
スカパー J S A T ホールディングス	135,100	660.00	89,166,000	
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,841.00	35,512,500	
日本BS放送	4,200	892.00	3,746,400	
ビジョン	26,200	1,212.00	31,754,400	
スマートバリュー	2,900	361.00	1,046,900	
USEN-NEXT HOLDINGS	19,500	3,555.00	69,322,500	
ワイヤレスゲート	5,200	199.00	1,034,800	

日本通信	171,400	216.00	37,022,400	
クロップス	1,900	996.00	1,892,400	
日本電信電話	51,740,600	173.50	8,976,994,100	
KDDI	1,344,100	4,616.00	6,204,365,600	
ソフトバンク	2,798,400	1,750.50	4,898,599,200	
光通信	17,500	22,610.00	395,675,000	
エムティーアイ	12,000	576.00	6,912,000	
GMOインターネットグループ	64,300	2,337.00	150,269,100	
ファイバーゲート	9,400	1,025.00	9,635,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,800	228.00	638,400	
KADOKAWA	92,000	2,724.00	250,608,000	
学研ホールディングス	29,000	937.00	27,173,000	
ゼンリン	29,800	875.00	26,075,000	
昭文社ホールディングス	5,000	360.00	1,800,000	
インプレスホールディングス	10,300	183.00	1,884,900	
アイネット	10,600	1,789.00	18,963,400	
松竹	9,000	9,640.00	86,760,000	
東宝	96,800	5,058.00	489,614,400	
東映	5,700	17,750.00	101,175,000	
NTTデータグループ	454,800	1,852.00	842,289,600	
ピー・シー・エー	10,000	1,170.00	11,700,000	
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,069.00	15,310,600	
DTS	37,000	3,285.00	121,545,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	79,500	5,177.00	411,571,500	
シーイーシー	22,000	1,709.00	37,598,000	
カプコン	155,600	5,047.00	785,313,200	
アイ・エス・ビー	8,900	1,484.00	13,207,600	
ジャステック	10,700	1,517.00	16,231,900	
SCSK	121,700	2,750.50	334,735,850	
NSW	7,700	2,886.00	22,222,200	
アイネス	13,600	1,539.00	20,930,400	
TKC	27,700	3,470.00	96,119,000	
富士ソフト	35,000	5,650.00	197,750,000	
NSD	62,100	2,617.00	162,515,700	
コナミグループ	65,200	7,456.00	486,131,200	
福井コンピュータホールディングス	10,800	2,588.00	27,950,400	

J B C Cホールディングス	11,500	3,255.00	37,432,500	
ミロク情報サービス	15,800	1,574.00	24,869,200	
ソフトバンクグループ	858,100	6,160.00	5,285,896,000	
高千穂交易	5,100	3,185.00	16,243,500	
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,772.00	3,189,600	
伊藤忠食品	4,100	7,140.00	29,274,000	
エレマテック	16,500	1,669.00	27,538,500	
あらた	14,000	6,220.00	87,080,000	
トーメンデバイス	2,700	4,870.00	13,149,000	
東京エレクトロン デバイス	18,300	4,540.00	83,082,000	
円谷フィールズホールディングス	31,500	1,187.00	37,390,500	
双日	204,300	3,049.00	622,910,700	
アルフレッサ ホールディングス	184,200	2,458.50	452,855,700	
横浜冷凍	50,000	1,083.00	54,150,000	
ラサ商事	6,500	1,526.00	9,919,000	
アルコニックス	24,200	1,310.00	31,702,000	
神戸物産	142,000	3,631.00	515,602,000	
ハイパー	2,800	349.00	977,200	
あい ホールディングス	29,400	2,346.00	68,972,400	
ディービーエックス	3,400	1,022.00	3,474,800	
ダイワボウホールディングス	81,200	2,913.00	236,535,600	
マクニカホールディングス	43,400	6,815.00	295,771,000	
ラクト・ジャパン	7,100	2,010.00	14,271,000	
グリムス	7,700	1,897.00	14,606,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,800	1,013.00	28,161,400	
八洲電機	14,900	1,270.00	18,923,000	
メディアスホールディングス	11,800	749.00	8,838,200	
レスターホールディングス	15,600	2,705.00	42,198,000	
ジオリーヴグループ	2,800	1,220.00	3,416,000	
大光	5,200	659.00	3,426,800	
O C H Iホールディングス	2,800	1,390.00	3,892,000	
T O K A Iホールディングス	99,700	961.00	95,811,700	
黒谷	3,400	580.00	1,972,000	
C o m i n i x	2,400	774.00	1,857,600	
三洋貿易	20,700	1,272.00	26,330,400	
ビューティガレージ	5,800	2,375.00	13,775,000	

ウイン・パートナーズ	13,300	1,230.00	16,359,000
ミタチ産業	3,100	1,166.00	3,614,600
シップヘルスケアホールディングス	66,000	2,139.50	141,207,000
明治電機工業	6,800	1,390.00	9,452,000
デリカフーズホールディングス	4,800	575.00	2,760,000
スターティアホールディングス	2,700	1,346.00	3,634,200
コメダホールディングス	45,000	2,805.00	126,225,000
ピーバンドットコム	1,800	386.00	694,800
アセンテック	7,100	532.00	3,777,200
富士興産	2,900	1,809.00	5,246,100
協栄産業	1,100	2,312.00	2,543,200
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,769.00	47,349,900
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,590.00	37,336,000
小野建	18,000	1,658.00	29,844,000
南陽	2,300	2,036.00	4,682,800
佐鳥電機	9,000	1,893.00	17,037,000
エコートレーディング	2,400	1,316.00	3,158,400
伯東	10,500	5,250.00	55,125,000
コンドーテック	14,100	1,136.00	16,017,600
中山福	6,600	351.00	2,316,600
ナガイレーベン	23,200	2,255.00	52,316,000
三菱食品	17,000	4,545.00	77,265,000
松田産業	14,000	2,455.00	34,370,000
第一興商	71,000	2,192.50	155,667,500
メディパルホールディングス	190,100	2,341.50	445,119,150
S P K	8,200	1,853.00	15,194,600
萩原電気ホールディングス	7,800	4,575.00	35,685,000
アズワン	28,700	5,038.00	144,590,600
スズデン	6,400	2,187.00	13,996,800
尾家産業	2,900	1,782.00	5,167,800
シモジマ	12,600	1,221.00	15,384,600
ドウシシャ	17,000	2,097.00	35,649,000
小津産業	2,700	1,582.00	4,271,400
高速	10,900	1,965.00	21,418,500
たけびし	7,000	1,795.00	12,565,000
リックス	3,200	3,230.00	10,336,000

丸文	16,400	1,347.00	22,090,800	
ハビネット	15,600	2,393.00	37,330,800	
橋本総業ホールディングス	7,300	1,160.00	8,468,000	
日本ライフライン	53,800	1,111.00	59,771,800	
タカショー	16,000	597.00	9,552,000	
I DOM	48,600	899.00	43,691,400	
進和	11,200	2,358.00	26,409,600	
エスケイジャパン	3,000	759.00	2,277,000	
ダイトロン	7,200	2,850.00	20,520,000	
シークス	26,200	1,473.00	38,592,600	
田中商事	3,500	702.00	2,457,000	
オーハシテクニカ	9,800	1,729.00	16,944,200	
白銅	5,200	2,232.00	11,606,400	
ダイコー通産	1,300	1,125.00	1,462,500	
伊藤忠商事	1,233,500	6,150.00	7,586,025,000	
丸紅	1,529,900	2,339.00	3,578,436,100	
高島	7,700	974.00	7,499,800	
長瀬産業	84,100	2,266.00	190,570,600	
蝶理	11,500	2,810.00	32,315,000	
豊田通商	160,700	8,497.00	1,365,467,900	
三共生興	25,500	720.00	18,360,000	
兼松	76,700	2,007.00	153,936,900	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,180.00	2,006,000	
三井物産	1,382,600	5,551.00	7,674,812,600	
日本紙パルプ商事	8,800	4,655.00	40,964,000	
カメイ	19,500	1,614.00	31,473,000	
東都水産	600	7,060.00	4,236,000	
OUGホールディングス	1,800	2,375.00	4,275,000	
スターゼン	12,700	2,477.00	31,457,900	
山善	55,700	1,198.00	66,728,600	
椿本興業	3,800	5,970.00	22,686,000	
住友商事	1,110,500	3,199.00	3,552,489,500	
内田洋行	7,400	7,210.00	53,354,000	
三菱商事	1,212,000	7,059.00	8,555,508,000	
第一実業	17,300	1,920.00	33,216,000	
キヤノンマーケティングジャパン	42,500	3,630.00	154,275,000	

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

ソーダニッカ	13,600	980.00	13,328,000	
立花エレテック	12,200	2,738.00	33,403,600	
フォーバル	7,200	1,193.00	8,589,600	
PALTAC	24,700	4,777.00	117,991,900	
三谷産業	32,100	330.00	10,593,000	
西本Wismettacホールディングス	4,700	6,290.00	29,563,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,108.00	2,108,000	
コア商事ホールディングス	10,300	734.00	7,560,200	
KPPグループホールディングス	47,600	694.00	33,034,400	
ヤマタネ	8,100	2,160.00	17,496,000	
丸紅建材リース	1,100	2,470.00	2,717,000	
泉州電業	9,200	3,240.00	29,808,000	
トラスコ中山	38,500	2,246.00	86,471,000	
オートバックスセブン	63,900	1,510.50	96,520,950	
モリト	13,200	1,361.00	17,965,200	
加藤産業	22,700	4,595.00	104,306,500	
北恵	3,100	886.00	2,746,600	
イエローハット	29,200	1,726.00	50,399,200	
JKホールディングス	14,100	954.00	13,451,400	
日伝	12,400	2,500.00	31,000,000	
北沢産業	6,600	287.00	1,894,200	
杉本商事	8,900	2,186.00	19,455,400	
因幡電機産業	47,600	3,190.00	151,844,000	
東テック	6,100	4,785.00	29,188,500	
ミスミグループ本社	277,000	2,473.50	685,159,500	
アルテック	6,600	233.00	1,537,800	
タキヒヨー	3,000	1,009.00	3,027,000	
蔵王産業	2,000	2,411.00	4,822,000	
スズケン	69,800	5,006.00	349,418,800	
ジェコス	11,000	981.00	10,791,000	
グローセル	18,800	431.00	8,102,800	
ローソン	39,000	7,260.00	283,140,000	
サンエー	14,100	4,520.00	63,732,000	
カワチ薬品	14,500	2,408.00	34,916,000	
エービーシー・マート	80,500	2,426.00	195,293,000	
ハードオフコーポレーション	6,000	1,500.00	9,000,000	

アスクル	38,200	2,019.00	77,125,800
ゲオホールディングス	20,800	2,313.00	48,110,400
アダストリア	22,300	3,490.00	77,827,000
くら寿司	21,600	3,650.00	78,840,000
キャンドウ	6,700	2,485.00	16,649,500
I Kホールディングス	5,200	344.00	1,788,800
パルグループホールディングス	36,200	2,136.00	77,323,200
エディオン	72,900	1,465.00	106,798,500
サーラコーポレーション	39,200	723.00	28,341,600
ワッツ	6,800	555.00	3,774,000
ハローズ	8,400	4,380.00	36,792,000
あみやき亭	4,600	3,640.00	16,744,000
大黒天物産	5,700	6,350.00	36,195,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,605.00	23,754,000
ファーマライズホールディングス	3,400	657.00	2,233,800
アルペン	15,400	1,898.00	29,229,200
ハブ	4,600	749.00	3,445,400
クオールホールディングス	25,500	1,623.00	41,386,500
ジーンズホールディングス	11,000	4,470.00	49,170,000
ビックカメラ	98,000	1,174.00	115,052,000
DCMホールディングス	97,300	1,200.00	116,760,000
Monotaro	260,500	1,473.00	383,716,500
東京一番フーズ	3,800	508.00	1,930,400
きちりホールディングス	2,900	980.00	2,842,000
J. フロント リテイリング	210,900	1,410.00	297,369,000
ドトール・日レスホールディングス	32,700	2,215.00	72,430,500
マツキヨココカラ&カンパニー	334,000	2,644.00	883,096,000
ブロンコビリー	10,900	3,130.00	34,117,000
ZOZO	121,400	3,122.00	379,010,800
トレジャー・ファクトリー	9,200	1,202.00	11,058,400
物語コーポレーション	30,800	3,810.00	117,348,000
三越伊勢丹ホールディングス	309,300	1,737.50	537,408,750
Hamee	6,900	1,018.00	7,024,200
マーケットエンタープライズ	1,600	1,234.00	1,974,400
ウエルシアホールディングス	95,400	2,540.00	242,316,000
クリエイトSDホールディングス	30,500	3,160.00	96,380,000

丸善CHIホールディングス	15,800	328.00	5,182,400	
ミサワ	3,000	628.00	1,884,000	
ティーライフ	2,000	1,390.00	2,780,000	
チムニー	3,800	1,381.00	5,247,800	
シュッピン	17,000	1,190.00	20,230,000	
オイシックス・ラ・大地	25,000	1,357.00	33,925,000	
ネクステージ	42,100	2,228.00	93,798,800	
ジョイフル本田	53,600	1,773.00	95,032,800	
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,948.00	20,341,200	
ホットランド	14,300	2,026.00	28,971,800	
すかいらーくホールディングス	251,000	2,238.50	561,863,500	
SFPホールディングス	10,000	2,258.00	22,580,000	
綿半ホールディングス	14,600	1,335.00	19,491,000	
ヨシックスホールディングス	3,500	3,035.00	10,622,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,700	1,026.00	53,044,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	661.00	5,949,000	
B E E N O S	8,000	1,504.00	12,032,000	
あさひ	17,400	1,300.00	22,620,000	
日本調剤	12,800	1,305.00	16,704,000	
コスモス薬品	18,200	15,715.00	286,013,000	
トーエル	6,100	697.00	4,251,700	
セブン&アイ・ホールディングス	632,400	5,663.00	3,581,281,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	124,200	1,057.00	131,279,400	
ツルハホールディングス	38,600	12,305.00	474,973,000	
サンマルクホールディングス	15,000	2,018.00	30,270,000	
フェリシモ	3,200	903.00	2,889,600	
トリドールホールディングス	51,500	4,312.00	222,068,000	
TOKYO BASE	23,500	291.00	6,838,500	
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,129.00	2,709,600	
JMホールディングス	14,100	2,004.00	28,256,400	
サツドラホールディングス	6,200	766.00	4,749,200	
アレンザホールディングス	14,200	1,000.00	14,200,000	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,697.00	8,824,400	
バロックジャパンリミテッド	14,800	801.00	11,854,800	
クスリのアオキホールディングス	49,200	3,360.00	165,312,000	

力の源ホールディングス	8,200	1,739.00	14,259,800	
FOOD & LIFE COMPANIES	98,000	2,818.50	276,213,000	
メディカルシステムネットワーク	20,900	533.00	11,139,700	
はるやまホールディングス	6,100	522.00	3,184,200	
ノジマ	53,600	1,401.00	75,093,600	
カップ・クリエイト	28,800	1,626.00	46,828,800	
ライトオン	9,200	457.00	4,204,400	
良品計画	200,500	2,084.00	417,842,000	
パリティホールディングス	16,500	433.00	7,144,500	
アドヴァングループ	17,900	1,016.00	18,186,400	
アルビス	6,200	2,521.00	15,630,200	
コナカ	13,300	398.00	5,293,400	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,603.00	2,885,400	
G-7ホールディングス	20,400	1,175.00	23,970,000	
イオン北海道	54,400	890.00	48,416,000	
コジマ	31,000	662.00	20,522,000	
ヒマラヤ	4,400	920.00	4,048,000	
コーナン商事	22,600	3,720.00	84,072,000	
エコス	7,000	2,186.00	15,302,000	
ワタミ	19,400	1,008.00	19,555,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	370,500	3,394.00	1,257,477,000	
西松屋チェーン	36,300	1,903.00	69,078,900	
ゼンショーホールディングス	90,500	8,817.00	797,938,500	
幸楽苑ホールディングス	13,600	1,096.00	14,905,600	
ハークスレイ	5,000	648.00	3,240,000	
サイゼリヤ	27,200	5,680.00	154,496,000	
VTホールディングス	70,600	516.00	36,429,600	
魚力	6,600	2,182.00	14,401,200	
フジ・コーポレーション	9,300	1,656.00	15,400,800	
ユナイテッドアローズ	21,800	1,786.00	38,934,800	
ハイデイ日高	27,400	2,709.00	74,226,600	
YU-WA Creation Holdings	10,200	155.00	1,581,000	
コロワイド	78,900	2,320.50	183,087,450	
壺番屋	14,600	5,320.00	77,672,000	
PLANT	3,500	1,362.00	4,767,000	

スギホールディングス	37,000	6,358.00	235,246,000	
薬王堂ホールディングス	9,100	2,733.00	24,870,300	
スクロール	27,800	924.00	25,687,200	
ヨンドシーホールディングス	17,600	1,911.00	33,633,600	
木曾路	27,900	2,530.00	70,587,000	
S R S ホールディングス	30,700	1,042.00	31,989,400	
千趣会	34,900	395.00	13,785,500	
リテールパートナーズ	27,500	1,794.00	49,335,000	
上新電機	18,300	2,260.00	41,358,000	
日本瓦斯	97,400	2,360.50	229,912,700	
ロイヤルホールディングス	32,300	2,646.00	85,465,800	
いなげや	17,900	1,590.00	28,461,000	
チヨダ	18,100	828.00	14,986,800	
ライフコーポレーション	19,300	3,405.00	65,716,500	
リンガーハット	23,700	2,319.00	54,960,300	
M r M a x HD	26,400	617.00	16,288,800	
A O K I ホールディングス	39,800	1,068.00	42,506,400	
オークワ	26,600	831.00	22,104,600	
コメリ	28,400	3,215.00	91,306,000	
青山商事	39,500	1,477.00	58,341,500	
しまむら	21,600	14,885.00	321,516,000	
はせがわ	7,300	350.00	2,555,000	
高島屋	126,900	2,041.50	259,066,350	
松屋	31,200	884.00	27,580,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,300	1,647.00	133,901,100	
近鉄百貨店	8,000	2,721.00	21,768,000	
丸井グループ	121,800	2,236.50	272,405,700	
アクシアル リテイリング	12,600	3,795.00	47,817,000	
イオン	622,100	3,080.00	1,916,068,000	
イズミ	32,600	3,574.00	116,512,400	
平和堂	30,700	2,244.00	68,890,800	
フジ	28,200	1,850.00	52,170,000	
ヤオコー	20,800	7,871.00	163,716,800	
ゼビオホールディングス	25,300	925.00	23,402,500	
ケーズホールディングス	130,000	1,280.00	166,400,000	
O l y m p i c グループ	5,500	506.00	2,783,000	

日産東京販売ホールディングス	16,600	431.00	7,154,600	
シルバーライフ	4,000	1,025.00	4,100,000	
Genky Drug Stores	8,100	5,080.00	41,148,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,121.00	2,690,400	
ブックオフグループホールディングス	9,800	1,053.00	10,319,400	
ギフトホールディングス	8,000	2,123.00	16,984,000	
アインホールディングス	25,400	4,277.00	108,635,800	
元気寿司	10,600	3,305.00	35,033,000	
ヤマダホールディングス	565,300	428.90	242,457,170	
アー克蘭ズ	55,100	1,614.00	88,931,400	
ニトリホールディングス	66,800	15,615.00	1,043,082,000	
グルメ杵屋	15,300	1,066.00	16,309,800	
愛眼	9,000	171.00	1,539,000	
ケーユーホールディングス	9,000	1,124.00	10,116,000	
吉野家ホールディングス	67,700	3,392.00	229,638,400	
松屋フーズホールディングス	8,800	4,810.00	42,328,000	
サガミホールディングス	27,800	1,375.00	38,225,000	
関西フードマーケット	12,800	1,402.00	17,945,600	
王将フードサービス	13,700	7,870.00	107,819,000	
ミニストップ	13,400	1,524.00	20,421,600	
アークス	33,800	2,725.00	92,105,000	
バローホールディングス	35,200	2,322.00	81,734,400	
ベルク	9,200	6,550.00	60,260,000	
大庄	8,100	1,239.00	10,035,900	
ファーストリテイリング	82,600	36,820.00	3,041,332,000	
サンドラッグ	62,000	4,338.00	268,956,000	
サックスパー ホールディングス	17,900	916.00	16,396,400	
ヤマザワ	2,600	1,261.00	3,278,600	
やまや	2,700	2,921.00	7,886,700	
ベルーナ	44,900	616.00	27,658,400	
いよぎんホールディングス	203,300	964.70	196,123,510	
しずおかフィナンシャルグループ	379,500	1,219.00	462,610,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,800	1,113.50	160,121,300	
楽天銀行	59,400	2,613.00	155,212,200	
京都フィナンシャルグループ	54,100	8,680.00	469,588,000	
島根銀行	3,900	526.00	2,051,400	

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

大垣共立銀行	32,600	1,879.00	61,255,400	
福井銀行	15,300	1,550.00	23,715,000	
清水銀行	6,800	1,566.00	10,648,800	
富山銀行	1,700	1,704.00	2,896,800	
滋賀銀行	28,400	3,765.00	106,926,000	
南都銀行	25,700	2,464.00	63,324,800	
百五銀行	160,700	535.00	85,974,500	
紀陽銀行	61,100	1,595.00	97,454,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	105,700	1,616.00	170,811,200	
山陰合同銀行	106,900	950.00	101,555,000	
鳥取銀行	3,600	1,321.00	4,755,600	
百十四銀行	16,800	2,613.00	43,898,400	
四国銀行	27,100	1,012.00	27,425,200	
阿波銀行	24,000	2,514.00	60,336,000	
大分銀行	10,300	2,665.00	27,449,500	
宮崎銀行	10,300	2,731.00	28,129,300	
佐賀銀行	10,000	1,916.00	19,160,000	
琉球銀行	36,300	1,145.00	41,563,500	
セブン銀行	535,400	301.50	161,423,100	
みずほフィナンシャルグループ	2,305,600	2,562.00	5,906,947,200	
高知銀行	3,900	985.00	3,841,500	
山口フィナンシャルグループ	167,500	1,292.00	216,410,000	
名古屋銀行	11,200	5,860.00	65,632,000	
北洋銀行	258,800	374.00	96,791,200	
大光銀行	3,400	1,325.00	4,505,000	
愛媛銀行	23,000	1,040.00	23,920,000	
トマト銀行	3,700	1,141.00	4,221,700	
京葉銀行	71,700	690.00	49,473,000	
栃木銀行	85,300	328.00	27,978,400	
北日本銀行	6,000	2,141.00	12,846,000	
東和銀行	31,300	619.00	19,374,700	
福島銀行	12,000	253.00	3,036,000	
大東銀行	4,400	779.00	3,427,600	
トモニホールディングス	138,000	479.00	66,102,000	
フィデアホールディングス	17,600	1,490.00	26,224,000	
池田泉州ホールディングス	236,900	359.00	85,047,100	

F P G	57,900	1,511.00	87,486,900	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,583.00	22,162,000	
マーキュリアホールディングス	6,000	749.00	4,494,000	
S B I ホールディングス	250,000	3,175.00	793,750,000	
ジャフコ グループ	51,000	1,676.50	85,501,500	
大和証券グループ本社	1,323,300	975.50	1,290,879,150	
野村ホールディングス	2,872,700	618.50	1,776,764,950	
岡三証券グループ	150,100	721.00	108,222,100	
丸三証券	57,000	880.00	50,160,000	
東洋証券	45,700	300.00	13,710,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	203,000	545.00	110,635,000	
光世証券	2,900	522.00	1,513,800	
水戸証券	50,700	439.00	22,257,300	
いちよし証券	32,200	719.00	23,151,800	
松井証券	84,200	752.00	63,318,400	
マネックスグループ	167,500	647.00	108,372,500	
極東証券	23,500	1,062.00	24,957,000	
岩井コスモホールディングス	19,500	1,750.00	34,125,000	
アイザワ証券グループ	24,800	1,178.00	29,214,400	
マネーパートナーズグループ	12,400	285.00	3,534,000	
スパークス・グループ	19,100	1,438.00	27,465,800	
かんぽ生命保険	174,000	2,824.00	491,376,000	
F P パートナー	3,400	4,500.00	15,300,000	
S O M P O ホールディングス	270,600	6,507.00	1,760,794,200	
アニコム ホールディングス	58,000	579.00	33,582,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	382,400	5,383.00	2,058,459,200	
第一生命ホールディングス	834,600	3,042.00	2,538,853,200	
東京海上ホールディングス	1,688,400	3,697.00	6,242,014,800	
T & D ホールディングス	496,600	2,309.50	1,146,897,700	
アドバンスクリエイト	9,900	977.00	9,672,300	
全国保証	44,700	4,804.00	214,738,800	
あんしん保証	6,600	259.00	1,709,400	
イントラスト	4,700	803.00	3,774,100	
日本モーゲージサービス	6,800	527.00	3,583,600	
C a s a	4,700	831.00	3,905,700	

アルヒ	16,800	811.00	13,624,800	
プレミアグループ	29,000	1,663.00	48,227,000	
ネットプロテクションズホールディングス	57,800	276.00	15,952,800	
クレディセゾン	108,400	2,352.00	254,956,800	
芙蓉総合リース	15,700	11,915.00	187,065,500	
みずほリース	28,700	4,855.00	139,338,500	
東京センチュリー	32,000	5,660.00	181,120,000	
日本証券金融	63,000	1,480.00	93,240,000	
アイフル	252,300	380.00	95,874,000	
リコーリース	16,300	4,535.00	73,920,500	
イオンフィナンシャルサービス	98,300	1,265.50	124,398,650	
アコム	305,700	336.90	102,990,330	
ジャックス	18,300	5,170.00	94,611,000	
オリエントコーポレーション	56,000	1,075.00	60,200,000	
オリックス	1,041,300	2,708.50	2,820,361,050	
三菱HCキャピタル	761,400	960.20	731,096,280	
九州リースサービス	5,600	913.00	5,112,800	
日本取引所グループ	445,800	3,078.00	1,372,172,400	
イー・ギャランティ	28,000	1,803.00	50,484,000	
アサックス	5,600	673.00	3,768,800	
NECキャピタルソリューション	8,500	3,255.00	27,667,500	
Robot Home	51,000	182.00	9,282,000	
大東建託	62,600	16,090.00	1,007,234,000	
いちご	198,700	342.00	67,955,400	
日本駐車場開発	183,900	205.00	37,699,500	
スター・マイカ・ホールディングス	21,000	600.00	12,600,000	
SREホールディングス	8,600	2,628.00	22,600,800	
ADワークスグループ	28,600	232.00	6,635,200	
ヒューリック	398,900	1,427.00	569,230,300	
野村不動産ホールディングス	95,200	3,729.00	355,000,800	
三重交通グループホールディングス	37,800	561.00	21,205,800	
サムティ	27,500	2,414.00	66,385,000	
ディア・ライフ	30,000	868.00	26,040,000	
地主	13,400	2,173.00	29,118,200	
プレサンスコーポレーション	27,500	1,484.00	40,810,000	
ハウスコム	2,600	818.00	2,126,800	

JPMC	10,500	1,113.00	11,686,500
サンセイラディック	4,100	1,052.00	4,313,200
フージャースホールディングス	26,300	1,050.00	27,615,000
オープンハウスグループ	62,700	4,135.00	259,264,500
東急不動産ホールディングス	514,300	958.50	492,956,550
飯田グループホールディングス	163,900	2,278.50	373,446,150
イーグランド	2,200	1,478.00	3,251,600
ムゲンエステート	8,300	1,224.00	10,159,200
Andoホールディングス	10,300	1,053.00	10,845,900
シーアールイー	9,900	1,583.00	15,671,700
ケイアイスター不動産	8,400	3,355.00	28,182,000
グッドコムアセット	16,600	959.00	15,919,400
ジェイ・エス・ビー	8,800	2,497.00	21,973,600
ロードスターキャピタル	11,500	2,030.00	23,345,000
テンポイノベーション	4,100	1,122.00	4,600,200
フェイスネットワーク	3,600	1,366.00	4,917,600
パーク24	111,300	1,753.00	195,108,900
パラカ	6,400	1,965.00	12,576,000
三井不動産	790,100	3,459.00	2,732,955,900
三菱地所	1,116,900	1,942.00	2,169,019,800
平和不動産	27,900	3,840.00	107,136,000
東京建物	149,600	2,095.00	313,412,000
京阪神ビルディング	32,400	1,332.00	43,156,800
住友不動産	247,200	4,166.00	1,029,835,200
テーオーシー	31,900	599.00	19,108,100
東京楽天地	3,000	4,185.00	12,555,000
レオパレス21	170,900	444.00	75,879,600
スターツコーポレーション	24,700	2,774.00	68,517,800
フジ住宅	24,900	689.00	17,156,100
空港施設	25,200	560.00	14,112,000
明和地所	9,100	1,138.00	10,355,800
ゴールドクレスト	14,200	2,006.00	28,485,200
エスリード	8,300	3,055.00	25,356,500
日神グループホールディングス	28,700	490.00	14,063,000
日本エスコン	32,000	897.00	28,704,000
MIRARTHホールディングス	78,500	454.00	35,639,000

AVANTIA	7,200	842.00	6,062,400	
イオンモール	88,900	1,714.50	152,419,050	
毎日コムネット	5,200	719.00	3,738,800	
ファースト住建	5,200	1,106.00	5,751,200	
カチタス	46,200	2,183.00	100,854,600	
トーセイ	28,800	1,891.00	54,460,800	
穴吹興産	2,600	1,983.00	5,155,800	
サンフロンティア不動産	25,700	1,553.00	39,912,100	
FJネクストホールディングス	18,600	1,159.00	21,557,400	
インテリックス	2,800	508.00	1,422,400	
ランドビジネス	4,200	269.00	1,129,800	
サンネクスタグループ	4,100	938.00	3,845,800	
グランディハウス	12,200	576.00	7,027,200	
日本空港ビルデング	60,500	6,923.00	418,841,500	
明豊ファシリティワークス	6,400	791.00	5,062,400	
LIFULL	62,300	199.00	12,397,700	
MIXI	38,400	2,321.00	89,126,400	
ジェイエイシーリクルートメント	16,200	2,587.00	41,909,400	
日本M&Aセンターホールディングス	284,500	678.50	193,033,250	
メンバーズ	6,300	1,093.00	6,885,900	
中広	2,400	415.00	996,000	
UTグループ	23,700	2,218.00	52,566,600	
アイティメディア	7,000	1,010.00	7,070,000	
E・Jホールディングス	10,600	1,617.00	17,140,200	
オープンアップグループ	53,600	2,063.00	110,576,800	
コシダカホールディングス	53,700	1,070.00	57,459,000	
アルトナー	4,300	1,768.00	7,602,400	
パソナグループ	21,800	2,266.00	49,398,800	
CDS	3,100	1,702.00	5,276,200	
リンクアンドモチベーション	51,300	523.00	26,829,900	
エス・エム・エス	62,600	2,667.50	166,985,500	
サニーサイドアップグループ	3,900	655.00	2,554,500	
パーソルホールディングス	1,816,200	245.50	445,877,100	
リニカル	7,200	548.00	3,945,600	
クックパッド	51,300	132.00	6,771,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	662.00	4,170,600	

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

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

テクノプロ・ホールディングス	105,600	3,427.00	361,891,200
アトラグループ	3,600	203.00	730,800
アイ・アールジャパンホールディングス	9,500	1,510.00	14,345,000
K e e P e r 技研	11,100	5,870.00	65,157,000
ファーストロジック	3,400	500.00	1,700,000
三機サービス	2,100	1,084.00	2,276,400
G u n o s y	14,600	691.00	10,088,600
デザインワン・ジャパン	4,800	159.00	763,200
イー・ガーディアン	6,900	1,551.00	10,701,900
リブセンス	6,500	281.00	1,826,500
ジャパンマテリアル	54,700	2,260.00	123,622,000
ベクトル	22,100	1,117.00	24,685,700
ウチヤマホールディングス	5,900	350.00	2,065,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,100	1,192.00	17,999,200
キャリアリンク	6,700	2,132.00	14,284,400
I B J	14,100	712.00	10,039,200
アサンテ	9,000	1,580.00	14,220,000
バリューHR	15,800	1,405.00	22,199,000
M&Aキャピタルパートナーズ	14,500	2,152.00	31,204,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,300	1,022.00	7,460,600
E R I ホールディングス	3,200	1,792.00	5,734,400
アビスト	1,900	3,075.00	5,842,500
シグマクシス・ホールディングス	24,200	1,310.00	31,702,000
ウィルグループ	15,100	1,092.00	16,489,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	141.00	2,072,700
メドピア	16,000	774.00	12,384,000
レアジョブ	2,600	941.00	2,446,600
リクルートホールディングス	1,320,000	5,118.00	6,755,760,000
エラン	24,000	946.00	22,704,000
土木管理総合試験所	6,400	320.00	2,048,000
日本郵政	2,095,300	1,314.00	2,753,224,200
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,645.00	31,748,500
鎌倉新書	15,700	590.00	9,263,000
SMN	3,600	291.00	1,047,600
グローバルキッズCOMPANY	2,700	642.00	1,733,400
エアトリ	13,200	1,819.00	24,010,800

アトラエ	10,800	788.00	8,510,400	
ストライク	7,600	3,810.00	28,956,000	
ソラスト	49,600	590.00	29,264,000	
セラク	5,700	1,299.00	7,404,300	
インソース	39,000	985.00	38,415,000	
ベイカレント・コンサルティング	131,100	4,645.00	608,959,500	
Orchestra Holdings	4,100	940.00	3,854,000	
アイモバイル	24,400	470.00	11,468,000	
キャリアインデックス	5,100	228.00	1,162,800	
MS-Japan	5,900	1,157.00	6,826,300	
船場	2,800	922.00	2,581,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	57,900	2,292.00	132,706,800	
フルテック	1,900	1,211.00	2,300,900	
GameWith	4,500	310.00	1,395,000	
MS&Consulting	1,900	663.00	1,259,700	
ウェルビー	13,500	719.00	9,706,500	
エル・ティー・エス	2,100	3,570.00	7,497,000	
ミダックホールディングス	11,000	1,815.00	19,965,000	
キュービーネットホールディングス	8,700	1,558.00	13,554,600	
RPAホールディングス	25,100	283.00	7,103,300	
スプリックス	3,800	794.00	3,017,200	
マネジメントソリューションズ	7,700	2,936.00	22,607,200	
プロレド・パートナーズ	5,100	374.00	1,907,400	
テノ.ホールディングス	2,000	461.00	922,000	
フロンティア・マネジメント	5,200	1,578.00	8,205,600	
ピアラ	2,900	320.00	928,000	
コプロ・ホールディングス	4,200	1,490.00	6,258,000	
ギークス	2,000	501.00	1,002,000	
アンビスホールディングス	19,200	2,806.00	53,875,200	
カーブスホールディングス	49,200	640.00	31,488,000	
フォーラムエンジニアリング	12,300	1,511.00	18,585,300	
Fast Fitness Japan	6,300	1,079.00	6,797,700	
ダイレクトマーケティングミックス	19,100	459.00	8,766,900	
ポピンズ	2,900	1,376.00	3,990,400	
LITALICO	14,000	2,083.00	29,162,000	

コンフィデンス・インターワークス	1,000	1,500.00	1,500,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	451.00	2,751,100	
リログループ	89,500	1,537.50	137,606,250	
東祥	12,700	792.00	10,058,400	
I D & Eホールディングス	10,800	3,305.00	35,694,000	
ビーウィズ	4,700	2,250.00	10,575,000	
T R Eホールディングス	34,400	1,154.00	39,697,600	
人・夢・技術グループ	6,900	1,795.00	12,385,500	
N I S S Oホールディングス	15,800	803.00	12,687,400	
大栄環境	32,500	2,306.00	74,945,000	
日本管財ホールディングス	18,800	2,497.00	46,943,600	
M & A総研ホールディングス	8,600	3,555.00	30,573,000	
エイチ・アイ・エス	52,000	1,768.00	91,936,000	
ラックランド	8,200	2,641.00	21,656,200	
共立メンテナンス	28,000	6,149.00	172,172,000	
イチネンホールディングス	19,100	1,541.00	29,433,100	
建設技術研究所	9,200	4,635.00	42,642,000	
スペース	12,300	903.00	11,106,900	
燦ホールディングス	17,000	1,058.00	17,986,000	
スバル興業	1,000	13,660.00	13,660,000	
東京テアトル	4,400	1,070.00	4,708,000	
タナベコンサルティンググループ	5,600	1,007.00	5,639,200	
ナガワ	5,600	6,400.00	35,840,000	
東京都競馬	15,000	4,275.00	64,125,000	
カナモト	27,800	2,530.00	70,334,000	
ニシオホールディングス	16,700	3,595.00	60,036,500	
トランス・コスモス	22,200	3,110.00	69,042,000	
乃村工藝社	78,100	826.00	64,510,600	
藤田観光	7,100	4,045.00	28,719,500	
K N T - C Tホールディングス	10,600	1,271.00	13,472,600	
トーカイ	15,900	1,896.00	30,146,400	
セコム	181,600	10,600.00	1,924,960,000	
セントラル警備保障	9,700	2,468.00	23,939,600	
丹青社	34,900	877.00	30,607,300	
メイテックグループホールディングス	64,300	2,894.50	186,116,350	
応用地質	16,800	2,089.00	35,095,200	

船井総研ホールディングス	37,200	2,524.00	93,892,800	
進学会ホールディングス	4,900	283.00	1,386,700	
オオバ	7,700	934.00	7,191,800	
いであ	3,400	1,644.00	5,589,600	
学究社	7,300	1,940.00	14,162,000	
ベネッセホールディングス	60,100	2,613.00	157,041,300	
イオンディライト	19,800	3,390.00	67,122,000	
ナック	7,900	971.00	7,670,900	
ダイセキ	36,500	4,120.00	150,380,000	
ステップ	6,700	1,851.00	12,401,700	
合 計	261,429,900		584,817,153,820	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2 【ファンドの現況】

【グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

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

(参考)

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

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

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限

該当事項はありません。

(4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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ます。）に支払います。

⑥ 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（2023年12月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

②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、各運用部において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

[DO (実行)]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK (検証・評価)]

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

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

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

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

委託会社の機構は 2024 年 2 月 20 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023 年 12 月 29 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	218,373
単位型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。
- また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。
- なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 37 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
- また、第 38 期事業年度の中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

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

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

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

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

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8. ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①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。

②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しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度 (2022年3月31日)

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

当事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 218 百万円) は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

(注 2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注 3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。
 なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建 ユーロ	21	—	0	0
	合計	6,915	—	△80	△80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建 米ドル	152	—	3	3
	合計	7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ	21	—	△0	
合計			5,082	—	△88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 100 百万円、当事業年度 109 百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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。

② 投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022 年 3 月 31 日）

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

当事業年度（2023 年 3 月 31 日）

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

(1 株当たり情報)

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

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

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田中洋一

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601
固定資産		
有形固定資産	※1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045
負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	※2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		43,700
利益剰余金合計		46,300
株主資本合計		65,540
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		164
繰延ヘッジ損益		△906
評価・換算差額等合計		△741
純資産合計		64,798
負債・純資産合計		77,045

中間損益計算書

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間

(自 2023 年 4 月 1 日

至 2023 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	※1	6,965
営業利益		3,722
営業外収益	※2	1,680
営業外費用	※3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				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	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	—	—	△1,055	△1,055	△1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	114	△395	△280	△280
当中間期変動額合計	114	△395	△280	△1,335
当中間期末残高	164	△906	△741	64,798

注記事項

(重要な会計方針)

第 38 期中間会計期間
(自 2023 年 4 月 1 日
至 2023 年 9 月 30 日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上してしております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」という。)に応じて手数料を受領してしております。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しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(表示方法の変更)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第 38 期中間会計期間末 (2023 年 9 月 30 日)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 957 百万円
※2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	91 百万円
無形固定資産	972 百万円
※2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589 百万円
※3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269 百万円
為替差損	784 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	—	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,137	—	4,137
資産計	1,206	18,133	—	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	—	339
通貨関連取引	—	(134)	—	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	—	205

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (中間貸借対照表計上額 1,041 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は 16,243 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (中間貸借対照表計上額 271 百万円) は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末(2023年9月30日)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位:百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	△343
小計	1,426	1,769	△343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額271百万円)は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)	
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	—	△76	△76
	英ポンド	267	—	△1	△1
	カナダドル	126	—	△1	△1
	スイスフラン	176	—	△0	△0
	香港ドル	214	—	△2	△2
	ユーロ	719	—	△3	△3
合計	7,449	—	△84	△84	

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	9,373	—	226	226
店頭				
トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	—	113	113
合計	13,239	—	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	—	△24
	英ポンド		3,612	—	△23
	スイスフラン		22	—	△0
	香港ドル		90	—	△1
	ユーロ	51	—	△0	
合計			5,713	—	△49

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057 百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
1株当たり純資産額	21,599,648 円 64 銭
1株当たり中間純利益	770,782 円 86 銭
なお、潜在株式調整後 1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
中間純利益	2,312 百万円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	2,312 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2024年2月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第 21 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

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。

2. 運用方法

(1) 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「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

(2) 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（以下、総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）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。

(3) 運用制限

- ①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。
- ②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。
- ③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。
- ④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。

- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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。
- ⑧一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。
- ⑨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. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき分配を行います。

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

追加型証券投資信託
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、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ます。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

（信託の目的、金額および限度額）

第3条 委託者は、金 2,029,479,762 円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 5,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第53条第1項、第53条第2項、第54条第1項、第55条第1項および第57条第2項の規定による信託終了の日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の分割および再分割）

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権については2,029,479,762口に、追加信託によって生じた受益権についてはこれを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第31条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令およ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口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ③第33条に規定する為替予約の評価は、原則として、わが国における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。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。

②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第5条第1項の規定により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また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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入

簿に記載または記録を申請する場合において、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

（受益権の申込単位、価額および手数料）

第12条 指定販売会社は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、指定販売会社が委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとし、ただし、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者に係る収益分配金の再投資に限り、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとし、また、ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みは受け付けられないものとし、

②前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第3項または第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る受益証券の価額は、1口につき1円に、次項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④前項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとし、

⑤第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第43条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥前各項の規定にかかわらず、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、指定販売会社は、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。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第13条 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また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、

②第1項の申請のある場合には、第1項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとし、ただし、第1項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

- ③委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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）

第 14 条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（無記名式の受益証券の再交付）

第 15 条 （削除）

（記名式の受益証券の再交付）

第 16 条 （削除）

（受益証券を毀損した場合等の再交付）

第 17 条 （削除）

（受益証券の再交付の費用）

第 18 条 （削除）

（投資の対象とする資産の種類）

第 19 条 この信託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

（運用の指図範囲）

第 20 条 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（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下、総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）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することができます。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ②委託者は、信託金を、前項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つ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

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、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、信託金を前項第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

④委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式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が、投資信託財産の純資産総額の100分の35を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券を除く投資信託証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券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は、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えないものとします。

⑥委託者は、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券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が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦前3項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド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株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(運用の基本方針)

第21条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第22条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②前項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。

(同一銘柄の株式等への投資制限)

第23条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該株式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が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券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が、投資信託財産の純資産総額の100分

の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ③前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド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株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第24条 委託者は、投資信託財産に属する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。）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転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債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が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド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転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第25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。

- ②前項の信用取引の指図は、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。

- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付に係る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となった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

- ④第2項において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とは、投資信託財産に属するマザーファンド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売付に係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(先物取引等の運用指図、目的および範囲)

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号ハ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。）

- ②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。

- ③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。

(スワップ取引の運用指図、目的および範囲)

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、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。

- ②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、原則として第 4 条に定める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。

- ③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（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- ④前項において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は、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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- ⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

- ⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲)

第 28 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。

- ②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第 4 条に定める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。

- ③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（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）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（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- ④前項において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は、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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、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は、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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤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（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）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（以下「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥前項において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は、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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、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は、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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取

り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第 29 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。

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。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

（公社債の空売りの指図範囲）

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、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ます。

- ②前項の売付の指図は、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。
- ③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の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を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

（公社債の借入れ）

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、公社債の借入れの指図をすることがで

きます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の指図は、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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の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を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④第1項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第32条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図)

第33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。

②前項の予約取引の指図は、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。

③前項において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は、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、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は、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④第2項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(保管業務の委任)

第34条 受託者は、委託者と協議のうえ、投資信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。保管費用は、受益者の負担とし、投資信託財産中より支弁します。

(有価証券等の保管)

第35条 受託者は、投資信託財産に属する有価証券等を、法令等にもとづき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第36条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第2条第9項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引

業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとしします。

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 37 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとしします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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します。ただし、受託者が認める場合は、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。

④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。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第 38 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 39 条 委託者は、第 38 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

(資金の借入れ)

第 40 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します。

②一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。

③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。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 41 条 委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 42 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 43 条 この信託の計算期間は、原則として毎月 20 日から翌月 19 日までとします。ただし、第 1 計算期間は、平成 16 年 12 月 1 日から平成 17 年 2 月 21 日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により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、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告)

第 44 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する計算書および報告書を作成してこれを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する総計算書および報告書を作成してこれを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第 45 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 43 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 46 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 43 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 120 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 47 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と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。）との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した

後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②前項第 1 号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の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投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第 48 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末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計算期間の末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指定販売会社の名義で記載また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します。）に支払います。なお、平成 19 年 1 月 4 日以降においても、第 50 条に規定する時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者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、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、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、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載また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します。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

④一部解約金は、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 営業日目から受益者に支払います。

⑤前各項（第 2 項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとしします。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

⑦前項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

⑧（削除）

⑨（削除）

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第49条 受託者は、収益分配金については、第48条第1項に規定する支払開始日および第48条第2項に規定する交付開始前までに、償還金については第48条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第48条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第50条 受益者が、収益分配金については第48条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第48条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（受益証券の保護預り）

第51条 （削除）

（投資信託契約の一部解約）

第52条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位または指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、当該請求日がニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日の場合は、指定販売会社は、当該請求には応じないものとします。

②平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。

③委託者は、第1項の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。なお、第1項の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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤委託者は、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、第 1 項による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。

- ⑥前項により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、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第 52 条の 2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第 53 条 委託者は、第 4 条の規定による信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 10 億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ③委託者は、前 2 項の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。

- ④前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

- ⑤前項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、第 1 項および第 2 項の投資信託契約の解約をしません。

- ⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、この投資信託契約に係るすべ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。

- ⑦第 4 項から前項までの規定は、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、第 4 項の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第 54 条 委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第 58 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 55 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 58 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 56 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 57 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 58 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第 58 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

④前項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、第 1 項の投資信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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すべ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。

(反対者の買取請求権)

第 59 条 第 53 条に規定する投資信託契約の解約または第 58 条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第 53 条第 4 項または第 58 条 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 59 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付

に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。

この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第 60 条 委託者が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第 61 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(付則)

第 1 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の投資信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条から第 18 条、第 51 条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 16 年 12 月 1 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社