

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	国内株式SMTBセレクション（SMA専用）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （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】

2021年 9月22日から2022年 3月18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、金融商品取引所等（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及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及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、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、及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。

## 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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般	年1回	グロ ー バ ル	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
	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 (隔月)	北米				
公債 社債		欧州				
その他債券 クレジット属 性 ( )	年12回 (毎月) 日々	アジア オセアニ ア				そ の 他 ( )
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ン グ				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

#### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

(1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ

ないファンドをいう。

- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

- (1)インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の



資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

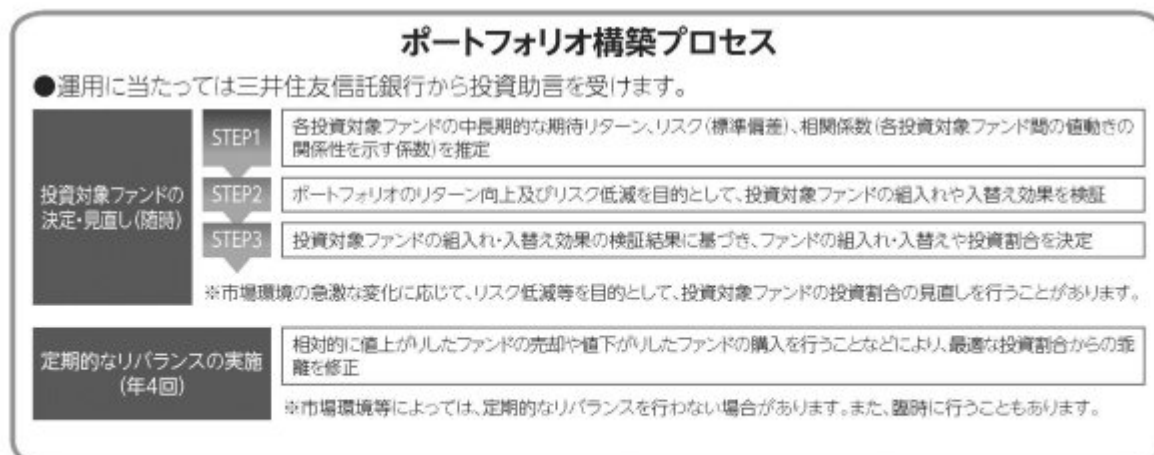
## 1. 主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド<sup>\*</sup>」)に投資します。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する株式以外の資産への実質投資割合には制限を設けません。
- コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

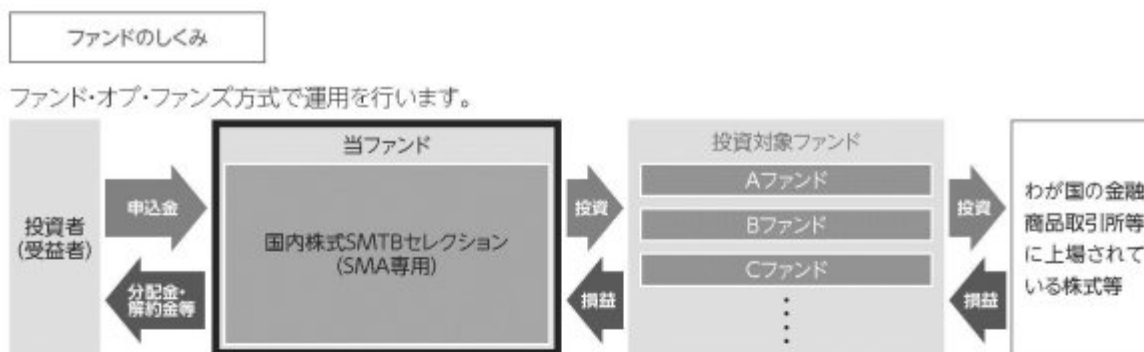
投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

## 2. 各投資対象ファンドへの投資割合については、定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また、投資対象ファンドは適宜見直しを行います。

- 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。
- 投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

### 分配方針

- 原則として12月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 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(評価益を含みます。)等の全額とします。
  - 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。
- ※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。

### 主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。なお、投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

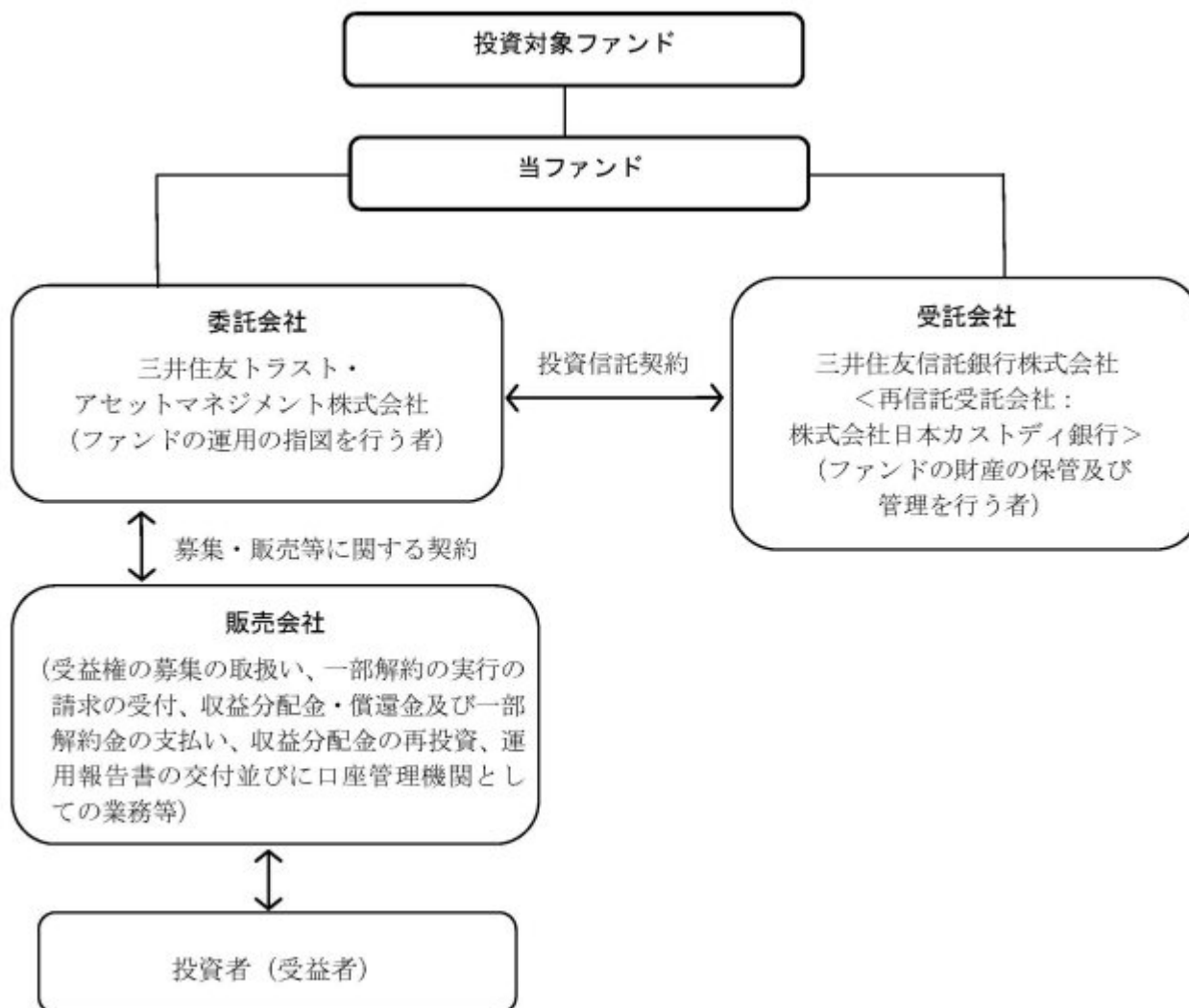
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 7月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立  
 1987年2月20日： 投資顧問業の登録  
 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可  
 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更  
 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更  
 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可  
 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）  
 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更  
 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

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】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

### 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

### 投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所等（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及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。
- ロ．各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ハ．投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。
- ニ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- ホ．投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する株式以外の資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ヘ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．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。）
  - １．有価証券
  - ２．金銭債権
  - ３．約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
  - １．為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 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。）

なお、上記3.の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

#### 金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記 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

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．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。

当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

#### （参考）投資対象ファンドの概要

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2021年 7月30日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

#### 1. JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用会社	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	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上市されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>同一銘柄の転換社債並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の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及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の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。</p> <p>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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及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。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2014年1月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

J P X日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、J P Xグループ並びに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

同指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJ P Xグループ及び日経に帰属しています。

当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループ及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数の構成銘柄、計算方法、その他同指数の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 2. F O F s用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。 なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。



主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>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及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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、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もあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

### 3. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	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	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>主として、わが国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます）のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞り込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>株式への投資比率は、原則として高位（80%以上）を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間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。</p> <p>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を行うことができるものとします。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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及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の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。</p> <p>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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及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。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>

決算日	年1回：6月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年9月22日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

#### 4. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	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	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、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。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、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、責任を有しません。

#### 5. 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）

決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、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もあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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取引等エクスポージャーの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%以下とし、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の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

## 7. マネープールマザーファンド

運用会社	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	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。

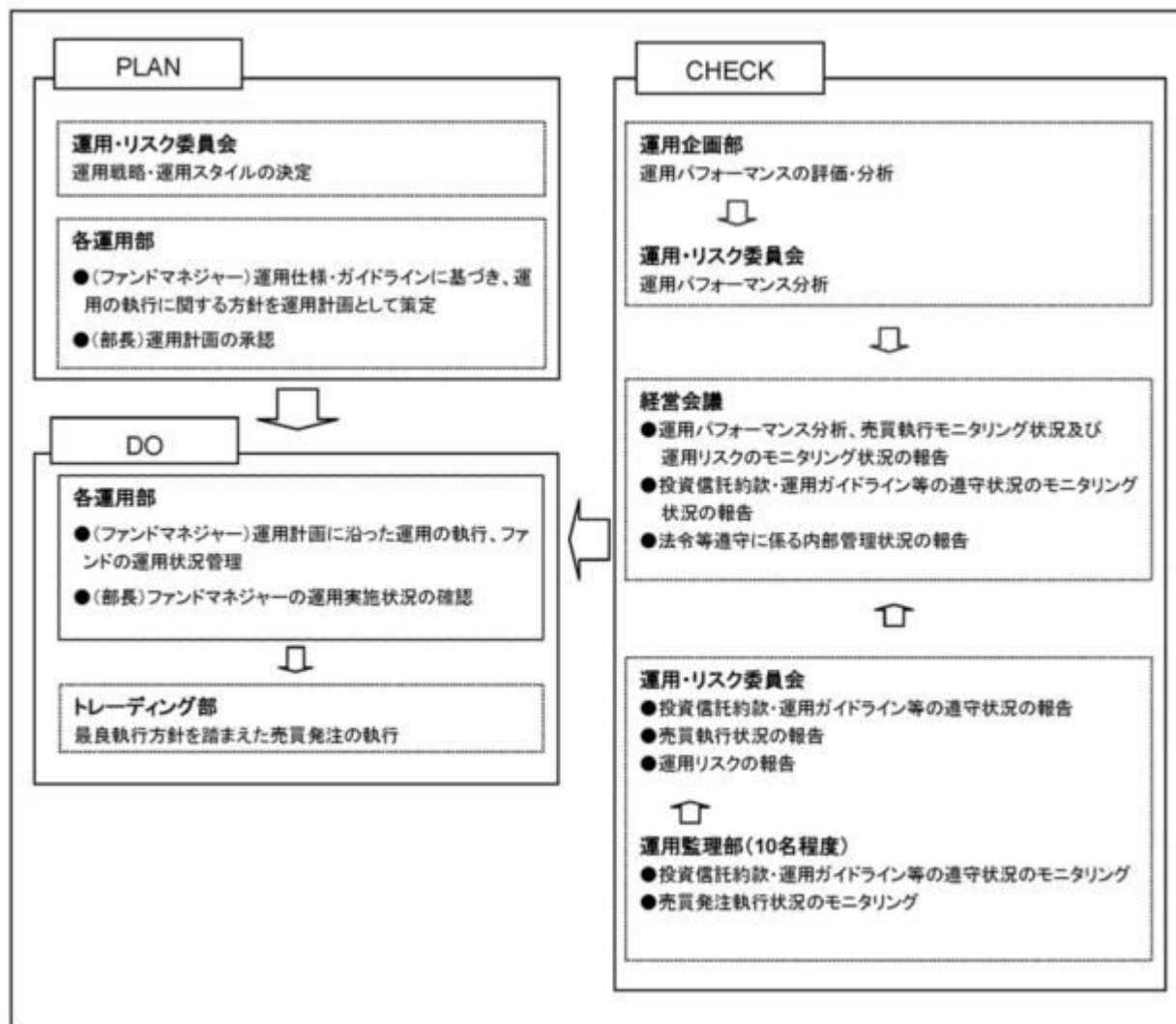
投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、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及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。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又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。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
------	--



主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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号及び第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。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の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及びデリバティブ等エクスポージャーの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の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。</p> <p>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及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、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。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2010年2月26日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### （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】

年1回の毎決算時（決算日は毎年12月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・ 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（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 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。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、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>

### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

### ハ．外貨建資産への投資

外貨建資産への直接投資は行いません。なお、投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

### ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

### ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、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。

（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、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。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り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。

（ニ）上記（イ）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。

### ヘ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又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。

（ロ）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又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、解約代金及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。

（ハ）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。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

### ト．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及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。

### <その他の投資制限>

イ.当ファンドでは直接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、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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ないものとします。

## 3【投資リスク】

### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象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。

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。

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。

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

が小さかった場合も同様です。

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

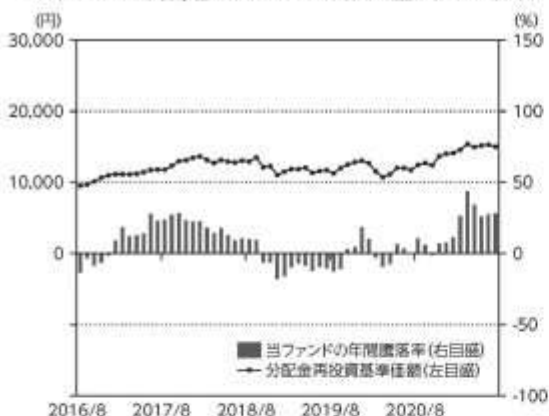
## (2) リスクの管理体制

### 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】

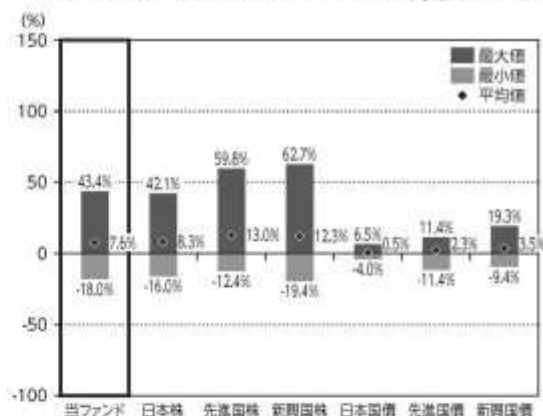
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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



\*2016年8月～2021年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出・公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式を銘柄を対象とした株価指数加重平均の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知財財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は運用に関するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産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、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募定期付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動に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により提供されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの他業、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、誤差または誤証につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 F&Mエマージングマーケットインデックス エマージング マーケットグローバルデベロップメント	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】

ありません。

## ( 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 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.605%（税抜 0.55%）（ ）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 0.352% ( 税抜 0.32% )	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 0.22% ( 税抜 0.2% )	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 0.033% ( 税抜 0.03% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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。

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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

## ( 参考 ) 各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
JPX日経インデックス400 マザーファンド	ありません。
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド ( 適格機関投資家専用 )	年率 0.374% ( 税抜 0.34% )

中小型株式 マザーファンド	ありません。
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517% （税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095% （税抜 0.645%）
マネープールマザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。

実質的な信託報酬率：年率0.605%～1.1774%程度（税抜 0.55%～1.08%程度）  
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.5724%程度（税抜 0.0%～0.53%程度））

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、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（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.055%（税抜0.05%）を乗じて得たものとします。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

#### ハ．損益通算について

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込  
手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たりま  
す。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行  
うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異な  
る場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当  
該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。  
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配  
金）」について」をご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元  
本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る  
部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配



金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は、2021年7月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年7月30日現在の状況について記載してあります。

### 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	53,661,815,176	40.26
親投資信託受益証券	日本	78,412,345,942	58.82
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,223,995,254	0.92
合計（純資産総額）		133,298,156,372	100.00

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	24,966,394,062	1.7131	42,770,223,707	1.8361	45,840,796,137	34.39
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	23,367,806,962	1.0357	24,202,683,029	1.1562	27,017,858,409	20.27
日本	親投資信託受益証券	J P X 日経インデックス400 マザーファンド	11,400,703,593	1.6244	18,519,759,521	1.7282	19,702,695,949	14.78
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	6,037,906,116	2.2028	13,300,480,208	2.2099	13,343,168,725	10.01
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,828,347,300	1.3801	12,184,241,178	1.5066	13,300,788,042	9.98
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	2,460,158,651	5.0009	12,303,007,398	5.2309	12,868,843,887	9.65
日本	親投資信託受益証券	マネーボールマザーファンド	9,953	1.0019	9,971	1.0017	9,969	0.00

（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（％）
投資信託受益証券	40.26
親投資信託受益証券	58.82
合計	99.08

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末 (2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末 (2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末 (2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282
第5期計算期間末 (2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
第6期計算期間末 (2020年12月21日)	142,930,348,485	142,930,348,485	13,862	13,862
2020年 7月末日	125,563,309,556		11,739	
8月末日	132,811,947,014		12,440	
9月末日	134,862,489,590		12,725	
10月末日	131,069,720,894		12,391	
11月末日	142,927,074,215		13,687	
12月末日	143,551,632,363		14,023	
2021年 1月末日	132,796,762,277		14,121	
2月末日	133,982,846,757		14,577	
3月末日	139,649,659,579		15,379	
4月末日	129,699,984,764		14,965	
5月末日	132,349,604,786		15,172	
6月末日	133,140,622,745		15,294	
7月末日	133,298,156,372		15,031	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	0
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	0
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	0
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	10.5
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	1.1
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	19.7
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	15.6
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	15.9
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	6.0
第7期中間計算期間	2020年12月22日～2021年 6月21日	8.5

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(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1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	81,752,097,825	11,939,046,387	69,813,051,438
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	32,549,745,987	26,264,044,984	76,098,752,441
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	25,222,310,539	24,029,412,202	77,291,650,778
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	39,648,856,359	16,087,379,469	100,853,127,668
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	35,149,470,870	24,542,896,159	111,459,702,379
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	23,651,763,751	31,999,573,730	103,111,892,400
第7期中間計算期間	2020年12月22日～2021年 6月21日	9,178,477,113	25,793,064,625	86,497,304,888

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、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)

J P X日経インデックス400 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	32,451,633,880	98.90
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		361,296,397	1.10
合計（純資産総額）		32,812,930,277	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	359,100,000	1.09

(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	ソニーグループ	電気機器	53,400	8,327.64	444,696,198	11,375.00	607,425,000	1.85
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,030,200	448.15	461,688,023	578.50	595,970,700	1.82
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	103,000	4,470.84	460,497,329	5,629.00	579,787,000	1.77
日本	株式	キーエンス	電気機器	9,500	51,165.31	486,070,508	60,740.00	577,030,000	1.76
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	56,100	7,182.71	402,950,417	9,805.00	550,060,500	1.68
日本	株式	信越化学工業	化学	29,500	15,167.16	447,431,442	17,750.00	523,625,000	1.60
日本	株式	日立製作所	電気機器	78,400	3,836.43	300,776,508	6,258.00	490,627,200	1.50
日本	株式	HOYA	精密機器	31,800	12,632.81	401,723,511	15,405.00	489,879,000	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	174,500	2,340.00	408,330,759	2,802.50	489,036,250	1.49
日本	株式	日本電産	電気機器	39,200	10,640.78	417,118,880	12,240.00	479,808,000	1.46
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,800	19,960.02	415,168,514	22,665.00	471,432,000	1.44
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	66,300	7,291.23	483,409,032	6,837.00	453,293,100	1.38
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	128,300	2,677.16	343,480,480	3,493.00	448,151,900	1.37
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,900	7,507.66	359,617,211	9,040.00	433,016,000	1.32

日本	株式	KDDI	情報・通信業	128,200	2,859.15	366,543,332	3,332.00	427,162,400	1.30
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,500	31,599.26	300,193,033	44,920.00	426,740,000	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	114,500	3,586.21	410,621,673	3,682.00	421,589,000	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,200	3,066.21	340,962,651	3,695.00	410,884,000	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	6,700	57,998.42	388,589,433	56,400.00	377,880,000	1.15
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	112,300	2,696.04	302,766,028	3,232.00	362,953,600	1.11
日本	株式	ファナック	電気機器	14,300	21,571.60	308,474,004	24,380.00	348,634,000	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	218,400	1,325.90	289,577,416	1,565.50	341,905,200	1.04
日本	株式	三井物産	卸売業	128,000	1,864.16	238,613,411	2,499.50	319,936,000	0.98
日本	株式	S M C	機械	4,800	58,883.53	282,640,988	64,800.00	311,040,000	0.95
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	62,800	3,700.80	232,410,533	4,868.00	305,710,400	0.93
日本	株式	三菱商事	卸売業	97,700	2,541.00	248,255,953	3,062.00	299,157,400	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	52,900	4,852.32	256,688,085	5,210.00	275,609,000	0.84
日本	株式	富士通	電気機器	14,700	14,521.51	213,466,341	18,565.00	272,905,500	0.83
日本	株式	デンソー	輸送用機器	35,900	5,153.15	184,998,376	7,482.00	268,603,800	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	121,500	2,737.20	332,570,827	2,159.50	262,379,250	0.80

(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	0.06
		鉱業	0.21
		建設業	2.32
		食料品	3.51
		繊維製品	0.38
		パルプ・紙	0.14
		化学	7.26
		医薬品	5.79
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.63
		非鉄金属	0.62
		金属製品	0.31
		機械	5.73
		電気機器	18.71
		輸送用機器	6.40
精密機器	3.29		
その他製品	1.75		

	電気・ガス業	1.12
	陸運業	3.66
	空運業	0.59
	情報・通信業	7.33
	卸売業	5.15
	小売業	4.59
	銀行業	5.19
	証券、商品先物取引業	0.79
	保険業	2.32
	その他金融業	1.23
	不動産業	2.28
	サービス業	5.40
	小計	98.90
合計		98.90

(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	J P X日経インデックス400先物	買建	210円		364,675,370	359,100,000	1.09

(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。

#### 中小型株式 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	29,965,877,000	94.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,627,789,749	5.15
合計(純資産総額)		31,593,666,749	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。

#### 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	ダイセキ	サービス業	208,000	4,825.00	1,003,600,000	5,060.00	1,052,480,000	3.33
日本	株式	アウトソーシング	サービス業	470,000	1,957.00	919,790,000	2,081.00	978,070,000	3.10
日本	株式	富士電機	電気機器	200,000	5,190.00	1,038,000,000	4,760.00	952,000,000	3.01
日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	270,000	3,310.00	893,700,000	3,475.00	938,250,000	2.97
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	78,500	10,950.00	859,575,000	10,690.00	839,165,000	2.66
日本	株式	良品計画	小売業	320,000	2,355.00	753,600,000	2,219.00	710,080,000	2.25
日本	株式	SHOEI	その他製品	149,000	4,098.20	610,631,938	4,560.00	679,440,000	2.15
日本	株式	SHIFT	情報・通信業	33,000	17,089.61	563,957,298	20,080.00	662,640,000	2.10
日本	株式	ニフコ	化学	180,000	4,255.00	765,900,000	3,620.00	651,600,000	2.06
日本	株式	エスプール	サービス業	640,000	996.00	637,440,000	943.00	603,520,000	1.91
日本	株式	イビデン	電気機器	100,000	6,050.00	605,000,000	5,770.00	577,000,000	1.83
日本	株式	メニコン	精密機器	70,000	7,990.00	559,300,000	7,990.00	559,300,000	1.77
日本	株式	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	サービス業	220,000	2,564.00	564,080,000	2,516.00	553,520,000	1.75
日本	株式	レノバ	電気・ガス業	110,000	4,410.00	485,100,000	4,930.00	542,300,000	1.72
日本	株式	アイ・アールジャパンホールディングス	サービス業	40,000	14,025.14	561,005,801	13,550.00	542,000,000	1.72
日本	株式	LITALICO	サービス業	103,000	5,540.00	570,620,000	5,250.00	540,750,000	1.71
日本	株式	手間いらず	サービス業	95,000	6,490.00	616,550,000	5,650.00	536,750,000	1.70
日本	株式	サイバーエージェント	サービス業	270,000	2,367.00	639,090,000	1,964.00	530,280,000	1.68
日本	株式	日本セラミック	電気機器	180,000	2,892.00	520,560,000	2,893.00	520,740,000	1.65
日本	株式	寿スピリッツ	食料品	78,000	7,310.00	570,180,000	6,550.00	510,900,000	1.62
日本	株式	物語コーポレーション	小売業	75,000	7,270.00	545,250,000	6,800.00	510,000,000	1.61
日本	株式	スター精密	機械	310,000	1,687.00	522,970,000	1,642.00	509,020,000	1.61
日本	株式	インターアクション	精密機器	210,000	2,482.35	521,294,945	2,418.00	507,780,000	1.61
日本	株式	オイシックス・ラ・大地	小売業	130,000	3,980.00	517,400,000	3,890.00	505,700,000	1.60
日本	株式	ペプチドリーム	医薬品	110,000	5,300.00	583,000,000	4,505.00	495,550,000	1.57
日本	株式	インソース	サービス業	250,000	2,387.23	596,807,866	1,982.00	495,500,000	1.57
日本	株式	シュッピン	小売業	440,000	1,119.00	492,360,000	1,120.00	492,800,000	1.56
日本	株式	KHネオケム	化学	190,000	2,515.00	477,850,000	2,583.00	490,770,000	1.55
日本	株式	アズワン	卸売業	33,000	14,605.02	481,965,671	14,840.00	489,720,000	1.55
日本	株式	KADOKAWA	情報・通信業	110,000	4,550.00	500,500,000	4,265.00	469,150,000	1.48

(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。

## □.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	建設業	0.70
		食料品	1.62
		繊維製品	1.05
		化学	5.14
		医薬品	1.96
		ガラス・土石製品	2.66
		金属製品	0.99
		機械	4.12
		電気機器	8.35
		精密機器	3.38
		その他製品	2.15
		電気・ガス業	1.72
		倉庫・運輸関連業	1.19
		情報・通信業	15.39
		卸売業	3.77
		小売業	9.60
		保険業	1.00
		その他金融業	1.94
		不動産業	2.27
		サービス業	25.84
	小計	94.85	
合計		94.85	

(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

該当事項はありません。

## 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	459,412,921,520	99.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,447,755,193	0.74
合計(純資産総額)		462,860,676,713	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,543,300,000	0.77

(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	1,785,800	9,127.79	16,300,424,865	9,805.00	17,509,769,000	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,104,300	10,787.43	11,912,562,545	11,375.00	12,561,412,500	2.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,000	53,921.96	9,328,500,526	60,740.00	10,508,020,000	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,372,600	8,241.70	11,312,568,433	6,837.00	9,384,466,200	2.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,893,400	619.53	7,368,400,465	578.50	6,880,331,900	1.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,206,700	5,554.75	6,702,924,007	5,629.00	6,792,514,300	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	100,900	67,622.13	6,823,073,071	56,400.00	5,690,760,000	1.23

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,023,400	2,930.29	5,929,166,589	2,802.50	5,670,578,500	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	319,300	18,844.65	6,017,098,951	17,750.00	5,667,575,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,466,600	3,719.01	5,454,305,574	3,682.00	5,400,021,200	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,600	5,748.53	4,872,459,771	6,258.00	5,304,280,800	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	344,000	14,361.24	4,940,267,065	15,405.00	5,299,320,000	1.14
日本	株式	日本電産	電気機器	424,300	12,534.65	5,318,454,769	12,240.00	5,193,432,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	224,600	21,597.96	4,850,903,057	22,665.00	5,090,559,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,387,900	3,356.58	4,658,598,373	3,493.00	4,847,934,700	1.05
日本	株式	村田製作所	電気機器	517,900	8,284.71	4,290,655,048	9,040.00	4,681,816,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	103,300	48,629.50	5,023,427,586	44,920.00	4,640,236,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,387,300	3,711.73	5,149,284,592	3,332.00	4,622,483,600	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,203,200	3,948.33	4,750,636,550	3,695.00	4,445,824,000	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,214,400	3,248.61	3,945,123,685	3,232.00	3,924,940,800	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	154,700	26,302.92	4,069,061,858	24,380.00	3,771,586,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,362,500	1,671.28	3,948,402,022	1,565.50	3,698,493,750	0.80
日本	株式	三井物産	卸売業	1,385,000	2,416.04	3,346,222,677	2,499.50	3,461,807,500	0.75
日本	株式	S M C	機械	51,600	65,517.32	3,380,694,031	64,800.00	3,343,680,000	0.72
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	679,200	4,744.67	3,222,584,653	4,868.00	3,306,345,600	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,057,100	2,985.27	3,155,733,927	3,062.00	3,236,840,200	0.70
日本	株式	第一三共	医薬品	1,385,300	2,526.75	3,500,319,076	2,159.50	2,991,555,350	0.65
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	572,600	5,178.18	2,965,026,787	5,210.00	2,983,246,000	0.64
日本	株式	富士通	電気機器	158,600	17,835.33	2,828,684,149	18,565.00	2,944,409,000	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	388,100	7,503.63	2,912,161,593	7,482.00	2,903,764,200	0.63

(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。

#### □. 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	0.09

鉱業	0.19
建設業	2.34
食料品	3.35
繊維製品	0.50
パルプ・紙	0.24
化学	7.07
医薬品	5.02
石油・石炭製品	0.42
ゴム製品	0.71
ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.80
非鉄金属	0.73
金属製品	0.62
機械	5.47
電気機器	18.33
輸送用機器	8.03
精密機器	2.78
その他製品	2.29
電気・ガス業	1.20
陸運業	3.26
海運業	0.36
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.44
卸売業	4.85
小売業	4.55
銀行業	4.89
証券、商品先物取引業	0.75
保険業	1.88
その他金融業	1.11
不動産業	1.98
サービス業	5.63
小計	99.26
合計	99.26

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	186	円	3,595,097,300	3,543,300,000	0.77

(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。

## マネープールマザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		372,104,342,712	100.00
合計(純資産総額)		372,104,342,712	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。

## 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

該当事項はありません。

## ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件


該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

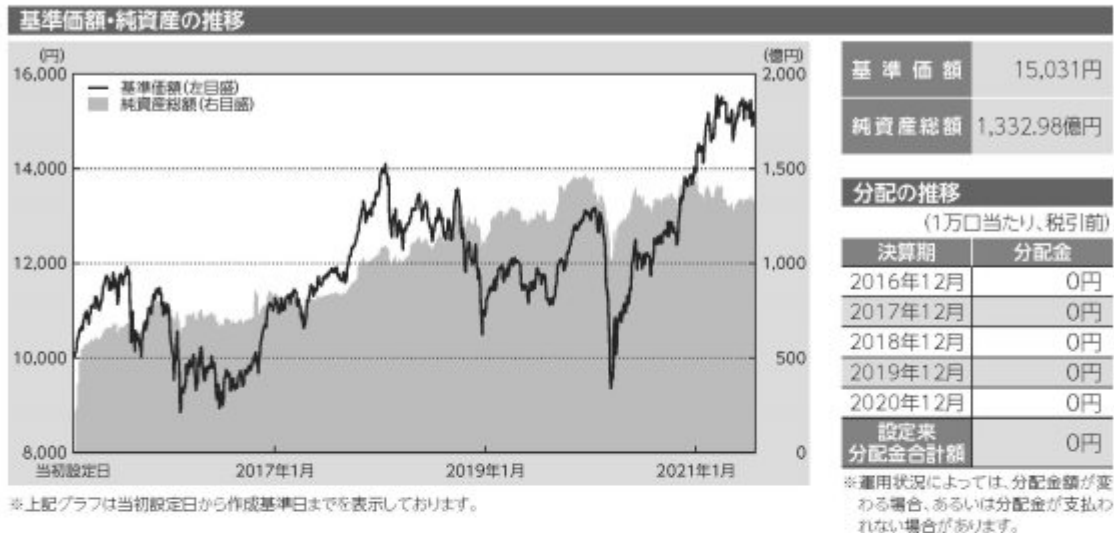
該当事項はありません。

## 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2015年2月6日  
作成基準日：2021年7月30日



**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	34.4%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	20.3%
JPX日経インデックス400 マザーファンド	14.8%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
中小型株式 マザーファンド	9.7%
マネーボールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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。

## 1【申込（販売）手続等】

### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限るものとし、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 >

ありません。

### < 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 >

ありません。

### < 申込受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、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、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6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 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、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、及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（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>

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法  
計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法



計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・公社債等

計算日における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

#### < 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】

2015年 2月 6日（設定日）から2024年12月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2015年2月6日から2015年12月21日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・ 受益権の口数が30億口を下回るようになった場合

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じ、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・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又はファンドの併合を行う場合は、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等に係る書面決議の手続き

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。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受

益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたこと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等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は

謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2019年12月21日から2020年12月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2019年12月20日現在）	第6期 （2020年12月21日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	1,460,042,774	1,078,881,377
投資信託受益証券	58,351,418,757	42,934,880,439
親投資信託受益証券	86,856,855,368	99,517,577,636
未収入金	300,175,643	352,352,480
<b>流動資産合計</b>	<b>146,968,492,542</b>	<b>143,883,691,932</b>
<b>資産合計</b>	<b>146,968,492,542</b>	<b>143,883,691,932</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	769,559,973	541,745,951
未払受託者報酬	21,954,826	22,389,661
未払委託者報酬	380,550,261	388,087,396
未払利息	3,432	822
その他未払費用	1,102,791	1,119,617
<b>流動負債合計</b>	<b>1,173,171,283</b>	<b>953,343,447</b>
<b>負債合計</b>	<b>1,173,171,283</b>	<b>953,343,447</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	111,459,702,379	103,111,892,400
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	34,335,618,880	39,818,456,085
（分配準備積立金）	15,915,774,821	22,605,290,138
<b>元本等合計</b>	<b>145,795,321,259</b>	<b>142,930,348,485</b>
<b>純資産合計</b>	<b>145,795,321,259</b>	<b>142,930,348,485</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>146,968,492,542</b>	<b>143,883,691,932</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2018年12月21日	自	2019年12月21日
	至	2019年12月20日	至	2020年12月21日
<b>営業収益</b>				
受取利息		576		8,341
有価証券売買等損益		20,978,812,335		10,175,433,767
営業収益合計		20,978,812,911		10,175,442,108
<b>営業費用</b>				
支払利息		834,238		801,770
受託者報酬		41,786,497		43,509,154
委託者報酬		724,299,121		754,158,577
その他費用		2,194,227		2,216,054
営業費用合計		769,114,083		800,685,555
営業利益又は営業損失（ ）		20,209,698,828		9,374,756,553
経常利益又は経常損失（ ）		20,209,698,828		9,374,756,553
当期純利益又は当期純損失（ ）		20,209,698,828		9,374,756,553
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（ ）		1,685,692,892		1,420,490,598
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,929,376,076		34,335,618,880
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,175,581,382		4,056,288,852
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,175,581,382		4,056,288,852
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,293,344,514		9,368,698,798
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,293,344,514		9,368,698,798
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,335,618,880		39,818,456,085



## (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	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)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 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は2019年12月21日から2020年12月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2019年12月20日現在)	第6期 (2020年12月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	111,459,702,379口	103,111,892,400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) 1.3081円 (13,081円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3862円 (13,862円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日			第6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,738,650,388円	費用控除後の配当等収益額	A	1,597,658,898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	1,091,202,340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	9,197,588,253円
収益調整金額	C	19,572,996,340円	収益調整金額	C	21,059,735,429円
分配準備積立金額	D	13,085,922,093円	分配準備積立金額	D	11,810,042,987円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,488,771,161円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	43,665,025,567円
当ファンドの期末残存口数	F	111,459,702,379口	当ファンドの期末残存口数	F	103,111,892,400口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,184円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,234円

第5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日			第6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日		
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	- 円	収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	- 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6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (2020年12月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第6期 (2020年12月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	第6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	100,853,127,668円	111,459,702,379円
期中追加設定元本額	35,149,470,870円	23,651,763,751円
期中一部解約元本額	24,542,896,159円	31,999,573,730円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 (2019年12月20日現在)	第6期 (2020年12月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	7,084,029,509	2,755,351,036
親投資信託受益証券	12,926,758,345	9,389,841,480
合計	20,010,787,854	12,145,192,516

（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
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	28,101,452,401	28,961,356,844	
	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	10,159,607,093	13,973,523,595	
投資信託受益証券合計		38,261,059,494	42,934,880,439	
親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	2,850,454,556	14,252,557,825	
	国内株式インデックス マザーファンド	29,214,148,814	49,859,787,780	
	J P X 日経インデックス400 マザーファンド	21,903,750,347	35,405,222,060	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,971	
親投資信託受益証券合計		53,968,363,670	99,517,577,636	
合計			142,452,458,075	

(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。

J P X 日経インデックス400 マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	352,320,161
株式	47,551,154,450
派生商品評価勘定	596,016
未収入金	242,880
未収配当金	1,988,175
差入委託証拠金	12,536,100
流動資産合計	47,918,837,782
資産合計	47,918,837,782
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	120,680
前受金	483,146
未払解約金	67,280,055
未払利息	268
流動負債合計	67,884,149
負債合計	67,884,149
純資産の部	
元本等	
元本	29,602,777,090
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,248,176,543
元本等合計	47,850,953,633
純資産合計	47,850,953,633
負債純資産合計	47,918,837,782

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2020年12月21日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年12月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,602,777,090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 1.6164円 (1万口当たり純資産額) (16,164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

	2020年12月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年12月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2020年12月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	42,069,940,769円
期中追加設定元本額	4,621,306,970円
期中一部解約元本額	17,088,470,649円

区分	2020年12月21日現在
期末元本額	29,602,777,090円
期末元本額の内訳	
SMT JPX日経インデックス400・オープン	4,455,205,361円
SMTAM JPX日経インデックス400オープン	954,689,548円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	21,903,750,347円
JPX日経インデックス400・オープン(SMA専用)	1,138,955,330円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	532,319,226円
JPX日経400オープン(適格機関投資家専用)	617,857,278円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2020年12月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,360,797,614
合計	4,360,797,614

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「JPX日経インデックス400 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

(2020年12月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	244,616,854	-	245,100,000	483,146
	合計	244,616,854	-	245,100,000	483,146

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

	評価額
--	-----



銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
日本水産	33,700	427.00	14,389,900	
マルハニチロ	4,900	2,209.00	10,824,100	
国際石油開発帝石	124,000	575.00	71,300,000	
安藤・間	20,100	711.00	14,291,100	
東急建設	9,900	505.00	4,999,500	
コムシスホールディングス	12,000	3,090.00	37,080,000	
東建コーポレーション	1,000	7,940.00	7,940,000	
大成建設	26,000	3,505.00	91,130,000	
大林組	77,900	884.00	68,863,600	
清水建設	79,000	765.00	60,435,000	
長谷工コーポレーション	30,200	1,183.00	35,726,600	
鹿島建設	61,100	1,377.00	84,134,700	
西松建設	6,000	2,011.00	12,066,000	
三井住友建設	18,800	425.00	7,990,000	
前田建設工業	19,500	916.00	17,862,000	
戸田建設	32,300	658.00	21,253,400	
熊谷組	3,600	2,515.00	9,054,000	
大東建託	8,500	9,350.00	79,475,000	
N I P P O	6,400	2,721.00	17,414,400	
五洋建設	30,900	855.00	26,419,500	
住友林業	19,700	2,215.00	43,635,500	
大和ハウス工業	77,100	3,024.00	233,150,400	
積水ハウス	84,500	2,013.50	170,140,750	
協和エクシオ	11,800	2,853.00	33,665,400	
九電工	5,500	3,175.00	17,462,500	
森永製菓	5,900	3,855.00	22,744,500	
寿スピリッツ	2,400	5,010.00	12,024,000	
カルビー	11,400	3,020.00	34,428,000	
森永乳業	4,600	4,995.00	22,977,000	
ヤクルト本社	17,100	5,230.00	89,433,000	
明治ホールディングス	16,500	7,170.00	118,305,000	
日本ハム	9,500	4,595.00	43,652,500	
アサヒグループホールディングス	54,500	4,220.00	229,990,000	
キリンホールディングス	105,700	2,413.50	255,106,950	
サントリー食品インターナショナル	16,700	3,795.00	63,376,500	
伊藤園	7,600	6,440.00	48,944,000	
キッコーマン	17,900	6,510.00	116,529,000	
味の素	55,100	2,297.00	126,564,700	
キューピー	13,900	2,199.00	30,566,100	
カゴメ	10,200	3,715.00	37,893,000	
アリアケジャパン	2,300	7,080.00	16,284,000	

ニチレイ	11,900	2,758.00	32,820,200
東洋水産	12,800	4,955.00	63,424,000
日清食品ホールディングス	10,600	8,670.00	91,902,000
日本たばこ産業	133,700	2,190.00	292,803,000
帝人	19,800	1,933.00	38,273,400
東レ	176,100	618.80	108,970,680
ゴールドウイン	4,400	7,320.00	32,208,000
王子ホールディングス	101,700	598.00	60,816,600
クラレ	38,300	1,133.00	43,393,900
旭化成	161,200	1,050.50	169,340,600
昭和電工	18,500	2,245.00	41,532,500
住友化学	178,700	405.00	72,373,500
日産化学	13,400	6,210.00	83,214,000
東ソー	37,600	1,611.00	60,573,600
トクヤマ	7,000	2,320.00	16,240,000
デンカ	8,900	3,970.00	35,333,000
信越化学工業	41,800	17,195.00	718,751,000
エア・ウォーター	22,600	1,836.00	41,493,600
日本酸素ホールディングス	23,400	2,001.00	46,823,400
三菱瓦斯化学	22,600	2,336.00	52,793,600
三井化学	22,600	3,005.00	67,913,000
J S R	22,700	2,818.00	63,968,600
三菱ケミカルホールディングス	162,600	639.20	103,933,920
K Hネオケム	4,000	2,770.00	11,080,000
ダイセル	30,400	751.00	22,830,400
積水化学工業	51,400	1,947.00	100,075,800
アイカ工業	7,300	3,565.00	26,024,500
宇部興産	12,300	1,913.00	23,529,900
日油	9,200	5,170.00	47,564,000
花王	59,500	7,839.00	466,420,500
日本ペイントホールディングス	20,100	11,800.00	237,180,000
関西ペイント	27,300	3,090.00	84,357,000
D I C	10,300	2,649.00	27,284,700
資生堂	49,400	7,133.00	352,370,200
ライオン	32,300	2,522.00	81,460,600
ファンケル	10,100	4,130.00	41,713,000
コーセー	4,700	17,540.00	82,438,000
ポーラ・オルビスホールディングス	10,600	2,074.00	21,984,400
小林製薬	7,000	12,400.00	86,800,000
日東電工	17,100	8,770.00	149,967,000
ニフコ	9,100	3,845.00	34,989,500
ユニ・チャーム	52,700	4,971.00	261,971,700

協和キリン	25,000	2,686.00	67,150,000
武田薬品工業	174,500	3,862.00	673,919,000
アステラス製薬	215,400	1,553.00	334,516,200
大日本住友製薬	18,400	1,319.00	24,269,600
塩野義製薬	31,200	5,640.00	175,968,000
日本新薬	6,500	7,020.00	45,630,000
中外製薬	77,700	5,010.00	389,277,000
科研製薬	4,300	3,915.00	16,834,500
エーザイ	29,700	7,380.00	219,186,000
ロート製薬	12,700	3,110.00	39,497,000
小野薬品工業	57,000	3,186.00	181,602,000
久光製薬	6,600	6,170.00	40,722,000
参天製薬	46,300	1,664.00	77,043,200
沢井製薬	5,100	4,720.00	24,072,000
第一三共	202,300	3,311.00	669,815,300
大塚ホールディングス	51,600	4,500.00	232,200,000
出光興産	27,600	2,282.00	62,983,200
E N E O Sホールディングス	373,600	367.10	137,148,560
コスモエネルギーホールディングス	7,200	1,810.00	13,032,000
横浜ゴム	14,400	1,565.00	22,536,000
TOYO TIRE	13,100	1,568.00	20,540,800
ブリヂストン	66,000	3,467.00	228,822,000
住友ゴム工業	22,300	928.00	20,694,400
A G C	22,800	3,695.00	84,246,000
太平洋セメント	15,700	2,594.00	40,725,800
東海カーボン	24,300	1,255.00	30,496,500
T O T O	17,700	5,980.00	105,846,000
日本碍子	29,800	1,607.00	47,888,600
日本特殊陶業	18,900	1,813.00	34,265,700
ニチアス	6,800	2,359.00	16,041,200
日本製鉄	109,900	1,348.00	148,145,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	66,300	1,061.00	70,344,300
住友金属鉱山	31,400	4,628.00	145,319,200
古河電気工業	7,600	2,907.00	22,093,200
住友電気工業	91,800	1,356.50	124,526,700
アサヒホールディングス	4,300	3,560.00	15,308,000
S U M C O	31,400	2,104.00	66,065,600
三和ホールディングス	23,200	1,211.00	28,095,200
リンナイ	4,800	11,980.00	57,504,000
日本製鋼所	7,500	2,937.00	22,027,500
三浦工業	10,600	5,490.00	58,194,000
アマダ	30,500	1,090.00	33,245,000

F U J I	10,600	2,681.00	28,418,600	
オーエスジー	12,100	1,878.00	22,723,800	
D M G 森精機	15,500	1,635.00	25,342,500	
ディスコ	3,300	33,250.00	109,725,000	
ナブテスコ	14,500	4,450.00	64,525,000	
S M C	7,800	63,540.00	495,612,000	
小松製作所	112,500	2,773.50	312,018,750	
住友重機械工業	14,200	2,550.00	36,210,000	
日立建機	10,000	2,834.00	28,340,000	
クボタ	130,500	2,162.50	282,206,250	
ダイキン工業	31,600	22,095.00	698,202,000	
ダイフク	12,700	12,470.00	158,369,000	
竹内製作所	4,200	2,415.00	10,143,000	
ホシザキ	7,800	9,620.00	75,036,000	
日本精工	46,800	917.00	42,915,600	
T H K	15,500	3,305.00	51,227,500	
マキタ	32,400	5,100.00	165,240,000	
三菱重工業	41,600	2,959.00	123,094,400	
I H I	17,900	1,922.00	34,403,800	
ブラザー工業	30,300	2,066.00	62,599,800	
ミネベアミツミ	46,100	2,085.00	96,118,500	
日立製作所	119,300	4,181.00	498,793,300	
三菱電機	248,400	1,552.50	385,641,000	
富士電機	15,000	3,655.00	54,825,000	
安川電機	26,700	4,840.00	129,228,000	
東芝テック	3,100	3,725.00	11,547,500	
日本電産	59,800	12,725.00	760,955,000	
オムロン	22,300	8,960.00	199,808,000	
M C J	7,100	1,102.00	7,824,200	
日本電気	30,100	5,560.00	167,356,000	
富士通	23,900	14,240.00	340,336,000	
ルネサスエレクトロニクス	106,500	1,066.00	113,529,000	
セイコーエプソン	30,800	1,599.00	49,249,200	
アルバック	4,600	4,440.00	20,424,000	
エレコム	2,800	5,070.00	14,196,000	
パナソニック	283,800	1,186.50	336,728,700	
シャープ	28,700	1,477.00	42,389,900	
アンリツ	16,000	2,360.00	37,760,000	
ソニー	81,300	10,405.00	845,926,500	
T D K	12,000	14,590.00	175,080,000	
アルプスアルパイン	22,000	1,402.00	30,844,000	
横河電機	22,800	1,948.00	44,414,400	

アズビル	15,700	5,400.00	84,780,000
日本光電工業	10,300	3,525.00	36,307,500
堀場製作所	4,900	6,030.00	29,547,000
アドバンテスト	18,500	7,180.00	132,830,000
キーエンス	13,300	55,530.00	738,549,000
シスメックス	17,800	11,825.00	210,485,000
O B A R A G R O U P	1,400	3,920.00	5,488,000
レーザーテック	10,900	11,820.00	128,838,000
スタンレー電気	17,400	3,435.00	59,769,000
カシオ計算機	22,000	1,874.00	41,228,000
ファナック	23,400	25,435.00	595,179,000
浜松ホトニクス	17,800	6,030.00	107,334,000
京セラ	34,900	6,248.00	218,055,200
太陽誘電	11,000	4,640.00	51,040,000
村田製作所	73,000	8,927.00	651,671,000
小糸製作所	14,900	6,860.00	102,214,000
S C R E E Nホールディングス	4,300	7,190.00	30,917,000
キャノン	123,400	2,062.50	254,512,500
東京エレクトロン	15,800	36,440.00	575,752,000
トヨタ紡織	7,200	1,719.00	12,376,800
豊田自動織機	20,100	7,950.00	159,795,000
デンソー	54,700	5,896.00	322,511,200
いすゞ自動車	72,000	991.00	71,352,000
トヨタ自動車	94,200	7,850.00	739,470,000
日野自動車	31,000	1,060.00	32,860,000
アイシン精機	20,500	3,125.00	64,062,500
マツダ	73,100	701.00	51,243,100
本田技研工業	195,600	3,015.00	589,734,000
スズキ	49,200	5,061.00	249,001,200
S U B A R U	77,100	2,132.00	164,377,200
ヤマハ発動機	35,100	2,114.00	74,201,400
豊田合成	8,000	3,015.00	24,120,000
シマノ	9,300	24,270.00	225,711,000
テイ・エス テック	5,800	3,300.00	19,140,000
テルモ	70,300	4,151.00	291,815,300
島津製作所	29,700	3,810.00	113,157,000
ブイ・テクノロジー	1,200	5,640.00	6,768,000
東京精密	4,500	4,850.00	21,825,000
ニコン	37,900	672.00	25,468,800
オリンパス	137,400	2,246.00	308,600,400
H O Y A	49,300	13,960.00	688,228,000
朝日インテック	28,100	3,620.00	101,722,000

バンダイナムコホールディングス	25,700	9,196.00	236,337,200
パイロットコーポレーション	4,400	3,055.00	13,442,000
ヤマハ	14,800	5,750.00	85,100,000
ピジョン	15,900	4,410.00	70,119,000
任天堂	10,900	65,250.00	711,225,000
中部電力	76,000	1,229.50	93,442,000
関西電力	94,100	957.30	90,081,930
中国電力	35,800	1,233.00	44,141,400
東北電力	62,000	852.00	52,824,000
九州電力	51,200	884.00	45,260,800
北海道電力	23,200	374.00	8,676,800
電源開発	19,800	1,382.00	27,363,600
東京瓦斯	47,800	2,320.00	110,896,000
大阪瓦斯	48,200	2,021.00	97,412,200
東武鉄道	25,900	2,998.00	77,648,200
相鉄ホールディングス	10,600	2,522.00	26,733,200
東急	62,600	1,228.00	76,872,800
小田急電鉄	36,900	3,045.00	112,360,500
京王電鉄	12,900	7,460.00	96,234,000
京成電鉄	17,300	3,395.00	58,733,500
東日本旅客鉄道	43,700	6,636.00	289,993,200
西日本旅客鉄道	22,100	5,115.00	113,041,500
東海旅客鉄道	20,700	13,845.00	286,591,500
西武ホールディングス	32,400	1,018.00	32,983,200
近鉄グループホールディングス	23,500	4,380.00	102,930,000
阪急阪神ホールディングス	31,400	3,310.00	103,934,000
南海電気鉄道	14,900	2,543.00	37,890,700
京阪ホールディングス	14,000	4,815.00	67,410,000
名古屋鉄道	25,800	2,644.00	68,215,200
日本通運	8,100	6,870.00	55,647,000
ヤマトホールディングス	39,000	2,589.00	100,971,000
山九	6,500	3,915.00	25,447,500
日立物流	4,300	3,120.00	13,416,000
九州旅客鉄道	20,600	2,134.00	43,960,400
日本航空	52,800	1,910.00	100,848,000
A N Aホールディングス	58,700	2,202.50	129,286,750
システナ	8,700	2,156.00	18,757,200
日鉄ソリューションズ	3,700	2,993.00	11,074,100
T I S	24,400	2,044.00	49,873,600
コーエーテクモホールディングス	5,000	6,290.00	31,450,000
ネクソン	61,500	3,250.00	199,875,000
ティーガイア	2,200	1,846.00	4,061,200

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,900	2,677.00	15,794,300
GMOペイメントゲートウェイ	5,200	14,070.00	73,164,000
アカツキ	900	4,320.00	3,888,000
野村総合研究所	34,500	3,530.00	121,785,000
インフォコム	2,700	3,335.00	9,004,500
オービック	8,400	21,000.00	176,400,000
ジャストシステム	4,000	7,210.00	28,840,000
Zホールディングス	334,700	610.50	204,334,350
トレンドマイクロ	13,000	5,710.00	74,230,000
日本オラクル	4,900	11,710.00	57,379,000
伊藤忠テクノソリューションズ	11,100	3,750.00	41,625,000
大塚商会	13,200	5,170.00	68,244,000
東映アニメーション	1,000	7,390.00	7,390,000
デジタルガレージ	4,400	4,435.00	19,514,000
日本ユニシス	7,600	3,890.00	29,564,000
日本電信電話	303,900	2,666.50	810,349,350
KDDI	177,700	3,028.00	538,075,600
光通信	2,500	24,730.00	61,825,000
東宝	14,400	4,310.00	62,064,000
エヌ・ティ・ティ・データ	64,900	1,376.00	89,302,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,400	6,470.00	67,288,000
カプコン	11,500	6,670.00	76,705,000
SCSK	5,600	5,670.00	31,752,000
コナミホールディングス	8,900	5,750.00	51,175,000
ソフトバンクグループ	101,000	8,489.00	857,389,000
双日	135,100	234.00	31,613,400
アルフレッサホールディングス	27,200	2,023.00	55,025,600
神戸物産	16,900	3,175.00	53,657,500
ダイワボウホールディングス	2,100	8,670.00	18,207,000
TOKAIホールディングス	12,900	1,007.00	12,990,300
シップヘルスケアホールディングス	3,900	5,540.00	21,606,000
コメダホールディングス	5,300	1,837.00	9,736,100
第一興商	4,900	3,495.00	17,125,500
メディカルホールディングス	26,400	2,008.00	53,011,200
日本ライフライン	7,200	1,567.00	11,282,400
伊藤忠商事	171,100	2,909.00	497,729,900
丸紅	254,600	677.70	172,542,420
豊田通商	27,300	3,890.00	106,197,000
兼松	9,100	1,260.00	11,466,000
三井物産	211,800	1,904.50	403,373,100
住友商事	154,300	1,340.00	206,762,000
三菱商事	160,400	2,588.00	415,115,200

岩谷産業	6,300	6,250.00	39,375,000	
PALTA C	3,900	5,780.00	22,542,000	
日鉄物産	1,700	3,740.00	6,358,000	
ミスミグループ本社	30,700	3,400.00	104,380,000	
ローソン	6,200	4,760.00	29,512,000	
エービーシー・マート	3,800	5,370.00	20,406,000	
日本マクドナルドホールディングス	10,300	5,100.00	52,530,000	
セリア	5,800	3,730.00	21,634,000	
ビックカメラ	14,500	1,126.00	16,327,000	
MonotaRO	17,400	5,430.00	94,482,000	
J.フロント リテイリング	29,200	845.00	24,674,000	
マツモトキヨシホールディングス	10,100	4,425.00	44,692,500	
ZOZO	16,800	2,540.00	42,672,000	
ウエルシアホールディングス	14,500	3,805.00	55,172,500	
クリエイティブSDホールディングス	4,100	3,680.00	15,088,000	
すかいらーくホールディングス	27,400	1,633.00	44,744,200	
コスモス薬品	2,200	16,410.00	36,102,000	
セブン&アイ・ホールディングス	95,700	3,528.00	337,629,600	
ツルハホールディングス	5,300	14,990.00	79,447,000	
クスリのアオキホールディングス	2,200	9,000.00	19,800,000	
スシローグローバルホールディングス	13,400	3,650.00	48,910,000	
ノジマ	4,400	2,738.00	12,047,200	
良品計画	32,500	2,029.00	65,942,500	
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	53,800	2,397.00	128,958,600	
ゼンショーホールディングス	11,700	2,637.00	30,852,900	
ワークマン	2,500	8,620.00	21,550,000	
スギホールディングス	4,900	6,950.00	34,055,000	
丸井グループ	22,400	1,794.00	40,185,600	
イオン	94,100	3,095.00	291,239,500	
イズミ	5,000	3,740.00	18,700,000	
ヤオコー	2,800	7,020.00	19,656,000	
ケーズホールディングス	23,600	1,397.00	32,969,200	
アインホールディングス	3,000	6,580.00	19,740,000	
ニトリホールディングス	10,600	21,875.00	231,875,000	
ファーストリテイリング	3,300	83,930.00	276,969,000	
サンドラッグ	9,200	4,125.00	37,950,000	
めぶきフィナンシャルグループ	127,300	207.00	26,351,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	139,900	366.00	51,203,400	
新生銀行	18,000	1,249.00	22,482,000	
あおぞら銀行	14,600	1,924.00	28,090,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,570,000	457.90	718,903,000	
りそなホールディングス	266,300	364.20	96,986,460	



三井住友トラスト・ホールディングス	46,300	3,131.00	144,965,300
三井住友フィナンシャルグループ	169,400	3,181.00	538,861,400
千葉銀行	81,800	560.00	45,808,000
ふくおかフィナンシャルグループ	20,600	1,878.00	38,686,800
セブン銀行	81,800	219.00	17,914,200
みずほフィナンシャルグループ	332,900	1,315.50	437,929,950
F P G	7,600	500.00	3,800,000
S B Iホールディングス	28,100	2,965.00	83,316,500
大和証券グループ本社	196,600	473.30	93,050,780
野村ホールディングス	431,000	532.10	229,335,100
S O M P Oホールディングス	46,100	4,038.00	186,151,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	64,100	3,037.00	194,671,700
第一生命ホールディングス	138,600	1,579.00	218,849,400
東京海上ホールディングス	86,600	5,247.00	454,390,200
T & Dホールディングス	73,200	1,205.00	88,206,000
全国保証	6,900	4,625.00	31,912,500
芙蓉総合リース	2,600	6,830.00	17,758,000
東京センチュリー	4,900	7,890.00	38,661,000
イオンフィナンシャルサービス	15,000	1,268.00	19,020,000
アコム	49,200	458.00	22,533,600
オリエントコーポレーション	66,300	116.00	7,690,800
オリックス	152,000	1,584.50	240,844,000
三菱UFJリース	62,200	491.00	30,540,200
日本取引所グループ	70,300	2,460.50	172,973,150
いちご	31,200	311.00	9,703,200
ヒューリック	52,000	1,088.00	56,576,000
野村不動産ホールディングス	14,900	2,233.00	33,271,700
オープンハウス	7,700	3,780.00	29,106,000
東急不動産ホールディングス	66,600	525.00	34,965,000
飯田グループホールディングス	20,400	2,149.00	43,839,600
パーク24	13,100	1,815.00	23,776,500
三井不動産	119,100	2,171.50	258,625,650
三菱地所	171,600	1,649.00	282,968,400
東京建物	24,200	1,413.00	34,194,600
住友不動産	55,100	3,238.00	178,413,800
スターツコーポレーション	3,300	2,929.00	9,665,700
イオンモール	12,300	1,644.00	20,221,200
日本空港ビルデング	7,800	6,690.00	52,182,000
ミクシィ	6,000	2,552.00	15,312,000
日本M&Aセンター	18,200	6,750.00	122,850,000
UTグループ	3,700	3,300.00	12,210,000
エス・エム・エス	7,400	3,825.00	28,305,000

パーソルホールディングス	23,700	2,008.00	47,589,600	
総合警備保障	9,400	5,270.00	49,538,000	
カカクコム	17,500	2,851.00	49,892,500	
ディップ	3,200	2,801.00	8,963,200	
ベネフィット・ワン	8,600	3,095.00	26,617,000	
エムスリー	52,300	9,361.00	489,580,300	
アウトソーシング	13,600	1,427.00	19,407,200	
博報堂D Yホールディングス	33,000	1,409.00	46,497,000	
電通グループ	26,700	3,235.00	86,374,500	
オリエンタルランド	25,200	16,645.00	419,454,000	
ユー・エス・エス	26,600	2,080.00	55,328,000	
楽天	110,600	1,035.00	114,471,000	
エン・ジャパン	4,200	3,300.00	13,860,000	
テクノプロ・ホールディングス	4,700	8,470.00	39,809,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	15,570.00	15,570,000	
リクルートホールディングス	157,000	4,156.00	652,492,000	
ペイカレント・コンサルティング	1,400	16,460.00	23,044,000	
リログループ	13,000	2,612.00	33,956,000	
エイチ・アイ・エス	3,400	1,634.00	5,555,600	
カナモト	4,200	2,257.00	9,479,400	
セコム	25,200	9,394.00	236,728,800	
メイテック	2,900	5,160.00	14,964,000	
合 計	18,004,400		47,551,154,450	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 中小型株式 マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年12月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2020年12月21日現在
項目	金額（円）
<b>流動資産</b>	
コール・ローン	1,542,043,667
株式	33,744,997,000
未収入金	727,622,290
未収配当金	24,256,250
流動資産合計	36,038,919,207
<b>資産合計</b>	36,038,919,207
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
未払金	244,165,376
未払解約金	121,498,825
未払利息	1,176
流動負債合計	365,665,377
<b>負債合計</b>	365,665,377
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	7,134,569,073
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	28,538,684,757
元本等合計	35,673,253,830
<b>純資産合計</b>	35,673,253,830
<b>負債純資産合計</b>	36,038,919,207

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年12月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年12月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,134,569,073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 5.0001円 (1万口当たり純資産額) (50,001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

	2020年12月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年12月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	9,838,394,791円
期中追加設定元本額	330,113,290円
期中一部解約元本額	3,033,939,008円
期末元本額	7,134,569,073円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	3,938,519,199円
中小型株式オープン（SMA専用）	265,774,493円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,850,454,556円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	79,820,825円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年12月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,040,155,812
合計	4,040,155,812

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「中小型株式 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）

該当事項はありません。
-------------

## 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)	
寿スピリッツ	97,400	5,010.00	487,974,000	
KHネオケム	105,000	2,770.00	290,850,000	
トリケミカル研究所	45,000	15,130.00	680,850,000	
レック	206,000	1,309.00	269,654,000	
ニフコ	150,000	3,845.00	576,750,000	
ペプチドリーム	120,000	5,360.00	643,200,000	
ステムリム	270,000	652.00	176,040,000	
MARUWA	95,000	11,950.00	1,135,250,000	
三益半導体工業	220,000	2,678.00	589,160,000	
NITTOKU	75,000	4,080.00	306,000,000	
ヒラノテクシード	62,000	2,243.00	139,066,000	
技研製作所	90,000	4,245.00	382,050,000	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	80,000	8,720.00	697,600,000	
スター精密	220,000	1,627.00	357,940,000	
イビデン	210,000	4,855.00	1,019,550,000	
富士電機	310,000	3,655.00	1,133,050,000	
I-PEX	195,000	1,999.00	389,805,000	
ワコム	230,000	891.00	204,930,000	
アンリツ	320,000	2,360.00	755,200,000	
レーザーテック	75,000	11,820.00	886,500,000	
スタンレー電気	150,000	3,435.00	515,250,000	
日本セラミック	160,000	2,974.00	475,840,000	
インターアクション	200,000	1,895.00	379,000,000	
メニコン	62,000	6,320.00	391,840,000	
SHOEI	175,000	3,700.00	647,500,000	
レノバ	130,000	3,155.00	410,150,000	
トランコム	50,000	8,420.00	421,000,000	
システナ	140,000	2,156.00	301,840,000	
FFRIセキュリティ	63,000	2,456.00	154,728,000	
SHIFT	30,000	13,970.00	419,100,000	
GMOペイメントゲートウェイ	40,000	14,070.00	562,800,000	
インターネットイニシアティブ	165,000	4,170.00	688,050,000	
カナミックネットワーク	260,000	745.00	193,700,000	
ユーザベース	100,000	3,355.00	335,500,000	
ニューラルポケット	50,000	4,800.00	240,000,000	

インフォコム	54,000	3,335.00	180,090,000	
チームスピリット	150,000	1,792.00	268,800,000	
B A S E	40,000	9,900.00	396,000,000	
ビザスク	75,000	4,150.00	311,250,000	
サイバーセキュリティクラウド	50,000	3,570.00	178,500,000	
ウェザーニューズ	60,000	5,730.00	343,800,000	
光通信	30,000	24,730.00	741,900,000	
ゼンリン	145,000	1,276.00	185,020,000	
東宝	150,000	4,310.00	646,500,000	
アズワン	17,000	15,970.00	271,490,000	
阪和興業	240,000	2,783.00	667,920,000	
P A L T A C	130,000	5,780.00	751,400,000	
バリュエンスホールディングス	48,000	4,035.00	193,680,000	
サンエー	82,000	4,125.00	338,250,000	
シュッピン	440,000	863.00	379,720,000	
オイシックス・ラ・大地	130,000	3,205.00	416,650,000	
クスリのアオキホールディングス	25,000	9,000.00	225,000,000	
ほぼ日	18,000	3,980.00	71,640,000	
良品計画	165,000	2,029.00	334,785,000	
ワークマン	25,000	8,620.00	215,500,000	
アニコム ホールディングス	660,000	1,071.00	706,860,000	
アルヒ	180,000	1,739.00	313,020,000	
イー・ギャランティ	135,000	2,154.00	290,790,000	
スター・マイカ・ホールディングス	230,000	1,337.00	307,510,000	
S R Eホールディングス	75,000	3,555.00	266,625,000	
日本M&Aセンター	80,000	6,750.00	540,000,000	
エムスリー	65,000	9,361.00	608,465,000	
エスプール	750,000	730.00	547,500,000	
手間いらず	95,000	5,340.00	507,300,000	
サイバーエージェント	120,000	7,020.00	842,400,000	
ジャパンマテリアル	340,000	1,408.00	478,720,000	
エラン	35,000	2,956.00	103,460,000	
ベルシステム24ホールディングス	240,000	1,653.00	396,720,000	
L I T A L I C O	136,000	3,590.00	488,240,000	
インソース	85,000	3,485.00	296,225,000	
グレイステクノロジー	70,000	7,120.00	498,400,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	220,000	4,775.00	1,050,500,000	
ダイセキ	370,000	3,045.00	1,126,650,000	
合 計	10,910,400		33,744,997,000	

## (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

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年12月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,255,978,173
株式	369,080,413,220
派生商品評価勘定	18,977,900
未収入金	182,156,522
未収配当金	89,719,731
差入委託証拠金	97,990,000
流動資産合計	371,725,235,546
資産合計	371,725,235,546
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	453,300
前受金	18,529,000
未払解約金	282,900,770
未払利息	1,720
流動負債合計	301,884,790
負債合計	301,884,790
純資産の部	
元本等	
元本	217,632,289,463
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	153,791,061,293
元本等合計	371,423,350,756
純資産合計	371,423,350,756
負債純資産合計	371,725,235,546

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式



	2020年12月21日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年12月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	217,632,289,463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 1.7067円 (1万口当たり純資産額) (17,067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

	2020年12月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年12月21日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年12月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	201,967,964,538円
期中追加設定元本額	64,096,798,849円
期中一部解約元本額	48,432,473,924円
期末元本額	217,632,289,463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）	477,145,407円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,997,323,069円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,087,425円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,862,831,096円
世界経済インデックスファンド	2,408,621,636円
日本株式インデックス・オープン	3,809,453,125円
DCマイセレクション25	6,775,431,261円
DCマイセレクション50	18,685,946,481円
DCマイセレクション75	17,886,974,787円
DC日本株式インデックス・オープン	5,809,812,541円
DCマイセレクションS25	2,959,715,181円
DCマイセレクションS50	8,099,203,587円
DCマイセレクションS75	5,421,958,423円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,156,421,447円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	312,870,047円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	709,124,721円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	488,200,733円
DC世界経済インデックスファンド	3,053,644,907円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,603,474,819円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,848,367円

区分	2020年12月21日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	29,211,886円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	30,422,250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)	244,229,406円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,505,321円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	61,791,192円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	214,122,125円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	42,213,017円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	149,331,860円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,354,451,494円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	585,528,612円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,539,741,457円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	526,783,769円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	31,253,250円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	656,816,872円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	364,408,242円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	462,642,570円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	47,073,561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)	728,738,443円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,230,850,883円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,904,424,388円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,250,753,090円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,251,597,133円
分散投資コア戦略ファンドA	2,249,878,534円
分散投資コア戦略ファンドS	7,711,269,663円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	354,481,150円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	365,331,524円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,330,044,710円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	203,900,391円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,481,942円
SMT インデックスバランス・オープン	63,053,270円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,214,148,814円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	731,236,988円
SMT 世界経済インデックス・オープン	28,907,942円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	89,994,691円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	16,089,005円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,737,459円
グローバル経済コア	242,553,594円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	20,951,608円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	42,655,456円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,917,852円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,146,961,068円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	117,678,642円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	489,659円

区分	2020年12月21日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	483,321円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	240,238円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	342,674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）	46,271,788,170円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,531,008,438円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	86,782,427円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,406,958円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	510,493,394円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年12月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	44,141,056,270	
合計	44,141,056,270	

(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

（2020年12月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,211,471,000	-	2,230,000,000	18,529,000
	合計	2,211,471,000	-	2,230,000,000	18,529,000

## (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

	評価額

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	7,100	2,947.00	20,923,700	
日本水産	202,200	427.00	86,339,400	
マルハニチロ	29,200	2,209.00	64,502,800	
雪国まいたけ	12,400	1,605.00	19,902,000	
カネコ種苗	6,100	1,596.00	9,735,600	
サカタのタネ	24,100	3,535.00	85,193,500	
ホクト	15,400	2,130.00	32,802,000	
ホクリヨウ	3,100	714.00	2,213,400	
住石ホールディングス	40,800	112.00	4,569,600	
日鉄鉱業	4,600	5,920.00	27,232,000	
三井松島ホールディングス	7,900	713.00	5,632,700	
国際石油開発帝石	743,700	575.00	427,627,500	
石油資源開発	26,400	1,929.00	50,925,600	
K&Oエナジーグループ	9,800	1,490.00	14,602,000	
ヒノキヤグループ	5,000	2,224.00	11,120,000	
ショーボンドホールディングス	31,500	5,030.00	158,445,000	
ミライト・ホールディングス	60,100	1,687.00	101,388,700	
タマホーム	10,900	1,450.00	15,805,000	
サンヨーホームズ	1,800	738.00	1,328,400	
日本アクア	8,000	647.00	5,176,000	
ファーストコーポレーション	6,200	710.00	4,402,000	
ベステラ	3,500	1,529.00	5,351,500	
TATERU	37,900	164.00	6,215,600	
キャンディル	3,500	504.00	1,764,000	
スペースバリューホールディングス	24,700	650.00	16,055,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	696.00	2,714,400	
第一カッター興業	2,500	2,722.00	6,805,000	
安藤・間	120,400	711.00	85,604,400	
東急建設	59,200	505.00	29,896,000	
コムシスホールディングス	71,700	3,090.00	221,553,000	
ピーアールホールディングス	22,000	683.00	15,026,000	
高松コンストラクショングループ	12,600	2,048.00	25,804,800	
東建コーポレーション	6,200	7,940.00	49,228,000	
ソネック	2,100	874.00	1,835,400	
ヤマウラ	8,800	949.00	8,351,200	
大成建設	155,700	3,505.00	545,728,500	
大林組	467,000	884.00	412,828,000	
清水建設	473,900	765.00	362,533,500	
飛鳥建設	13,400	1,093.00	14,646,200	
長谷工コーポレーション	180,800	1,183.00	213,886,400	
松井建設	18,400	768.00	14,131,200	

銭高組	2,000	4,540.00	9,080,000
鹿島建設	366,600	1,377.00	504,808,200
不動テトラ	12,200	1,724.00	21,032,800
大末建設	5,400	861.00	4,649,400
鉄建建設	10,100	1,827.00	18,452,700
西松建設	36,000	2,011.00	72,396,000
三井住友建設	112,800	425.00	47,940,000
大豊建設	11,100	3,570.00	39,627,000
前田建設工業	117,000	916.00	107,172,000
佐田建設	10,000	457.00	4,570,000
ナカノフドー建設	12,800	418.00	5,350,400
奥村組	22,000	2,507.00	55,154,000
東鉄工業	20,000	2,753.00	55,060,000
イチケン	3,400	1,848.00	6,283,200
富士ピー・エス	6,900	624.00	4,305,600
浅沼組	5,200	3,935.00	20,462,000
戸田建設	193,900	658.00	127,586,200
熊谷組	21,600	2,515.00	54,324,000
北野建設	2,800	2,520.00	7,056,000
植木組	2,100	2,824.00	5,930,400
矢作建設工業	20,600	874.00	18,004,400
ピーエス三菱	15,400	601.00	9,255,400
日本ハウスホールディングス	31,900	294.00	9,378,600
大東建託	51,000	9,350.00	476,850,000
新日本建設	19,900	825.00	16,417,500
N I P P O	38,600	2,721.00	105,030,600
東亜道路工業	2,900	3,785.00	10,976,500
前田道路	41,200	1,723.00	70,987,600
日本道路	4,500	7,610.00	34,245,000
東亜建設工業	14,600	1,932.00	28,207,200
日本国土開発	45,400	560.00	25,424,000
若築建設	8,400	1,179.00	9,903,600
東洋建設	52,400	420.00	22,008,000
五洋建設	185,100	855.00	158,260,500
世紀東急工業	22,400	833.00	18,659,200
福田組	5,400	5,460.00	29,484,000
住友林業	118,300	2,215.00	262,034,500
日本基礎技術	15,700	499.00	7,834,300
巴コーポレーション	20,700	410.00	8,487,000
大和ハウス工業	462,000	3,024.00	1,397,088,000
ライト工業	26,700	1,793.00	47,873,100
積水ハウス	506,500	2,013.50	1,019,837,750

日特建設	12,200	806.00	9,833,200
北陸電気工事	8,100	1,284.00	10,400,400
ユアテック	26,700	721.00	19,250,700
日本リーテック	9,800	2,306.00	22,598,800
四電工	2,500	2,851.00	7,127,500
中電工	18,800	2,158.00	40,570,400
関電工	66,400	806.00	53,518,400
きんでん	110,900	1,659.00	183,983,100
東京エネシス	15,500	862.00	13,361,000
トーエネック	4,700	3,955.00	18,588,500
住友電設	13,200	2,487.00	32,828,400
日本電設工業	25,600	2,084.00	53,350,400
協和エクシオ	70,800	2,853.00	201,992,400
新日本空調	12,300	2,260.00	27,798,000
九電工	32,800	3,175.00	104,140,000
三機工業	33,100	1,190.00	39,389,000
日揮ホールディングス	143,800	956.00	137,472,800
中外炉工業	5,000	1,605.00	8,025,000
ヤマト	14,900	712.00	10,608,800
太平電業	11,300	2,391.00	27,018,300
高砂熱学工業	35,700	1,520.00	54,264,000
三晃金属工業	2,000	2,789.00	5,578,000
朝日工業社	3,100	3,125.00	9,687,500
明星工業	30,200	786.00	23,737,200
大気社	22,700	2,737.00	62,129,900
ダイダン	11,200	2,846.00	31,875,200
日比谷総合設備	15,000	1,885.00	28,275,000
フィル・カンパニー	2,700	2,037.00	5,499,900
OSJBホールディングス	73,600	271.00	19,945,600
東洋エンジニアリング	19,600	404.00	7,918,400
レイズネクスト	25,000	1,183.00	29,575,000
日本製粉	43,700	1,635.00	71,449,500
日清製粉グループ本社	168,900	1,646.00	278,009,400
日東富士製粉	1,100	6,600.00	7,260,000
昭和産業	13,700	3,085.00	42,264,500
鳥越製粉	13,200	1,009.00	13,318,800
中部飼料	18,300	1,405.00	25,711,500
フィード・ワン	20,100	887.00	17,828,700
東洋精糖	2,500	1,221.00	3,052,500
日本甜菜製糖	7,800	1,616.00	12,604,800
三井製糖	13,100	1,823.00	23,881,300
塩水港精糖	16,200	222.00	3,596,400



日新製糖	7,100	1,863.00	13,227,300
森永製菓	35,100	3,855.00	135,310,500
中村屋	3,900	3,995.00	15,580,500
江崎グリコ	41,200	4,565.00	188,078,000
名糖産業	7,200	1,520.00	10,944,000
井村屋グループ	8,500	2,617.00	22,244,500
不二家	9,500	2,435.00	23,132,500
山崎製パン	112,000	1,751.00	196,112,000
第一屋製パン	2,900	1,003.00	2,908,700
モロゾフ	2,500	5,980.00	14,950,000
亀田製菓	8,500	4,885.00	41,522,500
寿スピリッツ	14,400	5,010.00	72,144,000
カルビー	68,100	3,020.00	205,662,000
森永乳業	27,600	4,995.00	137,862,000
六甲バター	9,900	1,898.00	18,790,200
ヤクルト本社	102,800	5,230.00	537,644,000
明治ホールディングス	98,800	7,170.00	708,396,000
雪印メグミルク	36,000	2,189.00	78,804,000
プリマハム	23,400	3,190.00	74,646,000
日本ハム	57,100	4,595.00	262,374,500
林兼産業	4,900	594.00	2,910,600
丸大食品	15,900	1,721.00	27,363,900
S Foods	11,900	3,350.00	39,865,000
柿安本店	5,200	2,566.00	13,343,200
伊藤ハム米久ホールディングス	96,200	687.00	66,089,400
サッポロホールディングス	51,000	2,068.00	105,468,000
アサヒグループホールディングス	326,500	4,220.00	1,377,830,000
キリンホールディングス	633,900	2,413.50	1,529,917,650
宝ホールディングス	110,800	1,254.00	138,943,200
オエノンホールディングス	42,500	398.00	16,915,000
養命酒製造	4,600	1,883.00	8,661,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	114,400	1,617.00	184,984,800
サントリー食品インターナショナル	100,000	3,795.00	379,500,000
ダイトーグループホールディングス	7,700	5,600.00	43,120,000
伊藤園	45,400	6,440.00	292,376,000
キーコーヒー	14,700	2,151.00	31,619,700
ユニカフェ	4,500	1,214.00	5,463,000
ジャパンフーズ	2,100	1,230.00	2,583,000
日清オイリオグループ	19,200	3,045.00	58,464,000
不二製油グループ本社	36,400	2,915.00	106,106,000
かどや製油	1,600	3,965.00	6,344,000
J - オイルミルズ	7,700	3,495.00	26,911,500

キッコーマン	107,600	6,510.00	700,476,000
味の素	330,100	2,297.00	758,239,700
キューピー	83,200	2,199.00	182,956,800
ハウス食品グループ本社	55,900	3,800.00	212,420,000
カゴメ	61,100	3,715.00	226,986,500
焼津水産化学工業	7,200	1,026.00	7,387,200
アリアケジャパン	13,700	7,080.00	96,996,000
ピエトロ	2,000	1,718.00	3,436,000
エバラ食品工業	3,600	2,440.00	8,784,000
やまみ	1,300	2,117.00	2,752,100
ニチレイ	71,200	2,758.00	196,369,600
東洋水産	76,900	4,955.00	381,039,500
イトアンドホールディングス	5,200	1,844.00	9,588,800
大冷	1,900	1,997.00	3,794,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,300	791.00	6,565,300
日清食品ホールディングス	63,500	8,670.00	550,545,000
永谷園ホールディングス	7,300	2,274.00	16,600,200
一正蒲鉾	5,800	1,217.00	7,058,600
フジッコ	16,200	2,027.00	32,837,400
ロック・フィールド	16,100	1,638.00	26,371,800
日本たばこ産業	801,400	2,190.00	1,755,066,000
ケンコーマヨネーズ	8,400	1,931.00	16,220,400
わらべや日洋ホールディングス	9,800	1,452.00	14,229,600
なとり	8,300	1,909.00	15,844,700
イフジ産業	2,600	841.00	2,186,600
ピククルスコーポレーション	3,300	3,120.00	10,296,000
北の達人コーポレーション	52,200	490.00	25,578,000
ユーグレナ	64,600	835.00	53,941,000
ミヨシ油脂	5,200	1,288.00	6,697,600
理研ビタミン	14,100	1,391.00	19,613,100
片倉工業	19,900	1,384.00	27,541,600
ゲンゼ	10,800	3,475.00	37,530,000
東洋紡	58,000	1,378.00	79,924,000
ユニチカ	43,900	395.00	17,340,500
富士紡ホールディングス	7,200	3,785.00	27,252,000
倉敷紡績	14,700	1,883.00	27,680,100
シキボウ	7,600	1,048.00	7,964,800
日本毛織	48,400	1,006.00	48,690,400
トーア紡コーポレーション	5,800	475.00	2,755,000
帝国繊維	16,600	2,538.00	42,130,800
帝人	119,200	1,933.00	230,413,600
東レ	1,056,800	618.80	653,947,840

サカイオーベックス	4,100	2,173.00	8,909,300
住江織物	3,200	2,248.00	7,193,600
日本フェルト	9,200	456.00	4,195,200
イチカワ	2,400	1,296.00	3,110,400
日東製網	1,700	1,465.00	2,490,500
アツギ	12,400	539.00	6,683,600
ダイニック	5,500	876.00	4,818,000
セーレン	36,100	1,620.00	58,482,000
ソトー	6,000	902.00	5,412,000
東海染工	2,200	1,136.00	2,499,200
小松マテーレ	24,100	965.00	23,256,500
ワコールホールディングス	36,500	2,080.00	75,920,000
ホギメディカル	16,700	3,390.00	56,613,000
T S Iホールディングス	45,200	213.00	9,627,600
マツオカコーポレーション	4,300	2,268.00	9,752,400
ワールド	20,800	1,307.00	27,185,600
三陽商会	7,600	549.00	4,172,400
ナイガイ	5,900	347.00	2,047,300
オンワードホールディングス	88,600	210.00	18,606,000
ルックホールディングス	5,200	1,017.00	5,288,400
ゴールドウイン	26,400	7,320.00	193,248,000
デサント	28,600	1,922.00	54,969,200
キング	7,200	573.00	4,125,600
ヤマトインターナショナル	13,400	349.00	4,676,600
特種東海製紙	9,000	5,100.00	45,900,000
王子ホールディングス	609,700	598.00	364,600,600
日本製紙	64,500	1,207.00	77,851,500
三菱製紙	16,500	326.00	5,379,000
北越コーポレーション	86,900	399.00	34,673,100
中越パルプ工業	6,200	1,295.00	8,029,000
巴川製紙所	4,300	800.00	3,440,000
大王製紙	70,300	1,970.00	138,491,000
阿波製紙	3,800	469.00	1,782,200
レンゴー	137,900	857.00	118,180,300
トーモク	8,900	1,716.00	15,272,400
ザ・パック	11,000	2,821.00	31,031,000
クラレ	229,700	1,133.00	260,250,100
旭化成	966,700	1,050.50	1,015,518,350
共和レザー	7,900	665.00	5,253,500
昭和電工	110,700	2,245.00	248,521,500
住友化学	1,071,500	405.00	433,957,500
住友精化	6,500	4,025.00	26,162,500

日産化学	80,400	6,210.00	499,284,000
ラサ工業	5,100	2,268.00	11,566,800
クレハ	12,500	6,800.00	85,000,000
多木化学	5,700	6,480.00	36,936,000
テイカ	10,700	1,569.00	16,788,300
石原産業	26,100	642.00	16,756,200
片倉コープアグリ	3,800	1,216.00	4,620,800
日本曹達	21,600	3,045.00	65,772,000
東ソー	225,400	1,611.00	363,119,400
トクヤマ	42,000	2,320.00	97,440,000
セントラル硝子	29,800	2,268.00	67,586,400
東亜合成	91,500	1,262.00	115,473,000
大阪ソーダ	14,800	2,699.00	39,945,200
関東電化工業	34,600	790.00	27,334,000
デンカ	53,200	3,970.00	211,204,000
信越化学工業	250,400	17,195.00	4,305,628,000
日本カーバイド工業	5,100	1,310.00	6,681,000
堺化学工業	9,400	1,987.00	18,677,800
第一稀元素化学工業	15,800	844.00	13,335,200
エア・ウォーター	135,700	1,836.00	249,145,200
日本酸素ホールディングス	140,200	2,001.00	280,540,200
日本化学工業	4,500	2,666.00	11,997,000
東邦アセチレン	2,200	1,518.00	3,339,600
日本パーカライズン	73,600	1,095.00	80,592,000
高压ガス工業	23,100	810.00	18,711,000
チタン工業	1,800	2,068.00	3,722,400
四国化成工業	21,300	1,236.00	26,326,800
戸田工業	3,400	2,247.00	7,639,800
ステラ ケミファ	7,900	3,310.00	26,149,000
保土谷化学工業	5,400	4,540.00	24,516,000
日本触媒	22,600	5,710.00	129,046,000
大日精化工業	12,900	2,370.00	30,573,000
カネカ	37,700	3,675.00	138,547,500
三菱瓦斯化学	135,700	2,336.00	316,995,200
三井化学	135,300	3,005.00	406,576,500
J S R	135,900	2,818.00	382,966,200
東京応化工業	25,000	7,130.00	178,250,000
大阪有機化学工業	13,500	3,075.00	41,512,500
三菱ケミカルホールディングス	975,000	639.20	623,220,000
K Hネオケム	24,000	2,770.00	66,480,000
ダイセル	182,100	751.00	136,757,100
住友ベークライト	22,900	3,515.00	80,493,500

積水化学工業	308,400	1,947.00	600,454,800
日本ゼオン	131,500	1,449.00	190,543,500
アイカ工業	43,800	3,565.00	156,147,000
宇部興産	73,700	1,913.00	140,988,100
積水樹脂	26,300	2,182.00	57,386,600
タキロンシーアイ	31,600	701.00	22,151,600
旭有機材	8,200	1,556.00	12,759,200
ニチバン	7,700	1,652.00	12,720,400
リケンテクノス	35,600	469.00	16,696,400
大倉工業	6,900	1,951.00	13,461,900
積水化成成品工業	19,600	543.00	10,642,800
群栄化学工業	3,300	2,427.00	8,009,100
タイガースポリマー	7,700	397.00	3,056,900
ミライアル	5,100	1,136.00	5,793,600
ダイキアクシス	5,200	1,142.00	5,938,400
ダイキョーニシカワ	30,700	841.00	25,818,700
竹本容器	5,200	994.00	5,168,800
森六ホールディングス	7,800	2,248.00	17,534,400
日本化薬	90,300	981.00	88,584,300
カーリットホールディングス	15,600	663.00	10,342,800
日本精化	11,700	1,453.00	17,000,100
扶桑化学工業	14,800	3,730.00	55,204,000
トリケミカル研究所	3,300	15,130.00	49,929,000
A D E K A	67,100	1,799.00	120,712,900
日油	54,900	5,170.00	283,833,000
新日本理化	24,100	245.00	5,904,500
ハリマ化成グループ	12,100	1,050.00	12,705,000
花王	356,600	7,839.00	2,795,387,400
第一工業製薬	5,400	4,400.00	23,760,000
石原ケミカル	4,000	2,258.00	9,032,000
日華化学	4,900	939.00	4,601,100
ニイタカ	3,000	3,090.00	9,270,000
三洋化成工業	8,700	5,140.00	44,718,000
有機合成薬品工業	11,200	313.00	3,505,600
大日本塗料	16,500	963.00	15,889,500
日本ペイントホールディングス	120,400	11,800.00	1,420,720,000
関西ペイント	163,900	3,090.00	506,451,000
神東塗料	11,500	221.00	2,541,500
中国塗料	41,500	1,029.00	42,703,500
日本特殊塗料	10,900	1,291.00	14,071,900
藤倉化成	19,700	553.00	10,894,100
太陽ホールディングス	10,700	6,150.00	65,805,000

D I C	61,600	2,649.00	163,178,400
サカタインクス	31,800	1,185.00	37,683,000
東洋インキＳＣホールディングス	30,800	2,005.00	61,754,000
T & K T O K A	11,300	909.00	10,271,700
富士フイルムホールディングス	285,500	5,542.00	1,582,241,000
資生堂	295,900	7,133.00	2,110,654,700
ライオン	193,600	2,522.00	488,259,200
高砂香料工業	9,300	2,504.00	23,287,200
マンダム	33,500	1,671.00	55,978,500
ミルボン	19,900	6,500.00	129,350,000
ファンケル	60,300	4,130.00	249,039,000
コーセー	28,000	17,540.00	491,120,000
コタ	8,600	1,393.00	11,979,800
シーボン	1,900	1,969.00	3,741,100
ポーラ・オルビスホールディングス	63,600	2,074.00	131,906,400
ノエビアホールディングス	12,600	4,435.00	55,881,000
アジュバンコスメジャパン	3,300	1,014.00	3,346,200
エステー	9,600	1,977.00	18,979,200
アグロ カネショウ	5,600	1,681.00	9,413,600
コニシ	24,500	1,628.00	39,886,000
長谷川香料	25,700	2,106.00	54,124,200
星光P M C	8,500	732.00	6,222,000
小林製薬	41,700	12,400.00	517,080,000
荒川化学工業	13,400	1,167.00	15,637,800
メック	10,200	2,236.00	22,807,200
日本高純度化学	4,100	2,660.00	10,906,000
タカラバイオ	39,000	2,847.00	111,033,000
J C U	18,000	3,820.00	68,760,000
新田ゼラチン	9,300	684.00	6,361,200
O A T アグリオ	2,800	1,433.00	4,012,400
デクセリアルズ	38,500	1,330.00	51,205,000
アース製薬	11,200	6,000.00	67,200,000
北興化学工業	13,900	1,080.00	15,012,000
大成ラミック	4,900	3,065.00	15,018,500
クミアイ化学工業	61,600	938.00	57,780,800
日本農薬	26,500	518.00	13,727,000
アキレス	10,300	1,452.00	14,955,600
有沢製作所	23,600	974.00	22,986,400
日東電工	102,800	8,770.00	901,556,000
レック	15,900	1,309.00	20,813,100
三光合成	17,000	344.00	5,848,000
きもと	25,300	179.00	4,528,700

藤森工業	13,400	4,740.00	63,516,000
前澤化成工業	9,500	979.00	9,300,500
未来工業	8,000	1,695.00	13,560,000
ウェーブロックホールディングス	5,100	765.00	3,901,500
J S P	8,700	1,741.00	15,146,700
エフピコ	31,300	4,265.00	133,494,500
天馬	9,900	2,056.00	20,354,400
信越ポリマー	26,700	946.00	25,258,200
東リ	37,100	247.00	9,163,700
ニフコ	54,700	3,845.00	210,321,500
バルカー	12,100	2,031.00	24,575,100
ユニ・チャーム	315,700	4,971.00	1,569,344,700
ショーエイコーポレーション	2,500	1,001.00	2,502,500
協和キリン	149,800	2,686.00	402,362,800
武田薬品工業	1,239,000	3,862.00	4,785,018,000
アステラス製薬	1,291,200	1,553.00	2,005,233,600
大日本住友製薬	110,400	1,319.00	145,617,600
塩野義製薬	187,300	5,640.00	1,056,372,000
わかもと製薬	17,700	263.00	4,655,100
あすか製薬	17,000	1,743.00	29,631,000
日本新薬	39,000	7,020.00	273,780,000
バイオフェルミン製薬	2,500	2,478.00	6,195,000
中外製薬	465,800	5,010.00	2,333,658,000
科研製薬	25,500	3,915.00	99,832,500
エーザイ	178,300	7,380.00	1,315,854,000
ロート製薬	76,400	3,110.00	237,604,000
小野薬品工業	342,000	3,186.00	1,089,612,000
久光製薬	39,400	6,170.00	243,098,000
持田製薬	20,700	3,910.00	80,937,000
参天製薬	277,500	1,664.00	461,760,000
扶桑薬品工業	5,200	2,845.00	14,794,000
日本ケミファ	2,000	2,331.00	4,662,000
ツムラ	46,100	3,195.00	147,289,500
日医工	42,200	996.00	42,031,200
キッセイ薬品工業	26,400	2,214.00	58,449,600
生化学工業	28,900	1,033.00	29,853,700
栄研化学	26,200	2,070.00	54,234,000
日水製薬	6,300	980.00	6,174,000
鳥居薬品	9,300	3,250.00	30,225,000
J C R ファーマ	42,000	2,428.00	101,976,000
東和薬品	19,100	1,884.00	35,984,400
富士製薬工業	10,100	1,238.00	12,503,800

沢井製薬	30,600	4,720.00	144,432,000
ゼリア新薬工業	27,000	1,911.00	51,597,000
第一三共	1,278,500	3,311.00	4,233,113,500
キョーリン製薬ホールディングス	32,900	1,903.00	62,608,700
大幸薬品	18,300	1,648.00	30,158,400
ダイト	9,500	3,700.00	35,150,000
大塚ホールディングス	309,500	4,500.00	1,392,750,000
大正製薬ホールディングス	31,500	6,820.00	214,830,000
ペプチドリーム	75,700	5,360.00	405,752,000
日本コークス工業	125,800	72.00	9,057,600
ニチレキ	17,600	1,650.00	29,040,000
ユシロ化学工業	8,400	1,171.00	9,836,400
ビーピー・カストロール	5,300	1,295.00	6,863,500
富士石油	39,800	179.00	7,124,200
MORESCO	5,400	1,018.00	5,497,200
出光興産	165,300	2,282.00	377,214,600
E N E O Sホールディングス	2,240,300	367.10	822,414,130
コスモエネルギーホールディングス	43,100	1,810.00	78,011,000
横浜ゴム	86,200	1,565.00	134,903,000
TOYO TIRE	78,400	1,568.00	122,931,200
ブリヂストン	396,000	3,467.00	1,372,932,000
住友ゴム工業	133,800	928.00	124,166,400
藤倉コンポジット	13,000	391.00	5,083,000
オカモト	9,100	3,960.00	36,036,000
フコク	6,500	699.00	4,543,500
ニッタ	16,800	2,332.00	39,177,600
住友理工	28,900	606.00	17,513,400
三ツ星ベルト	19,600	1,700.00	33,320,000
バンドー化学	26,200	637.00	16,689,400
日東紡績	22,200	4,365.00	96,903,000
A G C	136,800	3,695.00	505,476,000
日本板硝子	71,300	469.00	33,439,700
石塚硝子	2,700	2,000.00	5,400,000
日本山村硝子	6,400	904.00	5,785,600
日本電気硝子	55,300	2,362.00	130,618,600
オハラ	6,000	1,535.00	9,210,000
住友大阪セメント	28,300	3,100.00	87,730,000
太平洋セメント	94,100	2,594.00	244,095,400
日本ヒューム	15,200	807.00	12,266,400
日本コンクリート工業	32,700	318.00	10,398,600
三谷セキサン	7,000	4,175.00	29,225,000
アジアパイルホールディングス	21,600	468.00	10,108,800



東海カーボン	145,800	1,255.00	182,979,000
日本カーボン	8,300	4,030.00	33,449,000
東洋炭素	8,900	1,965.00	17,488,500
ノリタケカンパニーリミテド	8,300	3,075.00	25,522,500
TOTO	106,400	5,980.00	636,272,000
日本碍子	178,900	1,607.00	287,492,300
日本特殊陶業	113,400	1,813.00	205,594,200
MARUWA	5,700	11,950.00	68,115,000
品川リフラクトリーズ	4,000	2,536.00	10,144,000
黒崎播磨	3,000	4,200.00	12,600,000
ヨータイ	12,100	841.00	10,176,100
イソライト工業	8,100	483.00	3,912,300
東京窯業	19,600	366.00	7,173,600
ニッカトー	7,000	799.00	5,593,000
フジミインコーポレーテッド	13,300	3,815.00	50,739,500
クニミネ工業	6,200	1,089.00	6,751,800
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,023.00	2,557,500
ニチアス	40,800	2,359.00	96,247,200
ニチハ	20,800	3,170.00	65,936,000
日本製鉄	659,100	1,348.00	888,466,800
神戸製鋼所	269,700	569.00	153,459,300
中山製鋼所	20,600	387.00	7,972,200
合同製鐵	8,000	2,029.00	16,232,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	397,800	1,061.00	422,065,800
東京製鐵	71,800	650.00	46,670,000
共英製鋼	16,700	1,479.00	24,699,300
大和工業	31,300	2,810.00	87,953,000
東京鐵鋼	6,100	2,110.00	12,871,000
大阪製鐵	7,900	1,348.00	10,649,200
淀川製鋼所	19,900	2,064.00	41,073,600
丸一鋼管	47,800	2,281.00	109,031,800
モリ工業	4,400	2,500.00	11,000,000
大同特殊鋼	24,100	4,435.00	106,883,500
日本高周波鋼業	5,600	342.00	1,915,200
日本冶金工業	12,200	1,856.00	22,643,200
山陽特殊製鋼	10,100	1,311.00	13,241,100
愛知製鋼	8,300	2,876.00	23,870,800
日立金属	158,700	1,534.00	243,445,800
日本金属	3,400	1,163.00	3,954,200
大平洋金属	10,000	2,349.00	23,490,000
新日本電工	95,300	303.00	28,875,900
栗本鐵工所	7,300	1,694.00	12,366,200

虹技	2,200	1,142.00	2,512,400
三菱製鋼	11,000	683.00	7,513,000
日亜鋼業	21,800	314.00	6,845,200
日本精線	2,400	3,645.00	8,748,000
エンビプロ・ホールディングス	6,400	632.00	4,044,800
シンニッタン	23,300	204.00	4,753,200
新家工業	3,400	1,219.00	4,144,600
大紀アルミニウム工業所	24,400	823.00	20,081,200
日本軽金属ホールディングス	37,300	1,937.00	72,250,100
三井金属鉱業	39,800	3,845.00	153,031,000
東邦亜鉛	7,600	2,657.00	20,193,200
三菱マテリアル	97,300	2,305.00	224,276,500
住友金属鉱山	188,300	4,628.00	871,452,400
D O W Aホールディングス	37,300	3,795.00	141,553,500
古河機械金属	26,300	1,237.00	32,533,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	939.00	14,554,500
東邦チタニウム	26,500	915.00	24,247,500
U A C J	22,400	2,017.00	45,180,800
C Kサンエツ	3,100	3,800.00	11,780,000
古河電気工業	45,800	2,907.00	133,140,600
住友電気工業	550,700	1,356.50	747,024,550
フジクラ	177,800	472.00	83,921,600
昭和電線ホールディングス	17,200	1,726.00	29,687,200
東京特殊電線	2,300	2,404.00	5,529,200
タツタ電線	29,400	713.00	20,962,200
カナレ電気	2,500	1,834.00	4,585,000
平河ヒューテック	7,500	1,218.00	9,135,000
リョービ	18,200	1,312.00	23,878,400
アーレスティ	19,700	359.00	7,072,300
アサヒホールディングス	25,800	3,560.00	91,848,000
稲葉製作所	8,300	1,398.00	11,603,400
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,581.00	11,614,500
トーカロ	40,900	1,380.00	56,442,000
アルファC o	5,200	1,023.00	5,319,600
S U M C O	188,500	2,104.00	396,604,000
川田テクノロジーズ	3,000	4,190.00	12,570,000
R S Technologies	4,800	5,100.00	24,480,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,615.00	3,615,000
信和	8,500	689.00	5,856,500
東洋製罐グループホールディングス	93,800	1,175.00	110,215,000
ホッカンホールディングス	8,100	1,443.00	11,688,300
コロナ	8,100	943.00	7,638,300

横河ブリッジホールディングス	27,400	2,151.00	58,937,400
駒井ハルテック	2,800	1,812.00	5,073,600
高田機工	1,300	2,544.00	3,307,200
三和ホールディングス	138,800	1,211.00	168,086,800
文化シャッター	43,400	958.00	41,577,200
三協立山	19,000	850.00	16,150,000
アルインコ	10,700	930.00	9,951,000
東洋シャッター	3,500	734.00	2,569,000
L I X I L	217,300	2,321.00	504,353,300
日本フィルコン	10,200	528.00	5,385,600
ノーリツ	30,500	1,648.00	50,264,000
長府製作所	15,000	2,081.00	31,215,000
リンナイ	28,600	11,980.00	342,628,000
ダイニチ工業	7,900	859.00	6,786,100
日東精工	18,500	477.00	8,824,500
三洋工業	2,000	1,850.00	3,700,000
岡部	29,800	774.00	23,065,200
ジーテクト	18,300	1,566.00	28,657,800
東プレ	27,500	1,549.00	42,597,500
高周波熱錬	28,300	475.00	13,442,500
東京製綱	10,500	798.00	8,379,000
サンコール	11,000	438.00	4,818,000
モリテック スチール	11,500	455.00	5,232,500
パイオラックス	21,800	1,653.00	36,035,400
エイチワン	14,400	863.00	12,427,200
日本発條	158,000	742.00	117,236,000
中央発條	1,800	2,974.00	5,353,200
アドバネクス	2,100	1,309.00	2,748,900
立川ブラインド工業	6,500	1,329.00	8,638,500
三益半導体工業	11,500	2,678.00	30,797,000
日本ドライケミカル	3,700	1,540.00	5,698,000
日本製鋼所	44,700	2,937.00	131,283,900
三浦工業	63,700	5,490.00	349,713,000
タクマ	50,000	1,784.00	89,200,000
ツガミ	30,600	1,588.00	48,592,800
オークマ	17,200	5,680.00	97,696,000
芝浦機械	16,700	2,249.00	37,558,300
アマダ	182,800	1,090.00	199,252,000
アイダエンジニアリング	38,700	943.00	36,494,100
滝澤鉄工所	4,700	997.00	4,685,900
F U J I	63,400	2,681.00	169,975,400
牧野フライス製作所	17,300	3,955.00	68,421,500

オーエスジー	72,700	1,878.00	136,530,600
ダイジェット工業	1,800	1,443.00	2,597,400
旭ダイヤモンド工業	39,000	454.00	17,706,000
D M G 森精機	93,300	1,635.00	152,545,500
ソディック	32,200	909.00	29,269,800
ディスコ	20,000	33,250.00	665,000,000
日東工器	8,100	1,816.00	14,709,600
日進工具	5,800	2,671.00	15,491,800
パンチ工業	13,500	442.00	5,967,000
富士ダイス	6,600	656.00	4,329,600
豊和工業	8,300	880.00	7,304,000
O K K	6,000	447.00	2,682,000
東洋機械金属	10,800	416.00	4,492,800
津田駒工業	2,800	888.00	2,486,400
エンシュウ	3,700	937.00	3,466,900
島精機製作所	23,300	1,638.00	38,165,400
オプトラン	18,500	2,341.00	43,308,500
N C ホールディングス	4,600	585.00	2,691,000
イワキポンプ	9,500	820.00	7,790,000
フリー	14,500	1,065.00	15,442,500
ヤマシンフィルタ	33,000	1,085.00	35,805,000
日阪製作所	18,300	859.00	15,719,700
やまびこ	28,600	1,324.00	37,866,400
平田機工	7,000	8,020.00	56,140,000
ペガサスミシン製造	15,200	320.00	4,864,000
マルマエ	5,500	1,291.00	7,100,500
タツモ	6,300	1,428.00	8,996,400
ナプテスコ	86,800	4,450.00	386,260,000
三井海洋開発	15,700	1,875.00	29,437,500
レオン自動機	14,500	1,205.00	17,472,500
S M C	46,700	63,540.00	2,967,318,000
ホソカワミクロン	5,200	6,490.00	33,748,000
ユニオンツール	5,500	3,195.00	17,572,500
オイレス工業	19,100	1,710.00	32,661,000
日精エー・エス・ビー機械	4,300	6,030.00	25,929,000
サトーホールディングス	21,000	2,195.00	46,095,000
技研製作所	13,000	4,245.00	55,185,000
日本エアータック	4,900	1,760.00	8,624,000
カワタ	4,400	983.00	4,325,200
日精樹脂工業	12,500	896.00	11,200,000
オカダアイヨン	4,700	1,077.00	5,061,900
ワイエイシイホールディングス	6,300	1,052.00	6,627,600

小松製作所	674,600	2,773.50	1,871,003,100
住友重機械工業	85,300	2,550.00	217,515,000
日立建機	59,700	2,834.00	169,189,800
日工	20,600	687.00	14,152,200
巴工業	5,900	1,986.00	11,717,400
井関農機	15,000	1,413.00	21,195,000
TOWA	15,100	1,888.00	28,508,800
丸山製作所	3,100	1,500.00	4,650,000
北川鉄工所	6,800	1,391.00	9,458,800
ローツェ	6,500	5,940.00	38,610,000
タカキタ	5,300	731.00	3,874,300
クボタ	782,400	2,162.50	1,691,940,000
荏原実業	3,800	3,995.00	15,181,000
三菱化工機	5,200	2,827.00	14,700,400
月島機械	27,500	1,393.00	38,307,500
帝国電機製作所	12,300	1,209.00	14,870,700
新東工業	35,500	767.00	27,228,500
澁谷工業	13,100	3,580.00	46,898,000
アイチ コーポレーション	25,900	939.00	24,320,100
小森コーポレーション	37,900	737.00	27,932,300
鶴見製作所	11,500	1,777.00	20,435,500
住友精密工業	2,300	2,073.00	4,767,900
日本ギア工業	6,200	312.00	1,934,400
酒井重工業	2,900	2,374.00	6,884,600
荏原製作所	61,800	3,370.00	208,266,000
石井鐵工所	2,000	2,887.00	5,774,000
西島製作所	15,200	893.00	13,573,600
北越工業	15,400	1,059.00	16,308,600
ダイキン工業	189,700	22,095.00	4,191,421,500
オルガノ	5,400	6,080.00	32,832,000
トーヨーカネツ	6,500	2,151.00	13,981,500
栗田工業	80,600	3,915.00	315,549,000
椿本チエイン	21,300	2,793.00	59,490,900
大同工業	7,300	735.00	5,365,500
木村化工機	12,700	569.00	7,226,300
アネスト岩田	23,300	1,099.00	25,606,700
ダイフク	76,100	12,470.00	948,967,000
サムコ	3,700	3,225.00	11,932,500
加藤製作所	8,300	999.00	8,291,700
油研工業	2,600	1,535.00	3,991,000
タダノ	72,000	890.00	64,080,000
フジテック	54,200	2,177.00	117,993,400

C K D	40,900	2,156.00	88,180,400
キトー	11,300	1,567.00	17,707,100
平和	41,600	1,455.00	60,528,000
理想科学工業	13,200	1,394.00	18,400,800
S A N K Y O	33,200	2,736.00	90,835,200
日本金銭機械	16,600	523.00	8,681,800
マースグループホールディングス	9,500	1,534.00	14,573,000
フクシマガリレイ	9,200	4,515.00	41,538,000
オーイズミ	6,500	398.00	2,587,000
ダイコク電機	6,900	851.00	5,871,900
竹内製作所	25,000	2,415.00	60,375,000
アマノ	39,000	2,574.00	100,386,000
J U K I	20,700	528.00	10,929,600
蛇の目マシン工業	13,600	818.00	11,124,800
マックス	22,800	1,431.00	32,626,800
グローリー	38,300	2,118.00	81,119,400
新晃工業	13,900	1,730.00	24,047,000
大和冷機工業	24,000	1,112.00	26,688,000
セガサミーホールディングス	147,800	1,623.00	239,879,400
日本ピストンリング	5,500	976.00	5,368,000
リケン	6,900	2,222.00	15,331,800
T P R	20,100	1,502.00	30,190,200
ツバキ・ナカシマ	28,600	1,216.00	34,777,600
ホシザキ	46,900	9,620.00	451,178,000
大豊工業	12,300	762.00	9,372,600
日本精工	280,500	917.00	257,218,500
N T N	344,700	269.00	92,724,300
ジェイテクト	143,000	820.00	117,260,000
不二越	13,800	4,515.00	62,307,000
日本トムソン	44,400	375.00	16,650,000
T H K	92,900	3,305.00	307,034,500
ユーシン精機	11,600	912.00	10,579,200
前澤給装工業	5,400	2,368.00	12,787,200
イーグル工業	18,500	1,000.00	18,500,000
前澤工業	10,100	445.00	4,494,500
日本ピラー工業	15,100	1,535.00	23,178,500
キッツ	54,500	633.00	34,498,500
マキタ	194,200	5,100.00	990,420,000
日立造船	118,400	490.00	58,016,000
三菱重工業	249,600	2,959.00	738,566,400
I H I	107,400	1,922.00	206,422,800
スター精密	23,000	1,627.00	37,421,000

日清紡ホールディングス	91,200	772.00	70,406,400
イビデン	91,300	4,855.00	443,261,500
コニカミノルタ	327,400	398.00	130,305,200
ブラザー工業	182,200	2,066.00	376,425,200
ミネベアミツミ	276,800	2,085.00	577,128,000
日立製作所	715,600	4,181.00	2,991,923,600
三菱電機	1,489,200	1,552.50	2,311,983,000
富士電機	89,800	3,655.00	328,219,000
東洋電機製造	5,500	1,169.00	6,429,500
安川電機	160,300	4,840.00	775,852,000
シンフォニアテクノロジー	19,400	1,453.00	28,188,200
明電舎	27,400	2,201.00	60,307,400
オリジン	4,100	1,371.00	5,621,100
山洋電気	7,300	5,340.00	38,982,000
デンヨー	12,700	2,092.00	26,568,400
東芝テック	18,700	3,725.00	69,657,500
芝浦メカトロニクス	2,800	4,260.00	11,928,000
マブチモーター	41,400	4,410.00	182,574,000
日本電産	358,400	12,725.00	4,560,640,000
トレックス・セミコンダクター	9,100	1,393.00	12,676,300
東光高岳	8,800	1,610.00	14,168,000
ダイヘン	16,300	5,020.00	81,826,000
ヤーマン	24,600	1,907.00	46,912,200
JVCケンウッド	126,000	175.00	22,050,000
ミマキエンジニアリング	14,700	521.00	7,658,700
I - P E X	7,300	1,999.00	14,592,700
日新電機	35,000	1,180.00	41,300,000
大崎電気工業	29,800	562.00	16,747,600
オムロン	133,500	8,960.00	1,196,160,000
日東工業	21,900	2,015.00	44,128,500
I D E C	21,600	1,824.00	39,398,400
正興電機製作所	3,800	1,997.00	7,588,600
不二電機工業	3,000	1,298.00	3,894,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	50,000	2,778.00	138,900,000
サクサホールディングス	3,500	1,407.00	4,924,500
メルコホールディングス	5,400	3,455.00	18,657,000
テクノメディカ	3,800	1,460.00	5,548,000
日本電気	180,700	5,560.00	1,004,692,000
富士通	143,600	14,240.00	2,044,864,000
沖電気工業	60,600	915.00	55,449,000
岩崎通信機	6,500	848.00	5,512,000
電気興業	7,200	2,734.00	19,684,800

サンケン電気	16,300	4,615.00	75,224,500
ナカヨ	3,000	1,489.00	4,467,000
アイホン	8,500	1,712.00	14,552,000
ルネサスエレクトロニクス	639,000	1,066.00	681,174,000
セイコーエプソン	184,800	1,599.00	295,495,200
ワコム	100,800	891.00	89,812,800
アルバック	27,400	4,440.00	121,656,000
アクセル	7,100	728.00	5,168,800
E I Z O	11,600	3,735.00	43,326,000
日本信号	38,000	950.00	36,100,000
京三製作所	35,100	428.00	15,022,800
能美防災	20,000	2,303.00	46,060,000
ホーチキ	11,300	1,300.00	14,690,000
星和電機	8,500	724.00	6,154,000
エレコム	17,200	5,070.00	87,204,000
パナソニック	1,701,500	1,186.50	2,018,829,750
シャープ	172,400	1,477.00	254,634,800
アンリツ	95,900	2,360.00	226,324,000
富士通ゼネラル	40,500	2,816.00	114,048,000
ソニー	932,900	10,405.00	9,706,824,500
T D K	71,900	14,590.00	1,049,021,000
帝国通信工業	7,200	1,136.00	8,179,200
タムラ製作所	50,000	575.00	28,750,000
アルプスアルパイン	132,300	1,402.00	185,484,600
池上通信機	4,700	888.00	4,173,600
鈴木	8,100	1,089.00	8,820,900
日本トリム	2,200	4,120.00	9,064,000
ローランド ディー . ジー .	9,200	1,843.00	16,955,600
フォスター電機	15,700	1,282.00	20,127,400
S M K	3,800	3,150.00	11,970,000
ヨコオ	9,900	3,040.00	30,096,000
ホシデン	41,500	1,024.00	42,496,000
ヒロセ電機	23,000	15,110.00	347,530,000
日本航空電子工業	34,200	1,581.00	54,070,200
T O A	16,100	886.00	14,264,600
マクセルホールディングス	32,600	1,267.00	41,304,200
古野電気	19,800	1,189.00	23,542,200
ユニデンホールディングス	4,100	2,247.00	9,212,700
スミダコーポレーション	13,300	1,072.00	14,257,600
アイコム	8,300	2,696.00	22,376,800
リオン	6,500	3,430.00	22,295,000
本多通信工業	14,100	471.00	6,641,100



横河電機	136,700	1,948.00	266,291,600
新電元工業	5,300	2,396.00	12,698,800
アズビル	94,000	5,400.00	507,600,000
東亜ディーケーケー	8,200	907.00	7,437,400
日本光電工業	61,700	3,525.00	217,492,500
チノー	5,200	1,409.00	7,326,800
共和電業	15,800	404.00	6,383,200
日本電子材料	6,000	1,675.00	10,050,000
堀場製作所	29,500	6,030.00	177,885,000
アドバンテスト	110,700	7,180.00	794,826,000
小野測器	7,600	528.00	4,012,800
エスペック	13,600	2,009.00	27,322,400
キーエンス	134,900	55,530.00	7,490,997,000
日置電機	7,300	4,215.00	30,769,500
シスメックス	106,500	11,825.00	1,259,362,500
日本マイクロニクス	26,600	1,255.00	33,383,000
メガチップス	14,100	2,935.00	41,383,500
O B A R A G R O U P	8,900	3,920.00	34,888,000
澤藤電機	2,200	2,174.00	4,782,800
原田工業	7,900	856.00	6,762,400
コーセル	20,400	1,195.00	24,378,000
イリソ電子工業	12,700	4,315.00	54,800,500
オブテックスグループ	24,800	1,865.00	46,252,000
千代田インテグレ	6,700	1,725.00	11,557,500
アイ・オー・データ機器	5,500	1,036.00	5,698,000
レーザーテック	65,500	11,820.00	774,210,000
スタンレー電気	104,600	3,435.00	359,301,000
岩崎電気	6,300	1,429.00	9,002,700
ウシオ電機	82,700	1,309.00	108,254,300
岡谷電機産業	13,400	400.00	5,360,000
ハリオス テクノ ホールディング	15,900	290.00	4,611,000
エノモト	5,000	1,435.00	7,175,000
日本セラミック	15,300	2,974.00	45,502,200
遠藤照明	8,800	521.00	4,584,800
古河電池	11,000	1,644.00	18,084,000
双信電機	8,700	453.00	3,941,100
山一電機	11,200	1,530.00	17,136,000
図研	9,900	2,768.00	27,403,200
日本電子	29,500	4,595.00	135,552,500
カシオ計算機	131,800	1,874.00	246,993,200
ファナック	140,000	25,435.00	3,560,900,000
日本シイエムケイ	36,700	403.00	14,790,100

エンプラス	7,800	4,175.00	32,565,000
大真空	5,800	2,522.00	14,627,600
ローム	62,000	9,980.00	618,760,000
浜松ホトニクス	106,900	6,030.00	644,607,000
三井ハイテック	16,700	3,510.00	58,617,000
新光電気工業	50,300	2,325.00	116,947,500
京セラ	209,600	6,248.00	1,309,580,800
太陽誘電	66,400	4,640.00	308,096,000
村田製作所	437,500	8,927.00	3,905,562,500
双葉電子工業	24,300	911.00	22,137,300
北陸電気工業	6,800	925.00	6,290,000
ニチコン	51,100	1,336.00	68,269,600
日本ケミコン	11,900	1,874.00	22,300,600
K O A	22,900	1,487.00	34,052,300
市光工業	23,600	676.00	15,953,600
小糸製作所	89,300	6,860.00	612,598,000
ミツバ	27,400	504.00	13,809,600
S C R E E Nホールディングス	25,800	7,190.00	185,502,000
キャノン電子	14,100	1,528.00	21,544,800
キャノン	740,100	2,062.50	1,526,456,250
リコー	379,000	698.00	264,542,000
象印マホービン	40,600	1,832.00	74,379,200
M U T O Hホールディングス	2,300	1,479.00	3,401,700
東京エレクトロン	94,500	36,440.00	3,443,580,000
トヨタ紡織	43,400	1,719.00	74,604,600
芦森工業	3,200	984.00	3,148,800
ユニプレス	28,900	1,055.00	30,489,500
豊田自動織機	120,500	7,950.00	957,975,000
モリタホールディングス	26,100	1,708.00	44,578,800
三櫻工業	19,000	871.00	16,549,000
デンソー	327,900	5,896.00	1,933,298,400
東海理化電機製作所	39,300	1,777.00	69,836,100
三井E & Sホールディングス	53,800	397.00	21,358,600
川崎重工業	115,900	2,102.00	243,621,800
名村造船所	47,900	163.00	7,807,700
日本車輛製造	5,400	2,476.00	13,370,400
三菱ロジスネクスト	19,700	1,250.00	24,625,000
近畿車輛	2,200	1,312.00	2,886,400
日産自動車	1,756,300	562.60	988,094,380
いすゞ自動車	431,500	991.00	427,616,500
トヨタ自動車	1,661,600	7,850.00	13,043,560,000
日野自動車	186,000	1,060.00	197,160,000

三菱自動車工業	551,200	216.00	119,059,200
エフテック	10,500	645.00	6,772,500
レシップホールディングス	5,800	523.00	3,033,400
G M B	2,800	670.00	1,876,000
ファルテック	2,700	636.00	1,717,200
武蔵精密工業	33,200	1,643.00	54,547,600
日産車体	29,100	920.00	26,772,000
新明和工業	40,100	914.00	36,651,400
極東開発工業	27,700	1,458.00	40,386,600
トピー工業	12,300	1,243.00	15,288,900
ティラド	5,500	1,385.00	7,617,500
曙ブレーキ工業	81,700	127.00	10,375,900
タチエス	24,500	1,231.00	30,159,500
N O K	80,100	1,155.00	92,515,500
フタバ産業	41,600	540.00	22,464,000
K Y B	16,700	2,455.00	40,998,500
大同メタル工業	28,700	504.00	14,464,800
プレス工業	74,100	313.00	23,193,300
ミクニ	19,200	280.00	5,376,000
太平洋工業	31,300	1,097.00	34,336,100
河西工業	20,300	409.00	8,302,700
アイシン精機	122,600	3,125.00	383,125,000
マツダ	438,200	701.00	307,178,200
今仙電機製作所	13,900	795.00	11,050,500
本田技研工業	1,172,500	3,015.00	3,535,087,500
スズキ	295,200	5,061.00	1,494,007,200
S U B A R U	462,300	2,132.00	985,623,600
安永	7,200	1,236.00	8,899,200
ヤマハ発動機	210,400	2,114.00	444,785,600
T B K	17,900	460.00	8,234,000
エクセディ	20,300	1,346.00	27,323,800
豊田合成	48,100	3,015.00	145,021,500
愛三工業	23,500	501.00	11,773,500
盟和産業	2,400	932.00	2,236,800
日本プラスト	11,800	497.00	5,864,600
ヨロズ	14,000	1,098.00	15,372,000
エフ・シー・シー	24,400	1,889.00	46,091,600
シマノ	55,700	24,270.00	1,351,839,000
テイ・エス テック	34,600	3,300.00	114,180,000
ジャムコ	7,500	627.00	4,702,500
テルモ	421,400	4,151.00	1,749,231,400
クリエートメディック	5,000	1,023.00	5,115,000

日機装	48,100	1,025.00	49,302,500
日本エム・ディ・エム	8,600	2,289.00	19,685,400
島津製作所	178,000	3,810.00	678,180,000
JMS	12,600	909.00	11,453,400
長野計器	10,800	1,004.00	10,843,200
ブイ・テクノロジー	7,000	5,640.00	39,480,000
東京計器	9,500	961.00	9,129,500
愛知時計電機	2,000	4,530.00	9,060,000
インターアクション	8,000	1,895.00	15,160,000
オーバル	13,500	296.00	3,996,000
東京精密	27,000	4,850.00	130,950,000
マニー	59,300	2,691.00	159,576,300
ニコン	227,500	672.00	152,880,000
トプコン	75,000	1,261.00	94,575,000
オリンパス	824,000	2,246.00	1,850,704,000
理研計器	13,100	2,932.00	38,409,200
タムロン	12,000	1,856.00	22,272,000
HOYA	295,400	13,960.00	4,123,784,000
シード	6,400	609.00	3,897,600
ノーリツ鋼機	10,100	2,385.00	24,088,500
エー・アンド・デイ	13,600	1,157.00	15,735,200
朝日インテック	168,700	3,620.00	610,694,000
シチズン時計	174,600	296.00	51,681,600
リズム	4,700	642.00	3,017,400
大研医器	10,400	524.00	5,449,600
メニコン	21,100	6,320.00	133,352,000
シンシア	1,700	461.00	783,700
松風	6,700	1,886.00	12,636,200
セイコーホールディングス	21,100	1,357.00	28,632,700
ニプロ	103,100	1,218.00	125,575,800
中本パックス	3,800	1,610.00	6,118,000
スノーピーク	8,800	1,848.00	16,262,400
パラマウントベッドホールディングス	15,700	4,515.00	70,885,500
トランザクション	8,100	920.00	7,452,000
粧美堂	4,300	395.00	1,698,500
ニホンフラッシュ	13,900	1,303.00	18,111,700
前田工織	16,400	2,609.00	42,787,600
永大産業	19,500	290.00	5,655,000
アートネイチャー	15,900	657.00	10,446,300
バンダイナムコホールディングス	154,000	9,196.00	1,416,184,000
アイフィスジャパン	3,800	803.00	3,051,400
共立印刷	24,900	120.00	2,988,000

SHOEI	13,000	3,700.00	48,100,000
フランスベッドホールディングス	21,100	899.00	18,968,900
パイロットコーポレーション	26,300	3,055.00	80,346,500
萩原工業	8,300	1,477.00	12,259,100
トッパン・フォームズ	31,900	1,051.00	33,526,900
フジシールインターナショナル	33,400	2,046.00	68,336,400
タカラトミー	66,800	918.00	61,322,400
廣済堂	10,400	683.00	7,103,200
エステールホールディングス	4,000	626.00	2,504,000
タカノ	5,800	608.00	3,526,400
プロネクサス	12,800	1,048.00	13,414,400
ホクシン	9,200	109.00	1,002,800
ウッドワン	5,000	1,169.00	5,845,000
大建工業	10,000	1,883.00	18,830,000
凸版印刷	210,200	1,475.00	310,045,000
大日本印刷	194,900	1,909.00	372,064,100
共同印刷	4,600	3,120.00	14,352,000
NISSHA	30,600	1,441.00	44,094,600
光村印刷	1,300	1,783.00	2,317,900
TAKARA & COMPANY	7,200	1,959.00	14,104,800
アシックス	131,700	2,008.00	264,453,600
ツツミ	4,600	2,170.00	9,982,000
小松ウオール工業	4,500	1,731.00	7,789,500
ヤマハ	88,600	5,750.00	509,450,000
河合楽器製作所	4,600	3,075.00	14,145,000
クリナップ	13,800	474.00	6,541,200
ピジョン	95,600	4,410.00	421,596,000
オリバー	3,100	2,324.00	7,204,400
兼松サステック	1,000	1,642.00	1,642,000
キングジム	12,400	859.00	10,651,600
リンテック	35,400	2,300.00	81,420,000
イトーキ	29,600	348.00	10,300,800
任天堂	91,300	65,250.00	5,957,325,000
三菱鉛筆	24,500	1,452.00	35,574,000
タカラスタンダード	30,800	1,489.00	45,861,200
コクヨ	71,400	1,448.00	103,387,200
ナカバヤシ	14,600	630.00	9,198,000
グローブライド	6,700	4,340.00	29,078,000
オカムラ	52,000	934.00	48,568,000
美津濃	13,500	1,983.00	26,770,500
東京電力ホールディングス	1,188,800	272.00	323,353,600
中部電力	455,600	1,229.50	560,160,200

関西電力	564,200	957.30	540,108,660	
中国電力	214,800	1,233.00	264,848,400	
北陸電力	136,100	666.00	90,642,600	
東北電力	372,000	852.00	316,944,000	
四国電力	134,100	666.00	89,310,600	
九州電力	306,900	884.00	271,299,600	
北海道電力	139,400	374.00	52,135,600	
沖縄電力	29,000	1,390.00	40,310,000	
電源開発	118,500	1,382.00	163,767,000	
エフオン	8,000	1,205.00	9,640,000	
イーレックス	21,600	2,035.00	43,956,000	
レノバ	25,000	3,155.00	78,875,000	
東京瓦斯	286,400	2,320.00	664,448,000	
大阪瓦斯	289,000	2,021.00	584,069,000	
東邦瓦斯	73,200	6,400.00	468,480,000	
北海道瓦斯	8,000	1,561.00	12,488,000	
広島ガス	30,700	375.00	11,512,500	
西部瓦斯	16,800	3,120.00	52,416,000	
静岡ガス	42,300	1,003.00	42,426,900	
メタウォーター	14,400	2,319.00	33,393,600	
SBSホールディングス	11,000	2,616.00	28,776,000	
東武鉄道	155,200	2,998.00	465,289,600	
相鉄ホールディングス	47,600	2,522.00	120,047,200	
東急	375,600	1,228.00	461,236,800	
京浜急行電鉄	191,200	1,697.00	324,466,400	
小田急電鉄	221,500	3,045.00	674,467,500	
京王電鉄	77,300	7,460.00	576,658,000	
京成電鉄	103,600	3,395.00	351,722,000	
富士急行	20,300	4,395.00	89,218,500	
新京成電鉄	3,800	2,370.00	9,006,000	
東日本旅客鉄道	262,100	6,636.00	1,739,295,600	
西日本旅客鉄道	132,700	5,115.00	678,760,500	
東海旅客鉄道	123,800	13,845.00	1,714,011,000	
西武ホールディングス	194,400	1,018.00	197,899,200	
鴻池運輸	23,700	1,010.00	23,937,000	
西日本鉄道	41,300	2,955.00	122,041,500	
ハマキョウレックス	11,400	2,956.00	33,698,400	
サカイ引越センター	7,800	5,310.00	41,418,000	
近鉄グループホールディングス	141,000	4,380.00	617,580,000	
阪急阪神ホールディングス	188,100	3,310.00	622,611,000	
南海電気鉄道	66,800	2,543.00	169,872,400	
京阪ホールディングス	62,800	4,815.00	302,382,000	

神戸電鉄	3,400	3,710.00	12,614,000
名古屋鉄道	116,000	2,644.00	306,704,000
山陽電気鉄道	10,100	1,974.00	19,937,400
日本通運	48,800	6,870.00	335,256,000
ヤマトホールディングス	233,600	2,589.00	604,790,400
山九	39,200	3,915.00	153,468,000
丸運	8,000	259.00	2,072,000
丸全昭和運輸	11,400	3,320.00	37,848,000
センコーグループホールディングス	77,700	995.00	77,311,500
トナミホールディングス	3,400	6,080.00	20,672,000
ニッコンホールディングス	50,500	2,040.00	103,020,000
日本石油輸送	1,500	2,647.00	3,970,500
福山通運	18,000	4,500.00	81,000,000
セイノーホールディングス	105,600	1,482.00	156,499,200
エスライン	4,200	921.00	3,868,200
神奈川中央交通	3,500	4,000.00	14,000,000
日立物流	25,800	3,120.00	80,496,000
丸和運輸機関	14,900	4,325.00	64,442,500
C & F ロジホールディングス	14,300	1,993.00	28,499,900
九州旅客鉄道	123,600	2,134.00	263,762,400
S Gホールディングス	296,100	3,020.00	894,222,000
日本郵船	118,500	2,345.00	277,882,500
商船三井	89,700	3,130.00	280,761,000
川崎汽船	43,400	2,001.00	86,843,400
N S ユナイテッド海運	8,700	1,393.00	12,119,100
飯野海運	69,800	417.00	29,106,600
共栄タンカー	4,000	842.00	3,368,000
乾汽船	8,100	940.00	7,614,000
日本航空	316,600	1,910.00	604,706,000
A N A ホールディングス	351,100	2,202.50	773,297,750
パスコ	2,700	1,430.00	3,861,000
トランコム	3,900	8,420.00	32,838,000
日新	12,200	1,225.00	14,945,000
三菱倉庫	44,700	2,893.00	129,317,100
三井倉庫ホールディングス	16,100	2,221.00	35,758,100
住友倉庫	50,700	1,358.00	68,850,600
澁澤倉庫	7,700	2,286.00	17,602,200
東陽倉庫	25,500	324.00	8,262,000
日本トランスシティ	31,000	581.00	18,011,000
ケイヒン	2,700	1,376.00	3,715,200
中央倉庫	8,600	1,210.00	10,406,000
川西倉庫	2,600	1,115.00	2,899,000

安田倉庫	11,600	986.00	11,437,600
ファイブホールディングス	3,000	1,051.00	3,153,000
東洋埠頭	4,300	1,438.00	6,183,400
宇徳	12,100	486.00	5,880,600
上組	78,700	1,897.00	149,293,900
サンリツ	3,300	706.00	2,329,800
キムラユニティー	3,800	1,115.00	4,237,000
キューソー流通システム	3,500	1,670.00	5,845,000
近鉄エクスプレス	30,000	2,426.00	72,780,000
東海運	8,000	322.00	2,576,000
エーアイティー	10,000	957.00	9,570,000
内外トランスライン	4,900	1,363.00	6,678,700
日本コンセプト	4,500	1,746.00	7,857,000
NEC ネットエスアイ	41,600	1,824.00	75,878,400
クロスキャット	4,100	1,198.00	4,911,800
システナ	52,300	2,156.00	112,758,800
デジタルアーツ	7,200	9,190.00	66,168,000
日鉄ソリューションズ	22,000	2,993.00	65,846,000
キューブシステム	8,000	1,297.00	10,376,000
エイジア	2,800	1,920.00	5,376,000
コア	6,400	1,425.00	9,120,000
ラクーンホールディングス	7,400	1,801.00	13,327,400
ソリトンシステムズ	7,500	1,922.00	14,415,000
ソフトクリエイティブホールディングス	6,500	2,857.00	18,570,500
T I S	146,300	2,044.00	299,037,200
J N S ホールディングス	5,800	554.00	3,213,200
電算システム	5,600	3,200.00	17,920,000
グリー	90,200	612.00	55,202,400
コーエーテクモホールディングス	29,900	6,290.00	188,071,000
三菱総合研究所	6,300	4,235.00	26,680,500
電算	1,800	2,448.00	4,406,400
A G S	8,600	903.00	7,765,800
ファインデックス	12,500	1,275.00	15,937,500
ブレインパッド	3,900	4,605.00	17,959,500
K L a b	26,600	963.00	25,615,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,000	1,139.00	20,502,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	2,718.00	5,979,600
ネクソン	368,800	3,250.00	1,198,600,000
アイスタイル	41,600	392.00	16,307,200
エムアップホールディングス	4,300	2,633.00	11,321,900
エイチーム	10,400	1,125.00	11,700,000
エニグモ	14,100	1,281.00	18,062,100



テクノスジャパン	11,800	686.00	8,094,800
コロプラ	48,300	994.00	48,010,200
ブロードリーフ	72,900	708.00	51,613,200
クロス・マーケティンググループ	7,400	379.00	2,804,600
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,270.00	10,160,000
システム情報	11,200	1,066.00	11,939,200
メディアドゥ	4,800	7,370.00	35,376,000
じげん	37,200	400.00	14,880,000
ブイキューブ	8,000	3,195.00	25,560,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	797.00	2,869,200
サイバーリンクス	2,400	5,300.00	12,720,000
フィックスターズ	15,900	956.00	15,200,400
CARTA HOLDINGS	6,100	1,247.00	7,606,700
オブティム	7,800	2,883.00	22,487,400
セレス	4,900	2,824.00	13,837,600
SHIFT	6,500	13,970.00	90,805,000
ティーガイア	13,100	1,846.00	24,182,600
セック	2,200	2,907.00	6,395,400
日本アジアグループ	15,400	747.00	11,503,800
テクマトリックス	20,700	2,077.00	42,993,900
プロシップ	4,500	1,523.00	6,853,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	35,300	2,677.00	94,498,100
GMOペイメントゲートウェイ	30,900	14,070.00	434,763,000
ザッパラス	7,000	523.00	3,661,000
システムリサーチ	4,100	1,706.00	6,994,600
インターネットイニシアティブ	21,700	4,170.00	90,489,000
さくらインターネット	16,100	671.00	10,803,100
ヴィンクス	4,400	1,197.00	5,266,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	9,170.00	30,261,000
SRAホールディングス	7,900	2,544.00	20,097,600
システムインテグレータ	5,100	646.00	3,294,600
朝日ネット	10,700	863.00	9,234,100
eBASE	17,800	1,020.00	18,156,000
アバント	14,200	1,157.00	16,429,400
アドソル日進	5,300	3,180.00	16,854,000
フリービット	7,900	981.00	7,749,900
コムチュア	16,500	2,885.00	47,602,500
サイバーコム	2,800	1,725.00	4,830,000
アステリア	9,200	1,131.00	10,405,200
アイル	8,300	1,492.00	12,383,600
マークラインズ	6,200	2,633.00	16,324,600
メディカル・データ・ビジョン	16,800	2,714.00	45,595,200

g u m i	19,100	854.00	16,311,400
ショーケース	3,500	960.00	3,360,000
モバイルファクトリー	3,600	1,002.00	3,607,200
テラスカイ	5,400	4,055.00	21,897,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,000	1,554.00	9,324,000
P C Iホールディングス	5,800	1,652.00	9,581,600
パイプドHD	2,100	1,613.00	3,387,300
アイビーシー	2,700	1,114.00	3,007,800
ネオジャパン	2,900	2,309.00	6,696,100
P R T I M E S	2,600	3,210.00	8,346,000
ランドコンピュータ	2,500	1,134.00	2,835,000
ダブルスタンダード	2,000	4,185.00	8,370,000
オープンドア	7,500	1,309.00	9,817,500
マイネット	4,800	870.00	4,176,000
アカツキ	5,300	4,320.00	22,896,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,729.00	2,074,800
U b i c o mホールディングス	3,400	3,580.00	12,172,000
カナミックネットワーク	13,800	745.00	10,281,000
ノムラシステムコーポレーション	7,300	371.00	2,708,300
チェンジ	10,300	7,780.00	80,134,000
シンクロ・フード	7,300	304.00	2,219,200
オークネット	7,900	1,464.00	11,565,600
セグエグループ	4,000	1,368.00	5,472,000
エイトレッド	2,500	2,678.00	6,695,000
A O I T Y O H o l d i n g s	15,500	433.00	6,711,500
マクロミル	30,300	666.00	20,179,800
ビーグリー	3,000	1,898.00	5,694,000
オロ	4,700	4,685.00	22,019,500
ユーザーローカル	1,500	3,890.00	5,835,000
テモナ	3,400	1,081.00	3,675,400
ニーズウェル	3,200	679.00	2,172,800
サインポスト	3,500	845.00	2,957,500
ソルクシーズ	5,900	1,012.00	5,970,800
フェイス	5,500	791.00	4,350,500
プロトコーポレーション	13,400	1,054.00	14,123,600
ハイマックス	3,700	1,189.00	4,399,300
野村総合研究所	207,200	3,530.00	731,416,000
サイバネットシステム	10,700	963.00	10,304,100
C Eホールディングス	8,300	577.00	4,789,100
日本システム技術	2,500	1,510.00	3,775,000
インテージホールディングス	18,500	1,126.00	20,831,000
東邦システムサイエンス	4,200	941.00	3,952,200

ソースネクスト	70,300	287.00	20,176,100
インフォコム	16,100	3,335.00	53,693,500
HEROZ	2,200	2,627.00	5,779,400
ラクスル	11,900	4,440.00	52,836,000
F I G	17,000	292.00	4,964,000
システムサポート	3,600	1,688.00	6,076,800
イーソル	8,200	1,287.00	10,553,400
アルテリア・ネットワークス	16,400	1,519.00	24,911,600
E d u L a b	1,400	6,880.00	9,632,000
東海ソフト	1,300	1,112.00	1,445,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,511.00	4,079,700
東名	1,000	1,140.00	1,140,000
ヴィッツ	700	2,598.00	1,818,600
トピラシステムズ	1,600	1,387.00	2,219,200
L i n k - U	1,200	1,301.00	1,561,200
フォーカスシステムズ	9,400	915.00	8,601,000
クレスコ	9,100	1,341.00	12,203,100
フジ・メディア・ホールディングス	141,100	1,105.00	155,915,500
オービック	50,700	21,000.00	1,064,700,000
ジャストシステム	23,800	7,210.00	171,598,000
T D C ソフト	13,100	1,019.00	13,348,900
Zホールディングス	2,007,300	610.50	1,225,456,650
トレンドマイクロ	78,000	5,710.00	445,380,000
I Dホールディングス	5,800	1,260.00	7,308,000
日本オラクル	29,700	11,710.00	347,787,000
アルファシステムズ	4,600	3,520.00	16,192,000
フューチャー	17,800	1,807.00	32,164,600
C A C H o l d i n g s	9,700	1,466.00	14,220,200
S B テクノロジー	5,300	3,565.00	18,894,500
トーセ	4,300	855.00	3,676,500
オービックビジネスコンサルタント	15,000	7,150.00	107,250,000
伊藤忠テクノソリューションズ	66,700	3,750.00	250,125,000
アイティフォー	18,000	947.00	17,046,000
東計電算	2,200	4,465.00	9,823,000
エクスネット	2,600	967.00	2,514,200
大塚商会	79,100	5,170.00	408,947,000
サイボウズ	17,200	2,611.00	44,909,200
電通国際情報サービス	9,100	6,820.00	62,062,000
A C C E S S	14,100	747.00	10,532,700
デジタルガレージ	26,400	4,435.00	117,084,000
E M システムズ	21,100	872.00	18,399,200
ウェザーニューズ	5,000	5,730.00	28,650,000

C I J	10,300	917.00	9,445,100
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,275.00	5,895,000
日本エンタープライズ	16,300	211.00	3,439,300
WOWOW	7,100	2,862.00	20,320,200
スカラ	10,100	853.00	8,615,300
インテリジェント ウェイブ	9,000	684.00	6,156,000
I M A G I C A G R O U P	13,200	346.00	4,567,200
ネットワンシステムズ	55,800	3,660.00	204,228,000
システムソフト	35,200	89.00	3,132,800
アルゴグラフィックス	12,500	3,185.00	39,812,500
マーベラス	22,700	923.00	20,952,100
エイベックス	25,400	1,020.00	25,908,000
日本ユニシス	45,700	3,890.00	177,773,000
兼松エレクトロニクス	8,000	4,070.00	32,560,000
都築電気	4,800	1,658.00	7,958,400
T B S ホールディングス	89,000	1,886.00	167,854,000
日本テレビホールディングス	122,300	1,137.00	139,055,100
朝日放送グループホールディングス	15,000	707.00	10,605,000
テレビ朝日ホールディングス	40,300	1,683.00	67,824,900
スカパーJ S A Tホールディングス	96,800	516.00	49,948,800
テレビ東京ホールディングス	12,100	2,300.00	27,830,000
日本BS放送	5,200	1,083.00	5,631,600
ビジョン	18,400	1,007.00	18,528,800
スマートバリュー	4,100	950.00	3,895,000
ワイヤレスゲート	6,500	573.00	3,724,500
コネクシオ	8,500	1,406.00	11,951,000
クロップス	3,100	772.00	2,393,200
日本電信電話	1,953,500	2,666.50	5,209,007,750
K D D I	1,065,400	3,028.00	3,226,031,200
ソフトバンク	1,328,300	1,320.50	1,754,020,150
光通信	15,100	24,730.00	373,423,000
エムティーアイ	14,500	879.00	12,745,500
G M Oインターネット	52,500	2,925.00	153,562,500
ファイバーゲート	4,900	2,566.00	12,573,400
アйдママーケティングコミュニケーション	5,200	431.00	2,241,200
K A D O K A W A	39,400	3,630.00	143,022,000
学研ホールディングス	19,800	1,706.00	33,778,800
ゼンリン	29,400	1,276.00	37,514,400
昭文社ホールディングス	7,400	494.00	3,655,600
インプレスホールディングス	12,100	172.00	2,081,200
アイネット	7,700	1,574.00	12,119,800
松竹	9,700	13,820.00	134,054,000

東宝	86,300	4,310.00	371,953,000
東映	5,500	16,010.00	88,055,000
エヌ・ティ・ティ・データ	389,300	1,376.00	535,676,800
ピー・シー・エー	2,600	4,420.00	11,492,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,534.00	7,976,800
D T S	32,800	2,239.00	73,439,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,400	6,470.00	403,728,000
シーイーシー	15,900	1,534.00	24,390,600
カブコン	68,900	6,670.00	459,563,000
アイ・エス・ビー	3,500	3,085.00	10,797,500
ジャステック	9,500	1,353.00	12,853,500
S C S K	33,800	5,670.00	191,646,000
日本システムウエア	5,000	2,126.00	10,630,000
アイネス	14,600	1,407.00	20,542,200
T K C	12,400	6,940.00	86,056,000
富士ソフト	15,600	5,210.00	81,276,000
N S D	47,100	2,140.00	100,794,000
コナミホールディングス	53,100	5,750.00	305,325,000
福井コンピュータホールディングス	5,800	3,880.00	22,504,000
J B C Cホールディングス	10,100	1,438.00	14,523,800
ミロク情報サービス	13,000	2,005.00	26,065,000
ソフトバンクグループ	1,159,500	8,489.00	9,842,995,500
ハウスイ	1,200	1,012.00	1,214,400
高千穂交易	5,700	1,210.00	6,897,000
カワニシホールディングス	1,800	1,463.00	2,633,400
伊藤忠食品	3,600	5,500.00	19,800,000
エレマテック	13,700	1,014.00	13,891,800
J A L U X	4,200	1,341.00	5,632,200
あらた	11,700	5,000.00	58,500,000
トーマンデバイス	2,200	3,350.00	7,370,000
東京エレクトロン デバイス	5,300	3,160.00	16,748,000
フィールズ	11,200	515.00	5,768,000
双日	810,100	234.00	189,563,400
アルフレッサ ホールディングス	163,000	2,023.00	329,749,000
横浜冷凍	38,400	865.00	33,216,000
ラサ商事	7,800	903.00	7,043,400
アルコニックス	15,600	1,505.00	23,478,000
神戸物産	101,200	3,175.00	321,310,000
ハイパー	2,300	599.00	1,377,700
あい ホールディングス	20,900	2,104.00	43,973,600
ディーブイエックス	5,200	1,020.00	5,304,000
ダイワボウホールディングス	12,500	8,670.00	108,375,000

マクニカ・富士エレホールディングス	35,000	1,974.00	69,090,000
ラクト・ジャパン	6,400	2,909.00	18,617,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,600	839.00	23,156,400
八洲電機	11,400	991.00	11,297,400
メディアスホールディングス	8,300	795.00	6,598,500
レスターホールディングス	15,300	2,155.00	32,971,500
ジュテックホールディングス	3,400	1,034.00	3,515,600
大光	6,300	669.00	4,214,700
OCHIホールディングス	4,300	1,304.00	5,607,200
TOKAIホールディングス	77,500	1,007.00	78,042,500
黒谷	4,000	722.00	2,888,000
Cominix	2,600	739.00	1,921,400
三洋貿易	14,800	969.00	14,341,200
ビューティガレージ	2,400	2,774.00	6,657,600
ウイン・パートナーズ	10,600	1,251.00	13,260,600
ミタチ産業	4,400	606.00	2,666,400
シップヘルスケアホールディングス	23,500	5,540.00	130,190,000
明治電機工業	4,600	1,460.00	6,716,000
デリカフーズホールディングス	5,200	647.00	3,364,400
スターティアホールディングス	3,400	965.00	3,281,000
コメダホールディングス	32,000	1,837.00	58,784,000
ピーバンドットコム	1,500	916.00	1,374,000
アセンテック	3,100	1,865.00	5,781,500
富士興産	4,500	932.00	4,194,000
協栄産業	1,600	1,333.00	2,132,800
小野建	13,200	1,242.00	16,394,400
南陽	3,200	1,679.00	5,372,800
佐島電機	10,000	786.00	7,860,000
エコートレーディング	3,400	668.00	2,271,200
伯東	9,000	1,066.00	9,594,000
コンドーテック	11,400	1,060.00	12,084,000
中山福	8,500	558.00	4,743,000
ナガイレーベン	19,500	2,769.00	53,995,500
三菱食品	16,100	2,875.00	46,287,500
松田産業	10,700	1,878.00	20,094,600
第一興商	21,800	3,495.00	76,191,000
メディバルホールディングス	158,300	2,008.00	317,866,400
SPK	6,300	1,285.00	8,095,500
萩原電気ホールディングス	5,400	2,468.00	13,327,200
アズワン	9,600	15,970.00	153,312,000
スズデン	5,100	1,260.00	6,426,000
尾家産業	4,300	1,393.00	5,989,900

シモジマ	9,000	1,423.00	12,807,000
ドウシシャ	13,800	1,950.00	26,910,000
小津産業	3,200	1,900.00	6,080,000
高速	8,700	1,633.00	14,207,100
たけびし	5,200	1,576.00	8,195,200
リックス	3,300	1,680.00	5,544,000
丸文	13,000	509.00	6,617,000
ハピネット	12,300	1,605.00	19,741,500
橋本総業ホールディングス	3,000	2,761.00	8,283,000
日本ライフライン	43,500	1,567.00	68,164,500
タカショー	9,500	880.00	8,360,000
マルカ	4,800	1,982.00	9,513,600
I D O M	39,600	536.00	21,225,600
進和	8,700	2,200.00	19,140,000
エスケイジャパン	3,200	478.00	1,529,600
ダイトロン	6,200	1,620.00	10,044,000
シークス	18,700	1,652.00	30,892,400
田中商事	4,500	703.00	3,163,500
オーハシテクニカ	7,500	1,477.00	11,077,500
白銅	5,300	1,499.00	7,944,700
ダイコー通産	900	1,445.00	1,300,500
伊藤忠商事	1,025,900	2,909.00	2,984,343,100
丸紅	1,526,700	677.70	1,034,644,590
高島	2,300	1,645.00	3,783,500
長瀬産業	82,500	1,524.00	125,730,000
蝶理	9,400	1,590.00	14,946,000
豊田通商	163,700	3,890.00	636,793,000
三共生興	22,300	468.00	10,436,400
兼松	54,700	1,260.00	68,922,000
ツカモトコーポレーション	2,600	1,535.00	3,991,000
三井物産	1,269,900	1,904.50	2,418,524,550
日本紙パルプ商事	8,300	3,570.00	29,631,000
カメイ	19,100	1,175.00	22,442,500
東都水産	1,900	4,545.00	8,635,500
O U Gホールディングス	2,300	2,832.00	6,513,600
スターゼン	5,400	4,160.00	22,464,000
山善	57,300	1,056.00	60,508,800
椿本興業	2,700	3,960.00	10,692,000
住友商事	925,400	1,340.00	1,240,036,000
内田洋行	5,800	4,285.00	24,853,000
三菱商事	961,700	2,588.00	2,488,879,600
第一実業	7,200	4,120.00	29,664,000

キヤノンマーケティングジャパン	36,400	2,300.00	83,720,000
西華産業	8,300	1,317.00	10,931,100
佐藤商事	12,100	907.00	10,974,700
菱洋エレクトロ	14,900	2,851.00	42,479,900
東京産業	13,300	590.00	7,847,000
ユアサ商事	13,900	3,335.00	46,356,500
神鋼商事	3,700	1,886.00	6,978,200
トルク	8,800	267.00	2,349,600
阪和興業	27,400	2,783.00	76,254,200
正栄食品工業	9,500	3,550.00	33,725,000
カナデン	11,900	1,266.00	15,065,400
菱電商事	10,600	1,562.00	16,557,200
フルサト工業	8,100	1,327.00	10,748,700
岩谷産業	37,900	6,250.00	236,875,000
ナイス	6,300	1,690.00	10,647,000
昭光通商	4,700	607.00	2,852,900
ニチモウ	2,300	1,959.00	4,505,700
極東貿易	4,200	1,364.00	5,728,800
イワキ	19,300	515.00	9,939,500
三愛石油	36,100	1,166.00	42,092,600
稲畑産業	32,300	1,451.00	46,867,300
G S I クレオス	3,600	1,750.00	6,300,000
明和産業	13,600	452.00	6,147,200
クワザワホールディングス	5,300	595.00	3,153,500
ヤマエ久野	10,700	1,207.00	12,914,900
ワキタ	31,300	1,076.00	33,678,800
東邦ホールディングス	47,100	1,930.00	90,903,000
サンゲツ	39,600	1,534.00	60,746,400
ミツウロコグループホールディングス	21,600	1,407.00	30,391,200
シナネンホールディングス	6,000	2,963.00	17,778,000
伊藤忠エネクス	32,500	1,026.00	33,345,000
サンリオ	41,200	1,450.00	59,740,000
サンワテクノス	10,400	987.00	10,264,800
リョーサン	16,200	1,897.00	30,731,400
新光商事	22,000	727.00	15,994,000
トーホー	6,600	2,100.00	13,860,000
三信電気	7,900	2,172.00	17,158,800
東陽テクニカ	15,700	1,150.00	18,055,000
モスフードサービス	19,300	2,952.00	56,973,600
加賀電子	14,600	2,368.00	34,572,800
ソーダニッカ	15,200	540.00	8,208,000
立花エレテック	10,800	1,699.00	18,349,200



フォーバル	6,400	850.00	5,440,000
PALTA C	23,500	5,780.00	135,830,000
三谷産業	19,300	498.00	9,611,400
西本Wismettacホールディングス	3,300	2,349.00	7,751,700
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,567.00	2,037,100
コア商事ホールディングス	2,800	1,438.00	4,026,400
国際紙パルプ商事	34,800	250.00	8,700,000
ヤマタネ	7,400	1,370.00	10,138,000
丸紅建材リース	1,400	1,676.00	2,346,400
日鉄物産	10,500	3,740.00	39,270,000
泉州電業	4,100	3,235.00	13,263,500
トラスコ中山	33,600	2,944.00	98,918,400
オートバックスセブン	54,400	1,394.00	75,833,600
モリト	10,700	658.00	7,040,600
加藤産業	21,200	3,400.00	72,080,000
北恵	3,700	883.00	3,267,100
イノテック	7,600	1,017.00	7,729,200
イエローハット	27,700	1,614.00	44,707,800
J Kホールディングス	13,300	887.00	11,797,100
日伝	13,300	2,278.00	30,297,400
北沢産業	11,100	273.00	3,030,300
杉本商事	7,900	2,505.00	19,789,500
因幡電機産業	41,700	2,561.00	106,793,700
東テク	4,900	2,788.00	13,661,200
ミスミグループ本社	183,900	3,400.00	625,260,000
アルテック	10,800	306.00	3,304,800
タキヒヨー	4,500	1,946.00	8,757,000
蔵王産業	2,800	1,363.00	3,816,400
スズケン	62,100	3,905.00	242,500,500
ジェコス	10,100	979.00	9,887,900
グローセル	14,700	454.00	6,673,800
ローソン	37,100	4,760.00	176,596,000
サンエー	12,300	4,125.00	50,737,500
カワチ薬品	11,400	2,942.00	33,538,800
エービーシー・マート	22,900	5,370.00	122,973,000
ハードオフコーポレーション	6,200	714.00	4,426,800
アスクル	15,400	3,825.00	58,905,000
ゲオホールディングス	26,600	1,219.00	32,425,400
アダストリア	20,400	1,905.00	38,862,000
くら寿司	8,700	6,490.00	56,463,000
キャンドウ	7,100	1,890.00	13,419,000
パルグループホールディングス	15,200	1,183.00	17,981,600

エディオン	67,600	1,013.00	68,478,800
サーラコーポレーション	30,200	571.00	17,244,200
ワッツ	6,700	840.00	5,628,000
ハローズ	5,600	3,595.00	20,132,000
フジオフードグループ本社	12,400	1,371.00	17,000,400
あみやき亭	3,300	2,852.00	9,411,600
ひらまつ	27,000	169.00	4,563,000
大黒天物産	3,600	6,050.00	21,780,000
ハニーズホールディングス	13,200	961.00	12,685,200
ファーマライズホールディングス	3,900	782.00	3,049,800
アルペン	11,300	2,382.00	26,916,600
ハブ	4,600	559.00	2,571,400
クオールホールディングス	21,800	1,120.00	24,416,000
ジーンズホールディングス	7,800	6,890.00	53,742,000
ビックカメラ	87,200	1,126.00	98,187,200
D C Mホールディングス	90,000	1,169.00	105,210,000
MonotaRO	104,300	5,430.00	566,349,000
東京一番フーズ	4,100	565.00	2,316,500
きちりホールディングス	4,300	657.00	2,825,100
アークランドサービスホールディングス	12,400	2,200.00	27,280,000
J．フロント リテイリング	175,400	845.00	148,213,000
ドトール・日レスホールディングス	21,300	1,513.00	32,226,900
マツモトキヨシホールディングス	60,700	4,425.00	268,597,500
ブロンコビリー	7,800	2,399.00	18,712,200
Z O Z O	101,000	2,540.00	256,540,000
トレジャー・ファクトリー	4,600	694.00	3,192,400
物語コーポレーション	3,900	12,680.00	49,452,000
ココカラファイン	15,300	7,410.00	113,373,000
三越伊勢丹ホールディングス	257,000	613.00	157,541,000
H a m e e	5,400	1,998.00	10,789,200
ウエルシアホールディングス	87,300	3,805.00	332,176,500
クリエイトSDホールディングス	24,800	3,680.00	91,264,000
丸善C H Iホールディングス	17,100	374.00	6,395,400
ティーライフ	2,300	1,188.00	2,732,400
チムニー	4,700	1,184.00	5,564,800
シュッピン	10,300	863.00	8,888,900
オイシックス・ラ・大地	14,600	3,205.00	46,793,000
ネクステージ	25,200	1,282.00	32,306,400
ジョイフル本田	43,100	1,425.00	61,417,500
鳥貴族	4,500	1,442.00	6,489,000
ホットランド	11,100	1,286.00	14,274,600
すかいらーくホールディングス	164,500	1,633.00	268,628,500

S F Pホールディングス	8,500	1,249.00	10,616,500
綿半ホールディングス	11,100	1,312.00	14,563,200
ヨシックス	2,500	1,860.00	4,650,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,800	1,133.00	48,492,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,900	919.00	7,260,100
B E E N O S	6,900	2,815.00	19,423,500
あさひ	11,100	1,702.00	18,892,200
日本調剤	9,100	1,493.00	13,586,300
コスモス薬品	13,000	16,410.00	213,330,000
トーエル	7,400	851.00	6,297,400
オンリー	3,000	439.00	1,317,000
セブン&アイ・ホールディングス	573,800	3,528.00	2,024,366,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	78,800	607.00	47,831,600
ツルハホールディングス	32,000	14,990.00	479,680,000
サンマルクホールディングス	11,800	1,412.00	16,661,600
フェリシモ	3,400	1,404.00	4,773,600
トリドールホールディングス	36,500	1,380.00	50,370,000
T O K Y O B A S E	13,700	512.00	7,014,400
ウイルプラスホールディングス	2,200	698.00	1,535,600
J Mホールディングス	11,200	2,259.00	25,300,800
サツドラホールディングス	2,300	2,055.00	4,726,500
アレンザホールディングス	7,500	1,270.00	9,525,000
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,509.00	6,036,000
パロックジャパンリミテッド	10,500	675.00	7,087,500
クスリのアオキホールディングス	13,100	9,000.00	117,900,000
力の源ホールディングス	6,700	546.00	3,658,200
スシローグローバルホールディングス	80,600	3,650.00	294,190,000
メディカルシステムネットワーク	14,500	640.00	9,280,000
はるやまホールディングス	7,200	698.00	5,025,600
ノジマ	26,200	2,738.00	71,735,600
カップ・クリエイト	20,600	1,460.00	30,076,000
ライトオン	11,000	587.00	6,457,000
良品計画	194,800	2,029.00	395,249,200
三城ホールディングス	16,400	292.00	4,788,800
アドヴァン	22,600	1,232.00	27,843,200
アルビス	5,700	2,513.00	14,324,100
コナカ	18,200	290.00	5,278,000
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,640.00	3,116,000
G - 7ホールディングス	8,700	2,344.00	20,392,800
イオン北海道	19,500	999.00	19,480,500
コジマ	25,500	717.00	18,283,500

ヒマラヤ	5,400	994.00	5,367,600
コーナン商事	20,900	3,220.00	67,298,000
エコス	5,500	2,105.00	11,577,500
ワタミ	17,600	865.00	15,224,000
マルシェ	4,300	501.00	2,154,300
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	322,500	2,397.00	773,032,500
西松屋チェーン	32,300	1,527.00	49,322,100
ゼンショーホールディングス	70,400	2,637.00	185,644,800
幸楽苑ホールディングス	9,300	1,728.00	16,070,400
ハークスレイ	3,300	890.00	2,937,000
サイゼリヤ	21,900	1,888.00	41,347,200
V Tホールディングス	61,400	407.00	24,989,800
魚力	4,200	1,811.00	7,606,200
フジ・コーポレーション	4,000	2,199.00	8,796,000
ユナイテッドアローズ	15,500	1,608.00	24,924,000
ハイデイ日高	21,300	1,734.00	36,934,200
京都きもの友禅	10,400	221.00	2,298,400
コロワイド	48,700	1,588.00	77,335,600
ピーシーデポコーポレーション	19,900	574.00	11,422,600
壱番屋	10,400	5,140.00	53,456,000
P L A N T	4,100	743.00	3,046,300
スギホールディングス	29,300	6,950.00	203,635,000
薬王堂ホールディングス	6,500	2,408.00	15,652,000
スクロール	22,900	735.00	16,831,500
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,931.00	28,965,000
木曽路	19,300	2,399.00	46,300,700
S R Sホールディングス	17,600	841.00	14,801,600
タカキュー	11,300	136.00	1,536,800
リテールパートナーズ	19,600	1,463.00	28,674,800
ケーヨー	30,300	741.00	22,452,300
上新電機	17,300	2,712.00	46,917,600
日本瓦斯	23,200	5,460.00	126,672,000
ロイヤルホールディングス	25,600	1,960.00	50,176,000
いなげや	18,200	1,804.00	32,832,800
島忠	27,600	5,480.00	151,248,000
チヨダ	15,700	914.00	14,349,800
ライフコーポレーション	11,200	3,610.00	40,432,000
リンガーハット	18,100	2,299.00	41,611,900
M r M a x H D	20,400	802.00	16,360,800
A O K Iホールディングス	29,900	512.00	15,308,800
オークワ	23,100	1,339.00	30,930,900
コメリ	22,700	2,891.00	65,625,700

青山商事	30,800	568.00	17,494,400
しまむら	17,100	10,590.00	181,089,000
はせがわ	8,600	299.00	2,571,400
高島屋	107,000	859.00	91,913,000
松屋	29,800	755.00	22,499,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,700	700.00	48,790,000
近鉄百貨店	5,700	3,255.00	18,553,500
丸井グループ	134,500	1,794.00	241,293,000
アクシアル リテイリング	12,200	4,890.00	59,658,000
イオン	564,400	3,095.00	1,746,818,000
イズミ	29,900	3,740.00	111,826,000
平和堂	29,900	2,174.00	65,002,600
フジ	17,800	1,942.00	34,567,600
ヤオコー	16,700	7,020.00	117,234,000
ゼビオホールディングス	18,000	848.00	15,264,000
ケーズホールディングス	141,700	1,397.00	197,954,900
Olympicグループ	7,800	916.00	7,144,800
日産東京販売ホールディングス	22,600	268.00	6,056,800
シルバーライフ	2,100	2,242.00	4,708,200
Genky DrugStores	6,500	4,395.00	28,567,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	719.00	2,588,400
ブックオフグループホールディングス	8,600	824.00	7,086,400
ギフト	1,500	1,838.00	2,757,000
アインホールディングス	18,100	6,580.00	119,098,000
元気寿司	3,800	2,301.00	8,743,800
ヤマダホールディングス	447,400	530.00	237,122,000
アークランドサカモト	23,100	1,676.00	38,715,600
ニトリホールディングス	63,500	21,875.00	1,389,062,500
グルメ杵屋	10,700	1,002.00	10,721,400
愛眼	11,700	235.00	2,749,500
ケーユーホールディングス	7,900	846.00	6,683,400
吉野家ホールディングス	48,300	1,905.00	92,011,500
松屋フーズホールディングス	7,100	3,330.00	23,643,000
サガミホールディングス	19,800	1,250.00	24,750,000
関西スーパーマーケット	12,400	1,229.00	15,239,600
王将フードサービス	10,800	5,780.00	62,424,000
プレナス	16,600	1,755.00	29,133,000
ミニストップ	11,000	1,411.00	15,521,000
アークス	30,100	2,252.00	67,785,200
バローホールディングス	32,500	2,641.00	85,832,500
ベルク	7,300	6,140.00	44,822,000
大庄	8,100	984.00	7,970,400

ファーストリテイリング	19,600	83,930.00	1,645,028,000
サンドラッグ	55,200	4,125.00	227,700,000
サクスパー ホールディングス	12,900	536.00	6,914,400
ヤマザワ	3,600	1,785.00	6,426,000
やまや	3,000	2,167.00	6,501,000
ペルーナ	31,700	1,013.00	32,112,100
島根銀行	3,900	644.00	2,511,600
じもとホールディングス	9,900	849.00	8,405,100
めぶきフィナンシャルグループ	763,200	207.00	157,982,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,800	1,143.00	22,631,400
九州フィナンシャルグループ	321,400	440.00	141,416,000
ゆうちょ銀行	416,100	860.00	357,846,000
富山第一銀行	35,000	285.00	9,975,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	838,900	366.00	307,037,400
西日本フィナンシャルホールディングス	97,700	687.00	67,119,900
関西みらいフィナンシャルグループ	86,200	507.00	43,703,400
三十三フィナンシャルグループ	13,600	1,284.00	17,462,400
第四北越フィナンシャルグループ	25,500	2,293.00	58,471,500
ひろぎんホールディングス	216,600	597.00	129,310,200
新生銀行	107,800	1,249.00	134,642,200
あおぞら銀行	87,500	1,924.00	168,350,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,047,300	457.90	4,600,658,670
りそなホールディングス	1,596,800	364.20	581,554,560
三井住友トラスト・ホールディングス	277,600	3,131.00	869,165,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,015,800	3,181.00	3,231,259,800
千葉銀行	490,200	560.00	274,512,000
群馬銀行	282,100	321.00	90,554,100
武蔵野銀行	21,900	1,541.00	33,747,900
千葉興業銀行	40,300	254.00	10,236,200
筑波銀行	61,100	186.00	11,364,600
七十七銀行	49,600	1,423.00	70,580,800
青森銀行	11,400	2,396.00	27,314,400
秋田銀行	9,400	1,355.00	12,737,000
山形銀行	16,500	1,010.00	16,665,000
岩手銀行	9,600	2,092.00	20,083,200
東邦銀行	131,300	213.00	27,966,900
東北銀行	7,000	1,140.00	7,980,000
みちのく銀行	9,400	1,055.00	9,917,000
ふくおかフィナンシャルグループ	123,700	1,878.00	232,308,600
静岡銀行	357,700	757.00	270,778,900
十六銀行	18,400	1,917.00	35,272,800
スルガ銀行	150,300	332.00	49,899,600

八十二銀行	354,500	348.00	123,366,000	
山梨中央銀行	17,100	775.00	13,252,500	
大垣共立銀行	29,000	2,198.00	63,742,000	
福井銀行	12,600	1,836.00	23,133,600	
北國銀行	14,600	2,757.00	40,252,200	
清水銀行	6,100	1,744.00	10,638,400	
富山銀行	2,800	3,060.00	8,568,000	
滋賀銀行	29,500	2,168.00	63,956,000	
南都銀行	24,400	1,805.00	44,042,000	
百五銀行	132,200	307.00	40,585,400	
京都銀行	52,600	5,410.00	284,566,000	
紀陽銀行	52,000	1,516.00	78,832,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	97,800	1,007.00	98,484,600	
山陰合同銀行	87,100	526.00	45,814,600	
中国銀行	126,400	844.00	106,681,600	
鳥取銀行	5,000	1,170.00	5,850,000	
伊予銀行	209,600	662.00	138,755,200	
百十四銀行	15,600	1,531.00	23,883,600	
四国銀行	22,300	689.00	15,364,700	
阿波銀行	24,000	2,420.00	58,080,000	
大分銀行	8,400	2,060.00	17,304,000	
宮崎銀行	9,800	2,221.00	21,765,800	
佐賀銀行	8,900	1,346.00	11,979,400	
沖縄銀行	13,400	2,910.00	38,994,000	
琉球銀行	33,900	798.00	27,052,200	
セブン銀行	490,700	219.00	107,463,300	
みずほフィナンシャルグループ	1,995,800	1,315.50	2,625,474,900	
高知銀行	5,300	814.00	4,314,200	
山口フィナンシャルグループ	183,300	610.00	111,813,000	
長野銀行	4,800	1,473.00	7,070,400	
名古屋銀行	11,000	2,621.00	28,831,000	
北洋銀行	221,400	225.00	49,815,000	
愛知銀行	5,300	3,050.00	16,165,000	
中京銀行	6,000	2,030.00	12,180,000	
大光銀行	5,000	1,331.00	6,655,000	
愛媛銀行	20,500	1,009.00	20,684,500	
トマト銀行	5,700	1,104.00	6,292,800	
京葉銀行	62,600	435.00	27,231,000	
栃木銀行	70,900	175.00	12,407,500	
北日本銀行	4,600	2,008.00	9,236,800	
東和銀行	25,800	615.00	15,867,000	
福島銀行	13,800	205.00	2,829,000	

大東銀行	7,600	638.00	4,848,800
トモニホールディングス	113,500	321.00	36,433,500
フィデアホールディングス	142,600	106.00	15,115,600
池田泉州ホールディングス	168,900	150.00	25,335,000
F P G	45,700	500.00	22,850,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	7,500	1,315.00	9,862,500
マーキュリアインベストメント	6,000	651.00	3,906,000
S B Iホールディングス	168,700	2,965.00	500,195,500
ジャフコ グループ	22,600	4,755.00	107,463,000
大和証券グループ本社	1,179,000	473.30	558,020,700
野村ホールディングス	2,584,700	532.10	1,375,318,870
岡三証券グループ	125,600	377.00	47,351,200
丸三証券	44,000	469.00	20,636,000
東洋証券	53,900	132.00	7,114,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	169,300	307.00	51,975,100
光世証券	3,800	666.00	2,530,800
水戸証券	43,300	228.00	9,872,400
いちよし証券	27,900	466.00	13,001,400
松井証券	84,100	803.00	67,532,300
マネックスグループ	108,300	384.00	41,587,200
極東証券	20,000	690.00	13,800,000
岩井コスモホールディングス	14,000	1,272.00	17,808,000
藍澤証券	26,600	744.00	19,790,400
マネーパートナーズグループ	16,500	213.00	3,514,500
スパークス・グループ	68,600	255.00	17,493,000
かんぽ生命保険	52,000	2,110.00	109,720,000
S O M P Oホールディングス	276,200	4,038.00	1,115,295,600
アニコム ホールディングス	48,800	1,071.00	52,264,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	384,000	3,037.00	1,166,208,000
第一生命ホールディングス	831,100	1,579.00	1,312,306,900
東京海上ホールディングス	519,300	5,247.00	2,724,767,100
T & Dホールディングス	439,000	1,205.00	528,995,000
アドバンスクリエイト	3,100	1,975.00	6,122,500
全国保証	41,400	4,625.00	191,475,000
イントラスト	5,300	859.00	4,552,700
日本モーゲージサービス	6,200	1,137.00	7,049,400
C a s a	5,200	1,058.00	5,501,600
アルヒ	23,400	1,739.00	40,692,600
プレミアグループ	8,000	2,223.00	17,784,000
クレディセゾン	103,000	1,216.00	125,248,000
芙蓉総合リース	15,400	6,830.00	105,182,000
みずほリース	22,700	2,971.00	67,441,700



東京センチュリー	29,600	7,890.00	233,544,000
日本証券金融	65,000	521.00	33,865,000
アイフル	224,500	256.00	57,472,000
リコーリース	11,600	3,045.00	35,322,000
イオンフィナンシャルサービス	90,000	1,268.00	114,120,000
アコム	295,400	458.00	135,293,200
ジャックス	16,300	1,846.00	30,089,800
オリエントコーポレーション	398,300	116.00	46,202,800
日立キャピタル	34,700	2,460.00	85,362,000
オリックス	911,300	1,584.50	1,443,954,850
三菱UFJリース	373,000	491.00	183,143,000
九州リースサービス	7,400	622.00	4,602,800
日本取引所グループ	421,600	2,460.50	1,037,346,800
イー・ギャランティ	16,900	2,154.00	36,402,600
アサックス	7,800	715.00	5,577,000
NECキャピタルソリューション	6,000	1,874.00	11,244,000
いちご	193,200	311.00	60,085,200
日本駐車場開発	161,500	150.00	24,225,000
スター・マイカ・ホールディングス	9,100	1,337.00	12,166,700
ADワークスグループ	27,800	161.00	4,475,800
ヒューリック	313,600	1,088.00	341,196,800
三栄建築設計	7,100	1,710.00	12,141,000
野村不動産ホールディングス	90,200	2,233.00	201,416,600
三重交通グループホールディングス	34,300	472.00	16,189,600
サムティ	22,100	1,758.00	38,851,800
ディア・ライフ	25,900	420.00	10,878,000
日本商業開発	10,600	1,723.00	18,263,800
ハウスコム	4,200	1,329.00	5,581,800
日本管理センター	9,600	1,192.00	11,443,200
サンセイランディック	7,200	740.00	5,328,000
フージャースホールディングス	29,300	711.00	20,832,300
オープンハウス	46,800	3,780.00	176,904,000
東急不動産ホールディングス	403,500	525.00	211,837,500
飯田グループホールディングス	123,500	2,149.00	265,401,500
イーランド	5,200	797.00	4,144,400
ムゲンエステート	13,200	492.00	6,494,400
ハウズドゥ	7,200	1,208.00	8,697,600
シーアールイー	5,400	1,222.00	6,598,800
グッドコムアセット	8,500	1,280.00	10,880,000
ジェイ・エス・ビー	3,400	3,420.00	11,628,000
テンポイノベーション	5,800	824.00	4,779,200
パーク24	80,200	1,815.00	145,563,000

パラカ	5,100	1,604.00	8,180,400
三井不動産	714,900	2,171.50	1,552,405,350
三菱地所	1,030,300	1,649.00	1,698,964,700
平和不動産	27,600	3,590.00	99,084,000
東京建物	146,500	1,413.00	207,004,500
ダイビル	39,400	1,290.00	50,826,000
京阪神ビルディング	24,600	1,853.00	45,583,800
住友不動産	330,800	3,238.00	1,071,130,400
テーオーシー	32,000	705.00	22,560,000
東京楽天地	2,900	4,385.00	12,716,500
スターツコーポレーション	20,700	2,929.00	60,630,300
フジ住宅	20,600	660.00	13,596,000
空港施設	19,300	486.00	9,379,800
明和地所	12,000	553.00	6,636,000
ゴールドクレスト	13,100	1,625.00	21,287,500
エスリード	7,300	1,407.00	10,271,100
日神グループホールディングス	27,300	418.00	11,411,400
日本エスコン	26,600	899.00	23,913,400
タカラレーベン	67,100	310.00	20,801,000
A V A N T I A	10,900	849.00	9,254,100
イオンモール	74,900	1,644.00	123,135,600
毎日コムネット	6,800	704.00	4,787,200
ファースト住建	8,300	1,058.00	8,781,400
カチタス	37,000	3,205.00	118,585,000
トーセイ	22,100	1,201.00	26,542,100
穴吹興産	4,500	1,678.00	7,551,000
サンフロンティア不動産	22,700	904.00	20,520,800
エフ・ジェー・ネクスト	15,000	1,023.00	15,345,000
インテリックス	4,100	528.00	2,164,800
ランドビジネス	5,000	338.00	1,690,000
サンネクスタグループ	6,800	986.00	6,704,800
グランディハウス	17,000	390.00	6,630,000
日本空港ビルデング	47,200	6,690.00	315,768,000
明豊ファシリティワークス	6,900	671.00	4,629,900
日本工営	9,700	2,647.00	25,675,900
L I F U L L	50,300	382.00	19,214,600
ミクシィ	27,200	2,552.00	69,414,400
ジェイエイシーリクルートメント	9,700	1,874.00	18,177,800
日本M&Aセンター	108,900	6,750.00	735,075,000
メンバーズ	4,300	2,183.00	9,386,900
中広	2,700	325.00	877,500
UTグループ	22,500	3,300.00	74,250,000

アイティメディア	5,800	2,269.00	13,160,200
タケエイ	15,800	1,277.00	20,176,600
E・Jホールディングス	5,700	1,024.00	5,836,800
ビーネックスグループ	18,100	1,138.00	20,597,800
コシダカホールディングス	34,900	434.00	15,146,600
アルトナー	3,700	962.00	3,559,400
パソナグループ	15,600	2,248.00	35,068,800
CDS	3,700	1,370.00	5,069,000
リンクアンドモチベーション	26,100	571.00	14,903,100
GCA	18,800	757.00	14,231,600
エス・エム・エス	44,400	3,825.00	169,830,000
サニーサイドアップグループ	5,300	645.00	3,418,500
パーソルホールディングス	142,400	2,008.00	285,939,200
リニカル	7,200	731.00	5,263,200
クックパッド	45,500	326.00	14,833,000
アイ・ケイ・ケイ	7,400	634.00	4,691,600
学情	5,300	1,397.00	7,404,100
スタジオアリス	7,300	1,980.00	14,454,000
シミックホールディングス	7,200	1,341.00	9,655,200
エプロ	3,700	1,001.00	3,703,700
NJS	3,600	2,094.00	7,538,400
総合警備保障	56,700	5,270.00	298,809,000
カカクコム	105,200	2,851.00	299,925,200
アイロムグループ	5,100	1,675.00	8,542,500
セントケア・ホールディング	9,500	873.00	8,293,500
サイネックス	2,800	679.00	1,901,200
ルネサンス	8,200	920.00	7,544,000
ディップ	19,600	2,801.00	54,899,600
デジタルホールディングス	10,100	1,802.00	18,200,200
ツクイホールディングス	34,000	550.00	18,700,000
キャリアデザインセンター	3,500	980.00	3,430,000
ベネフィット・ワン	51,900	3,095.00	160,630,500
エムスリー	313,800	9,361.00	2,937,481,800
ツカダ・グローバルホールディング	11,300	259.00	2,926,700
アウトソーシング	81,700	1,427.00	116,585,900
ウェルネット	14,900	467.00	6,958,300
ワールドホールディングス	5,000	2,077.00	10,385,000
ディー・エヌ・エー	60,300	1,877.00	113,183,100
博報堂DYホールディングス	198,100	1,409.00	279,122,900
ぐるなび	25,300	533.00	13,484,900
タカミヤ	15,600	525.00	8,190,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	894.00	10,012,800

ファンコミュニケーションズ	39,700	437.00	17,348,900
ライク	4,800	2,046.00	9,820,800
ビジネス・ブレークスルー	6,600	443.00	2,923,800
エスプール	36,900	730.00	26,937,000
WDBホールディングス	6,600	2,744.00	18,110,400
手間いらず	900	5,340.00	4,806,000
ティア	8,900	408.00	3,631,200
CDG	1,700	1,586.00	2,696,200
バリューコマース	9,600	3,240.00	31,104,000
インフォマート	144,200	936.00	134,971,200
J Pホールディングス	45,600	287.00	13,087,200
エコナックホールディングス	28,600	91.00	2,602,600
E P Sホールディングス	19,500	993.00	19,363,500
レグス	3,700	1,911.00	7,070,700
プレステージ・インターナショナル	53,600	901.00	48,293,600
アミューズ	7,900	2,666.00	21,061,400
ドリームインキュベータ	4,500	1,335.00	6,007,500
クイック	9,100	1,091.00	9,928,100
T A C	9,800	244.00	2,391,200
ケネディクス	122,700	748.00	91,779,600
電通グループ	160,100	3,235.00	517,923,500
イオンファンタジー	5,600	2,402.00	13,451,200
シーティーエス	16,300	1,013.00	16,511,900
ネクシィーズグループ	4,600	908.00	4,176,800
H . U . グループホールディングス	39,900	2,918.00	116,428,200
アルプス技研	12,700	2,140.00	27,178,000
ダイオーズ	3,100	961.00	2,979,100
日本空調サービス	15,200	778.00	11,825,600
オリエンタルランド	151,400	16,645.00	2,520,053,000
ダスキン	35,500	2,904.00	103,092,000
明光ネットワークジャパン	18,500	572.00	10,582,000
ファルコホールディングス	8,000	1,655.00	13,240,000
ラウンドワン	40,000	924.00	36,960,000
リゾートトラスト	65,400	1,528.00	99,931,200
ビー・エム・エル	18,400	3,390.00	62,376,000
りらいあコミュニケーションズ	24,900	1,354.00	33,714,600
リソー教育	65,900	304.00	20,033,600
早稲田アカデミー	6,400	1,016.00	6,502,400
ユー・エス・エス	159,400	2,080.00	331,552,000
東京個別指導学院	5,500	648.00	3,564,000
サイバーエージェント	87,700	7,020.00	615,654,000
楽天	663,500	1,035.00	686,722,500

クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,096.00	8,439,200
モーニングスター	16,100	457.00	7,357,700
テー・オー・ダブリュー	23,600	270.00	6,372,000
山田コンサルティンググループ	9,500	992.00	9,424,000
セントラルスポーツ	5,400	2,228.00	12,031,200
フルキャストホールディングス	12,600	1,752.00	22,075,200
エン・ジャパン	25,400	3,300.00	83,820,000
リソルホールディングス	1,600	3,935.00	6,296,000
テクノプロ・ホールディングス	28,400	8,470.00	240,548,000
アトラ	3,300	346.00	1,141,800
インターワークス	3,600	343.00	1,234,800
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	15,570.00	90,306,000
Keeper 技研	10,600	2,269.00	24,051,400
ファーストロジック	3,100	777.00	2,408,700
三機サービス	3,000	980.00	2,940,000
Gunosy	9,200	735.00	6,762,000
デザインワン・ジャパン	5,400	208.00	1,123,200
イー・ガーディアン	6,300	3,015.00	18,994,500
リブセンス	8,900	233.00	2,073,700
ジャパンマテリアル	43,900	1,408.00	61,811,200
ベクトル	18,000	933.00	16,794,000
ウチヤマホールディングス	7,900	307.00	2,425,300
チャーム・ケア・コーポレーション	12,300	1,285.00	15,805,500
キャリアリンク	4,800	2,016.00	9,676,800
I B J	12,000	803.00	9,636,000
アサンテ	5,900	1,474.00	8,696,600
N・フィールド	10,100	883.00	8,918,300
バリューHR	5,800	1,760.00	10,208,000
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	6,060.00	70,296,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,600	1,980.00	11,088,000
E R Iホールディングス	4,400	685.00	3,014,000
アビスト	2,300	2,994.00	6,886,200
シグマクシス	9,900	1,800.00	17,820,000
ウィルグループ	9,600	1,009.00	9,686,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,800	319.00	6,954,200
メドピア	6,700	6,940.00	46,498,000
リクルートホールディングス	1,019,400	4,156.00	4,236,626,400
エラン	9,900	2,956.00	29,264,400
土木管理総合試験所	7,700	348.00	2,679,600
ネットマーケティング	5,900	647.00	3,817,300
日本郵政	1,166,700	802.10	935,810,070
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,653.00	39,672,000

鎌倉新書	11,000	1,173.00	12,903,000
S MN	3,400	754.00	2,563,600
L I T A L I C O	5,000	3,590.00	17,950,000
グローバルキッズCOMPANY	2,900	981.00	2,844,900
エアトリ	7,700	1,243.00	9,571,100
アトラエ	4,400	2,560.00	11,264,000
ストライク	5,400	5,980.00	32,292,000
ソラスト	39,400	1,495.00	58,903,000
セラク	4,600	2,316.00	10,653,600
インソース	6,000	3,485.00	20,910,000
バイカレント・コンサルティング	8,600	16,460.00	141,556,000
Orchestra Holdings	3,100	2,243.00	6,953,300
アイモバイル	5,300	1,217.00	6,450,100
キャリアインデックス	6,200	688.00	4,265,600
MS - J a p a n	5,000	962.00	4,810,000
船場	3,100	914.00	2,833,400
グレイステクノロジー	6,600	7,120.00	46,992,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,400	4,775.00	78,310,000
フルテック	2,200	1,546.00	3,401,200
グリーンズ	3,600	465.00	1,674,000
GameWith	4,700	604.00	2,838,800
ソウルドアウト	3,600	1,455.00	5,238,000
MS&Consulting	3,100	606.00	1,878,600
エル・ティー・エス	1,100	4,225.00	4,647,500
ミダック	1,900	3,520.00	6,688,000
日総工産	9,800	694.00	6,801,200
キュービーネットホールディングス	6,100	1,452.00	8,857,200
RPAホールディングス	11,200	639.00	7,156,800
スプリックス	4,300	801.00	3,444,300
マネジメントソリューションズ	7,100	1,785.00	12,673,500
プロレド・パートナーズ	2,000	3,985.00	7,970,000
フロンティア・マネジメント	1,200	5,040.00	6,048,000
ピアラ	800	2,243.00	1,794,400
コプロ・ホールディングス	1,000	3,340.00	3,340,000
ギークス	1,700	1,111.00	1,888,700
カーブスホールディングス	39,400	738.00	29,077,200
フォーラムエンジニアリング	7,700	869.00	6,691,300
ダイレクトマーケティングミックス	5,700	2,657.00	15,144,900
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	662.00	5,031,200
リログループ	77,900	2,612.00	203,474,800
東祥	9,100	1,572.00	14,305,200
エイチ・アイ・エス	20,700	1,634.00	33,823,800

ラックランド	4,200	2,380.00	9,996,000	
共立メンテナンス	23,600	3,950.00	93,220,000	
イチネンホールディングス	16,100	1,283.00	20,656,300	
建設技術研究所	9,300	2,176.00	20,236,800	
スペース	9,600	822.00	7,891,200	
長大	5,900	1,393.00	8,218,700	
燦ホールディングス	6,400	1,245.00	7,968,000	
スバル興業	900	8,620.00	7,758,000	
東京テアトル	5,800	1,300.00	7,540,000	
タナベ経営	2,900	1,333.00	3,865,700	
ナガワ	4,600	9,370.00	43,102,000	
よみうりランド	3,100	6,020.00	18,662,000	
東京都競馬	9,400	4,565.00	42,911,000	
カナモト	25,200	2,257.00	56,876,400	
東京ドーム	57,800	1,300.00	75,140,000	
西尾レントオール	13,300	2,157.00	28,688,100	
トランス・コスモス	13,600	2,708.00	36,828,800	
乃村工藝社	61,300	835.00	51,185,500	
藤田観光	5,600	1,435.00	8,036,000	
KNT-CTホールディングス	8,800	901.00	7,928,800	
日本管財	15,400	2,046.00	31,508,400	
トーカイ	13,900	2,073.00	28,814,700	
セコム	151,000	9,394.00	1,418,494,000	
セントラル警備保障	6,900	3,575.00	24,667,500	
丹青社	27,200	835.00	22,712,000	
メイテック	17,500	5,160.00	90,300,000	
応用地質	16,800	1,233.00	20,714,400	
船井総研ホールディングス	29,500	2,568.00	75,756,000	
進学会ホールディングス	6,200	449.00	2,783,800	
オオバ	10,500	737.00	7,738,500	
いであ	3,600	1,826.00	6,573,600	
学究社	4,400	1,288.00	5,667,200	
ベネッセホールディングス	47,500	2,068.00	98,230,000	
イオンディライト	17,600	2,614.00	46,006,400	
ナック	8,200	928.00	7,609,600	
ダイセキ	23,900	3,045.00	72,775,500	
ステップ	5,400	1,597.00	8,623,800	
合計	155,826,700		369,080,413,220	

## (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。

## マネープールマザーファンド

## 貸借対照表

項目	2020年12月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	432,247,252,348
流動資産合計	432,247,252,348
資産合計	432,247,252,348
負債の部	
流動負債	
未払解約金	999,631
未払利息	329,692
流動負債合計	1,329,323
負債合計	1,329,323
純資産の部	
元本等	
元本	431,429,543,849
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	816,379,176
元本等合計	432,245,923,025
純資産合計	432,245,923,025
負債純資産合計	432,247,252,348

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年12月21日現在	
	1. 計算期間の末日における受益権の総数	
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)	1.0019円 (10,019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

	2020年12月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年12月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	528,832,318,446円
期中追加設定元本額	263,395,386,647円
期中一部解約元本額	360,798,161,244円
期末元本額	431,429,543,849円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9,963円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,992,033円
バンクローン・オープン（円コース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（豪ドルコース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（米ドルコース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（ユーロコース）（SMA専用）	1,993円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	9,961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（年1回決算型）（円コース）	9,960円

区分	2020年12月21日現在
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
欧州REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	996円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	9,957円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	996円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)	9,970円

区分	2020年12月21日現在
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
M S I Mグローバル株式コンセントレイト・ファンド(SMA専用)	9,979円
225ベアファンド6(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	79,088,608,682円
225ベアファンド7(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	114,786,354,952円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド(適格機関投資家専用)	607,915,273円
米国国債ベアファンド(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	1,693,023,732円
日本債券ベアファンド4(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	760,935,151円
ドイツ中期国債ベアファンド3(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	956,061,117円
T O P I Xベアファンド2(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	32,791,358,394円
T O P I XベアファンドR(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	15,599,072,892円
225ベアファンド8(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	22,749,283,975円
225ベアファンド9(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	4,413,389,477円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド(適格機関投資家専用)	1,390,191,638円
225ベアファンド10(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	13,180,772,188円
T O P I XベアファンドR2(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	38,964,677,216円
T O P I XベアファンドF(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	103,281,703,349円
T O P I XベアファンドF2(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	299,044円
米国株式ベアファンド4(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	1,108,432,634円
北米株配当戦略投信2018-11(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	9,982円
私募マネープールファンドAL(適格機関投資家専用)	32,735,269円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 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

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

該当事項はありません。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2020年12月22日から2021年6月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2020年12月21日現在）	第7期中間計算期間 （2021年 6月21日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,078,881,377	2,047,295,647
投資信託受益証券	42,934,880,439	52,336,543,475
親投資信託受益証券	99,517,577,636	76,169,105,803
未収入金	352,352,480	600,213,376
流動資産合計	143,883,691,932	131,153,158,301
資産合計	143,883,691,932	131,153,158,301
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	541,745,951	630,714,064
未払受託者報酬	22,389,661	22,338,414
未払委託者報酬	388,087,396	387,199,091
未払利息	822	3,035
その他未払費用	1,119,617	1,112,644
流動負債合計	953,343,447	1,041,367,248
負債合計	953,343,447	1,041,367,248
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	103,111,892,400	86,497,304,888
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	39,818,456,085	43,614,486,165
（分配準備積立金）	22,605,290,138	17,128,900,981
元本等合計	142,930,348,485	130,111,791,053
純資産合計	142,930,348,485	130,111,791,053
負債純資産合計	143,883,691,932	131,153,158,301

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日	第7期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年 6月21日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	-	119,855,799
受取利息	2,906	1,203
有価証券売買等損益	8,010,427,092	11,946,342,071
<b>営業収益合計</b>	<b>8,010,424,186</b>	<b>12,066,199,073</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	338,700	221,843
受託者報酬	21,119,493	22,338,414
委託者報酬	366,071,181	387,199,091
その他費用	1,096,437	1,112,644
<b>営業費用合計</b>	<b>388,625,811</b>	<b>410,871,992</b>
営業利益又は営業損失（ ）	8,399,049,997	11,655,327,081
経常利益又は経常損失（ ）	8,399,049,997	11,655,327,081
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,399,049,997	11,655,327,081
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,273,102,307	2,357,754,316
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,335,618,880	39,818,456,085
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,330,512,676	4,524,538,418
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,330,512,676	4,524,538,418
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,255,519,597	10,026,081,103
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,255,519,597	10,026,081,103
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	24,284,664,269	43,614,486,165



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	(2)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。
3. その他	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は2020年12月22日から2021年 6月21日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第6期 (2020年12月21日現在)	第7期中間計算期間 (2021年 6月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	103,111,892,400口	86,497,304,888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) 1.3862円 (13,862円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5042円 (15,042円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第7期中間計算期間 (2021年 6月21日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (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6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第7期中間計算期間 自 2020年12月22日 至 2021年 6月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	111,459,702,379円	103,111,892,400円
期中追加設定元本額	23,651,763,751円	9,178,477,113円
期中一部解約元本額	31,999,573,730円	25,793,064,625円

## (デリバティブ取引に関する注記)

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、中間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。

## J P X日経インデックス400 マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 6月21日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	880,893,428
株式	30,432,876,820
未収配当金	185,953,026
前払金	15,325,320
差入委託証拠金	8,109,500
流動資産合計	31,523,158,094
資産合計	31,523,158,094
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,328,730
未払解約金	595,194,827
未払利息	1,306
流動負債合計	610,524,863
負債合計	610,524,863
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	17,843,437,198
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,069,196,033
元本等合計	30,912,633,231
純資産合計	30,912,633,231
負債純資産合計	31,523,158,094

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 6月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

	2021年 6月21日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 6月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,843,437,198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 1.7324円 (1万口当たり純資産額) (17,324円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

2021年 6月21日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 6月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	29,602,777,090円
期中追加設定元本額	2,688,199,255円
期中一部解約元本額	14,447,539,147円
期末元本額	17,843,437,198円
期末元本額の内訳	
SMT J P X日経インデックス400・オープン	4,509,981,126円
SMTAM J P X日経インデックス400オープン	766,162,079円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	10,971,868,547円
J P X日経インデックス400・オープン（SMA専用）	656,962,675円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	277,851,505円
J P X日経400オープン（適格機関投資家専用）	660,611,266円

## （デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 6月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引		うち1年超	(円)

	買建	493,252,320	-	477,927,000	15,325,320
	合計	493,252,320	-	477,927,000	15,325,320

## (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。

## 中小型株式 マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 6月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,421,588,727
株式	30,534,248,000
未収入金	696,928,948
未収配当金	91,969,000
流動資産合計	32,744,734,675
資産合計	32,744,734,675
負債の部	
流動負債	
未払金	146,440,497
未払解約金	503,338,588
未払利息	2,107
流動負債合計	649,781,192
負債合計	649,781,192
純資産の部	
元本等	
元本	6,173,816,050
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	25,921,137,433
元本等合計	32,094,953,483
純資産合計	32,094,953,483
負債純資産合計	32,744,734,675

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

	2021年 6月21日現在
	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。

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 6月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,173,816,050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 5.1986円 (1万口当たり純資産額) (51,986円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 6月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 6月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	7,134,569,073円
期中追加設定元本額	70,178,134円
期中一部解約元本額	1,030,931,157円
期末元本額	6,173,816,050円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	3,359,132,370円
中小型株式オープン（SMA専用）	292,208,353円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,460,158,651円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	62,316,676円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	2021年 6月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,603,220,146
株式	450,510,655,560
未収配当金	2,582,299,585
前払金	176,850,000
差入委託証拠金	133,315,000
流動資産合計	457,006,340,291
資産合計	457,006,340,291
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	176,853,850
未払金	6,080,000
未払解約金	102,725,697
未払利息	5,342
流動負債合計	285,664,889
負債合計	285,664,889
純資産の部	
元本等	
元本	249,263,594,199
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	207,457,081,203



	2021年 6月21日現在
項目	金額（円）
元本等合計	456,720,675,402
純資産合計	456,720,675,402
負債純資産合計	457,006,340,291

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 6月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 6月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	249,263,594,199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 1.8323円 (1万口当たり純資産額) (18,323円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 6月21日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 6月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	217,632,289,463円
期中追加設定元本額	54,505,234,074円
期中一部解約元本額	22,873,929,338円
期末元本額	249,263,594,199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)	424,821,656円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,871,109,692円

区分	2021年 6月21日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,712,867円
S M T T O P I X インデックス・オープン	10,447,617,010円
世界経済インデックスファンド	2,726,180,302円
日本株式インデックス・オープン	3,554,955,216円
D C マイセレクション 2 5	6,029,859,968円
D C マイセレクション 5 0	17,815,406,921円
D C マイセレクション 7 5	17,468,680,860円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,786,323,535円
D C マイセレクション S 2 5	2,849,486,826円
D C マイセレクション S 5 0	8,427,961,427円
D C マイセレクション S 7 5	5,951,988,281円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,482,779,012円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	248,338,921円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	649,394,256円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	462,731,315円
D C 世界経済インデックスファンド	3,192,341,310円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,533,541,222円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	25,297,047円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	198,796,196円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	49,034,856円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	170,985,948円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	30,043,192円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	97,548,884円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,159,550,837円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	481,671,179円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,081,843,100円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	254,708,283円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	28,587,703円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	556,996,171円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	318,403,754円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	399,782,482円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	41,816,544円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	647,958,597円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	3,731,672,493円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,859,161,925円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,627,336,157円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,169,363,685円
分散投資コア戦略ファンド A	2,047,093,068円
分散投資コア戦略ファンド S	7,251,551,602円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	398,988,786円

区分	2021年 6月21日現在
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	383,039,304円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,069,376,596円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	204,641,326円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,341,179円
S M T インデックスバランス・オープン	59,639,926円
国内株式S M T Bセクション(S M A専用)	24,216,585,712円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	617,812,436円
S M T 世界経済インデックス・オープン	34,040,379円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	113,198,105円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,355,953円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,913,063円
グローバル経済コア	234,157,628円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	22,312,729円
i - S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	58,952,551円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	7,962,785円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,165,542,032円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	131,698,810円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2 0 3 0	4,061,834円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2 0 4 0	2,795,042円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2 0 5 0	1,155,582円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2 0 6 0	876,899円
F O F s 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)	42,381,913,883円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,190,337,978円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	162,635,515円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,615,873円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	46,536,929,192円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2021年 6月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,161,850,000	-	5,985,000,000	176,850,000
	合計	6,161,850,000	-	5,985,000,000	176,850,000

(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。

## マネープールマザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 6月21日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	355,972,941,049
流動資産合計	355,972,941,049
資産合計	355,972,941,049
負債の部	
流動負債	
未払解約金	30
未払利息	527,815
流動負債合計	527,845
負債合計	527,845
純資産の部	
元本等	
元本	355,348,645,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	623,767,585
元本等合計	355,972,413,204
純資産合計	355,972,413,204
負債純資産合計	355,972,941,049

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 6月21日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	355,348,645,619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 1.0018円 (1万口当たり純資産額) (10,018円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2021年 6月21日現在
1.	貸借対照表計上額、時価及びその差 額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	2021年 6月21日現在
2.時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 6月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	431,429,543,849円
期中追加設定元本額	79,550,075,646円
期中一部解約元本額	155,630,973,876円
期末元本額	355,348,645,619円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円

区分	2021年 6月21日現在
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	1,993円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	996円

区分	2021年 6月21日現在
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド（SMA専用）	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド（適格機関投資家専用）	18,365,106,299円
225ベアファンド6（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	1,374,768,429円
225ベアファンド7（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	98,725,537,820円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド（適格機関投資家専用）	3,602,226,083円
米国国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	2,273,296,476円
日本債券ベアファンド4（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	760,301,707円
ドイツ中期国債ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	954,799,220円
TOPIXベアファンド2（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	23,175,902,160円
TOPIXベアファンドR（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	17,367,933,662円
225ベアファンド8（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	21,827,692,985円
225ベアファンド9（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	2,634,990,853円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド（適格機関投資家専用）	4,053,112,675円
225ベアファンド10（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	1,539,280,245円
TOPIXベアファンドR2（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	33,215,244,043円
TOPIXベアファンドF（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	88,331,803,512円
TOPIXベアファンドF2（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	37,113,642,601円
TOPIXベアファンドF3（建玉数量固定型/リセットありZ）（適格機関投資家専用）	299,461円
北米株配当戦略投信2018-11（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）	9,983円
私募マネープールファンドAL（適格機関投資家専用）	7,971,468円



（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## 【純資産額計算書】

(2021年 7月30日現在)

資産総額	133,486,100,964円
負債総額	187,944,592円
純資産総額（ - ）	133,298,156,372円
発行済口数	88,683,304,092口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5031円
（1万口当たり純資産額）	（15,031円）

(参考)

## J P X日経インデックス400 マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	33,173,696,944円
負債総額	360,766,667円
純資産総額（ - ）	32,812,930,277円
発行済口数	18,986,516,196口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7282円
（1万口当たり純資産額）	（17,282円）

## 中小型株式 マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	31,846,546,753円
負債総額	252,880,004円
純資産総額（ - ）	31,593,666,749円
発行済口数	6,039,830,260口
1口当たり純資産額（ / ）	5.2309円
（1万口当たり純資産額）	（52,309円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	464,224,984,794円
負債総額	1,364,308,081円
純資産総額（ - ）	462,860,676,713円
発行済口数	252,090,254,402口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8361円
（1万口当たり純資産額）	（18,361円）

## マネープールマザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 7月30日現在)

資産総額	372,105,078,504円
負債総額	735,792円
純資産総額（ - ）	372,104,342,712円
発行済口数	371,475,674,654口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0017円
（1万口当たり純資産額）	（10,017円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2021年7月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2021年 9月21日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	14,468,851
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	287,195
単位型公社債投資信託	49	314,283
合計	656	15,070,328

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

(単位: 百万円)

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

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	305	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## (2) 【損益計算書】



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

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

(自 2019年4月1日  
至 2020年3月31日)(自 2020年4月1日  
至 2021年3月31日)

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

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7．ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

効性を判定しております。

#### 8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

#### 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

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

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	21,589	21,589	-
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	-
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	-
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-



投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

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

##### (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

#### 3. 確定拠出制度

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

#### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

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

## [関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
-------	------

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

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

親会社 の子会 社	三井住 友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	-	営業上の 取引 役員の兼 任	運用受託報 酬	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年 9月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社



当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載すること

があります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年2月19日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印  
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」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2019年12月21日から2020年12月21日までの計算期間の財務諸表、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、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2020年12月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年8月13日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2020年12月22日から2021年6月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2021年6月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月22日から2021年6月21日まで）の損益の状況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、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、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の責任

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

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

## 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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 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、経営者に対して、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

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

以 上

(注) 1. 上記は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。