

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年9月24日提出
【計算期間】	第15期(自 2020年6月26日至 2021年6月25日)
【ファンド名】	日本株式インデックス・オープン（SMA専用）
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、わが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指します。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

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	日本			TOPIX	条件付運用型
債券 一般	年4回	北米	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
公債 社債 その他債券	年6回 (隔月)	欧州				
クレジット属 性 ( )	年12回 (毎月)	アジア				その他 ( )
不動産投信	日々	オセアニア				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))	その他 ( )	中南米				
資産複合 ( )		アフリカ				
資産配分 固定型 資産配分 変更型		中近東 (中東)				
		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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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 ]

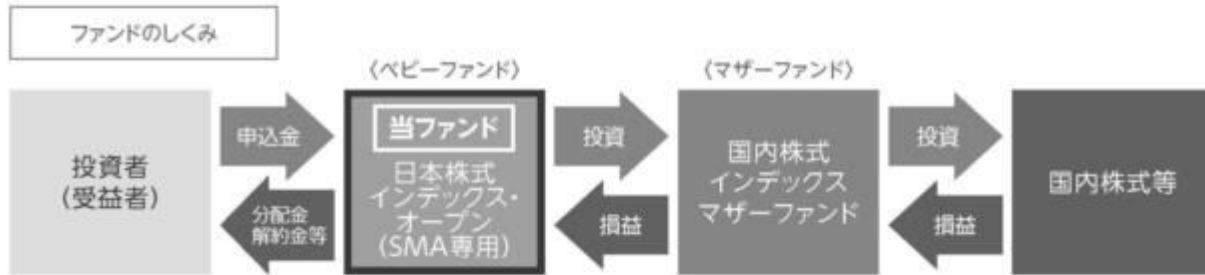
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 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. わが国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。



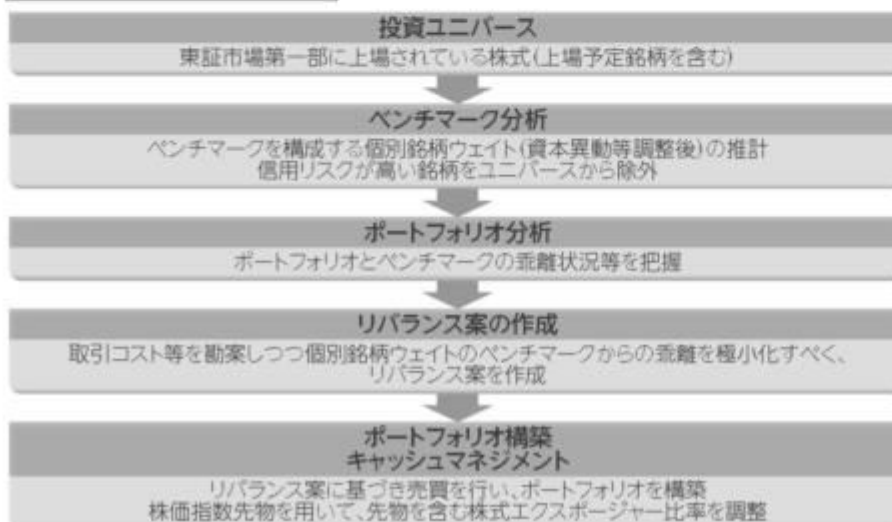
## ? ファミリーファンド方式とは

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

### 〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場されている 株式	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。

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

### ? TOPIX(東証株価指数)とは

インデックスの概要 (2021年7月末現在)		東証一部時価総額上位10銘柄		
構成国	1か国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,189銘柄	1	トヨタ自動車	159,968
時価総額	約420兆円	2	ソニーグループ	114,756
※上記時価総額は浮動株ベース		3	キーエンス	96,021
		4	ソフトバンクグループ	85,734
		5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	62,857
		6	リクルートホールディングス	62,053
		7	任天堂	51,983
		8	日本電信電話	51,801
		9	信越化学工業	51,770
		10	武田薬品工業	49,335
		※上記時価総額は浮動株ベース		

(出所) 株式会社東京証券取引所のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※「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。

TOPIX(東証株価指数)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。



**分配方針**

- 原則として、毎年6月25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**

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は行いません。

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】**

- |            |   |
|------------|---|
| 2007年2月16日 | 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始  |
| 2012年4月 1日 | 本ファンドの名称を「STAM日本株式インデックス・オープン（SMA専用）」から「日本株式インデックス・オープン（SMA専用）」に変更<br>本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更 |

**(3) 【ファンドの仕組み】**

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2021年 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】

### （イ）基本方針

本ファンドは、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。

### （ロ）運用方法

#### 投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

なお、株式等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)株式以外の資産（他の投資信託受益証券（振替投資信託受益権を含む）を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資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、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- 5)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。
- 6)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。

## （２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに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.株券または新株引受権証書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

- 1.預金
- 2.指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3.コール・ローン
- 4.手形割引市場において売買される手形
- 5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二)前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、

委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記（八）第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## （参考）マザーファンドの概要

### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### （1）投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### （2）投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに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。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

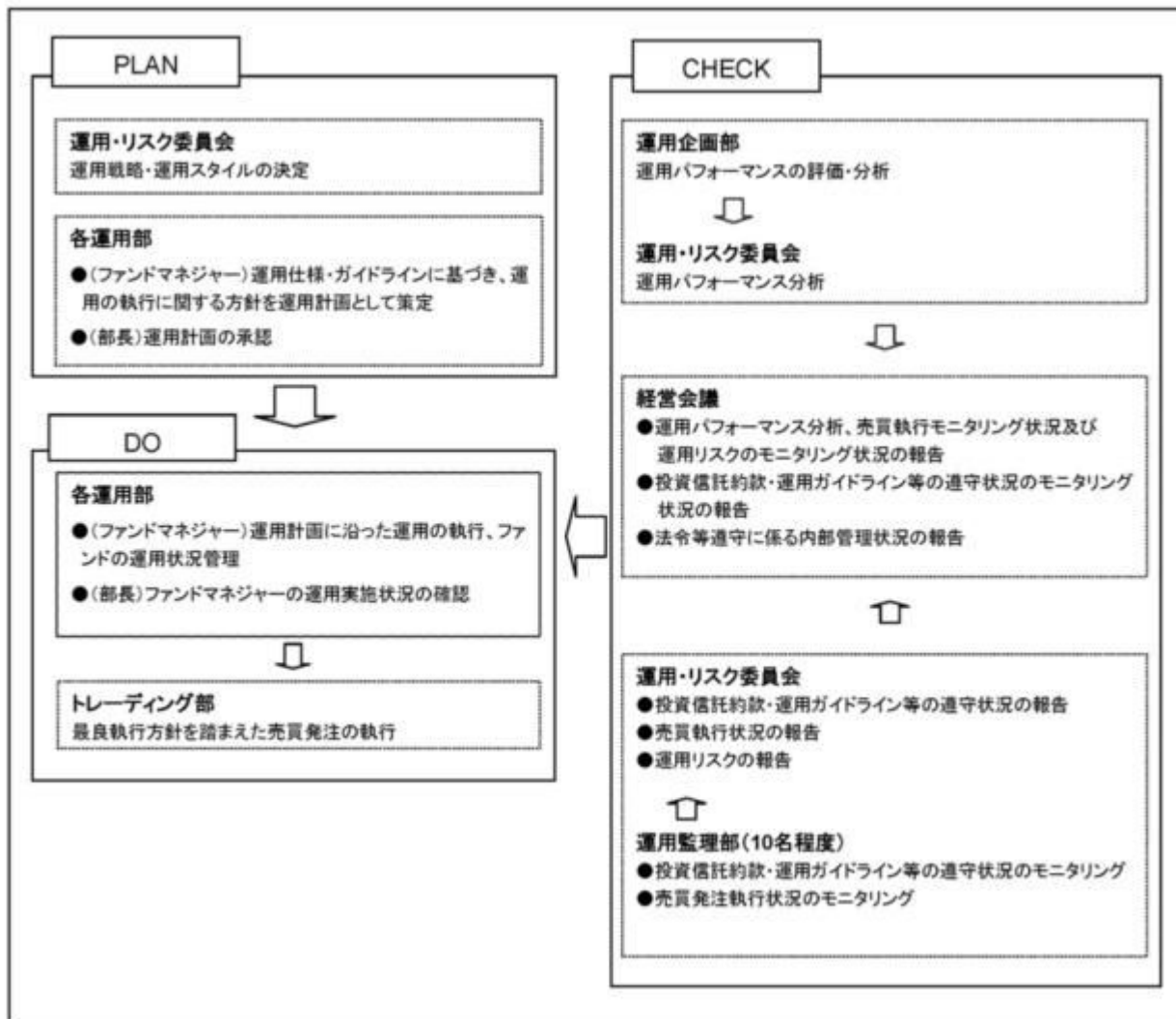
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に

したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### （３）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【配分方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲については、経費控除後の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。
- ・ 分配については、委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないこともあります。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならび

に投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（投資信託約款第23条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第24条）

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第31条）

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

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

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



乗じて得た額をいいます。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 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 >

ファンドは、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が、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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。

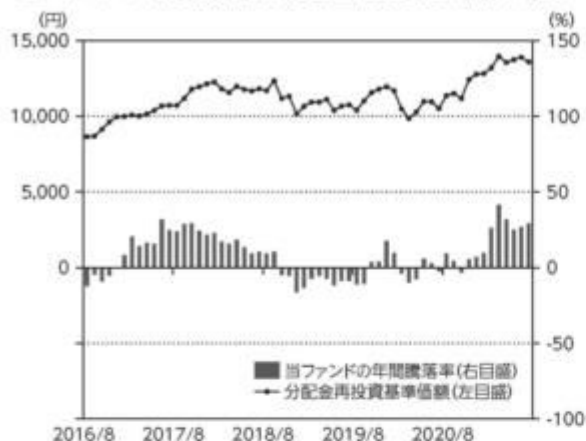
## (2) リスクの管理体制

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】

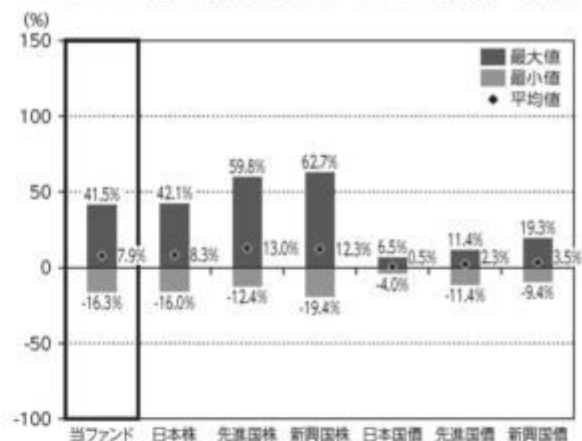
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、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固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社が、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債・インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債・インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤集または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPM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・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.407%（税抜 0.37%）（ ）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 0.132% (税抜 0.12%)	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 0.198% (税抜 0.18%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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。

##### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込

手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)に当たります。

- ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ. 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の「普通分配金と元本払戻金(特別分配金)」について)をご参照ください。)

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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。

### 【日本株式インデックス・オープン(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(%)
親投資信託受益証券	日本	2,858,449,930	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,449,715	0.05
合計(純資産総額)		2,859,899,645	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

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

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,556,805,147	1.8925	2,946,398,923	1.8361	2,858,449,930	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(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6期計算期間末 (2012年 6月25日)	3,928,359,394	3,928,359,394	4,569	4,569
第7期計算期間末 (2013年 6月25日)	324,037,180	324,037,180	6,721	6,721
第8期計算期間末 (2014年 6月25日)	421,829,003	421,829,003	7,970	7,970
第9期計算期間末 (2015年 6月25日)	462,803,071	462,803,071	10,698	10,698
第10期計算期間末 (2016年 6月27日)	399,546,072	399,546,072	7,968	7,968
第11期計算期間末 (2017年 6月26日)	473,027,168	473,027,168	10,666	10,666
第12期計算期間末 (2018年 6月25日)	600,485,748	600,485,748	11,635	11,635
第13期計算期間末 (2019年 6月25日)	1,610,423,900	1,610,423,900	10,595	10,595
第14期計算期間末 (2020年 6月25日)	1,570,256,552	1,570,256,552	10,957	10,957
第15期計算期間末 (2021年 6月25日)	2,908,068,863	2,908,068,863	14,010	14,010
2020年 7月末日	1,503,294,124		10,507	
8月末日	1,592,935,135		11,360	
9月末日	2,754,644,515		11,504	
10月末日	2,563,891,749		11,174	
11月末日	2,712,884,466		12,417	

12月末日	2,771,733,290		12,781
2021年 1月末日	2,805,639,688		12,806
2月末日	2,659,829,677		13,200
3月末日	2,912,895,079		13,948
4月末日	2,814,185,175		13,549
5月末日	2,831,400,176		13,730
6月末日	2,888,423,853		13,888
7月末日	2,859,899,645		13,581

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	0
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	0
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	0
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	0
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	0
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	0
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	0
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	0
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	0
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	8.1
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	47.1
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	18.6
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	34.2
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	25.5
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	33.9
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	9.1
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	8.9
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	3.4
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	27.9

(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6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	6,367,958,848	3,270,880,713	8,597,216,405
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	833,004,843	8,948,125,655	482,095,593
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	240,217,610	193,049,580	529,263,623
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	267,031,202	363,702,679	432,592,146
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	168,629,406	99,774,600	501,446,952
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	105,855,663	163,810,500	443,492,115
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	205,570,147	132,941,629	516,120,633
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	1,166,396,443	162,578,396	1,519,938,680
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	390,544,895	477,351,199	1,433,132,376
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	1,441,950,295	799,305,694	2,075,776,977

(注)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)

## 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。

#### 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	0.09
		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。

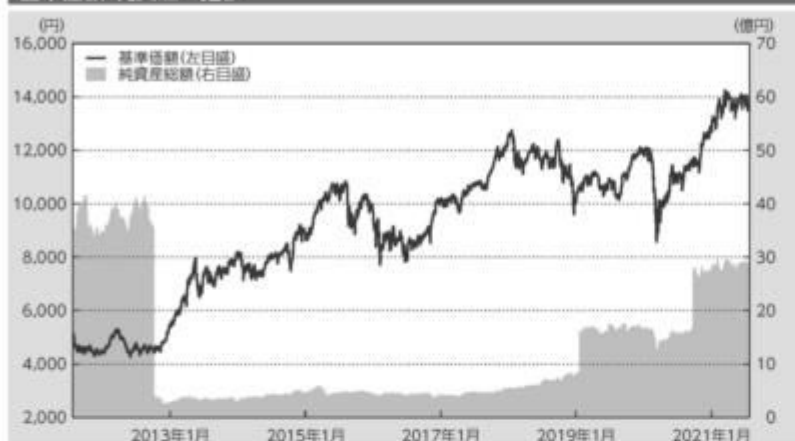
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 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：2007年2月16日  
作成基準日：2021年7月30日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	13,581円
純資産総額	28.60億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

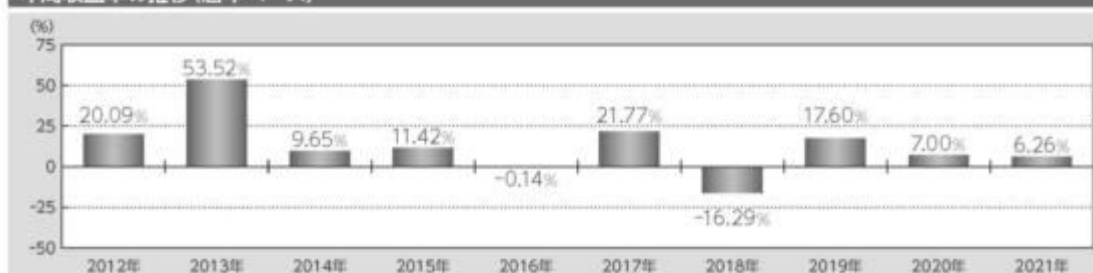
決算期	分配金
2017年6月	0円
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.8%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.7%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.5%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.5%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.2%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.2%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.2%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**

※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

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。

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

受益権取得申込者は、販売会社と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 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付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 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所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、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

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

### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

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

1口単位とします。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（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、4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、取引所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、一部解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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>

マザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

#### （３）【信託期間】

無期限とします。（2007年 2月16日設定）

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

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25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ち、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5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任し

た場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎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、）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、）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15期計算期間(2020年6月26日から2021年6月25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】

## 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 （2020年 6月25日現在）	第15期 （2021年 6月25日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,961,239	7,321,902
親投資信託受益証券	1,569,462,064	2,906,626,431
未収入金	36,626	31,151
流動資産合計	1,573,459,929	2,913,979,484
資産合計	1,573,459,929	2,913,979,484
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	589,411	1,092,378
未払委託者報酬	2,525,962	4,681,570
未払利息	5	11
その他未払費用	87,999	136,662
流動負債合計	3,203,377	5,910,621
負債合計	3,203,377	5,910,621
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,433,132,376	2,075,776,977
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	137,124,176	832,291,886
（分配準備積立金）	117,240,134	564,146,869
元本等合計	1,570,256,552	2,908,068,863
純資産合計	1,570,256,552	2,908,068,863
負債純資産合計	1,573,459,929	2,913,979,484

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2019年 6月26日 至 2020年 6月25日	自	2020年 6月26日 至 2021年 6月25日
営業収益				
受取利息		7		17
有価証券売買等損益		71,326,397		645,842,884
営業収益合計		71,326,404		645,842,901
営業費用				
支払利息		1,319		1,594
受託者報酬		1,233,700		1,914,944
委託者報酬		5,287,136		8,206,785
その他費用		87,999		136,662
営業費用合計		6,610,154		10,259,985
営業利益又は営業損失（ ）		64,716,250		635,582,916
経常利益又は経常損失（ ）		64,716,250		635,582,916
当期純利益又は当期純損失（ ）		64,716,250		635,582,916
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（ ）		16,046,315		120,215,220
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		90,485,220		137,124,176
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,432,231		279,052,623
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		27,432,231		279,052,623
剰余金減少額又は欠損金増加額		29,463,210		99,252,609
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		29,463,210		99,252,609
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		137,124,176		832,291,886

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2020年 6月25日現在)	第15期 (2021年 6月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,433,132,376口	2,075,776,977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) 1.0957円 (10,957円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4010円 (14,010円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2019年 6月26日 至 2020年 6月25日			第15期 自 2020年 6月26日 至 2021年 6月25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	34,239,793円	費用控除後の配当等収益額	A	57,466,566円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	426,658,343円
収益調整金額	C	826,671,178円	収益調整金額	C	1,287,504,447円
分配準備積立金額	D	83,000,341円	分配準備積立金額	D	80,021,960円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	943,911,312円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,851,651,316円
当ファンドの期末残存口数	F	1,433,132,376口	当ファンドの期末残存口数	F	2,075,776,977口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,586円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,920円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × 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15期 自 2020年 6月26日 至 2021年 6月25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15期 (2021年 6月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。



## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2019年 6月26日 至 2020年 6月25日	自 2020年 6月26日 至 2021年 6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,519,938,680円	1,433,132,376円
期中追加設定元本額	390,544,895円	1,441,950,295円
期中一部解約元本額	477,351,199円	799,305,694円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2020年 6月25日現在)	第15期 (2021年 6月25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)
親投資信託受益証券	58,116,397	543,159,790
合計	58,116,397	543,159,790

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,535,217,045	2,906,626,431	
合計		1,535,217,045	2,906,626,431	

(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。

### 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25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,300,836,028
株式	467,101,059,850
派生商品評価勘定	10,531,750
未収配当金	1,929,560,868
差入委託証拠金	259,350,000
流動資産合計	472,601,338,496
資産合計	472,601,338,496
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,150
前受金	10,390,000
未払解約金	69,533,980
未払利息	5,230
流動負債合計	80,086,360
負債合計	80,086,360
純資産の部	
元本等	
元本	249,570,740,519
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	222,950,511,617
元本等合計	472,521,252,136
純資産合計	472,521,252,136
負債純資産合計	472,601,338,496

#### 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25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25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	249,570,740,519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 1.8933円 (1万口当たり純資産額) (18,933円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 6月25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。

	2021年 6月25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

	2021年 6月25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	2021年 6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月26日
期首元本額	217,882,558,317円
期中追加設定元本額	81,069,596,423円
期中一部解約元本額	49,381,414,221円
期末元本額	249,570,740,519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）	424,476,210円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,873,870,605円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,707,576円
S M T T O P I X インデックス・オープン	10,501,736,834円
世界経済インデックスファンド	2,745,751,028円
日本株式インデックス・オープン	3,550,304,448円
D C マイセクション 2 5	6,020,246,337円
D C マイセクション 5 0	17,819,437,977円
D C マイセクション 7 5	17,477,998,191円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,807,149,743円
D C マイセクション S 2 5	2,849,301,851円
D C マイセクション S 5 0	8,431,246,306円
D C マイセクション S 7 5	5,959,802,327円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,507,254,741円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	248,073,796円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	650,495,463円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	462,817,286円
D C 世界経済インデックスファンド	3,194,476,350円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,535,217,045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

区分	2021年 6月25日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション75VA1（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VA1（適格機関投資家専用）	198,782,459円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	48,458,166円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	169,732,716円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,043,192円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	96,953,171円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,155,829,031円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	480,723,881円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,060,091,026円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	247,060,709円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,587,703円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	555,063,847円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	318,403,754円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	399,476,145円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,816,544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）	647,940,393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	1,859,107,448円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,572,759,941円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,125,702,712円
分散投資コア戦略ファンドA	2,020,639,441円
分散投資コア戦略ファンドS	7,198,644,348円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	399,064,398円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	383,156,546円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,053,504,419円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	204,920,022円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,325,363円
SMT インデックスバランス・オープン	59,650,335円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,481,121,980円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	609,709,451円
SMT 世界経済インデックス・オープン	34,172,790円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	115,079,436円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	20,569,016円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,994,132円
グローバル経済コア	234,730,047円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,351,645円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	59,321,415円
DCターゲット・イヤーフンド2055	7,874,040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）	130,902,386円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	4,087,501円

区分	2021年 6月25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	2,799,642円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,162,910円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	878,982円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	42,526,438,342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)	1,189,629,551円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	162,635,515円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,979,891円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,536,709,650円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		9,414,805,641
合計		9,414,805,641

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2021年 6月25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	5,512,580,000	-	5,522,970,000	10,390,000
	合計	5,512,580,000	-	5,522,970,000	10,390,000

## (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
極洋	7,600	2,916.00	22,161,600	
日本水産	218,600	534.00	116,732,400	
マルハニチロ	36,800	2,415.00	88,872,000	
雪国まいたけ	19,300	1,692.00	32,655,600	
カネコ種苗	7,100	1,486.00	10,550,600	
サカタのタネ	28,100	3,745.00	105,234,500	
ホクト	19,700	1,931.00	38,040,700	
ホクリヨウ	3,600	791.00	2,847,600	
住石ホールディングス	41,200	127.00	5,232,400	
日鉄鉱業	5,400	5,910.00	31,914,000	
三井松島ホールディングス	9,800	992.00	9,721,600	
I N P E X	865,700	887.00	767,875,900	
石油資源開発	30,800	2,067.00	63,663,600	
K & O エナジーグループ	11,400	1,353.00	15,424,200	
ヒノキヤグループ	5,800	2,586.00	14,998,800	
ショーボンドホールディングス	33,600	4,680.00	157,248,000	
ミライト・ホールディングス	81,600	1,913.00	156,100,800	
タマホーム	14,300	2,340.00	33,462,000	
サンヨーホームズ	2,700	732.00	1,976,400	
日本アクア	9,400	556.00	5,226,400	
ファーストコーポレーション	7,200	767.00	5,522,400	
ベステラ	4,500	1,675.00	7,537,500	
Robot Home	44,100	250.00	11,025,000	
キャンディル	4,000	561.00	2,244,000	
スペースバリューホールディングス	28,700	718.00	20,606,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	1,051.00	4,729,500	
第一カッター興業	5,800	1,370.00	7,946,000	
安藤・間	151,000	806.00	121,706,000	
東急建設	68,900	778.00	53,604,200	
コムシスホールディングス	83,500	3,090.00	258,015,000	
ピーアールホールディングス	31,500	490.00	15,435,000	
高松コンストラクショングループ	14,600	2,057.00	30,032,200	
東建コーポレーション	7,300	10,020.00	73,146,000	
ソネック	2,400	984.00	2,361,600	
ヤマウラ	10,200	906.00	9,241,200	
オリエンタル白石	79,100	280.00	22,148,000	
大成建設	169,200	3,675.00	621,810,000	
大林組	543,600	903.00	490,870,800	
清水建設	509,200	859.00	437,402,800	
飛鳥建設	15,600	1,064.00	16,598,400	
長谷工コーポレーション	178,100	1,508.00	268,574,800	



松井建設	21,400	738.00	15,793,200
銭高組	2,400	4,050.00	9,720,000
鹿島建設	398,300	1,445.00	575,543,500
不動テトラ	13,300	1,824.00	24,259,200
大末建設	6,900	982.00	6,775,800
鉄建建設	11,000	1,860.00	20,460,000
西松建設	38,900	3,490.00	135,761,000
三井住友建設	131,300	482.00	63,286,600
大豊建設	11,900	4,100.00	48,790,000
前田建設工業	136,200	959.00	130,615,800
佐田建設	12,500	495.00	6,187,500
ナカノフドー建設	13,000	416.00	5,408,000
奥村組	29,900	2,929.00	87,577,100
東鉄工業	23,300	2,268.00	52,844,400
イチケン	3,900	1,817.00	7,086,300
富士ピー・エス	7,000	575.00	4,025,000
浅沼組	6,500	4,520.00	29,380,000
戸田建設	225,700	774.00	174,691,800
熊谷組	25,200	2,805.00	70,686,000
北野建設	3,300	2,373.00	7,830,900
植木組	4,800	1,463.00	7,022,400
矢作建設工業	24,000	711.00	17,064,000
ピーエス三菱	17,900	623.00	11,151,700
日本ハウスホールディングス	37,100	390.00	14,469,000
大東建託	59,300	12,110.00	718,123,000
新日本建設	23,100	858.00	19,819,800
N I P P O	45,000	3,185.00	143,325,000
東亜道路工業	3,400	4,550.00	15,470,000
前田道路	33,600	2,178.00	73,180,800
日本道路	5,300	8,160.00	43,248,000
東亜建設工業	14,500	2,496.00	36,192,000
日本国土開発	52,900	581.00	30,734,900
若築建設	9,800	1,520.00	14,896,000
東洋建設	60,900	570.00	34,713,000
五洋建設	230,900	777.00	179,409,300
世紀東急工業	26,100	847.00	22,106,700
福田組	6,300	4,920.00	30,996,000
住友林業	127,900	2,181.00	278,949,900
日本基礎技術	16,600	517.00	8,582,200
巴コーポレーション	24,100	374.00	9,013,400
大和ハウス工業	502,000	3,375.00	1,694,250,000
ライト工業	31,100	1,824.00	56,726,400

積水ハウス	589,600	2,313.00	1,363,744,800
日特建設	14,200	771.00	10,948,200
北陸電気工事	9,400	1,254.00	11,787,600
ユアテック	31,100	722.00	22,454,200
日本リーテック	11,400	1,707.00	19,459,800
四電工	3,000	3,220.00	9,660,000
中電工	25,000	2,313.00	57,825,000
関電工	88,400	872.00	77,084,800
きんでん	110,400	1,811.00	199,934,400
東京エネシス	18,000	973.00	17,514,000
トーエネック	5,500	3,710.00	20,405,000
住友電設	15,300	2,306.00	35,281,800
日本電設工業	29,800	1,859.00	55,398,200
協和エクシオ	82,400	2,720.00	224,128,000
新日本空調	14,400	2,045.00	29,448,000
九電工	38,100	3,630.00	138,303,000
三機工業	38,500	1,429.00	55,016,500
日揮ホールディングス	181,400	1,066.00	193,372,400
中外炉工業	5,900	2,025.00	11,947,500
ヤマト	17,400	816.00	14,198,400
太平電業	12,000	2,644.00	31,728,000
高砂熱学工業	49,100	1,884.00	92,504,400
三晃金属工業	2,100	2,408.00	5,056,800
朝日工業社	4,000	3,020.00	12,080,000
明星工業	35,200	738.00	25,977,600
大気社	26,400	3,440.00	90,816,000
ダイダン	12,100	2,648.00	32,040,800
日比谷総合設備	17,500	1,840.00	32,200,000
フィル・カンパニー	3,100	2,889.00	8,955,900
テスホールディングス	9,900	1,754.00	17,364,600
東洋エンジニアリング	22,800	728.00	16,598,400
レイズネクスト	29,200	1,157.00	33,784,400
ニッポン	50,900	1,588.00	80,829,200
日清製粉グループ本社	196,600	1,666.00	327,535,600
日東富士製粉	1,300	7,000.00	9,100,000
昭和産業	14,600	3,025.00	44,165,000
鳥越製粉	15,400	782.00	12,042,800
中部飼料	21,200	1,155.00	24,486,000
フィード・ワン	23,400	746.00	17,456,400
東洋精糖	2,900	1,214.00	3,520,600
日本甜菜製糖	9,100	1,661.00	15,115,100
D M三井製糖ホールディングス	13,700	1,873.00	25,660,100

塩水港精糖	20,700	221.00	4,574,700
日新製糖	8,200	1,709.00	14,013,800
森永製菓	40,800	3,600.00	146,880,000
中村屋	4,200	3,790.00	15,918,000
江崎グリコ	47,900	4,320.00	206,928,000
名糖産業	7,700	1,537.00	11,834,900
井村屋グループ	9,900	2,331.00	23,076,900
不道家	11,100	2,185.00	24,253,500
山崎製パン	130,400	1,585.00	206,684,000
第一屋製パン	3,400	946.00	3,216,400
モロゾフ	2,800	5,450.00	15,260,000
亀田製菓	9,900	4,580.00	45,342,000
寿スピリッツ	16,700	7,360.00	122,912,000
カルビー	79,300	2,583.00	204,831,900
森永乳業	32,200	5,900.00	189,980,000
六甲バター	11,500	1,589.00	18,273,500
ヤクルト本社	119,700	6,300.00	754,110,000
明治ホールディングス	115,000	6,850.00	787,750,000
雪印メグミルク	41,900	2,172.00	91,006,800
プリマハム	24,500	2,993.00	73,328,500
日本ハム	66,500	4,425.00	294,262,500
林兼産業	5,800	596.00	3,456,800
丸大食品	17,100	1,700.00	29,070,000
S Foods	15,600	3,310.00	51,636,000
柿安本店	6,000	2,573.00	15,438,000
伊藤ハム米久ホールディングス	112,000	709.00	79,408,000
サッポロホールディングス	59,400	2,317.00	137,629,800
アサヒグループホールディングス	380,100	5,406.00	2,054,820,600
キリンホールディングス	737,900	2,223.00	1,640,351,700
宝ホールディングス	129,000	1,395.00	179,955,000
オエノンホールディングス	49,400	381.00	18,821,400
養命酒製造	5,300	1,838.00	9,741,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,200	1,769.00	235,630,800
サントリー食品インターナショナル	116,400	4,210.00	490,044,000
ダイドーグループホールディングス	9,800	5,100.00	49,980,000
伊藤園	52,800	6,920.00	365,376,000
キーコーヒー	17,100	2,127.00	36,371,700
ユニカフェ	5,200	1,001.00	5,205,200
ジャパンフーズ	2,500	1,218.00	3,045,000
日清オイリオグループ	22,200	3,135.00	69,597,000
不二製油グループ本社	42,400	2,715.00	115,116,000
かどや製油	1,900	4,045.00	7,685,500

J - オイルミルズ	16,200	1,911.00	30,958,200
キッコーマン	125,200	7,450.00	932,740,000
味の素	413,800	2,848.00	1,178,502,400
ブルドックソース	7,900	2,332.00	18,422,800
キューピー	96,900	2,497.00	241,959,300
ハウス食品グループ本社	65,100	3,450.00	224,595,000
カゴメ	71,100	2,988.00	212,446,800
焼津水産化学工業	8,400	984.00	8,265,600
アリアケジャパン	15,900	6,950.00	110,505,000
ピエトロ	2,300	1,718.00	3,951,400
エバラ食品工業	3,800	2,662.00	10,115,600
やまみ	1,900	1,954.00	3,712,600
ニチレイ	82,900	2,934.00	243,228,600
東洋水産	89,500	4,385.00	392,457,500
イトアンドホールディングス	6,000	1,895.00	11,370,000
大冷	1,900	2,021.00	3,839,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,700	792.00	7,682,400
日清食品ホールディングス	68,300	8,150.00	556,645,000
永谷園ホールディングス	8,500	2,166.00	18,411,000
一正蒲鉾	6,800	947.00	6,439,600
フジッコ	18,800	1,932.00	36,321,600
ロック・フィールド	18,700	1,531.00	28,629,700
日本たばこ産業	932,900	2,199.00	2,051,447,100
ケンコーマヨネーズ	10,600	1,621.00	17,182,600
わらべや日洋ホールディングス	11,400	2,127.00	24,247,800
なとり	9,700	1,901.00	18,439,700
イフジ産業	2,700	930.00	2,511,000
ピククルスコーポレーション	4,200	3,255.00	13,671,000
ファーマフーズ	16,400	2,665.00	43,706,000
北の達人コーポレーション	60,700	497.00	30,167,900
ユーグレナ	88,600	887.00	78,588,200
紀文食品	10,100	1,420.00	14,342,000
ミヨシ油脂	6,100	1,258.00	7,673,800
理研ビタミン	16,400	1,582.00	25,944,800
片倉工業	23,100	1,495.00	34,534,500
ゲンゼ	12,600	4,715.00	59,409,000
東洋紡	67,500	1,353.00	91,327,500
ユニチカ	51,100	359.00	18,344,900
富士紡ホールディングス	8,300	4,055.00	33,656,500
倉敷紡績	15,900	1,920.00	30,528,000
シキボウ	9,500	942.00	8,949,000
日本毛織	56,300	983.00	55,342,900

トーア紡コーポレーション	6,700	465.00	3,115,500
帝国繊維	19,400	2,141.00	41,535,400
帝人	160,100	1,727.00	276,492,700
東レ	1,229,900	751.80	924,638,820
サカイオーベックス	4,700	3,035.00	14,264,500
住江織物	3,700	2,000.00	7,400,000
日本フェルト	10,700	454.00	4,857,800
イチカワ	2,600	1,368.00	3,556,800
日東製網	1,800	1,520.00	2,736,000
アツギ	13,400	620.00	8,308,000
ダイニック	6,400	768.00	4,915,200
セーレン	42,000	2,157.00	90,594,000
ソトー	7,000	798.00	5,586,000
東海染工	2,300	1,128.00	2,594,400
小松マテーレ	28,100	948.00	26,638,800
ワコールホールディングス	42,400	2,533.00	107,399,200
ホギメディカル	22,900	3,345.00	76,600,500
T S Iホールディングス	52,200	325.00	16,965,000
マツオカコーポレーション	5,600	1,652.00	9,251,200
ワールド	22,400	1,440.00	32,256,000
三陽商会	8,800	929.00	8,175,200
ナイガイ	6,800	350.00	2,380,000
オンワードホールディングス	102,600	342.00	35,089,200
ルックホールディングス	6,000	1,482.00	8,892,000
ゴールドウイン	28,100	6,560.00	184,336,000
デサント	29,100	2,750.00	80,025,000
キング	9,400	524.00	4,925,600
ヤマトインターナショナル	15,600	338.00	5,272,800
特種東海製紙	10,400	4,505.00	46,852,000
王子ホールディングス	764,300	650.00	496,795,000
日本製紙	75,100	1,286.00	96,578,600
三菱製紙	24,100	358.00	8,627,800
北越コーポレーション	121,500	600.00	72,900,000
中越パルプ工業	6,500	1,290.00	8,385,000
巴川製紙所	5,600	817.00	4,575,200
大王製紙	81,900	1,820.00	149,058,000
阿波製紙	4,400	420.00	1,848,000
レンゴー	175,100	940.00	164,594,000
トーモク	10,400	1,951.00	20,290,400
ザ・パック	12,900	2,760.00	35,604,000
クラレ	267,400	1,106.00	295,744,400
旭化成	1,125,300	1,232.50	1,386,932,250

共和レザー	9,200	749.00	6,890,800
昭和電工	128,900	3,335.00	429,881,500
住友化学	1,336,400	598.00	799,167,200
住友精化	8,300	3,700.00	30,710,000
日産化学	93,600	5,410.00	506,376,000
ラサ工業	5,600	1,950.00	10,920,000
クレハ	14,600	6,480.00	94,608,000
多木化学	6,600	5,380.00	35,508,000
テイカ	12,500	1,299.00	16,237,500
石原産業	30,400	1,155.00	35,112,000
片倉コープアグリ	4,400	1,247.00	5,486,800
日本曹達	23,700	3,280.00	77,736,000
東ソー	262,400	1,949.00	511,417,600
トクヤマ	50,400	2,285.00	115,164,000
セントラル硝子	32,400	2,174.00	70,437,600
東亜合成	103,600	1,135.00	117,586,000
大阪ソーダ	17,300	2,472.00	42,765,600
関東電化工業	40,300	1,022.00	41,186,600
デンカ	62,000	3,720.00	230,640,000
信越化学工業	313,900	18,685.00	5,865,221,500
日本カーバイド工業	6,200	1,308.00	8,109,600
堺化学工業	11,900	1,875.00	22,312,500
第一稀元素化学工業	17,100	1,896.00	32,421,600
エア・ウォーター	173,100	1,740.00	301,194,000
日本酸素ホールディングス	139,900	2,298.00	321,490,200
日本化学工業	4,800	3,055.00	14,664,000
東邦アセチレン	2,500	1,158.00	2,895,000
日本パーカライジング	85,600	1,122.00	96,043,200
高压ガス工業	26,900	658.00	17,700,200
チタン工業	2,100	1,861.00	3,908,100
四国化成工業	22,600	1,327.00	29,990,200
戸田工業	3,600	2,411.00	8,679,600
ステラ ケミファ	9,200	2,959.00	27,222,800
保土谷化学工業	5,000	4,055.00	20,275,000
日本触媒	30,700	5,360.00	164,552,000
大日精化工業	14,000	2,313.00	32,382,000
カネカ	43,900	4,435.00	194,696,500
三菱瓦斯化学	170,100	2,350.00	399,735,000
三井化学	146,500	3,845.00	563,292,500
J S R	170,400	3,345.00	569,988,000
東京応化工業	29,100	7,000.00	203,700,000
大阪有機化学工業	15,700	4,485.00	70,414,500

三菱ケミカルホールディングス	1,134,900	926.20	1,051,144,380
KHネオケム	28,000	2,585.00	72,380,000
ダイセル	228,300	918.00	209,579,400
住友ベークライト	26,700	4,895.00	130,696,500
積水化学工業	359,000	1,922.00	689,998,000
日本ゼオン	153,100	1,542.00	236,080,200
アイカ工業	47,300	3,990.00	188,727,000
宇部興産	85,700	2,311.00	198,052,700
積水樹脂	28,000	2,134.00	59,752,000
タキロンシーアイ	36,700	580.00	21,286,000
旭有機材	9,600	1,358.00	13,036,800
ニチバン	8,900	1,802.00	16,037,800
リケンテクノス	41,400	614.00	25,419,600
大倉工業	8,000	2,454.00	19,632,000
積水化成成品工業	22,800	608.00	13,862,400
群栄化学工業	3,900	2,480.00	9,672,000
タイガースポリマー	8,900	446.00	3,969,400
ミライアル	5,400	1,344.00	7,257,600
ダイキアクシス	6,500	869.00	5,648,500
ダイキョーニシカワ	35,800	706.00	25,274,800
竹本容器	6,100	1,011.00	6,167,100
森六ホールディングス	9,100	2,242.00	20,402,200
恵和	3,300	3,320.00	10,956,000
日本化薬	105,100	1,065.00	111,931,500
カーリットホールディングス	16,800	735.00	12,348,000
日本精化	12,300	1,514.00	18,622,200
扶桑化学工業	13,400	4,185.00	56,079,000
トリケミカル研究所	15,700	3,360.00	52,752,000
ADEKA	78,100	2,049.00	160,026,900
日油	63,900	5,860.00	374,454,000
新日本理化	28,100	276.00	7,755,600
ハリマ化成グループ	12,600	908.00	11,440,800
花王	415,100	6,841.00	2,839,699,100
第一工業製薬	5,800	3,280.00	19,024,000
石原ケミカル	4,300	2,131.00	9,163,300
日華化学	5,700	1,218.00	6,942,600
ニイタカ	3,500	2,398.00	8,393,000
三洋化成工業	10,100	5,440.00	54,944,000
有機合成薬品工業	13,000	364.00	4,732,000
大日本塗料	19,200	834.00	16,012,800
日本ペイントホールディングス	700,400	1,594.00	1,116,437,600
関西ペイント	190,700	2,888.00	550,741,600

神東塗料	13,300	195.00	2,593,500
中国塗料	40,900	870.00	35,583,000
日本特殊塗料	12,700	1,120.00	14,224,000
藤倉化成	22,900	521.00	11,930,900
太陽ホールディングス	12,500	5,300.00	66,250,000
D I C	71,700	2,882.00	206,639,400
サカタインクス	37,100	1,051.00	38,992,100
東洋インキＳＣホールディングス	35,900	2,085.00	74,851,500
T & K T O K A	11,800	848.00	10,006,400
富士フィルムホールディングス	304,700	8,139.00	2,479,953,300
資生堂	344,400	8,230.00	2,834,412,000
ライオン	225,400	1,928.00	434,571,200
高砂香料工業	10,800	2,707.00	29,235,600
マンダム	36,400	2,087.00	75,966,800
ミルボン	23,200	6,190.00	143,608,000
ファンケル	63,100	3,610.00	227,791,000
コーセー	32,600	17,990.00	586,474,000
コタ	11,000	1,431.00	15,741,000
シーボン	2,200	1,964.00	4,320,800
ポーラ・オルビスホールディングス	74,000	2,995.00	221,630,000
ノエビアホールディングス	14,700	5,600.00	82,320,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,064.00	4,149,600
新日本製薬	4,700	2,222.00	10,443,400
エステー	11,100	1,758.00	19,513,800
アグロ カネショウ	6,500	1,469.00	9,548,500
コニシ	28,500	1,644.00	46,854,000
長谷川香料	29,900	2,448.00	73,195,200
星光P M C	9,900	921.00	9,117,900
小林製薬	48,600	9,690.00	470,934,000
荒川化学工業	14,400	1,206.00	17,366,400
メック	11,900	3,200.00	38,080,000
日本高純度化学	4,800	2,985.00	14,328,000
タカラバイオ	45,400	3,000.00	136,200,000
J C U	19,500	3,640.00	70,980,000
新田ゼラチン	10,900	640.00	6,976,000
O A T アグリオ	3,300	1,450.00	4,785,000
デクセリアルズ	48,400	2,356.00	114,030,400
アース製薬	13,100	6,670.00	87,377,000
北興化学工業	16,100	975.00	15,697,500
大成ラミック	5,300	2,727.00	14,453,100
クミアイ化学工業	71,700	851.00	61,016,700
日本農薬	30,900	514.00	15,882,600



アキレス	12,000	1,381.00	16,572,000
有沢製作所	24,100	909.00	21,906,900
日東電工	104,800	8,500.00	890,800,000
レック	20,500	1,157.00	23,718,500
三光合成	18,200	440.00	8,008,000
きもと	26,500	265.00	7,022,500
藤森工業	15,600	4,075.00	63,570,000
前澤化成工業	11,000	1,265.00	13,915,000
未来工業	6,200	1,736.00	10,763,200
ウェーブロックホールディングス	6,000	700.00	4,200,000
J S P	10,100	1,627.00	16,432,700
エフピコ	31,900	4,145.00	132,225,500
天馬	13,000	2,562.00	33,306,000
信越ポリマー	26,700	1,030.00	27,501,000
東リ	43,200	244.00	10,540,800
ニフコ	63,600	4,215.00	268,074,000
バルカー	14,100	2,151.00	30,329,100
ユニ・チャーム	367,500	4,488.00	1,649,340,000
ショーエイコーポレーション	3,800	996.00	3,784,800
協和キリン	174,400	3,905.00	681,032,000
武田薬品工業	1,442,200	3,758.00	5,419,787,600
アステラス製薬	1,503,000	2,009.50	3,020,278,500
大日本住友製薬	128,500	2,324.00	298,634,000
塩野義製薬	218,000	5,706.00	1,243,908,000
わかもと製薬	20,600	316.00	6,509,600
日本新薬	49,200	9,100.00	447,720,000
バイオフェルミン製薬	2,900	2,991.00	8,673,900
中外製薬	542,200	4,442.00	2,408,452,400
科研製薬	29,700	4,825.00	143,302,500
エーザイ	191,500	11,765.00	2,252,997,500
ロート製薬	82,600	2,917.00	240,944,200
小野薬品工業	398,100	2,511.50	999,828,150
久光製薬	50,400	5,650.00	284,760,000
持田製薬	24,100	3,685.00	88,808,500
参天製薬	301,700	1,544.00	465,824,800
扶桑薬品工業	5,600	2,290.00	12,824,000
日本ケミファ	2,100	2,384.00	5,006,400
ツムラ	57,800	3,565.00	206,057,000
日医工	49,100	912.00	44,779,200
キッセイ薬品工業	30,700	2,240.00	68,768,000
生化学工業	30,600	1,097.00	33,568,200
栄研化学	30,500	2,220.00	67,710,000

日水製薬	6,400	983.00	6,291,200
鳥居薬品	10,800	2,458.00	26,546,400
JCRファーマ	48,900	3,615.00	176,773,500
東和薬品	25,000	2,684.00	67,100,000
富士製薬工業	10,700	1,160.00	12,412,000
ゼリア新薬工業	31,400	2,107.00	66,159,800
第一三共	1,362,200	2,445.00	3,330,579,000
キョーリン製薬ホールディングス	38,200	1,807.00	69,027,400
大幸薬品	21,300	1,039.00	22,130,700
ダイト	11,100	3,410.00	37,851,000
大塚ホールディングス	360,300	4,739.00	1,707,461,700
大正製薬ホールディングス	41,200	6,000.00	247,200,000
ペプチドリーム	89,400	5,400.00	482,760,000
あすか製薬ホールディングス	19,700	1,004.00	19,778,800
サワイグループホールディングス	38,000	5,050.00	191,900,000
日本コークス工業	146,500	103.00	15,089,500
ニチレキ	20,500	1,313.00	26,916,500
ユシロ化学工業	9,700	1,201.00	11,649,700
ビーピー・カストロール	6,200	1,420.00	8,804,000
富士石油	42,100	274.00	11,535,400
MORESCO	6,300	1,110.00	6,993,000
出光興産	192,400	2,719.00	523,135,600
ENEOSホールディングス	2,607,800	475.40	1,239,748,120
コスモエネルギーホールディングス	54,700	2,524.00	138,062,800
横浜ゴム	100,400	2,439.00	244,875,600
TOYO TIRE	91,200	2,361.00	215,323,200
ブリヂストン	460,900	5,162.00	2,379,165,800
住友ゴム工業	155,700	1,566.00	243,826,200
藤倉コンポジット	15,100	492.00	7,429,200
オカモト	10,500	4,165.00	43,732,500
フコク	7,600	966.00	7,341,600
ニッタ	17,900	2,696.00	48,258,400
住友理工	33,600	732.00	24,595,200
三ツ星ベルト	21,100	1,797.00	37,916,700
バンドー化学	30,500	890.00	27,145,000
日東紡績	25,800	3,610.00	93,138,000
AGC	159,200	4,835.00	769,732,000
日本板硝子	88,000	670.00	58,960,000
石塚硝子	3,000	1,922.00	5,766,000
日本山村硝子	7,300	959.00	7,000,700
日本電気硝子	64,300	2,711.00	174,317,300
オハラ	6,900	1,447.00	9,984,300

住友大阪セメント	31,200	3,110.00	97,032,000
太平洋セメント	102,700	2,478.00	254,490,600
日本ヒューム	16,000	718.00	11,488,000
日本コンクリート工業	37,700	328.00	12,365,600
三谷セキサン	8,100	4,100.00	33,210,000
アジアパイルホールディングス	26,900	474.00	12,750,600
東海カーボン	169,600	1,608.00	272,716,800
日本カーボン	9,600	4,425.00	42,480,000
東洋炭素	10,200	2,888.00	29,457,600
ノリタケカンパニーリミテド	9,600	4,200.00	40,320,000
TOTO	123,800	5,950.00	736,610,000
日本碍子	190,800	1,935.00	369,198,000
日本特殊陶業	131,900	1,697.00	223,834,300
MARUWA	6,000	11,110.00	66,660,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,815.00	15,641,500
黒崎播磨	3,000	4,420.00	13,260,000
ヨータイ	12,500	1,357.00	16,962,500
イソライト工業	7,800	666.00	5,194,800
東京窯業	22,400	319.00	7,145,600
ニッカトー	8,000	700.00	5,600,000
フジインコーポレーテッド	13,900	5,070.00	70,473,000
クニミネ工業	5,500	1,151.00	6,330,500
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,025.00	3,382,500
ニチアス	43,800	2,802.00	122,727,600
ニチハ	24,100	2,903.00	69,962,300
日本製鉄	818,400	1,909.50	1,562,734,800
神戸製鋼所	313,900	721.00	226,321,900
中山製鋼所	24,000	402.00	9,648,000
合同製鐵	9,300	1,658.00	15,419,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	496,100	1,322.00	655,844,200
東京製鐵	66,800	1,099.00	73,413,200
共英製鋼	19,400	1,476.00	28,634,400
大和工業	36,400	3,710.00	135,044,000
東京鐵鋼	6,600	1,569.00	10,355,400
大阪製鐵	9,200	1,098.00	10,101,600
淀川製鋼所	22,500	2,285.00	51,412,500
丸一鋼管	55,700	2,710.00	150,947,000
モリ工業	5,100	2,389.00	12,183,900
大同特殊鋼	28,100	5,510.00	154,831,000
日本高周波鋼業	6,500	402.00	2,613,000
日本冶金工業	13,400	2,269.00	30,404,600
山陽特殊製鋼	20,600	1,653.00	34,051,800

愛知製鋼	9,700	3,145.00	30,506,500
日立金属	161,600	2,125.00	343,400,000
日本金属	4,300	950.00	4,085,000
大太平洋金属	11,600	1,760.00	20,416,000
新日本電工	110,900	307.00	34,046,300
栗本鐵工所	7,800	1,656.00	12,916,800
虹技	2,400	1,136.00	2,726,400
三菱製鋼	12,800	867.00	11,097,600
日亜鋼業	25,400	291.00	7,391,400
日本精線	2,500	4,770.00	11,925,000
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,246.00	9,220,400
シンニッタン	21,100	255.00	5,380,500
新家工業	4,300	1,663.00	7,150,900
大紀アルミニウム工業所	25,900	1,157.00	29,966,300
日本軽金属ホールディングス	46,800	1,916.00	89,668,800
三井金属鉱業	46,300	3,170.00	146,771,000
東邦亜鉛	9,600	1,911.00	18,345,600
三菱マテリアル	113,300	2,291.00	259,570,300
住友金属鉱山	219,200	4,558.00	999,113,600
D O W Aホールディングス	43,400	4,455.00	193,347,000
古河機械金属	28,400	1,255.00	35,642,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,000	788.00	14,184,000
東邦チタニウム	30,800	1,048.00	32,278,400
U A C J	26,100	2,920.00	76,212,000
C Kサンエツ	3,600	3,175.00	11,430,000
古河電気工業	53,300	2,820.00	150,306,000
住友電気工業	598,300	1,675.00	1,002,152,500
フジクラ	207,000	506.00	104,742,000
昭和電線ホールディングス	16,700	1,747.00	29,174,900
東京特殊電線	2,300	2,566.00	5,901,800
タツタ電線	30,500	560.00	17,080,000
カナレ電気	2,900	1,803.00	5,228,700
平河ヒューテック	9,600	1,223.00	11,740,800
リョービ	21,200	1,580.00	33,496,000
アーレスティ	21,300	488.00	10,394,400
アサヒホールディングス	64,400	2,245.00	144,578,000
稲葉製作所	9,600	1,504.00	14,438,400
宮地エンジニアリンググループ	5,600	2,306.00	12,913,600
トーカロ	44,200	1,440.00	63,648,000
アルファC o	6,000	1,148.00	6,888,000
S U M C O	218,600	2,778.00	607,270,800
川田テクノロジーズ	3,500	3,500.00	12,250,000

RS Technologies	5,600	6,490.00	36,344,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,440.00	6,536,000
信和	9,100	705.00	6,415,500
東洋製罐グループホールディングス	109,200	1,565.00	170,898,000
ホッカンホールディングス	8,700	1,402.00	12,197,400
コロナ	9,500	927.00	8,806,500
横河ブリッジホールディングス	29,400	2,088.00	61,387,200
駒井ハルテック	3,500	1,761.00	6,163,500
高田機工	1,600	2,795.00	4,472,000
三和ホールディングス	161,600	1,362.00	220,099,200
文化シャッター	50,500	1,114.00	56,257,000
三協立山	22,100	910.00	20,111,000
アルインコ	11,300	1,035.00	11,695,500
東洋シャッター	3,800	653.00	2,481,400
LIXIL	236,100	2,920.00	689,412,000
日本フィルコン	11,900	497.00	5,914,300
ノーリツ	35,500	1,915.00	67,982,500
長府製作所	17,400	2,019.00	35,130,600
リンナイ	33,300	10,670.00	355,311,000
ダイニチ工業	8,200	788.00	6,461,600
日東精工	21,500	573.00	12,319,500
三洋工業	2,100	1,879.00	3,945,900
岡部	34,700	667.00	23,144,900
ジーテクト	21,300	1,580.00	33,654,000
東プレ	32,000	1,619.00	51,808,000
高周波熱錬	33,000	570.00	18,810,000
東京製綱	12,300	1,146.00	14,095,800
サンコール	14,700	460.00	6,762,000
モリテック スチール	13,400	514.00	6,887,600
パイオラックス	25,400	1,532.00	38,912,800
エイチワン	16,800	772.00	12,969,600
日本発條	170,800	917.00	156,623,600
中央発條	8,200	1,278.00	10,479,600
アドバネクス	2,500	1,305.00	3,262,500
立川ブラインド工業	7,500	1,349.00	10,117,500
三益半導体工業	13,400	2,796.00	37,466,400
日本ドライケミカル	4,300	1,765.00	7,589,500
日本製鋼所	52,100	2,951.00	153,747,100
三浦工業	74,200	4,850.00	359,870,000
タクマ	58,200	1,706.00	99,289,200
ツガミ	35,700	1,700.00	60,690,000
オークマ	20,000	5,400.00	108,000,000

芝浦機械	17,800	2,555.00	45,479,000
アマダ	251,500	1,135.00	285,452,500
アイダエンジニアリング	45,100	970.00	43,747,000
滝澤鉄工所	5,000	1,141.00	5,705,000
F U J I	68,500	2,559.00	175,291,500
牧野フライス製作所	20,200	4,410.00	89,082,000
オーエスジー	84,700	1,839.00	155,763,300
ダイジェット工業	2,100	1,306.00	2,742,600
旭ダイヤモンド工業	45,400	522.00	23,698,800
D M G 森精機	108,600	1,986.00	215,679,600
ソディック	41,200	1,048.00	43,177,600
ディスコ	23,300	34,750.00	809,675,000
日東工器	8,300	1,825.00	15,147,500
日進工具	13,500	1,463.00	19,750,500
パンチ工業	14,500	629.00	9,120,500
富士ダイス	8,800	638.00	5,614,400
豊和工業	9,800	815.00	7,987,000
O K K	6,600	398.00	2,626,800
東洋機械金属	12,500	544.00	6,800,000
津田駒工業	3,300	891.00	2,940,300
エンシュウ	4,400	852.00	3,748,800
島精機製作所	25,200	1,944.00	48,988,800
オプトラン	21,500	2,486.00	53,449,000
N C ホールディングス	5,300	1,132.00	5,999,600
イワキポンプ	11,000	962.00	10,582,000
フリー	16,800	1,424.00	23,923,200
ヤマシンフィルタ	34,700	720.00	24,984,000
日阪製作所	21,300	825.00	17,572,500
やまびこ	33,300	1,224.00	40,759,200
平田機工	8,100	6,800.00	55,080,000
ペガサスミシン製造	17,600	478.00	8,412,800
マルマエ	7,100	2,440.00	17,324,000
タツモ	7,300	1,750.00	12,775,000
ナプテスコ	101,100	4,220.00	426,642,000
三井海洋開発	18,300	2,120.00	38,796,000
レオン自動機	16,900	1,432.00	24,200,800
S M C	50,800	65,770.00	3,341,116,000
ホソカワミクロン	6,000	5,910.00	35,460,000
ユニオンツール	6,400	4,030.00	25,792,000
オイレス工業	24,100	1,603.00	38,632,300
日精エー・エス・ビー機械	5,800	4,940.00	28,652,000
サトーホールディングス	22,600	2,662.00	60,161,200

技研製作所	15,100	4,375.00	66,062,500
日本エアージェット	5,700	1,335.00	7,609,500
カワタ	4,800	908.00	4,358,400
日精樹脂工業	13,400	1,406.00	18,840,400
オカダアイヨン	5,500	1,297.00	7,133,500
ワイエイシイホールディングス	6,800	1,223.00	8,316,400
小松製作所	785,500	2,825.50	2,219,430,250
住友重機械工業	99,300	3,135.00	311,305,500
日立建機	81,100	3,440.00	278,984,000
日工	26,200	695.00	18,209,000
巴工業	6,800	2,299.00	15,633,200
井関農機	17,500	1,518.00	26,565,000
TOWA	16,200	2,311.00	37,438,200
丸山製作所	3,700	1,796.00	6,645,200
北川鉄工所	7,900	1,691.00	13,358,900
ローツェ	7,600	9,990.00	75,924,000
タカキタ	6,200	629.00	3,899,800
クボタ	910,700	2,315.50	2,108,725,850
荏原実業	4,400	6,640.00	29,216,000
三菱化工機	5,600	2,640.00	14,784,000
月島機械	32,100	1,184.00	38,006,400
帝国電機製作所	12,200	1,289.00	15,725,800
新東工業	41,400	795.00	32,913,000
澁谷工業	15,200	3,290.00	50,008,000
アイチ コーポレーション	29,800	838.00	24,972,400
小森コーポレーション	44,200	815.00	36,023,000
鶴見製作所	13,500	1,777.00	23,989,500
住友精密工業	2,600	2,612.00	6,791,200
日本ギア工業	7,200	325.00	2,340,000
酒井重工業	3,100	2,529.00	7,839,900
荏原製作所	71,900	5,690.00	409,111,000
石井鐵工所	2,500	3,040.00	7,600,000
西島製作所	17,800	878.00	15,628,400
北越工業	18,000	1,134.00	20,412,000
ダイキン工業	220,900	21,005.00	4,640,004,500
オルガノ	5,700	6,430.00	36,651,000
トーヨーカネツ	6,600	2,486.00	16,407,600
栗田工業	93,900	5,270.00	494,853,000
椿本チエイン	24,800	3,240.00	80,352,000
大同工業	8,400	1,167.00	9,802,800
木村化工機	14,700	856.00	12,583,200
アネスト岩田	29,300	993.00	29,094,900

ダイフク	95,400	10,050.00	958,770,000
サムコ	4,400	3,435.00	15,114,000
加藤製作所	9,700	1,009.00	9,787,300
油研工業	3,100	1,725.00	5,347,500
タダノ	83,900	1,160.00	97,324,000
フジテック	59,700	2,477.00	147,876,900
C K D	40,200	2,376.00	95,515,200
キトー	14,600	1,739.00	25,389,400
平和	48,400	1,961.00	94,912,400
理想科学工業	12,800	1,714.00	21,939,200
S A N K Y O	41,200	2,867.00	118,120,400
日本金銭機械	19,300	573.00	11,058,900
マースグループホールディングス	11,100	1,617.00	17,948,700
フクシマガリレイ	11,900	4,660.00	55,454,000
オーイズミ	7,500	379.00	2,842,500
ダイコク電機	8,100	909.00	7,362,900
竹内製作所	29,000	2,816.00	81,664,000
アマノ	45,400	2,798.00	127,029,200
J U K I	24,100	815.00	19,641,500
蛇の目マシン工業	15,900	755.00	12,004,500
マックス	23,300	1,799.00	41,916,700
グローリー	44,600	2,331.00	103,962,600
新晃工業	16,200	1,912.00	30,974,400
大和冷機工業	27,900	1,070.00	29,853,000
セガサミーホールディングス	157,700	1,475.00	232,607,500
日本ピストンリング	6,400	1,302.00	8,332,800
リケン	8,100	2,575.00	20,857,500
T P R	23,400	1,526.00	35,708,400
ツバキ・ナカシマ	33,400	1,777.00	59,351,800
ホシザキ	54,600	9,760.00	532,896,000
大豊工業	14,200	1,003.00	14,242,600
日本精工	356,100	979.00	348,621,900
N T N	401,200	298.00	119,557,600
ジェイテクト	166,400	1,185.00	197,184,000
不二越	16,100	3,985.00	64,158,500
日本トムソン	47,600	608.00	28,940,800
T H K	108,100	3,355.00	362,675,500
ユースン精機	11,600	812.00	9,419,200
前澤給装工業	12,200	1,063.00	12,968,600
イーグル工業	21,500	1,125.00	24,187,500
前澤工業	10,500	613.00	6,436,500
日本ピラー工業	17,600	2,220.00	39,072,000



キッツ	53,600	796.00	42,665,600
マキタ	226,100	5,160.00	1,166,676,000
日立造船	137,800	708.00	97,562,400
三菱重工業	272,400	3,396.00	925,070,400
I H I	116,600	2,712.00	316,219,200
スター精密	26,800	1,727.00	46,283,600
日清紡ホールディングス	106,100	969.00	102,810,900
イビデン	83,600	5,970.00	499,092,000
コニカミノルタ	353,400	636.00	224,762,400
ブラザー工業	212,200	2,309.00	489,969,800
ミネベアミツミ	299,200	2,844.00	850,924,800
日立製作所	833,500	6,411.00	5,343,568,500
東芝	343,100	4,815.00	1,652,026,500
三菱電機	1,733,500	1,678.00	2,908,813,000
富士電機	104,500	5,250.00	548,625,000
東洋電機製造	7,000	1,191.00	8,337,000
安川電機	186,600	5,410.00	1,009,506,000
シンフォニアテクノロジー	22,500	1,285.00	28,912,500
明電舎	29,500	2,263.00	66,758,500
オリジン	4,900	1,372.00	6,722,800
山洋電気	8,500	7,640.00	64,940,000
デンヨー	14,800	2,009.00	29,733,200
東芝テック	18,600	4,530.00	84,258,000
芝浦メカトロニクス	3,200	8,510.00	27,232,000
マブチモーター	48,200	4,260.00	205,332,000
日本電産	417,300	12,930.00	5,395,689,000
トレックス・セミコンダクター	9,800	2,868.00	28,106,400
東光高岳	9,500	1,394.00	13,243,000
ダイヘン	19,000	4,715.00	89,585,000
ヤーマン	29,100	1,387.00	40,361,700
JVCケンウッド	154,500	232.00	35,844,000
ミマキエンジニアリング	17,000	760.00	12,920,000
I - P E X	8,500	2,458.00	20,893,000
日新電機	40,700	1,387.00	56,450,900
大崎電気工業	34,700	622.00	21,583,400
オムロン	144,300	8,760.00	1,264,068,000
日東工業	25,500	1,811.00	46,180,500
I D E C	23,300	2,086.00	48,603,800
正興電機製作所	6,100	1,662.00	10,138,200
不二電機工業	3,700	1,280.00	4,736,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62,700	2,858.00	179,196,600
サクサホールディングス	4,200	1,343.00	5,640,600

メルコホールディングス	6,200	5,400.00	33,480,000
テクノメディカ	4,600	1,611.00	7,410,600
日本電気	220,300	5,430.00	1,196,229,000
富士通	156,000	20,225.00	3,155,100,000
沖電気工業	70,500	1,019.00	71,839,500
岩崎通信機	7,600	949.00	7,212,400
電気興業	8,400	2,194.00	18,429,600
サンケン電気	20,300	5,160.00	104,748,000
ナカヨ	3,500	1,460.00	5,110,000
アイホン	9,900	2,080.00	20,592,000
ルネサスエレクトロニクス	830,000	1,200.00	996,000,000
セイコーエプソン	215,100	1,984.00	426,758,400
ワコム	127,000	721.00	91,567,000
アルバック	31,900	5,800.00	185,020,000
アクセル	8,500	896.00	7,616,000
E I Z O	14,700	4,890.00	71,883,000
日本信号	40,600	923.00	37,473,800
京三製作所	37,500	432.00	16,200,000
能美防災	23,400	2,141.00	50,099,400
ホーチキ	13,500	1,199.00	16,186,500
星和電機	10,600	516.00	5,469,600
エレコム	40,200	2,057.00	82,691,400
パナソニック	1,848,800	1,309.00	2,420,079,200
シャープ	230,600	1,831.00	422,228,600
アンリツ	104,300	2,054.00	214,232,200
富士通ゼネラル	53,000	2,849.00	150,997,000
ソニーグループ	1,085,900	10,850.00	11,782,015,000
T D K	83,800	13,320.00	1,116,216,000
帝国通信工業	8,600	1,125.00	9,675,000
タムラ製作所	62,500	878.00	54,875,000
アルプスアルパイン	142,500	1,183.00	168,577,500
池上通信機	5,500	858.00	4,719,000
鈴木	8,800	1,003.00	8,826,400
日本トリム	4,000	3,845.00	15,380,000
ローランド ディー . ジー .	10,700	2,740.00	29,318,000
フォスター電機	17,600	979.00	17,230,400
S M K	4,500	2,534.00	11,403,000
ヨコオ	14,000	2,476.00	34,664,000
ホシデン	48,500	1,005.00	48,742,500
ヒロセ電機	26,700	16,450.00	439,215,000
日本航空電子工業	39,800	1,931.00	76,853,800
T O A	20,600	904.00	18,622,400

マクセルホールディングス	35,300	1,268.00	44,760,400
古野電気	23,400	1,036.00	24,242,400
ユニデンホールディングス	4,500	2,656.00	11,952,000
スマダコーポレーション	15,700	1,179.00	18,510,300
アイコム	7,200	2,419.00	17,416,800
リオン	7,700	2,745.00	21,136,500
本多通信工業	15,700	496.00	7,787,200
横河電機	173,600	1,686.00	292,689,600
新電元工業	6,700	4,825.00	32,327,500
アズビル	117,200	4,570.00	535,604,000
東亜ディーケーケー	9,900	829.00	8,207,100
日本光電工業	72,000	3,190.00	229,680,000
チノー	5,600	1,507.00	8,439,200
共和電業	18,700	389.00	7,274,300
日本電子材料	7,200	1,970.00	14,184,000
堀場製作所	34,400	7,280.00	250,432,000
アドバンテスト	128,900	10,150.00	1,308,335,000
小野測器	9,200	564.00	5,188,800
エスベック	15,800	2,252.00	35,581,600
キーエンス	170,200	55,590.00	9,461,418,000
日置電機	8,500	5,780.00	49,130,000
シスメックス	135,400	12,580.00	1,703,332,000
日本マイクロニクス	30,800	1,561.00	48,078,800
メガチップス	17,700	3,305.00	58,498,500
O B A R A G R O U P	8,100	3,835.00	31,063,500
澤藤電機	2,400	2,045.00	4,908,000
原田工業	8,200	914.00	7,494,800
コーセル	22,100	1,120.00	24,752,000
イリソ電子工業	14,800	5,310.00	78,588,000
オブテックスグループ	29,000	1,890.00	54,810,000
千代田インテグレ	7,900	1,811.00	14,306,900
アイ・オー・データ機器	7,400	1,061.00	7,851,400
レーザーテック	76,200	22,830.00	1,739,646,000
スタンレー電気	121,600	3,315.00	403,104,000
岩崎電気	7,000	1,932.00	13,524,000
ウシオ電機	89,500	1,789.00	160,115,500
岡谷電機産業	15,400	372.00	5,728,800
ヘリオス テクノ ホールディング	19,100	343.00	6,551,300
エノモト	5,400	1,771.00	9,563,400
日本セラミック	18,000	2,933.00	52,794,000
遠藤照明	10,200	766.00	7,813,200
古河電池	13,000	1,563.00	20,319,000

双信電機	10,500	603.00	6,331,500
山一電機	11,900	1,708.00	20,325,200
図研	11,600	3,100.00	35,960,000
日本電子	31,700	6,520.00	206,684,000
カシオ計算機	139,500	1,950.00	272,025,000
ファナック	152,100	26,880.00	4,088,448,000
日本シイエムケイ	39,800	432.00	17,193,600
エンプラス	8,100	3,765.00	30,496,500
大真空	6,200	4,260.00	26,412,000
ローム	72,200	10,260.00	740,772,000
浜松ホトニクス	124,500	6,860.00	854,070,000
三井ハイテック	17,200	6,510.00	111,972,000
新光電気工業	58,500	4,090.00	239,265,000
京セラ	264,400	6,911.00	1,827,268,400
太陽誘電	77,300	5,440.00	420,512,000
村田製作所	509,300	8,343.00	4,249,089,900
双葉電子工業	31,100	789.00	24,537,900
北陸電気工業	7,600	1,053.00	8,002,800
ニチコン	55,500	1,202.00	66,711,000
日本ケミコン	17,500	2,737.00	47,897,500
K O A	24,600	1,642.00	40,393,200
市光工業	27,400	733.00	20,084,200
小糸製作所	104,000	6,920.00	719,680,000
ミツバ	31,900	848.00	27,051,200
S C R E E Nホールディングス	30,100	10,900.00	328,090,000
キャノン電子	16,500	1,772.00	29,238,000
キャノン	861,400	2,605.00	2,243,947,000
リコー	441,100	1,290.00	569,019,000
象印マホービン	47,500	1,724.00	81,890,000
M U T O Hホールディングス	2,900	1,595.00	4,625,500
東京エレクトロン	101,500	48,970.00	4,970,455,000
トヨタ紡織	50,500	2,299.00	116,099,500
芦森工業	3,300	1,076.00	3,550,800
ユニプレス	28,500	934.00	26,619,000
豊田自動織機	140,300	9,970.00	1,398,791,000
モリタホールディングス	27,800	1,611.00	44,785,800
三櫻工業	24,000	1,223.00	29,352,000
デンソー	381,700	7,779.00	2,969,244,300
東海理化電機製作所	45,700	1,773.00	81,026,100
三井E & Sホールディングス	67,100	521.00	34,959,100
川崎重工業	134,900	2,422.00	326,727,800
名村造船所	52,100	184.00	9,586,400

日本車輛製造	6,300	2,135.00	13,450,500
三菱ロジスネクスト	22,900	999.00	22,877,100
近畿車輛	3,000	1,219.00	3,657,000
日産自動車	2,044,400	552.60	1,129,735,440
いすゞ自動車	460,300	1,493.00	687,227,900
トヨタ自動車	1,756,100	9,849.00	17,295,828,900
日野自動車	216,500	994.00	215,201,000
三菱自動車工業	641,600	309.00	198,254,400
エフテック	12,200	860.00	10,492,000
レシップホールディングス	6,900	577.00	3,981,300
G M B	3,200	1,118.00	3,577,600
ファルテック	3,100	763.00	2,365,300
武蔵精密工業	38,700	2,428.00	93,963,600
日産車体	25,400	738.00	18,745,200
新明和工業	49,000	965.00	47,285,000
極東開発工業	29,900	1,639.00	49,006,100
トピー工業	14,300	1,310.00	18,733,000
ティラド	5,400	2,703.00	14,596,200
曙ブレーキ工業	95,100	173.00	16,452,300
タチエス	26,600	1,487.00	39,554,200
N O K	83,900	1,366.00	114,607,400
フタバ産業	43,600	522.00	22,759,200
K Y B	19,400	3,860.00	74,884,000
大同メタル工業	35,900	616.00	22,114,400
プレス工業	86,200	345.00	29,739,000
ミクニ	22,300	310.00	6,913,000
太平洋工業	36,400	1,190.00	43,316,000
河西工業	23,600	406.00	9,581,600
アイシン	126,900	4,850.00	615,465,000
マツダ	544,100	1,062.00	577,834,200
今仙電機製作所	15,300	711.00	10,878,300
本田技研工業	1,364,900	3,593.00	4,904,085,700
スズキ	343,600	4,760.00	1,635,536,000
S U B A R U	496,800	2,251.00	1,118,296,800
安永	8,400	1,199.00	10,071,600
ヤマハ発動機	245,000	3,240.00	793,800,000
T B K	20,800	417.00	8,673,600
エクセディ	23,600	1,656.00	39,081,600
豊田合成	56,000	2,766.00	154,896,000
愛三工業	27,200	896.00	24,371,200
盟和産業	2,700	999.00	2,697,300
日本プラスト	14,700	713.00	10,481,100

ヨロズ	14,900	1,227.00	18,282,300
エフ・シー・シー	28,400	1,628.00	46,235,200
シマノ	64,900	26,100.00	1,693,890,000
テイ・エス テック	80,600	1,680.00	135,408,000
ジャムコ	10,100	1,129.00	11,402,900
テルモ	531,400	4,440.00	2,359,416,000
クリエートメディック	5,800	1,015.00	5,887,000
日機装	56,000	1,144.00	64,064,000
日本エム・ディ・エム	10,000	2,187.00	21,870,000
島津製作所	223,100	4,315.00	962,676,500
JMS	14,700	836.00	12,289,200
長野計器	12,600	1,101.00	13,872,600
ブイ・テクノロジー	8,100	5,530.00	44,793,000
東京計器	11,100	1,094.00	12,143,400
愛知時計電機	2,300	4,305.00	9,901,500
インターアクション	8,700	2,467.00	21,462,900
オーバル	15,700	278.00	4,364,600
東京精密	29,200	5,170.00	150,964,000
マニー	69,100	2,474.00	170,953,400
ニコン	264,700	1,231.00	325,845,700
トプコン	87,300	1,663.00	145,179,900
オリンパス	959,200	2,261.00	2,168,751,200
理研計器	15,300	2,787.00	42,641,100
タムロン	14,000	2,480.00	34,720,000
HOYA	341,100	15,055.00	5,135,260,500
シード	6,800	802.00	5,453,600
ノーリツ鋼機	15,600	2,353.00	36,706,800
エー・アンド・デイ	14,600	1,021.00	14,906,600
朝日インテック	182,500	2,598.00	474,135,000
シチズン時計	220,000	415.00	91,300,000
リズム	5,500	796.00	4,378,000
大研医器	13,800	554.00	7,645,200
メニコン	26,600	7,790.00	207,214,000
シンシア	1,900	652.00	1,238,800
松風	8,000	2,019.00	16,152,000
セイコーホールディングス	24,500	2,238.00	54,831,000
ニプロ	129,200	1,354.00	174,936,800
中本パックス	4,400	1,592.00	7,004,800
スノーピーク	10,300	3,230.00	33,269,000
パラマウントベッドホールディングス	33,200	1,966.00	65,271,200
トランザクション	9,500	1,446.00	13,737,000
粧美堂	5,100	423.00	2,157,300

ニホンフラッシュ	14,800	1,288.00	19,062,400
前田工織	19,100	3,500.00	66,850,000
永大産業	22,700	300.00	6,810,000
アートネイチャー	16,700	691.00	11,539,700
バンダイナムコホールディングス	143,400	7,758.00	1,112,497,200
アイフィスジャパン	4,400	704.00	3,097,600
共立印刷	29,000	139.00	4,031,000
SHOEI	16,300	4,130.00	67,319,000
フランスベッドホールディングス	22,300	933.00	20,805,900
パイロットコーポレーション	29,300	3,775.00	110,607,500
萩原工業	9,600	1,435.00	13,776,000
トッパン・フォームズ	30,900	1,084.00	33,495,600
フジシールインターナショナル	35,600	2,380.00	84,728,000
タカラトミー	77,700	975.00	75,757,500
廣済堂	12,100	783.00	9,474,300
エステールホールディングス	4,600	659.00	3,031,400
タカノ	5,900	640.00	3,776,000
プロネクサス	13,900	1,021.00	14,191,900
ホクシン	10,700	157.00	1,679,900
ウッドワン	5,800	1,241.00	7,197,800
大建工業	11,700	2,132.00	24,944,400
凸版印刷	263,500	1,822.00	480,097,000
大日本印刷	209,400	2,377.00	497,743,800
共同印刷	5,300	2,732.00	14,479,600
NISSHA	35,600	1,665.00	59,274,000
光村印刷	1,500	1,600.00	2,400,000
TAKARA & COMPANY	8,500	1,708.00	14,518,000
アシックス	153,300	2,715.00	416,209,500
ツツミ	4,300	2,325.00	9,997,500
ローランド	13,500	5,700.00	76,950,000
小松ウオール工業	5,300	1,956.00	10,366,800
ヤマハ	103,100	6,190.00	638,189,000
河合楽器製作所	4,800	3,865.00	18,552,000
クリナップ	16,100	526.00	8,468,600
ピジョン	111,300	3,210.00	357,273,000
オリバー	3,700	3,780.00	13,986,000
兼松サステック	1,100	1,815.00	1,996,500
キングジム	14,300	896.00	12,812,800
リンテック	37,100	2,414.00	89,559,400
イトーキ	34,400	366.00	12,590,400
任天堂	99,200	64,070.00	6,355,744,000
三菱鉛筆	28,500	1,454.00	41,439,000

タカラスタANDARD	35,800	1,540.00	55,132,000
コクヨ	83,100	1,761.00	146,339,100
ナカバヤシ	17,000	599.00	10,183,000
グローブライド	8,400	4,185.00	35,154,000
オカムラ	59,600	1,479.00	88,148,400
美津濃	17,200	2,318.00	39,869,600
東京電力ホールディングス	1,470,300	334.00	491,080,200
中部電力	530,300	1,372.50	727,836,750
関西電力	656,800	1,076.50	707,045,200
中国電力	250,000	1,020.00	255,000,000
北陸電力	158,500	613.00	97,160,500
東北電力	406,000	881.00	357,686,000
四国電力	144,100	762.00	109,804,200
九州電力	382,800	872.00	333,801,600
北海道電力	162,200	510.00	82,722,000
沖縄電力	33,700	1,393.00	46,944,100
電源開発	137,900	1,595.00	219,950,500
エフオン	10,500	950.00	9,975,000
イーレックス	25,500	2,348.00	59,874,000
レノバ	29,400	4,420.00	129,948,000
東京瓦斯	333,400	2,116.50	705,641,100
大阪瓦斯	314,000	2,081.00	653,434,000
東邦瓦斯	85,300	5,570.00	475,121,000
北海道瓦斯	9,300	1,555.00	14,461,500
広島ガス	35,700	372.00	13,280,400
西部ガスホールディングス	19,500	2,451.00	47,794,500
静岡ガス	49,200	977.00	48,068,400
メタウォーター	19,500	2,126.00	41,457,000
SBSホールディングス	12,800	3,335.00	42,688,000
東武鉄道	180,700	2,919.00	527,463,300
相鉄ホールディングス	59,400	2,225.00	132,165,000
東急	437,200	1,540.00	673,288,000
京浜急行電鉄	222,600	1,389.00	309,191,400
小田急電鉄	277,700	2,871.00	797,276,700
京王電鉄	96,900	6,680.00	647,292,000
京成電鉄	129,900	3,655.00	474,784,500
富士急行	23,600	5,430.00	128,148,000
新京成電鉄	4,400	2,145.00	9,438,000
東日本旅客鉄道	305,100	8,020.00	2,446,902,000
西日本旅客鉄道	154,500	6,470.00	999,615,000
東海旅客鉄道	144,100	17,165.00	2,473,476,500
西武ホールディングス	208,900	1,310.00	273,659,000



鴻池運輸	27,600	1,207.00	33,313,200
西日本鉄道	48,100	2,737.00	131,649,700
ハマキョウレックス	13,300	3,290.00	43,757,000
サカイ引越センター	8,000	6,040.00	48,320,000
近鉄グループホールディングス	164,200	3,965.00	651,053,000
阪急阪神ホールディングス	219,000	3,495.00	765,405,000
南海電気鉄道	77,800	2,444.00	190,143,200
京阪ホールディングス	73,100	3,440.00	251,464,000
神戸電鉄	3,900	3,480.00	13,572,000
名古屋鉄道	135,000	2,105.00	284,175,000
山陽電気鉄道	11,700	1,924.00	22,510,800
アルプス物流	11,500	998.00	11,477,000
日本通運	56,800	8,620.00	489,616,000
ヤマトホールディングス	230,000	3,160.00	726,800,000
山九	42,100	4,785.00	201,448,500
丸運	9,400	279.00	2,622,600
丸全昭和運輸	13,300	3,430.00	45,619,000
センコーグループホールディングス	90,500	1,101.00	99,640,500
トナミホールディングス	3,900	4,780.00	18,642,000
ニッコンホールディングス	55,100	2,458.00	135,435,800
日本石油輸送	1,800	2,589.00	4,660,200
福山通運	21,000	4,235.00	88,935,000
セイノーホールディングス	122,900	1,456.00	178,942,400
エスライン	4,500	897.00	4,036,500
神奈川中央交通	4,100	3,595.00	14,739,500
日立物流	36,100	4,610.00	166,421,000
丸和運輸機関	34,700	1,611.00	55,901,700
C & F ロジホールディングス	16,600	1,682.00	27,921,200
九州旅客鉄道	127,000	2,533.00	321,691,000
S Gホールディングス	310,200	2,894.00	897,718,800
日本郵船	137,600	5,570.00	766,432,000
商船三井	97,700	5,160.00	504,132,000
川崎汽船	50,600	3,890.00	196,834,000
N S ユナイテッド海運	8,500	2,368.00	20,128,000
飯野海運	80,100	453.00	36,285,300
共栄タンカー	4,900	891.00	4,365,900
乾汽船	11,200	1,329.00	14,884,800
日本航空	400,000	2,477.00	990,800,000
A N Aホールディングス	443,100	2,698.50	1,195,705,350
パスコ	3,200	1,669.00	5,340,800
トランコム	5,000	7,980.00	39,900,000
日新	13,100	1,483.00	19,427,300

三菱倉庫	56,800	3,400.00	193,120,000
三井倉庫ホールディングス	17,400	2,503.00	43,552,200
住友倉庫	58,000	1,609.00	93,322,000
澁澤倉庫	9,000	2,120.00	19,080,000
東陽倉庫	27,500	329.00	9,047,500
日本トランスシティ	36,100	544.00	19,638,400
ケイヒン	3,200	1,387.00	4,438,400
中央倉庫	10,000	1,055.00	10,550,000
川西倉庫	3,000	1,154.00	3,462,000
安田倉庫	13,500	955.00	12,892,500
ファイズホールディングス	2,900	837.00	2,427,300
東洋埠頭	5,000	1,531.00	7,655,000
宇徳	11,700	531.00	6,212,700
上組	90,300	2,315.00	209,044,500
サンリツ	4,200	756.00	3,175,200
キムラユニティー	4,400	1,340.00	5,896,000
キューソー流通システム	4,100	1,748.00	7,166,800
近鉄エクスプレス	31,000	2,364.00	73,284,000
東海運	9,300	312.00	2,901,600
エーアイティー	10,300	1,075.00	11,072,500
内外トランスライン	5,800	2,004.00	11,623,200
日本コンセプト	5,200	1,745.00	9,074,000
NEC ネットズエスアイ	56,500	1,750.00	98,875,000
クロスキャット	4,900	1,000.00	4,900,000
システナ	60,900	2,018.00	122,896,200
デジタルアーツ	9,900	8,470.00	83,853,000
日鉄ソリューションズ	24,700	3,610.00	89,167,000
キューブシステム	9,400	1,050.00	9,870,000
エイジア	2,800	2,010.00	5,628,000
コア	7,500	1,469.00	11,017,500
ラクーンホールディングス	12,200	2,344.00	28,596,800
ソリトンシステムズ	8,700	1,663.00	14,468,100
ソフトクリエイイトホールディングス	6,800	2,536.00	17,244,800
T I S	170,200	2,862.00	487,112,400
J N S ホールディングス	8,400	592.00	4,972,800
電算システム	6,500	3,035.00	19,727,500
グリー	104,900	602.00	63,149,800
G M O ペパボ	1,600	4,960.00	7,936,000
コーエーテクモホールディングス	45,300	5,320.00	240,996,000
三菱総合研究所	7,400	3,990.00	29,526,000
電算	2,000	2,447.00	4,894,000
A G S	9,100	884.00	8,044,400

ファインデックス	14,700	1,014.00	14,905,800
ブレインパッド	4,500	4,805.00	21,622,500
K L a b	31,200	686.00	21,403,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	22,900	1,088.00	24,915,200
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,430.00	9,947,000
ネクソン	430,600	2,421.00	1,042,482,600
アイスタイル	52,700	521.00	27,456,700
エムアップホールディングス	4,500	3,595.00	16,177,500
エイチーム	12,000	1,548.00	18,576,000
エニグモ	16,400	1,383.00	22,681,200
テクノスジャパン	13,800	624.00	8,611,200
コロプラ	56,300	819.00	46,109,700
ブロードリーフ	85,100	512.00	43,571,200
クロス・マーケティンググループ	8,200	669.00	5,485,800
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,569.00	12,552,000
システム情報	13,200	925.00	12,210,000
メディアドゥ	6,700	4,545.00	30,451,500
じげん	43,000	419.00	18,017,000
ブイキューブ	9,400	2,628.00	24,703,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	670.00	2,412,000
サイバーリンクス	5,800	1,670.00	9,686,000
フィックスターズ	18,600	855.00	15,903,000
C A R T A H O L D I N G S	7,100	1,855.00	13,170,500
オブティム	12,000	2,270.00	27,240,000
セレス	5,700	3,315.00	18,895,500
S H I F T	8,600	16,290.00	140,094,000
ティーガイア	18,300	1,961.00	35,886,300
セック	2,600	2,643.00	6,871,800
日本アジアグループ	16,400	967.00	15,858,800
テクマトリックス	26,600	1,762.00	46,869,200
プロシップ	5,300	1,418.00	7,515,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,200	2,170.00	89,404,000
G M O ペイメントゲートウェイ	32,600	14,080.00	459,008,000
ザッパラス	7,400	547.00	4,047,800
システムリサーチ	5,100	2,204.00	11,240,400
インターネットイニシアティブ	45,400	3,300.00	149,820,000
さくらインターネット	18,800	631.00	11,862,800
ヴィンクス	5,200	1,011.00	5,257,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,985.00	19,441,500
S R A ホールディングス	9,200	2,697.00	24,812,400
システムインテグレータ	5,400	651.00	3,515,400
朝日ネット	14,300	693.00	9,909,900

e B A S E	20,800	859.00	17,867,200	
アバント	18,500	1,624.00	30,044,000	
アドソル日進	6,200	2,336.00	14,483,200	
ODKソリューションズ	4,000	822.00	3,288,000	
フリービット	10,600	802.00	8,501,200	
コムチュア	15,800	2,366.00	37,382,800	
サイバーコム	3,300	1,514.00	4,996,200	
アステリア	12,700	820.00	10,414,000	
アイル	9,700	1,462.00	14,181,400	
マークライنز	7,200	2,900.00	20,880,000	
メディカル・データ・ビジョン	19,600	2,091.00	40,983,600	
g u m i	24,000	851.00	20,424,000	
ショーケース	4,200	756.00	3,175,200	
モバイルファクトリー	4,100	1,211.00	4,965,100	
テラスカイ	5,600	2,674.00	14,974,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	1,942.00	14,953,400	
P C Iホールディングス	7,900	1,196.00	9,448,400	
パイプドHD	3,700	1,719.00	6,360,300	
アイビーシー	3,200	990.00	3,168,000	
ネオジャパン	3,500	1,532.00	5,362,000	
P R T I M E S	3,700	3,505.00	12,968,500	
ラクス	51,400	2,708.00	139,191,200	
ランドコンピュータ	2,900	1,131.00	3,279,900	
ダブルスタンダード	2,300	5,620.00	12,926,000	
オープンドア	10,300	2,331.00	24,009,300	
マイネット	5,600	781.00	4,373,600	
アカツキ	6,900	3,525.00	24,322,500	
ベネフィットジャパン	1,500	2,094.00	3,141,000	
U b i c o mホールディングス	4,600	3,665.00	16,859,000	
カナミックネットワーク	18,700	659.00	12,323,300	
ノムラシステムコーポレーション	8,800	298.00	2,622,400	
チェンジ	31,400	2,867.00	90,023,800	
シンクロ・フード	11,100	378.00	4,195,800	
オークネット	9,300	1,440.00	13,392,000	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	1,028.00	3,906,400	
セグエグループ	4,700	1,124.00	5,282,800	
エイトレッド	3,400	2,262.00	7,690,800	
A O I T Y O H o l d i n g s	17,600	898.00	15,804,800	
マクロミル	35,200	884.00	31,116,800	
ビーグリー	3,600	1,502.00	5,407,200	
オロ	5,500	3,755.00	20,652,500	
ユーザーローカル	2,600	4,440.00	11,544,000	

テモナ	4,000	1,248.00	4,992,000
ニーズウェル	4,100	627.00	2,570,700
サインポスト	4,100	946.00	3,878,600
ソルクシーズ	6,900	974.00	6,720,600
フェイス	5,700	754.00	4,297,800
プロトコーポレーション	20,600	1,290.00	26,574,000
ハイマックス	5,200	1,125.00	5,850,000
野村総合研究所	295,600	3,615.00	1,068,594,000
サイバネットシステム	12,600	748.00	9,424,800
C Eホールディングス	9,700	527.00	5,111,900
日本システム技術	3,300	1,517.00	5,006,100
インテージホールディングス	21,500	1,555.00	33,432,500
東邦システムサイエンス	4,900	965.00	4,728,500
ソースネクスト	81,900	317.00	25,962,300
インフォコム	15,600	3,010.00	46,956,000
HEROZ	5,000	2,184.00	10,920,000
ラクスル	18,600	5,300.00	98,580,000
I P S	4,100	2,998.00	12,291,800
F I G	19,800	280.00	5,544,000
システムサポート	5,300	1,370.00	7,261,000
イーソル	9,600	1,116.00	10,713,600
アルテリア・ネットワークス	19,100	1,750.00	33,425,000
E d u L a b	1,700	5,550.00	9,435,000
東海ソフト	2,900	1,507.00	4,370,300
ウイングアーク1st	9,100	2,328.00	21,184,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,193.00	8,772,000
サーバーワークス	1,700	4,195.00	7,131,500
東名	2,000	1,035.00	2,070,000
ヴィッツ	1,800	2,051.00	3,691,800
トピラシステムズ	2,500	1,340.00	3,350,000
S a n s a n	15,100	9,850.00	148,735,000
L i n k - U	3,400	1,463.00	4,974,200
ギフティ	10,400	3,380.00	35,152,000
ベース	2,000	5,620.00	11,240,000
フォーカスシステムズ	11,800	1,012.00	11,941,600
クレスコ	11,400	1,850.00	21,090,000
フジ・メディア・ホールディングス	176,800	1,264.00	223,475,200
オービック	53,600	20,960.00	1,123,456,000
ジャストシステム	24,300	6,410.00	155,763,000
T D C ソフト	15,300	1,000.00	15,300,000
Zホールディングス	2,337,600	561.20	1,311,861,120
トレンドマイクロ	90,900	5,840.00	530,856,000

I Dホールディングス	6,800	1,368.00	9,302,400
日本オラクル	34,500	8,700.00	300,150,000
アルファシステムズ	4,600	3,750.00	17,250,000
フューチャー	20,700	1,946.00	40,282,200
C A C Holdings	11,300	1,449.00	16,373,700
S Bテクノロジー	6,200	3,095.00	19,189,000
トーセ	5,100	819.00	4,176,900
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,480.00	112,104,000
伊藤忠テクノソリューションズ	77,600	3,385.00	262,676,000
アイティフォー	22,700	793.00	18,001,100
東計電算	2,600	4,820.00	12,532,000
エクスネット	3,100	1,021.00	3,165,100
大塚商会	92,100	5,890.00	542,469,000
サイボウズ	20,000	2,329.00	46,580,000
電通国際情報サービス	21,100	4,075.00	85,982,500
A C C E S S	21,700	910.00	19,747,000
デジタルガレージ	28,200	4,855.00	136,911,000
E Mシステムズ	28,500	848.00	24,168,000
ウェザーニューズ	5,200	5,630.00	29,276,000
C I J	12,000	847.00	10,164,000
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,195.00	5,751,000
日本エンタープライズ	19,100	215.00	4,106,500
WOWOW	8,300	2,417.00	20,061,100
スカラ	15,600	773.00	12,058,800
インテリジェント ウェイブ	10,500	658.00	6,909,000
I M A G I C A GROUP	15,300	457.00	6,992,100
ネットワンシステムズ	69,500	3,765.00	261,667,500
システムソフト	37,600	169.00	6,354,400
アルゴグラフィックス	13,400	3,385.00	45,359,000
マーベラス	27,300	787.00	21,485,100
エイベックス	29,500	1,602.00	47,259,000
日本ユニシス	59,100	3,410.00	201,531,000
兼松エレクトロニクス	9,400	3,625.00	34,075,000
都築電気	7,800	1,799.00	14,032,200
T B Sホールディングス	113,100	1,739.00	196,680,900
日本テレビホールディングス	142,300	1,298.00	184,705,400
朝日放送グループホールディングス	17,400	708.00	12,319,200
テレビ朝日ホールディングス	52,800	1,759.00	92,875,200
スカパーJ S A Tホールディングス	112,900	419.00	47,305,100
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,150.00	26,660,000
日本BS放送	6,100	1,123.00	6,850,300
ビジョン	21,400	1,185.00	25,359,000

スマートバリュー	4,900	747.00	3,660,300
ワイヤレスゲート	7,900	430.00	3,397,000
コネクシオ	9,900	1,544.00	15,285,600
クロップス	3,600	860.00	3,096,000
日本電信電話	1,989,700	2,897.00	5,764,160,900
K D D I	1,364,200	3,440.00	4,692,848,000
ソフトバンク	1,546,100	1,457.00	2,252,667,700
光通信	20,100	19,480.00	391,548,000
エムティーアイ	17,100	664.00	11,354,400
G M Oインターネット	60,300	3,070.00	185,121,000
ファイバーゲート	5,800	1,462.00	8,479,600
アйдママーケティングコミュニケーション	5,300	408.00	2,162,400
K A D O K A W A	44,100	4,725.00	208,372,500
学研ホールディングス	24,300	1,343.00	32,634,900
ゼンリン	31,200	1,147.00	35,786,400
昭文社ホールディングス	7,700	472.00	3,634,400
インプレスホールディングス	14,100	200.00	2,820,000
アイネット	9,000	1,463.00	13,167,000
松竹	11,300	12,700.00	143,510,000
東宝	100,500	4,625.00	464,812,500
東映	5,600	20,360.00	114,016,000
エヌ・ティ・ティ・データ	453,100	1,734.00	785,675,400
ピー・シー・エー	2,600	3,950.00	10,270,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,738.00	10,428,000
D T S	35,400	2,615.00	92,571,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,600	5,430.00	394,218,000
シーイーシー	18,500	1,602.00	29,637,000
カブコン	145,900	3,255.00	474,904,500
アイ・エス・ビー	8,100	1,460.00	11,826,000
ジャステック	11,100	1,299.00	14,418,900
S C S K	39,300	6,590.00	258,987,000
日本システムウエア	5,800	2,261.00	13,113,800
アイネス	17,000	1,351.00	22,967,000
T K C	28,900	3,375.00	97,537,500
富士ソフト	18,200	5,770.00	105,014,000
N S D	54,900	1,855.00	101,839,500
コナミホールディングス	61,800	7,060.00	436,308,000
福井コンピュータホールディングス	7,900	4,140.00	32,706,000
J B C Cホールディングス	11,800	1,453.00	17,145,400
ミロク情報サービス	17,100	1,571.00	26,864,100
ソフトバンクグループ	1,349,700	7,931.00	10,704,470,700
ハウスイ	1,400	948.00	1,327,200

高千穂交易	6,600	1,139.00	7,517,400
オルパヘルスケアホールディングス	2,800	1,708.00	4,782,400
伊藤忠食品	4,100	5,200.00	21,320,000
エレマテック	13,700	1,291.00	17,686,700
JALUX	4,800	1,828.00	8,774,400
あらた	13,600	4,285.00	58,276,000
トーメンデバイス	2,200	4,070.00	8,954,000
東京エレクトロン デバイス	5,600	5,590.00	31,304,000
フィールズ	14,900	481.00	7,166,900
双日	943,000	344.00	324,392,000
アルフレッサ ホールディングス	177,100	1,741.00	308,331,100
横浜冷凍	47,900	894.00	42,822,600
ラサ商事	9,100	910.00	8,281,000
アルコニクス	18,200	1,475.00	26,845,000
神戸物産	117,800	3,400.00	400,520,000
ハイパー	3,500	545.00	1,907,500
あい ホールディングス	24,400	2,101.00	51,264,400
ディーブイエックス	5,300	1,002.00	5,310,600
ダイワボウホールディングス	77,800	1,833.00	142,607,400
マクニカ・富士エレホールディングス	40,700	2,574.00	104,761,800
ラクト・ジャパン	7,500	2,821.00	21,157,500
グリムス	5,100	1,824.00	9,302,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,700	716.00	21,265,200
八洲電機	13,200	972.00	12,830,400
メディアスホールディングス	9,700	1,034.00	10,029,800
レスターホールディングス	17,800	1,906.00	33,926,800
ジューテックホールディングス	3,900	1,015.00	3,958,500
大光	6,600	692.00	4,567,200
OCHIホールディングス	5,000	1,275.00	6,375,000
TOKAIホールディングス	82,700	891.00	73,685,700
黒谷	4,700	904.00	4,248,800
Cominix	3,000	751.00	2,253,000
三洋貿易	17,200	1,315.00	22,618,000
ビューティガレージ	2,800	4,525.00	12,670,000
ウイン・パートナーズ	12,400	1,001.00	12,412,400
ミタチ産業	4,700	689.00	3,238,300
シップヘルスケアホールディングス	60,200	2,609.00	157,061,800
明治電機工業	5,900	1,408.00	8,307,200
デリカフーズホールディングス	6,700	653.00	4,375,100
スターティアホールディングス	3,300	1,630.00	5,379,000
コメダホールディングス	37,300	2,058.00	76,763,400
ピーバンドットコム	2,400	805.00	1,932,000



アセンテック	4,400	1,346.00	5,922,400
富士興産	5,200	1,165.00	6,058,000
協栄産業	1,900	1,437.00	2,730,300
小野建	15,300	1,278.00	19,553,400
南陽	3,500	1,896.00	6,636,000
佐島電機	10,700	828.00	8,859,600
エコートレーディング	3,600	615.00	2,214,000
伯東	10,400	1,510.00	15,704,000
コンドーテック	13,200	1,004.00	13,252,800
中山福	9,900	465.00	4,603,500
ナガイレーベン	22,700	2,568.00	58,293,600
三菱食品	18,800	2,945.00	55,366,000
松田産業	12,500	2,106.00	26,325,000
第一興商	33,900	4,280.00	145,092,000
メディパルホールディングス	171,100	2,190.00	374,709,000
S P K	7,300	1,374.00	10,030,200
萩原電気ホールディングス	6,300	2,377.00	14,975,100
アズワン	12,300	14,480.00	178,104,000
スズデン	5,900	1,509.00	8,903,100
尾家産業	5,000	1,284.00	6,420,000
シモジマ	10,500	1,120.00	11,760,000
ドウシシャ	16,100	1,703.00	27,418,300
小津産業	3,800	1,952.00	7,417,600
高速	9,100	1,464.00	13,322,400
たけびし	6,000	1,553.00	9,318,000
リックス	3,900	1,537.00	5,994,300
丸文	15,200	630.00	9,576,000
ハピネット	14,300	1,451.00	20,749,300
橋本総業ホールディングス	3,500	2,973.00	10,405,500
日本ライフライン	55,200	1,383.00	76,341,600
タカショー	11,100	820.00	9,102,000
マルカ	5,500	2,479.00	13,634,500
I D O M	57,600	653.00	37,612,800
進和	10,100	2,182.00	22,038,200
エスケイジャパン	4,200	459.00	1,927,800
ダイトロン	7,200	2,005.00	14,436,000
シークス	21,700	1,469.00	31,877,300
田中商事	5,300	684.00	3,625,200
オーハシテクニカ	8,800	1,505.00	13,244,000
白銅	6,100	2,155.00	13,145,500
ダイコー通産	2,000	1,399.00	2,798,000
伊藤忠商事	1,194,200	3,270.00	3,905,034,000

丸紅	1,683,600	991.70	1,669,626,120
高島	2,700	1,868.00	5,043,600
長瀬産業	93,800	1,671.00	156,739,800
蝶理	10,900	1,724.00	18,791,600
豊田通商	171,500	5,420.00	929,530,000
三共生興	25,900	544.00	14,089,600
兼松	68,200	1,476.00	100,663,200
ツカモトコーポレーション	2,800	1,389.00	3,889,200
三井物産	1,362,000	2,550.50	3,473,781,000
日本紙パルプ商事	8,900	3,565.00	31,728,500
カメイ	22,300	1,150.00	25,645,000
東都水産	2,000	4,880.00	9,760,000
OUGホールディングス	2,700	2,843.00	7,676,100
スターゼン	12,600	2,145.00	27,027,000
山善	66,700	1,001.00	66,766,700
椿本興業	3,200	3,450.00	11,040,000
住友商事	1,077,500	1,532.50	1,651,268,750
内田洋行	7,300	4,660.00	34,018,000
三菱商事	1,039,500	3,089.00	3,211,015,500
第一実業	7,800	4,230.00	32,994,000
キャノンマーケティングジャパン	42,300	2,656.00	112,348,800
西華産業	9,000	1,665.00	14,985,000
佐藤商事	14,100	1,117.00	15,749,700
菱洋エレクトロ	13,000	2,548.00	33,124,000
東京産業	15,500	622.00	9,641,000
ユアサ商事	17,500	3,095.00	54,162,500
神鋼商事	3,800	2,457.00	9,336,600
トルク	10,400	242.00	2,516,800
阪和興業	34,200	3,290.00	112,518,000
正栄食品工業	11,100	3,795.00	42,124,500
カナデン	13,900	1,074.00	14,928,600
菱電商事	12,300	1,647.00	20,258,100
フルサト工業	8,700	1,926.00	16,756,200
岩谷産業	41,000	6,510.00	266,910,000
ナイス	6,800	2,042.00	13,885,600
ニチモウ	2,700	2,076.00	5,605,200
極東貿易	4,900	2,468.00	12,093,200
アステナホールディングス	24,600	642.00	15,793,200
三愛石油	42,100	1,345.00	56,624,500
稲畑産業	41,000	1,711.00	70,151,000
G S I クレオス	8,400	995.00	8,358,000
明和産業	15,800	469.00	7,410,200

クワザワホールディングス	6,100	618.00	3,769,800
ヤマエ久野	12,500	1,156.00	14,450,000
ワキタ	33,600	1,064.00	35,750,400
東邦ホールディングス	54,800	1,787.00	97,927,600
サンゲツ	46,100	1,586.00	73,114,600
ミツウロコグループホールディングス	25,200	1,193.00	30,063,600
シナネンホールディングス	6,300	3,080.00	19,404,000
伊藤忠エネクス	37,800	993.00	37,535,400
サンリオ	48,000	1,933.00	92,784,000
サンワテクノス	11,300	1,191.00	13,458,300
リョーサン	18,900	2,063.00	38,990,700
新光商事	23,100	745.00	17,209,500
トーホー	7,700	1,634.00	12,581,800
三信電気	9,200	2,141.00	19,697,200
東陽テクニカ	16,900	1,082.00	18,285,800
モスフードサービス	24,100	3,070.00	73,987,000
加賀電子	15,500	2,930.00	45,415,000
ソーダニッカ	16,300	550.00	8,965,000
立花エレテック	12,600	1,455.00	18,333,000
フォーバル	6,000	868.00	5,208,000
PALTAC	27,400	5,650.00	154,810,000
三谷産業	22,600	386.00	8,723,600
西本Wismettacホールディングス	3,900	2,719.00	10,604,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	1,895.00	2,842,500
コア商事ホールディングス	12,900	710.00	9,159,000
国際紙パルプ商事	36,500	252.00	9,198,000
ヤマタネ	7,400	1,574.00	11,647,600
丸紅建材リース	1,700	1,822.00	3,097,400
日鉄物産	12,200	4,375.00	53,375,000
泉州電業	4,800	3,725.00	17,880,000
トラスコ中山	39,100	2,858.00	111,747,800
オートバックスセブン	63,400	1,475.00	93,515,000
モリト	12,500	609.00	7,612,500
加藤産業	24,700	3,420.00	84,474,000
北恵	4,400	989.00	4,351,600
イノテック	9,600	1,359.00	13,046,400
イエローハット	32,300	1,987.00	64,180,100
JKホールディングス	15,500	787.00	12,198,500
日伝	14,200	2,233.00	31,708,600
北沢産業	11,700	248.00	2,901,600
杉本商事	8,600	2,291.00	19,702,600
因幡電機産業	45,600	2,602.00	118,651,200

東テク	5,700	2,703.00	15,407,100
ミスミグループ本社	214,200	3,725.00	797,895,000
アルテック	12,600	347.00	4,372,200
タキヒヨー	5,700	1,909.00	10,881,300
蔵王産業	3,300	1,478.00	4,877,400
スズケン	72,300	3,395.00	245,458,500
ジェコス	11,800	906.00	10,690,800
グローセル	18,600	444.00	8,258,400
ローソン	43,200	5,070.00	219,024,000
サンエー	13,000	4,230.00	54,990,000
カワチ薬品	12,100	2,242.00	27,128,200
エービーシー・マート	26,700	6,420.00	171,414,000
ハードオフコーポレーション	8,100	770.00	6,237,000
アスクル	27,800	1,869.00	51,958,200
ゲオホールディングス	23,200	1,258.00	29,185,600
アダストリア	23,900	2,105.00	50,309,500
くら寿司	20,200	4,485.00	90,597,000
キャンドウ	8,300	1,955.00	16,226,500
アイケイ	5,500	786.00	4,323,000
パルグループホールディングス	15,200	1,717.00	26,098,400
エディオン	72,700	1,047.00	76,116,900
サーラコーポレーション	35,400	588.00	20,815,200
ワッツ	8,700	937.00	8,151,900
ハローズ	7,000	2,658.00	18,606,000
フジオフードグループ本社	14,400	1,291.00	18,590,400
あみやき亭	3,800	2,952.00	11,217,600
大黒天物産	5,500	8,490.00	46,695,000
ハニーズホールディングス	13,900	1,015.00	14,108,500
ファーマライズホールディングス	4,700	786.00	3,694,200
アルペン	13,200	2,985.00	39,402,000
ハブ	6,000	751.00	4,506,000
クオールホールディングス	23,300	1,485.00	34,600,500
ジーンズホールディングス	11,700	8,350.00	97,695,000
ビックカメラ	101,600	1,126.00	114,401,600
D C Mホールディングス	105,700	1,074.00	113,521,800
Monotaro	243,000	2,606.00	633,258,000
東京一番フーズ	5,000	589.00	2,945,000
きちりホールディングス	4,500	590.00	2,655,000
アーランドサービスホールディングス	14,400	2,199.00	31,665,600
J.フロント リテイリング	204,300	1,060.00	216,558,000
ドトール・日レスホールディングス	27,200	1,725.00	46,920,000
マツモトキヨシホールディングス	70,700	4,965.00	351,025,500

ブロンコピリー	9,100	2,425.00	22,067,500
Z O Z O	100,800	3,690.00	371,952,000
トレジャー・ファクトリー	5,400	953.00	5,146,200
物語コーポレーション	9,200	7,250.00	66,700,000
ココカラファイン	15,300	8,320.00	127,296,000
三越伊勢丹ホールディングス	299,200	800.00	239,360,000
H a m e e	4,700	1,535.00	7,214,500
マーケットエンタープライズ	1,500	1,146.00	1,719,000
ウエルシアホールディングス	90,400	3,685.00	333,124,000
クリエイティブSDホールディングス	25,300	3,325.00	84,122,500
丸善C H Iホールディングス	19,900	415.00	8,258,500
ミサワ	4,100	678.00	2,779,800
ティーライフ	2,600	1,541.00	4,006,600
チムニー	5,200	1,357.00	7,056,400
シュッピン	12,000	1,080.00	12,960,000
オイシックス・ラ・大地	22,600	3,685.00	83,281,000
ネクステージ	30,300	1,880.00	56,964,000
ジョイフル本田	50,300	1,391.00	69,967,300
鳥貴族ホールディングス	6,500	1,816.00	11,804,000
ホットランド	13,100	1,347.00	17,645,700
すかいらーくホールディングス	217,800	1,556.00	338,896,800
S F Pホールディングス	8,300	1,442.00	11,968,600
綿半ホールディングス	13,200	1,210.00	15,972,000
ヨシックスホールディングス	3,500	2,287.00	8,004,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,000	1,093.00	54,650,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	1,522.00	13,850,200
B E E N O S	8,700	3,615.00	31,450,500
あさひ	13,000	1,442.00	18,746,000
日本調剤	10,600	1,587.00	16,822,200
コスモス薬品	17,200	17,080.00	293,776,000
トーエル	8,800	804.00	7,075,200
オンリー	3,800	467.00	1,774,600
セブン&アイ・ホールディングス	667,900	5,033.00	3,361,540,700
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	91,800	899.00	82,528,200
ツルハホールディングス	37,300	12,840.00	478,932,000
サンマルクホールディングス	13,800	1,604.00	22,135,200
フェリシモ	4,100	1,404.00	5,756,400
トリドールホールディングス	42,500	1,897.00	80,622,500
T O K Y O B A S E	16,000	728.00	11,648,000
ウイルプラスホールディングス	3,000	1,114.00	3,342,000
J Mホールディングス	11,700	2,131.00	24,932,700

サツドラホールディングス	2,800	2,058.00	5,762,400
アレンザホールディングス	13,300	1,274.00	16,944,200
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,847.00	8,680,900
パロックジャパンリミテッド	12,400	804.00	9,969,600
クスリのアオキホールディングス	17,000	8,430.00	143,310,000
力の源ホールディングス	7,800	633.00	4,937,400
FOOD & LIFE COMPANIES	100,000	4,875.00	487,500,000
メディカルシステムネットワーク	15,500	717.00	11,113,500
はるやまホールディングス	8,600	671.00	5,770,600
ノジマ	30,500	2,817.00	85,918,500
カップ・クリエイト	23,900	1,480.00	35,372,000
ライトオン	12,800	709.00	9,075,200
良品計画	196,700	2,232.00	439,034,400
三城ホールディングス	22,700	269.00	6,106,300
アドヴァン	17,800	950.00	16,910,000
アルビス	5,700	2,328.00	13,269,600
コナカ	20,100	346.00	6,954,600
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,644.00	3,781,200
G - 7ホールディングス	8,400	3,255.00	27,342,000
イオン北海道	22,700	1,104.00	25,060,800
コジマ	30,000	728.00	21,840,000
ヒマラヤ	6,400	1,073.00	6,867,200
コーナン商事	24,400	3,845.00	93,818,000
エコス	6,500	1,933.00	12,564,500
ワタミ	22,400	967.00	21,660,800
マルシェ	4,500	518.00	2,331,000
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	341,400	2,309.00	788,292,600
西松屋チェーン	37,700	1,557.00	58,698,900
ゼンショーホールディングス	91,800	2,904.00	266,587,200
幸楽苑ホールディングス	10,800	1,553.00	16,772,400
ハークスレイ	4,000	1,003.00	4,012,000
サイゼリヤ	25,500	2,625.00	66,937,500
V Tホールディングス	65,200	465.00	30,318,000
魚力	5,500	2,040.00	11,220,000
フジ・コーポレーション	9,400	1,283.00	12,060,200
ユナイテッドアローズ	19,700	2,173.00	42,808,100
ハイデイ日高	24,900	1,801.00	44,844,900
京都きもの友禅	12,400	271.00	3,360,400
コロナイド	56,700	1,977.00	112,095,900
ピーシーデポコーポレーション	20,800	456.00	9,484,800
壱番屋	12,100	4,910.00	59,411,000

P L A N T	4,900	729.00	3,572,100
スギホールディングス	34,100	8,700.00	296,670,000
薬王堂ホールディングス	7,600	2,408.00	18,300,800
スクロール	24,900	872.00	21,712,800
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,921.00	30,543,900
木曽路	22,500	2,362.00	53,145,000
S R S ホールディングス	22,600	814.00	18,396,400
リテールパートナーズ	21,100	1,204.00	25,404,400
ケーヨー	31,800	801.00	25,471,800
上新電機	19,700	2,737.00	53,918,900
日本瓦斯	84,600	1,873.00	158,455,800
ロイヤルホールディングス	29,800	2,224.00	66,275,200
いなげや	19,100	1,496.00	28,573,600
チヨダ	18,200	884.00	16,088,800
ライフコーポレーション	17,100	3,545.00	60,619,500
リンガーハット	21,000	2,313.00	48,573,000
M r M a x H D	24,100	648.00	15,616,800
A O K I ホールディングス	34,800	663.00	23,072,400
オークワ	26,900	1,094.00	29,428,600
コメリ	26,500	2,656.00	70,384,000
青山商事	38,500	765.00	29,452,500
しまむら	19,900	9,940.00	197,806,000
はせがわ	10,500	299.00	3,139,500
高島屋	124,500	1,308.00	162,846,000
松屋	37,500	959.00	35,962,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,100	934.00	75,747,400
近鉄百貨店	6,700	3,115.00	20,870,500
丸井グループ	144,500	2,186.00	315,877,000
アクシアル リテイリング	14,300	3,835.00	54,840,500
イオン	657,000	3,027.00	1,988,739,000
イズミ	34,800	4,200.00	146,160,000
平和堂	31,600	2,240.00	70,784,000
フジ	20,700	2,017.00	41,751,900
ヤオコー	19,400	6,370.00	123,578,000
ゼビオホールディングス	21,100	978.00	20,635,800
ケースホールディングス	145,600	1,271.00	185,057,600
O l y m p i c グループ	9,300	790.00	7,347,000
日産東京販売ホールディングス	26,900	235.00	6,321,500
シルバーライフ	3,700	2,204.00	8,154,800
Genky DrugStores	7,600	3,800.00	28,880,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	1,109.00	4,103,300
ブックオフグループホールディングス	10,000	954.00	9,540,000

ギフト	2,300	2,485.00	5,715,500
アインホールディングス	24,800	6,790.00	168,392,000
元気寿司	4,900	2,617.00	12,823,300
ヤマダホールディングス	573,100	516.00	295,719,600
アークランドサカモト	27,000	1,526.00	41,202,000
ニトリホールディングス	67,800	19,620.00	1,330,236,000
グルメ杵屋	12,600	968.00	12,196,800
愛眼	13,600	226.00	3,073,600
ケーユーホールディングス	9,400	973.00	9,146,200
吉野家ホールディングス	56,300	2,137.00	120,313,100
松屋フーズホールディングス	8,300	3,515.00	29,174,500
サガミホールディングス	24,500	1,029.00	25,210,500
関西スーパーマーケット	13,300	1,002.00	13,326,600
王将フードサービス	11,400	5,680.00	64,752,000
プレナス	19,300	2,047.00	39,507,100
ミニストップ	12,800	1,418.00	18,150,400
アークス	32,800	2,435.00	79,868,000
パローホールディングス	35,100	2,341.00	82,169,100
ベルク	8,500	5,470.00	46,495,000
大庄	9,500	1,050.00	9,975,000
ファーストリテイリング	22,800	82,710.00	1,885,788,000
サンドラッグ	64,300	3,590.00	230,837,000
サックスパー ホールディングス	15,100	657.00	9,920,700
ヤマザワ	4,200	1,734.00	7,282,800
やまや	3,500	2,262.00	7,917,000
ベルーナ	37,100	983.00	36,469,300
島根銀行	5,900	644.00	3,799,600
じもとホールディングス	11,600	642.00	7,447,200
めぶきフィナンシャルグループ	888,400	236.00	209,662,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,400	1,485.00	31,779,000
九州フィナンシャルグループ	349,100	398.00	138,941,800
ゆうちょ銀行	484,400	940.00	455,336,000
富山第一銀行	40,800	277.00	11,301,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,041,600	428.00	445,804,800
西日本フィナンシャルホールディングス	111,700	655.00	73,163,500
三十三フィナンシャルグループ	14,800	1,361.00	20,142,800
第四北越フィナンシャルグループ	27,800	2,443.00	67,915,400
ひろぎんホールディングス	252,200	582.00	146,780,400
新生銀行	139,400	1,501.00	209,239,400
あおぞら銀行	101,900	2,509.00	255,667,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,695,600	607.90	7,109,755,240
りそなホールディングス	1,973,100	439.10	866,388,210



三井住友トラスト・ホールディングス	323,200	3,634.00	1,174,508,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,183,200	3,893.00	4,606,197,600
千葉銀行	570,600	682.00	389,149,200
群馬銀行	351,900	358.00	125,980,200
武蔵野銀行	25,500	1,691.00	43,120,500
千葉興業銀行	43,500	261.00	11,353,500
筑波銀行	71,100	174.00	12,371,400
七十七銀行	53,600	1,233.00	66,088,800
青森銀行	13,200	2,118.00	27,957,600
秋田銀行	10,200	1,397.00	14,249,400
山形銀行	19,200	837.00	16,070,400
岩手銀行	11,200	1,728.00	19,353,600
東邦銀行	152,900	214.00	32,720,600
東北銀行	8,200	1,016.00	8,331,200
みちのく銀行	11,000	943.00	10,373,000
ふくおかフィナンシャルグループ	154,300	1,956.00	301,810,800
静岡銀行	416,400	883.00	367,681,200
十六銀行	21,400	1,989.00	42,564,600
スルガ銀行	149,900	342.00	51,265,800
八十二銀行	385,100	367.00	141,331,700
山梨中央銀行	19,800	840.00	16,632,000
大垣共立銀行	33,800	1,904.00	64,355,200
福井銀行	14,600	1,409.00	20,571,400
北國銀行	15,900	2,229.00	35,441,100
清水銀行	7,000	1,512.00	10,584,000
富山銀行	3,300	2,395.00	7,903,500
滋賀銀行	34,300	2,007.00	68,840,100
南都銀行	24,900	1,856.00	46,214,400
百五銀行	153,900	309.00	47,555,100
京都銀行	61,200	5,080.00	310,896,000
紀陽銀行	60,500	1,470.00	88,935,000
ほくほくフィナンシャルグループ	113,800	828.00	94,226,400
山陰合同銀行	107,700	548.00	59,019,600
中国銀行	147,100	872.00	128,271,200
鳥取銀行	5,400	1,113.00	6,010,200
伊予銀行	226,500	553.00	125,254,500
百十四銀行	18,200	1,483.00	26,990,600
四国銀行	24,200	705.00	17,061,000
阿波銀行	26,200	2,088.00	54,705,600
大分銀行	9,800	1,688.00	16,542,400
宮崎銀行	10,700	1,996.00	21,357,200
佐賀銀行	9,700	1,393.00	13,512,100

沖縄銀行	15,700	2,552.00	40,066,400
琉球銀行	37,100	722.00	26,786,200
セブン銀行	571,200	235.00	134,232,000
みずほフィナンシャルグループ	2,323,200	1,609.50	3,739,190,400
高知銀行	6,200	851.00	5,276,200
山口フィナンシャルグループ	213,400	651.00	138,923,400
長野銀行	5,600	1,124.00	6,294,400
名古屋銀行	13,800	2,572.00	35,493,600
北洋銀行	257,700	244.00	62,878,800
愛知銀行	5,700	2,795.00	15,931,500
中京銀行	6,100	1,454.00	8,869,400
大光銀行	5,900	1,349.00	7,959,100
愛媛銀行	23,900	798.00	19,072,200
トマト銀行	6,600	1,035.00	6,831,000
京葉銀行	72,900	409.00	29,816,100
栃木銀行	82,600	174.00	14,372,400
北日本銀行	5,300	1,703.00	9,025,900
東和銀行	30,000	519.00	15,570,000
福島銀行	19,600	239.00	4,684,400
大東銀行	8,200	609.00	4,993,800
トモニホールディングス	132,200	299.00	39,527,800
フィデアホールディングス	166,000	121.00	20,086,000
池田泉州ホールディングス	196,600	160.00	31,456,000
F P G	57,900	744.00	43,077,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,700	1,450.00	16,965,000
マーキュリアインベストメント	7,000	750.00	5,250,000
S B Iホールディングス	210,800	2,651.00	558,830,800
ジャフコ グループ	26,300	6,720.00	176,736,000
大和証券グループ本社	1,280,800	614.00	786,411,200
野村ホールディングス	2,610,900	571.90	1,493,173,710
岡三証券グループ	146,300	421.00	61,592,300
丸三証券	51,200	612.00	31,334,400
東洋証券	57,900	164.00	9,495,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	182,900	395.00	72,245,500
光世証券	4,500	628.00	2,826,000
水戸証券	46,500	299.00	13,903,500
いちよし証券	34,700	569.00	19,744,300
松井証券	84,000	807.00	67,788,000
マネックスグループ	153,700	738.00	113,430,600
極東証券	23,200	811.00	18,815,200
岩井コスモホールディングス	17,700	1,642.00	29,063,400
藍澤証券	30,900	1,010.00	31,209,000

マネーパートナーズグループ	19,300	233.00	4,496,900
スパークス・グループ	79,900	257.00	20,534,300
かんぽ生命保険	212,000	2,068.00	438,416,000
S O M P Oホールディングス	301,400	4,176.00	1,258,646,400
アニコム ホールディングス	48,100	890.00	42,809,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	415,200	3,236.00	1,343,587,200
第一生命ホールディングス	903,200	2,034.00	1,837,108,800
東京海上ホールディングス	563,100	5,127.00	2,887,013,700
T & Dホールディングス	511,000	1,449.00	740,439,000
アドバンスクリエイト	8,100	909.00	7,362,900
全国保証	44,500	4,785.00	212,932,500
イントラスト	5,300	743.00	3,937,900
日本モーゲージサービス	9,000	993.00	8,937,000
C a s a	5,100	977.00	4,982,700
アルヒ	25,500	1,439.00	36,694,500
プレミアグループ	8,000	3,495.00	27,960,000
クレディセゾン	100,000	1,381.00	138,100,000
芙蓉総合リース	18,000	6,980.00	125,640,000
みずほリース	26,500	3,680.00	97,520,000
東京センチュリー	39,800	5,900.00	234,820,000
日本証券金融	72,700	801.00	58,232,700
アイフル	287,700	389.00	111,915,300
リコーリース	13,500	3,475.00	46,912,500
イオンフィナンシャルサービス	104,900	1,312.00	137,628,800
アコム	344,300	507.00	174,560,100
ジャックス	19,000	2,627.00	49,913,000
オリエントコーポレーション	464,600	149.00	69,225,400
オリックス	1,038,100	1,925.00	1,998,342,500
三菱H C キャピタル	591,900	596.00	352,772,400
九州リースサービス	8,900	671.00	5,971,900
日本取引所グループ	462,000	2,535.00	1,171,170,000
イー・ギャランティ	19,800	2,412.00	47,757,600
アサックス	9,300	701.00	6,519,300
N E C キャピタルソリューション	7,100	2,178.00	15,463,800
いちご	194,600	358.00	69,666,800
日本駐車場開発	197,100	163.00	32,127,300
スター・マイカ・ホールディングス	10,200	1,156.00	11,791,200
S R E ホールディングス	2,800	7,100.00	19,880,000
A Dワークスグループ	34,300	164.00	5,625,200
ヒューリック	363,900	1,290.00	469,431,000
三栄建築設計	7,600	2,016.00	15,321,600
野村不動産ホールディングス	104,500	2,858.00	298,661,000

三重交通グループホールディングス	37,900	486.00	18,419,400
サムティ	25,100	2,047.00	51,379,700
ディア・ライフ	25,300	458.00	11,587,400
日本商業開発	11,700	1,850.00	21,645,000
プレサンスコーポレーション	29,200	1,501.00	43,829,200
ハウスコム	4,200	1,250.00	5,250,000
日本管理センター	10,400	1,329.00	13,821,600
サンセイランディック	6,800	877.00	5,963,600
フージャースホールディングス	27,900	725.00	20,227,500
オープンハウス	54,600	5,240.00	286,104,000
東急不動産ホールディングス	467,100	693.00	323,700,300
飯田グループホールディングス	143,100	2,962.00	423,862,200
イーランド	4,300	1,040.00	4,472,000
ムゲンエステート	13,500	511.00	6,898,500
ハウズドゥ	8,400	1,027.00	8,626,800
シーアールイー	5,500	1,605.00	8,827,500
グッドコムアセット	9,300	1,352.00	12,573,600
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,905.00	14,058,000
テンポイノベーション	6,600	869.00	5,735,400
フェイスネットワーク	2,600	1,338.00	3,478,800
パーク24	92,500	1,985.00	183,612,500
パラカ	5,400	1,612.00	8,704,800
三井不動産	779,800	2,670.50	2,082,455,900
三菱地所	1,124,000	1,837.00	2,064,788,000
平和不動産	29,600	4,215.00	124,764,000
東京建物	169,800	1,604.00	272,359,200
ダイビル	44,400	1,407.00	62,470,800
京阪神ビルディング	30,600	1,392.00	42,595,200
住友不動産	384,700	4,078.00	1,568,806,600
テーオーシー	35,800	687.00	24,594,600
東京楽天地	3,200	4,205.00	13,456,000
スターツコーポレーション	20,900	2,760.00	57,684,000
フジ住宅	22,300	627.00	13,982,100
空港施設	19,500	617.00	12,031,500
明和地所	10,600	614.00	6,508,400
ゴールドクレスト	16,300	1,728.00	28,166,400
エスリード	7,600	1,604.00	12,190,400
日神グループホールディングス	28,600	465.00	13,299,000
日本エスコン	31,000	774.00	23,994,000
タカラレーベン	71,600	339.00	24,272,400
A V A N T I A	10,600	898.00	9,518,800
イオンモール	86,600	1,776.00	153,801,600

毎日コムネット	8,000	733.00	5,864,000
ファースト住建	8,600	1,216.00	10,457,600
カチタス	42,800	3,165.00	135,462,000
トーセイ	25,000	1,067.00	26,675,000
穴吹興産	4,500	2,026.00	9,117,000
サンフロンティア不動産	22,600	1,025.00	23,165,000
エフ・ジェー・ネクスト	18,300	1,022.00	18,702,600
インテリックス	3,800	726.00	2,758,800
ランドビジネス	7,200	359.00	2,584,800
サンネクスタグループ	6,900	1,026.00	7,079,400
グランディハウス	15,300	428.00	6,548,400
日本空港ビルデング	59,700	5,290.00	315,813,000
明豊ファシリティワークス	8,000	841.00	6,728,000
日本工営	10,400	3,250.00	33,800,000
L I F U L L	51,500	347.00	17,870,500
ミクシィ	42,200	2,853.00	120,396,600
ジェイエイシーリクルートメント	11,600	1,767.00	20,497,200
日本M&Aセンター	271,800	2,843.00	772,727,400
メンバーズ	5,000	3,325.00	16,625,000
中広	3,200	364.00	1,164,800
UTグループ	24,000	3,165.00	75,960,000
アイティメディア	5,700	2,025.00	11,542,500
タケエイ	18,700	1,502.00	28,087,400
E・Jホールディングス	9,000	1,071.00	9,639,000
夢真ビーネックスグループ	44,300	1,284.00	56,881,200
コシダカホールディングス	44,800	609.00	27,283,200
アルトナー	4,400	863.00	3,797,200
パソナグループ	18,100	2,227.00	40,308,700
C D S	4,300	1,561.00	6,712,300
リンクアンドモチベーション	30,400	696.00	21,158,400
G C A	22,000	984.00	21,648,000
エス・エム・エス	56,400	3,220.00	181,608,000
サニーサイドアップグループ	6,100	797.00	4,861,700
パーソルホールディングス	165,800	2,219.00	367,910,200
リニカル	9,700	886.00	8,594,200
クックパッド	53,300	251.00	13,378,300
アイ・ケイ・ケイ	8,600	670.00	5,762,000
学情	6,100	1,399.00	8,533,900
スタジオアリス	8,500	2,391.00	20,323,500
シミックホールディングス	9,400	1,599.00	15,030,600
エプコ	4,400	940.00	4,136,000
N J S	4,200	2,092.00	8,786,400

総合警備保障	66,000	5,100.00	336,600,000
カカクコム	122,500	3,290.00	403,025,000
アイロムグループ	6,000	2,037.00	12,222,000
セントケア・ホールディング	12,400	1,026.00	12,722,400
サイネックス	3,300	695.00	2,293,500
ルネサンス	10,600	1,241.00	13,154,600
ディップ	26,000	3,500.00	91,000,000
デジタルホールディングス	11,700	2,236.00	26,161,200
新日本科学	20,600	832.00	17,139,200
キャリアデザインセンター	4,500	1,055.00	4,747,500
ベネフィット・ワン	60,400	3,445.00	208,078,000
エムスリー	292,300	7,862.00	2,298,062,600
ツカダ・グローバルホールディング	13,200	384.00	5,068,800
アウトソーシング	95,000	2,014.00	191,330,000
ウェルネット	17,300	534.00	9,238,200
ワールドホールディングス	5,800	2,960.00	17,168,000
ディー・エヌ・エー	70,200	2,306.00	161,881,200
博報堂D Yホールディングス	230,700	1,753.00	404,417,100
ぐるなび	29,400	538.00	15,817,200
タカミヤ	20,700	520.00	10,764,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	864.00	9,676,800
ファンコミュニケーションズ	46,400	393.00	18,235,200
ライク	4,500	2,122.00	9,549,000
ビジネス・ブレークスルー	7,700	436.00	3,357,200
エスプール	42,900	1,025.00	43,972,500
WDBホールディングス	7,700	2,878.00	22,160,600
手間いらず	2,100	6,690.00	14,049,000
ティア	10,300	469.00	4,830,700
C D G	1,700	1,588.00	2,699,600
アドウェイズ	27,300	850.00	23,205,000
バリューコマース	11,200	3,255.00	36,456,000
インフォマート	167,900	928.00	155,811,200
J Pホールディングス	48,500	274.00	13,289,000
エコナックホールディングス	33,500	90.00	3,015,000
E P Sホールディングス	25,100	1,798.00	45,129,800
レッグス	4,200	2,709.00	11,377,800
プレステージ・インターナショナル	62,500	693.00	43,312,500
アミューズ	9,200	2,380.00	21,896,000
ドリームインキュベータ	5,400	993.00	5,362,200
クイック	10,500	1,253.00	13,156,500
T A C	10,400	235.00	2,444,000
電通グループ	186,400	3,990.00	743,736,000

イオンファンタジー	6,500	2,236.00	14,534,000
シーティーエス	19,100	856.00	16,349,600
ネクシィーズグループ	6,100	921.00	5,618,100
H．U．グループホールディングス	46,500	2,899.00	134,803,500
アルプス技研	14,800	2,011.00	29,762,800
ダイオーズ	3,600	1,030.00	3,708,000
日本空調サービス	17,800	724.00	12,887,200
オリエンタルランド	176,200	16,085.00	2,834,177,000
ダスキン	38,600	2,544.00	98,198,400
明光ネットワークジャパン	20,000	576.00	11,520,000
ファルコホールディングス	8,100	1,681.00	13,616,100
ラウンドワン	56,700	1,406.00	79,720,200
リゾートトラスト	76,100	1,831.00	139,339,100
ビー・エム・エル	21,400	3,680.00	78,752,000
りらいあコミュニケーションズ	25,400	1,348.00	34,239,200
リソー教育	85,100	334.00	28,423,400
早稲田アカデミー	7,400	920.00	6,808,000
ユー・エス・エス	185,600	1,945.00	360,992,000
東京個別指導学院	15,100	625.00	9,437,500
サイバーエージェント	408,400	2,376.00	970,358,400
楽天グループ	773,300	1,251.00	967,398,300
クリーク・アンド・リバー社	8,900	1,493.00	13,287,700
モーニングスター	24,900	455.00	11,329,500
テー・オー・ダブリュー	30,000	343.00	10,290,000
山田コンサルティンググループ	9,900	1,213.00	12,008,700
セントラルスポーツ	6,300	2,468.00	15,548,400
フルキャストホールディングス	14,300	2,272.00	32,489,600
エン・ジャパン	29,500	3,965.00	116,967,500
リソルホールディングス	1,900	4,020.00	7,638,000
テクノプロ・ホールディングス	33,100	7,830.00	259,173,000
アトラグループ	3,800	319.00	1,212,200
インターワークス	5,500	418.00	2,299,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,700	13,920.00	93,264,000
K e e P e r 技研	10,800	2,956.00	31,924,800
ファーストロジック	3,600	730.00	2,628,000
三機サービス	3,500	1,042.00	3,647,000
G u n o s y	10,700	946.00	10,122,200
デザインワン・ジャパン	5,500	223.00	1,226,500
イー・ガーディアン	6,800	2,828.00	19,230,400
リブセンス	10,600	226.00	2,395,600
ジャパンマテリアル	51,200	1,339.00	68,556,800
ベクトル	21,000	943.00	19,803,000

ウチヤマホールディングス	9,000	382.00	3,438,000
チャーム・ケア・コーポレーション	12,600	1,209.00	15,233,400
キャリアリンク	5,600	2,168.00	12,140,800
I B J	13,900	1,059.00	14,720,100
アサンテ	6,200	1,750.00	10,850,000
バリューHR	6,800	1,663.00	11,308,400
M & Aキャピタルパートナーズ	13,700	5,070.00	69,459,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,450.00	9,570,000
E R Iホールディングス	5,200	643.00	3,343,600
アビスト	2,700	2,932.00	7,916,400
シグマクシス	9,200	2,280.00	20,976,000
ウィルグループ	12,500	1,005.00	12,562,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	25,800	254.00	6,553,200
メドピア	12,800	4,475.00	57,280,000
レアジョブ	3,300	1,794.00	5,920,200
リクルートホールディングス	1,186,600	5,522.00	6,552,405,200
エラン	23,100	1,284.00	29,660,400
土木管理総合試験所	8,900	390.00	3,471,000
ネットマーケティング	8,800	406.00	3,572,800
日本郵政	1,253,600	919.40	1,152,559,840
ベルシステム24ホールディングス	27,900	1,770.00	49,383,000
鎌倉新書	17,000	983.00	16,711,000
S M N	4,000	801.00	3,204,000
グローバルキッズCOMPANY	3,300	966.00	3,187,800
エアトリ	10,500	2,909.00	30,544,500
アトラエ	11,700	1,969.00	23,037,300
ストライク	6,300	4,260.00	26,838,000
ソラスト	40,900	1,404.00	57,423,600
セラク	5,400	2,270.00	12,258,000
インソース	16,200	2,396.00	38,815,200
ベikalレント・コンサルティング	10,900	36,500.00	397,850,000
Orchestra Holdings	3,800	3,010.00	11,438,000
アイモバイル	4,900	1,800.00	8,820,000
キャリアインデックス	7,200	957.00	6,890,400
MS - Japan	7,000	1,209.00	8,463,000
船場	3,700	810.00	2,997,000
グレイステクノロジー	17,000	1,579.00	26,843,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,900	2,557.00	122,480,300
フルテック	2,600	1,391.00	3,616,600
GameWith	5,500	576.00	3,168,000
ソウルドアウト	4,100	1,790.00	7,339,000
MS&Consulting	3,200	597.00	1,910,400



ウェルビー	6,300	1,420.00	8,946,000
エル・ティー・エス	1,700	3,600.00	6,120,000
ミダック	3,600	6,840.00	24,624,000
日総工産	13,300	823.00	10,945,900
キュービーネットホールディングス	7,700	1,786.00	13,752,200
R P Aホールディングス	19,800	717.00	14,196,600
スプリックス	5,000	1,275.00	6,375,000
マネジメントソリューションズ	8,200	2,769.00	22,705,800
プロレド・パートナーズ	3,100	2,804.00	8,692,400
テノ・ホールディングス	2,000	1,200.00	2,400,000
フロンティア・マネジメント	4,000	1,137.00	4,548,000
ピアラ	1,500	1,076.00	1,614,000
コプロ・ホールディングス	2,400	1,284.00	3,081,600
ギークス	3,000	1,848.00	5,544,000
カーブスホールディングス	45,800	909.00	41,632,200
フォーラムエンジニアリング	11,800	956.00	11,280,800
ダイレクトマーケティングミックス	8,900	4,145.00	36,890,500
ポピンズホールディングス	4,500	4,655.00	20,947,500
L I T A L I C O	6,700	5,070.00	33,969,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,700	1,089.00	9,474,300
リログループ	90,700	2,576.00	233,643,200
東祥	10,500	1,932.00	20,286,000
エイチ・アイ・エス	26,000	2,588.00	67,288,000
ラックランド	4,800	2,771.00	13,300,800
共立メンテナンス	27,500	3,800.00	104,500,000
イチネンホールディングス	17,500	1,220.00	21,350,000
建設技術研究所	10,800	2,321.00	25,066,800
スペース	11,100	907.00	10,067,700
長大	6,800	1,938.00	13,178,400
燦ホールディングス	7,500	1,195.00	8,962,500
スバル興業	1,000	7,920.00	7,920,000
東京テアトル	6,500	1,280.00	8,320,000
タナベ経営	3,400	1,478.00	5,025,200
ナガワ	5,300	8,520.00	45,156,000
東京都競馬	10,900	4,645.00	50,630,500
カナモト	29,300	2,576.00	75,476,800
西尾レントオール	15,400	3,165.00	48,741,000
トランス・コスモス	15,900	3,105.00	49,369,500
乃村工藝社	71,300	942.00	67,164,600
藤田観光	6,600	2,223.00	14,671,800
K N T - C Tホールディングス	8,800	1,337.00	11,765,600
日本管財	17,900	2,420.00	43,318,000

トーカイ	16,100	2,411.00	38,817,100	
セコム	163,300	8,526.00	1,392,295,800	
セントラル警備保障	8,100	3,085.00	24,988,500	
丹青社	31,600	867.00	27,397,200	
メイテック	20,100	6,250.00	125,625,000	
応用地質	18,900	1,270.00	24,003,000	
船井総研ホールディングス	34,000	2,480.00	84,320,000	
進学会ホールディングス	7,300	425.00	3,102,500	
オオバ	12,000	791.00	9,492,000	
いであ	4,200	1,779.00	7,471,800	
学究社	5,100	1,363.00	6,951,300	
ベネッセホールディングス	60,800	2,740.00	166,592,000	
イオンディライト	20,500	3,465.00	71,032,500	
ナック	8,200	910.00	7,462,000	
ダイセキ	27,800	4,680.00	130,104,000	
ステップ	6,300	1,601.00	10,086,300	
合 計	181,788,900		467,101,059,850	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2【ファンドの現況】

## 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

## 【純資産額計算書】

(2021年 7月30日現在)

資産総額	2,861,041,700円
負債総額	1,142,055円
純資産総額（ - ）	2,859,899,645円
発行済口数	2,105,788,297口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3581円
（1万口当たり純資産額）	（13,581円）

(参考)

## 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）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（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年間ににお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。

#### [ D0（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 - D0 - 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24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24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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 9月25日	有価証券届出書
2020年 9月25日	有価証券報告書
2021年 3月25日	有価証券届出書
2021年 3月25日	半期報告書

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年8月25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

## 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」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2020年6月26日から2021年6月25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、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2021年6月25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。