

**【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】	2022年1月20日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年10月21日至 2021年10月20日)
【ファンド名】	i - S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)
【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、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 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 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  日本	フ ァ ミ リ ー フ ァ ン ド  フ ァ ン ド ・ オ ブ ・ フ ァ ン ズ	あり ( )  なし	日経225  T O P I X  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ  中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円ででの為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

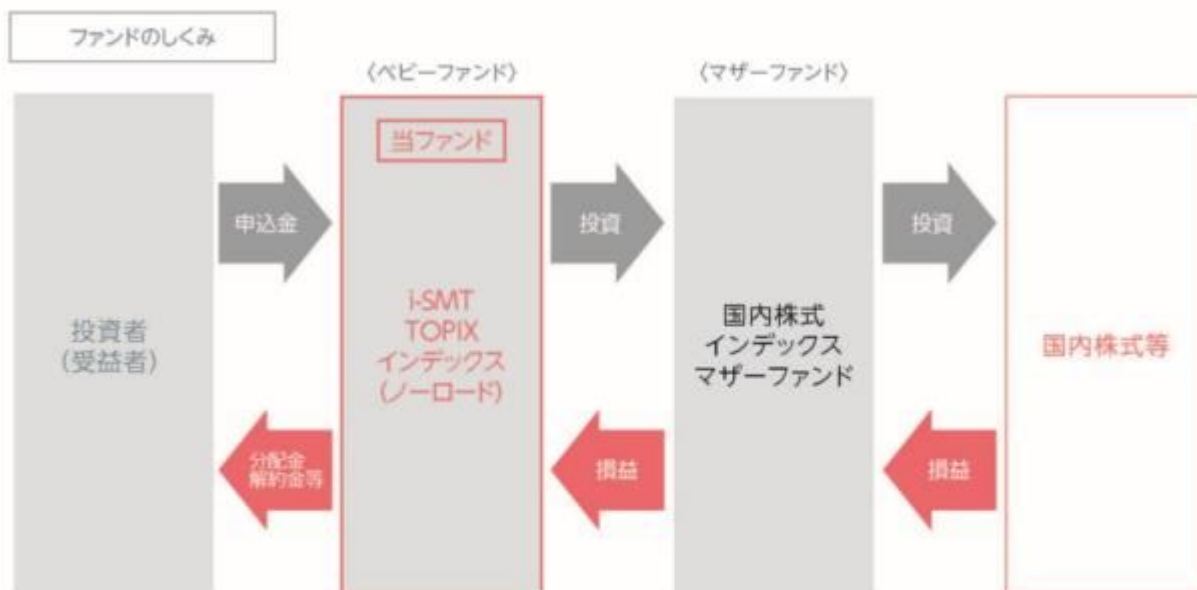
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

## 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。

## 特色2 TOPIX(東証株価指数)<sup>\*</sup>に連動する投資成果を目指します。

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

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

「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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 特色3 ノーロードファンドです。

●購入時手数料が無料のノーロードファンドです。

その他の費用等については、後掲「4 手数料等及び税金」をご参照ください。



## 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。  
※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】

2018年 1月12日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2021年11月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 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」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として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。
- ロ．株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。
- ハ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の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。
- ホ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。
- ヘ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

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

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1. 有価証券
  - 2. 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22条に定めるものに限ります。）
  - 3. 金銭債権
  - 4. 約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
  - 1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・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親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」の受益証券並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. 株券又は新株引受権証書
- 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又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。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（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又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又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号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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
- ロ . 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ . に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (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号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に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。

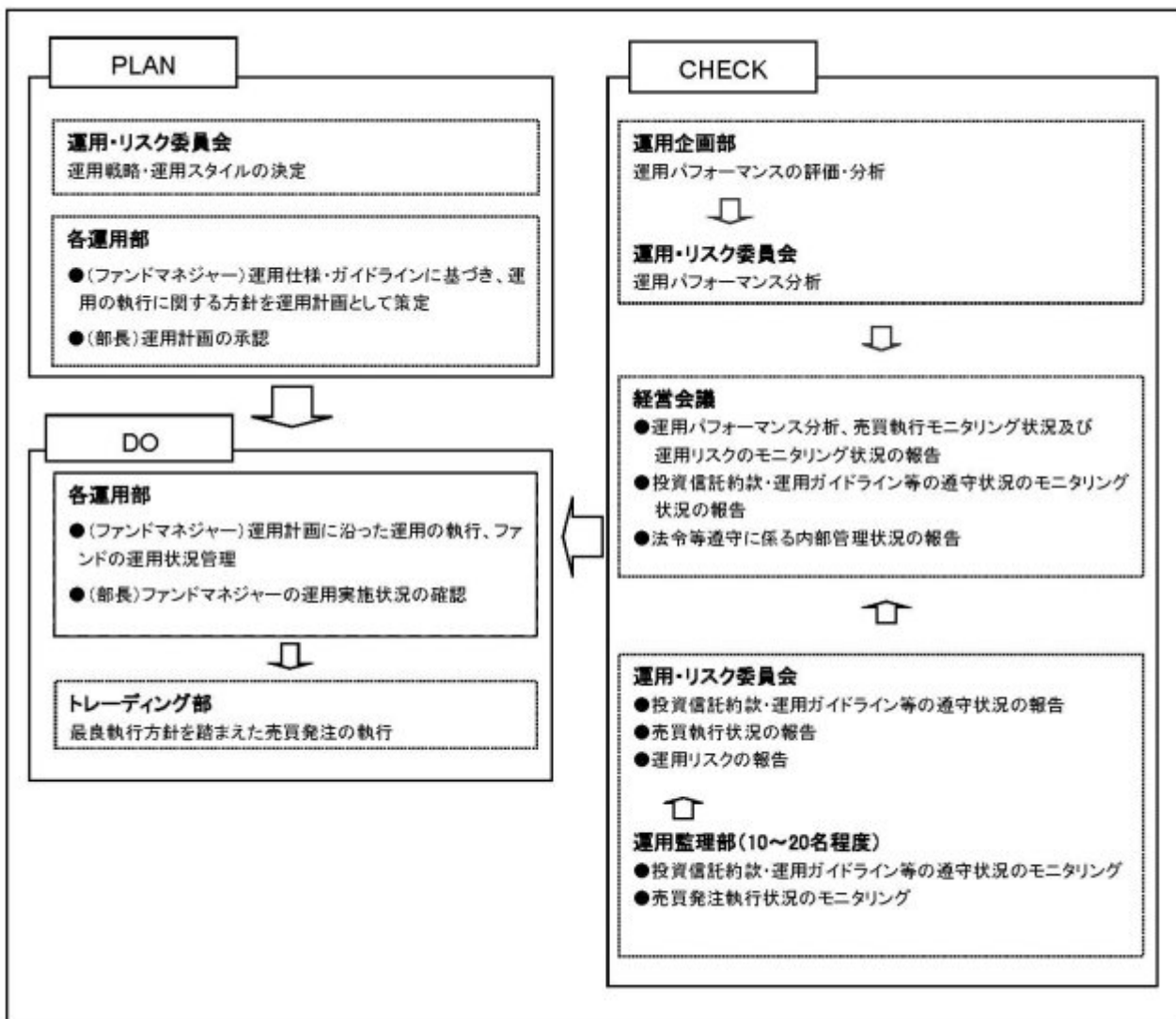
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### <約款に定める投資制限>

##### イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

##### ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

##### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

##### ニ．新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券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。

##### ホ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又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。

##### ヘ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又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。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、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。

1. 投資信託財産に属する株券及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及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）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及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及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
- ト．先物取引等の運用指図、目的及び範囲
- 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等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。）及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。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品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。
- チ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲
- （イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- a. 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。
  - b. 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。
- （ロ）上記（イ）a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- （ハ）委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- リ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲
- （イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ヌ．の規定により借入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又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。
- （ロ）上記（イ）の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- ヌ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲
- （イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- （ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- （ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。



## ル．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

（ハ）収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

ワ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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。

### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

## 3【投資リスク】

### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 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払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

#### (2) リスクの管理体制

##### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- \*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \*当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

### 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12月～2021年11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。
- \*当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

### 各資産クラスの指数について

<b>日本株</b> 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調整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。
<b>先進国株</b> MSCIロックスイートインデックス(配当込み、円ベース)	MSCIロックスイートインデックスとは、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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> 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、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> JPモルガン・グローバル・ディベント・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディベント・インデックス(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 0.187%（税抜 0.17%）（ ）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 0.0825% （税抜 0.075%）	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 0.0825% （税抜 0.075%）	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 0.022% （税抜 0.02%）	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間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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ず（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

##### ハ．損益通算について

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

##### ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### 個別元本について

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

す。

- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 二．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11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11月30日現在の状況について記載してあります。

### 【i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

#### （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	172,617,480	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		87,268	0.05
合計（純資産総額）		172,704,748	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ．評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	91,920,486	1.9659	180,712,359	1.8779	172,617,480	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1期計算期間末 (2018年10月22日)	52,836,312	52,836,312	9,205	9,205
第2期計算期間末 (2019年10月21日)	65,609,096	65,609,096	9,053	9,053
第3期計算期間末 (2020年10月20日)	73,637,471	73,637,471	9,241	9,241
第4期計算期間末 (2021年10月20日)	177,526,478	177,526,478	11,746	11,746
2020年11月末日	71,828,101		9,978	
12月末日	72,039,254		10,273	
2021年1月末日	77,064,703		10,293	
2月末日	82,164,306		10,612	
3月末日	92,278,501		11,215	
4月末日	95,297,224		10,897	
5月末日	98,224,086		11,044	
6月末日	110,604,360		11,174	
7月末日	116,727,167		10,929	
8月末日	120,916,552		11,272	
9月末日	156,314,670		11,761	

10月末日	183,996,425		11,592	
11月末日	172,704,748		11,170	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	0
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	0
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	8.0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	1.7
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	2.1
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	27.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	108,701,841	51,304,223	57,397,618
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	50,853,131	35,774,595	72,476,154
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	64,823,463	57,612,303	79,687,314
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	280,298,231	208,842,771	151,142,774

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

## (参考)

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	468,547,544,500	98.81



現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,621,757,910	1.19
合計(純資産総額)		474,169,302,410	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	6,124,080,000	1.29

(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	8,981,000	1,829.45	16,430,324,107	2,001.00	17,970,981,000	3.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,110,700	10,827.29	12,025,872,406	13,825.00	15,355,427,500	3.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	160,700	54,228.70	8,714,553,101	70,330.00	11,302,031,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,307,100	5,715.37	7,470,563,519	6,901.00	9,020,297,100	1.90
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,214,800	619.44	6,946,990,415	601.40	6,744,580,720	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	112,500	48,976.64	5,509,872,421	59,840.00	6,732,000,000	1.42
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,035,000	2,933.01	5,968,684,217	3,125.00	6,359,375,000	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,043,300	8,196.71	8,551,632,719	6,030.00	6,291,099,000	1.33
日本	株式	HOYA	精密機器	346,000	14,437.24	4,995,285,296	18,020.00	6,234,920,000	1.31
日本	株式	日本電産	電気機器	459,600	12,527.90	5,757,825,443	13,000.00	5,974,800,000	1.26
日本	株式	日立製作所	電気機器	852,800	5,766.75	4,917,885,604	6,688.00	5,703,526,400	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	298,200	18,841.95	5,618,669,703	19,000.00	5,665,800,000	1.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	225,900	21,688.73	4,899,485,035	23,150.00	5,229,585,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	100,100	67,237.97	6,730,521,727	50,100.00	5,015,010,000	1.06
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,210,500	3,944.50	4,774,821,628	3,703.00	4,482,481,500	0.95
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,308,600	3,102.78	4,060,306,973	3,391.00	4,437,462,600	0.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	521,000	8,297.32	4,322,907,915	8,380.00	4,365,980,000	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,396,000	3,357.29	4,686,788,885	3,101.00	4,328,996,000	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,393,600	3,710.74	5,171,295,739	3,031.00	4,224,001,600	0.89

日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,268,500	3,705.59	4,700,544,170	3,300.00	4,186,050,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,635,400	1,464.85	3,860,466,892	1,562.50	4,117,812,500	0.87
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,221,400	3,250.05	3,969,612,969	3,260.00	3,981,764,000	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	1,393,300	2,529.67	3,524,589,534	2,824.50	3,935,375,850	0.83
日本	株式	S M C	機械	51,900	65,615.45	3,405,442,037	72,650.00	3,770,535,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	200,200	16,483.72	3,300,041,637	17,840.00	3,571,568,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	1,356,100	2,419.72	3,281,390,304	2,557.00	3,467,547,700	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	155,600	26,236.99	4,082,476,192	22,245.00	3,461,322,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	575,900	5,191.77	2,989,943,313	5,708.00	3,287,237,200	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	390,400	7,515.28	2,933,967,642	8,331.00	3,252,422,400	0.69
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,236,500	1,667.93	3,730,343,318	1,402.00	3,135,573,000	0.66

(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	0.22
		建設業	2.16
		食料品	3.21
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.71
		医薬品	4.76
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.70
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.63
		機械	5.30
		電気機器	19.57
		輸送用機器	7.98
		精密機器	2.98
		その他製品	2.16
		電気・ガス業	1.07
陸運業	2.95		
海運業	0.42		
空運業	0.37		

	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	8.52
	卸売業	5.03
	小売業	4.14
	銀行業	4.60
	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	1.89
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.86
	サービス業	6.34
	小計	98.81
合計		98.81

(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	323	円	6,505,204,650	6,124,080,000	1.29

(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。

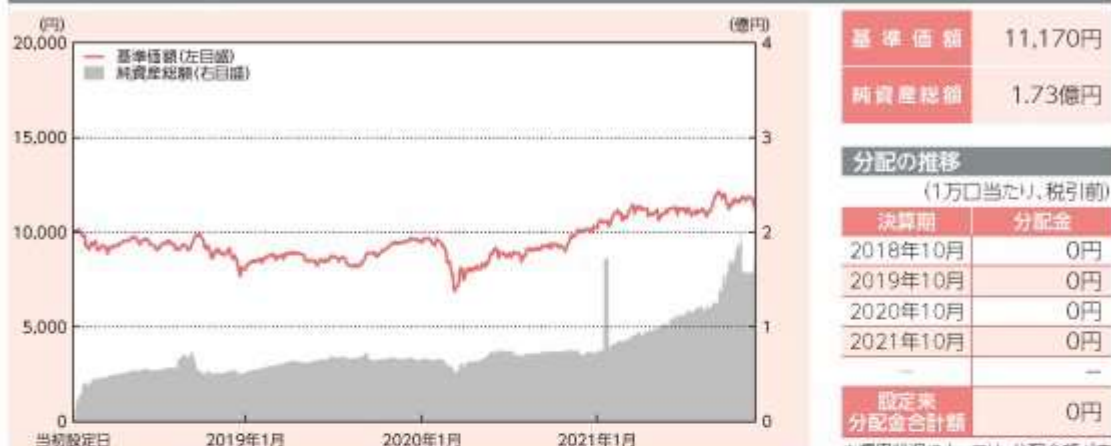
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 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：2018年1月12日  
作成基準日：2021年11月30日

**基準価額・純資産の推移**


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種別	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	3.2%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.4%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.4%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.3%
HOYA	日本	株式	精密機器	1.3%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.3%

※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）**


※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

※2012年～2017年は、ファンドのベンチマークである「TOPIX(東証株価指数)」の年間収益率です。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

（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、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

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

### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

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

### < 一部解約の受付 >

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

### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

### < 一部解約代金の支払い >

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

### < 受付不可日 >

ありません。

### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

します。

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

##### <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。(2018年1月12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10月21日から翌年10月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年1月12日から2018年10月22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30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週



間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

##### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

##### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

できません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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4期計算期間(2020年10月21日から2021年10月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【i - SMT TOPIXインデックス(ノーロード)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年10月20日現在)	第4期 (2021年10月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	682,074	5,100,826
親投資信託受益証券	73,600,376	177,437,776
流動資産合計	74,282,450	182,538,602
資産合計	74,282,450	182,538,602
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	577,140	4,896,999
未払受託者報酬	7,764	13,171
未払委託者報酬	58,193	98,713
未払利息	-	9
その他未払費用	1,882	3,232
流動負債合計	644,979	5,012,124
負債合計	644,979	5,012,124
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,687,314	151,142,774
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,049,843	26,383,704
(分配準備積立金)	2,481,570	9,238,243
元本等合計	73,637,471	177,526,478
純資産合計	73,637,471	177,526,478
負債純資産合計	74,282,450	182,538,602

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2019年10月22日	自	2020年10月21日
	至	2020年10月20日	至	2021年10月20日
営業収益				
受取利息		-		33
有価証券売買等損益		3,446,023		21,073,413
営業収益合計		3,446,023		21,073,446
営業費用				
支払利息		99		250
受託者報酬		14,759		22,440
委託者報酬		110,524		168,137
その他費用		3,551		5,483
営業費用合計		128,933		196,310
営業利益又は営業損失（ ）		3,317,090		20,877,136
経常利益又は経常損失（ ）		3,317,090		20,877,136
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,317,090		20,877,136
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（ ）		857,934		11,951,569
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,867,058		6,049,843
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,008,192		27,641,403
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,008,192		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		27,641,403
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,650,133		4,133,423
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		4,133,423
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,650,133		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,049,843		26,383,704

## (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3期 (2020年10月20日現在)	第4期 (2021年10月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,687,314口	151,142,774口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 6,049,843円	元本の欠損 - 円
3. 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 0.9241円 (1万口当たり純資産額) (9,241円)	1口当たり純資産額 1.1746円 (1万口当たり純資産額) (11,746円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2019年10月22日 至 2020年10月20日			第4期 自 2020年10月21日 至 2021年10月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,497,690円	費用控除後の配当等収益額	A	2,389,140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	47,090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	6,536,427円
収益調整金額	C	2,041,506円	収益調整金額	C	17,145,461円
分配準備積立金額	D	936,790円	分配準備積立金額	D	312,676円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,523,076円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,383,704円
当ファンドの期末残存口数	F	79,687,314口	当ファンドの期末残存口数	F	151,142,774口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	567円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,745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4期 自 2020年10月21日 至 2021年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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4期 (2021年10月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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3期	第4期
	自 2019年10月22日 至 2020年10月20日	自 2020年10月21日 至 2021年10月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	72,476,154円	79,687,314円
期中追加設定元本額	64,823,463円	280,298,231円
期中一部解約元本額	57,612,303円	208,842,771円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第3期 (2020年10月20日現在)	第4期 (2021年10月20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	2,777,553	10,560,892
合計	2,777,553	10,560,892

## （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	89,873,766	177,437,776	
合計		89,873,766	177,437,776	

(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10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,762,777,912
株式	487,846,566,730
派生商品評価勘定	45,797,450
未収入金	2,601,000
未収配当金	4,004,181,884
前払金	41,921,800
差入委託証拠金	277,903,800
流動資産合計	494,981,750,576
資産合計	494,981,750,576
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,763,250
未払金	914,900
未払解約金	85,210,494
未払利息	5,032
流動負債合計	173,893,676
負債合計	173,893,676
純資産の部	
元本等	
元本	250,628,037,965
剰余金	

	2021年10月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	244,179,818,935
元本等合計	494,807,856,900
純資産合計	494,807,856,900
負債純資産合計	494,981,750,576

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	250,628,037,965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 1.9743円 (1万口当たり純資産額) (19,743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10月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2021年10月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年10月21日
期首元本額	226,482,907,645円
期中追加設定元本額	68,515,513,840円
期中一部解約元本額	44,370,383,520円
期末元本額	250,628,037,965円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	412,939,309円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,898,361,583円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,988,651円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,999,074,226円
世界経済インデックスファンド	3,169,149,859円
日本株式インデックス・オープン	3,418,852,787円
DCマイセレクション25	6,056,631,494円
DCマイセレクション50	17,957,441,241円
DCマイセレクション75	17,946,405,330円
DC日本株式インデックス・オープン	5,969,481,711円

区分	2021年10月20日現在
DCマイセレクションS25	2,995,149,344円
DCマイセレクションS50	8,591,182,346円
DCマイセレクションS75	6,209,166,351円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,889,728,985円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	222,114,710円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	688,371,481円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	491,698,324円
DC世界経済インデックスファンド	3,349,443,750円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,695,637,154円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	7,718,233円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	24,501,128円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,260,254円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	190,678,214円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	35,010,666円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	149,785,910円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,694,578円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	84,167,351円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,023,221,435円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	449,708,742円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,947,616,953円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	100,580,026円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,418,929円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	523,500,012円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	293,284,929円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	372,414,747円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,500,534円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	595,379,531円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,962,600,596円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,344,847,747円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,746,652,083円
分散投資コア戦略ファンドA	1,322,664,148円
分散投資コア戦略ファンドS	5,666,691,514円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	426,225,490円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	397,240,866円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,888,465,724円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	212,643,257円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,543,946円
SMT インデックスバランス・オープン	59,829,890円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	25,767,064,648円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,578,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン	38,351,050円

区分	2021年10月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	135,295,510円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	25,130,266円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,702,515円
グローバル経済コア	219,861,267円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,966,104円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	89,873,766円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,484,253円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,191,365,373円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	154,546,869円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,815,331円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,458,861円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,536,644円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,913,160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）	42,306,493,181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）	1,084,202,450円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	228,852,208円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	35,607,806円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	47,244,631,506円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	3,577,738円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	41,168,786円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	24,989,838,952	
合計	24,989,838,952	

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,940,521,800	-	6,898,600,000	41,921,800
合計		6,940,521,800	-	6,898,600,000	41,921,800

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,700	3,030.00	23,331,000	
日本水産	221,200	648.00	143,337,600	
マルハニチロ	37,300	2,622.00	97,800,600	
雪国まいたけ	19,600	1,452.00	28,459,200	
カネコ種苗	7,200	1,479.00	10,648,800	
サカタのタネ	28,400	3,440.00	97,696,000	
ホクト	20,000	1,935.00	38,700,000	
ホクリヨウ	3,700	753.00	2,786,100	
住石ホールディングス	41,700	148.00	6,171,600	
日鉄鉱業	5,500	6,970.00	38,335,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,482.00	14,820,000	
I N P E X	955,700	969.00	926,073,300	
石油資源開発	31,100	2,153.00	66,958,300	
K & O エナジーグループ	11,600	1,650.00	19,140,000	
ヒノキヤグループ	5,200	2,211.00	11,497,200	
ショーボンドホールディングス	34,000	4,785.00	162,690,000	
ミライト・ホールディングス	82,600	2,202.00	181,885,200	
タマホーム	14,400	2,375.00	34,200,000	
サンヨーホームズ	2,700	729.00	1,968,300	
日本アクア	9,500	581.00	5,519,500	
ファーストコーポレーション	7,300	808.00	5,898,400	
ベステラ	4,700	1,461.00	6,866,700	
Robot Home	39,700	290.00	11,513,000	
キャンディル	4,100	522.00	2,140,200	
スペースバリューホールディングス	29,000	806.00	23,374,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,852.00	8,519,200	
第一カッター興業	5,900	1,279.00	7,546,100	
安藤・間	152,800	796.00	121,628,800	
東急建設	69,800	812.00	56,677,600	
コムシスホールディングス	84,500	2,928.00	247,416,000	



ビーアールホールディングス	31,900	437.00	13,940,300	
高松コンストラクショングループ	14,800	2,004.00	29,659,200	
東建コーポレーション	7,300	9,500.00	69,350,000	
ソネック	2,500	1,095.00	2,737,500	
ヤマウラ	10,300	920.00	9,476,000	
オリエンタル白石	80,100	270.00	21,627,000	
大成建設	171,200	3,680.00	630,016,000	
大林組	550,200	976.00	536,995,200	
清水建設	515,300	859.00	442,642,700	
飛鳥建設	15,800	1,086.00	17,158,800	
長谷工コーポレーション	180,200	1,512.00	272,462,400	
松井建設	21,700	754.00	16,361,800	
銭高組	2,400	4,045.00	9,708,000	
鹿島建設	403,100	1,461.00	588,929,100	
不動テトラ	13,500	1,809.00	24,421,500	
大末建設	6,900	911.00	6,285,900	
鉄建建設	11,100	1,816.00	20,157,600	
西松建設	39,400	3,425.00	134,945,000	
三井住友建設	132,900	496.00	65,918,400	
大豊建設	12,000	3,890.00	46,680,000	
佐田建設	12,700	490.00	6,223,000	
ナカノフドー建設	13,200	353.00	4,659,600	
奥村組	30,200	2,983.00	90,086,600	
東鉄工業	23,600	2,509.00	59,212,400	
イチケン	4,000	1,936.00	7,744,000	
富士ピー・エス	7,100	562.00	3,990,200	
浅沼組	6,600	4,560.00	30,096,000	
戸田建設	228,500	752.00	171,832,000	
熊谷組	25,500	2,853.00	72,751,500	
北野建設	3,400	2,180.00	7,412,000	
植木組	4,900	1,458.00	7,144,200	
矢作建設工業	24,300	791.00	19,221,300	
ピーエス三菱	18,100	669.00	12,108,900	
日本ハウスホールディングス	37,600	421.00	15,829,600	
大東建託	60,100	13,800.00	829,380,000	
新日本建設	23,400	853.00	19,960,200	
N I P P O	45,500	4,045.00	184,047,500	
東亜道路工業	3,400	4,935.00	16,779,000	
日本道路	5,300	8,120.00	43,036,000	
東亜建設工業	14,700	2,478.00	36,426,600	
日本国土開発	53,500	604.00	32,314,000	
若築建設	9,900	2,037.00	20,166,300	

東洋建設	61,700	582.00	35,909,400
五洋建設	233,700	775.00	181,117,500
世紀東急工業	26,400	824.00	21,753,600
福田組	5,900	4,775.00	28,172,500
住友林業	140,700	2,145.00	301,801,500
日本基礎技術	16,800	520.00	8,736,000
巴コーポレーション	24,400	452.00	11,028,800
大和ハウス工業	508,000	3,791.00	1,925,828,000
ライト工業	31,500	2,025.00	63,787,500
積水ハウス	596,700	2,392.50	1,427,604,750
日特建設	13,600	718.00	9,764,800
北陸電気工事	9,500	1,223.00	11,618,500
ユアテック	31,500	699.00	22,018,500
日本リーテック	11,500	1,514.00	17,411,000
四電工	6,000	1,656.00	9,936,000
中電工	25,300	2,257.00	57,102,100
関電工	89,400	904.00	80,817,600
きんでん	111,700	1,900.00	212,230,000
東京エネシス	18,300	1,080.00	19,764,000
トーエネック	5,500	3,445.00	18,947,500
住友電設	15,500	2,202.00	34,131,000
日本電設工業	30,200	1,858.00	56,111,600
エクシオグループ	83,400	2,695.00	224,763,000
新日本空調	14,500	2,369.00	34,350,500
九電工	38,600	3,710.00	143,206,000
三機工業	39,000	1,447.00	56,433,000
日揮ホールディングス	183,500	1,111.00	203,868,500
中外炉工業	5,900	1,757.00	10,366,300
ヤマト	17,600	754.00	13,270,400
太平電業	12,200	2,783.00	33,952,600
高砂熱学工業	49,700	2,104.00	104,568,800
三晃金属工業	2,200	2,494.00	5,486,800
朝日工業社	4,100	3,405.00	13,960,500
明星工業	35,600	725.00	25,810,000
大気社	26,700	3,375.00	90,112,500
ダイダン	12,200	2,466.00	30,085,200
日比谷総合設備	17,700	1,912.00	33,842,400
フィル・カンパニー	3,100	3,000.00	9,300,000
テスホールディングス	10,000	2,253.00	22,530,000
インフロニア・ホールディングス	215,200	920.00	197,984,000
東洋エンジニアリング	23,100	884.00	20,420,400
レイズネクスト	29,500	1,228.00	36,226,000

ニッポン	51,500	1,635.00	84,202,500
日清製粉グループ本社	198,900	1,856.00	369,158,400
日東富士製粉	2,600	3,120.00	8,112,000
昭和産業	15,300	2,825.00	43,222,500
鳥越製粉	15,600	762.00	11,887,200
中部飼料	21,500	1,100.00	23,650,000
フィード・ワン	23,700	745.00	17,656,500
東洋精糖	3,000	1,165.00	3,495,000
日本甜菜製糖	9,200	1,653.00	15,207,600
D M三井製糖ホールディングス	13,900	2,040.00	28,356,000
塩水港精糖	21,000	222.00	4,662,000
日新製糖	8,300	1,712.00	14,209,600
森永製菓	41,300	4,055.00	167,471,500
中村屋	4,200	3,770.00	15,834,000
江崎グリコ	48,500	4,225.00	204,912,500
名糖産業	7,800	1,723.00	13,439,400
井村屋グループ	10,000	2,344.00	23,440,000
不二家	9,800	2,393.00	23,451,400
山崎製パン	132,000	1,869.00	246,708,000
第一屋製パン	3,400	758.00	2,577,200
モロゾフ	2,800	5,400.00	15,120,000
亀田製菓	10,000	4,515.00	45,150,000
寿スピリッツ	17,000	7,410.00	125,970,000
カルビー	80,200	2,780.00	222,956,000
森永乳業	32,600	6,750.00	220,050,000
六甲バター	12,900	1,660.00	21,414,000
ヤクルト本社	121,100	5,750.00	696,325,000
明治ホールディングス	116,400	7,110.00	827,604,000
雪印メグミルク	42,400	2,225.00	94,340,000
プリマハム	24,800	2,747.00	68,125,600
日本ハム	67,300	4,060.00	273,238,000
林兼産業	5,800	603.00	3,497,400
丸大食品	17,300	1,748.00	30,240,400
S Foods	15,800	2,994.00	47,305,200
柿安本店	6,100	2,655.00	16,195,500
伊藤ハム米久ホールディングス	113,400	709.00	80,400,600
サッポロホールディングス	60,100	2,557.00	153,675,700
アサヒグループホールディングス	414,200	5,231.00	2,166,680,200
キリンホールディングス	647,100	2,032.00	1,314,907,200
宝ホールディングス	130,500	1,607.00	209,713,500
オエノンホールディングス	50,000	378.00	18,900,000
養命酒製造	5,400	1,842.00	9,946,800

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,600	1,620.00	200,232,000	
サントリー食品インターナショナル	117,800	4,455.00	524,799,000	
ダイドーグループホールディングス	9,900	5,530.00	54,747,000	
伊藤園	53,400	7,290.00	389,286,000	
キーコーヒー	17,300	2,226.00	38,509,800	
ユニカフェ	5,300	1,090.00	5,777,000	
ジャパンフーズ	2,500	1,228.00	3,070,000	
日清オイリオグループ	22,000	3,045.00	66,990,000	
不二製油グループ本社	42,900	2,706.00	116,087,400	
かどや製油	1,900	4,070.00	7,733,000	
J - オイルミルズ	16,400	1,833.00	30,061,200	
キッコーマン	126,700	9,570.00	1,212,519,000	
味の素	418,700	3,411.00	1,428,185,700	
ブルドックソース	8,000	2,303.00	18,424,000	
キューピー	98,000	2,537.00	248,626,000	
ハウス食品グループ本社	65,800	3,315.00	218,127,000	
カゴメ	66,800	2,878.00	192,250,400	
焼津水産化学工業	8,500	991.00	8,423,500	
アリアケジャパン	16,100	7,280.00	117,208,000	
ピエトロ	2,300	1,801.00	4,142,300	
エバラ食品工業	3,800	2,481.00	9,427,800	
やまみ	1,900	2,109.00	4,007,100	
ニチレイ	83,900	2,862.00	240,121,800	
東洋水産	90,600	4,835.00	438,051,000	
イトアンドホールディングス	6,100	2,164.00	13,200,400	
大冷	2,000	1,922.00	3,844,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,800	750.00	7,350,000	
日清食品ホールディングス	69,100	8,820.00	609,462,000	
永谷園ホールディングス	8,600	2,091.00	17,982,600	
一正蒲鉾	6,800	920.00	6,256,000	
フジッコ	19,100	1,927.00	36,805,700	
ロック・フィールド	19,000	1,785.00	33,915,000	
日本たばこ産業	944,000	2,295.50	2,166,952,000	
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,542.00	16,653,600	
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,262.00	26,013,000	
なとり	9,800	1,951.00	19,119,800	
イフジ産業	2,700	923.00	2,492,100	
ピクルスコーポレーション	8,400	1,849.00	15,531,600	
ファーマフーズ	16,600	2,718.00	45,118,800	
ユーグレナ	89,700	869.00	77,949,300	
紀文食品	10,300	1,235.00	12,720,500	
ミヨシ油脂	6,700	1,326.00	8,884,200	

理研ビタミン	16,600	1,857.00	30,826,200
片倉工業	19,500	1,777.00	34,651,500
グンゼ	12,700	4,310.00	54,737,000
東洋紡	68,300	1,363.00	93,092,900
ユニチカ	51,700	367.00	18,973,900
富士紡ホールディングス	8,400	3,975.00	33,390,000
倉敷紡績	14,900	1,905.00	28,384,500
シキボウ	9,600	940.00	9,024,000
日本毛織	52,300	928.00	48,534,400
トーア紡コーポレーション	6,300	432.00	2,721,600
帝国繊維	19,600	2,046.00	40,101,600
帝人	162,000	1,571.00	254,502,000
東レ	1,244,700	719.50	895,561,650
住江織物	3,800	1,818.00	6,908,400
日本フェルト	10,800	443.00	4,784,400
イチカワ	2,600	1,341.00	3,486,600
日東製網	1,800	1,473.00	2,651,400
アツギ	13,500	667.00	9,004,500
ダイニック	6,500	754.00	4,901,000
セーレン	42,500	2,333.00	99,152,500
ソトー	7,100	851.00	6,042,100
東海染工	2,400	1,139.00	2,733,600
小松マテーレ	28,400	927.00	26,326,800
ワコールホールディングス	43,000	2,260.00	97,180,000
ホギメディカル	23,200	3,100.00	71,920,000
T S Iホールディングス	52,800	352.00	18,585,600
マツオカコーポレーション	5,600	1,405.00	7,868,000
ワールド	22,600	1,393.00	31,481,800
三陽商会	8,900	905.00	8,054,500
ナイガイ	6,900	332.00	2,290,800
オンワードホールディングス	103,800	339.00	35,188,200
ルックホールディングス	5,600	1,394.00	7,806,400
ゴールドウイン	28,500	6,860.00	195,510,000
デサント	29,400	3,975.00	116,865,000
キング	9,500	539.00	5,120,500
ヤマトインターナショナル	15,700	321.00	5,039,700
特種東海製紙	10,500	4,435.00	46,567,500
王子ホールディングス	773,500	562.00	434,707,000
日本製紙	76,000	1,177.00	89,452,000
三菱製紙	24,400	359.00	8,759,600
北越コーポレーション	122,900	742.00	91,191,800
中越パルプ工業	6,500	1,208.00	7,852,000

巴川製紙所	5,700	884.00	5,038,800	
大王製紙	82,800	2,024.00	167,587,200	
阿波製紙	4,400	382.00	1,680,800	
レンゴー	177,200	867.00	153,632,400	
トーモク	10,500	1,938.00	20,349,000	
ザ・パック	13,000	2,942.00	38,246,000	
北の達人コーポレーション	61,500	445.00	27,367,500	
クラレ	251,300	1,053.00	264,618,900	
旭化成	1,138,800	1,216.00	1,384,780,800	
共和レザー	9,300	692.00	6,435,600	
昭和電工	149,000	2,866.00	427,034,000	
住友化学	1,352,400	573.00	774,925,200	
住友精化	8,400	3,365.00	28,266,000	
日産化学	93,500	6,440.00	602,140,000	
ラサ工業	5,600	1,892.00	10,595,200	
クレハ	14,700	7,530.00	110,691,000	
多木化学	6,700	6,490.00	43,483,000	
テイカ	12,600	1,338.00	16,858,800	
石原産業	30,800	1,231.00	37,914,800	
片倉コープアグリ	4,400	1,178.00	5,183,200	
日本曹達	23,500	3,475.00	81,662,500	
東ソー	265,600	1,930.00	512,608,000	
トクヤマ	51,000	2,066.00	105,366,000	
セントラル硝子	32,800	2,120.00	69,536,000	
東亜合成	97,800	1,285.00	125,673,000	
大阪ソーダ	17,500	2,873.00	50,277,500	
関東電化工業	40,700	1,013.00	41,229,100	
デンカ	62,700	3,865.00	242,335,500	
信越化学工業	317,700	19,510.00	6,198,327,000	
日本カーバイド工業	6,400	1,398.00	8,947,200	
堺化学工業	12,000	2,031.00	24,372,000	
第一稀元素化学工業	17,300	1,462.00	25,292,600	
エア・ウォーター	175,200	1,733.00	303,621,600	
日本酸素ホールディングス	141,500	2,715.00	384,172,500	
日本化学工業	4,900	2,915.00	14,283,500	
東邦アセチレン	2,600	1,240.00	3,224,000	
日本パーカライズン	86,700	1,172.00	101,612,400	
高圧ガス工業	27,200	763.00	20,753,600	
チタン工業	2,100	1,833.00	3,849,300	
四国化成工業	22,400	1,389.00	31,113,600	
戸田工業	3,700	3,120.00	11,544,000	
ステラ ケミファ	9,400	2,960.00	27,824,000	

保土谷化学工業	5,000	5,020.00	25,100,000
日本触媒	31,100	5,820.00	181,002,000
大日精化工業	14,200	2,642.00	37,516,400
カネカ	44,400	4,500.00	199,800,000
三菱瓦斯化学	172,100	2,355.00	405,295,500
三井化学	148,300	3,570.00	529,431,000
J S R	172,400	3,945.00	680,118,000
東京応化工業	29,500	6,990.00	206,205,000
大阪有機化学工業	14,600	3,470.00	50,662,000
三菱ケミカルホールディングス	1,148,500	974.20	1,118,868,700
K Hネオケム	28,300	3,055.00	86,456,500
ダイセル	231,000	867.00	200,277,000
住友ベークライト	27,000	4,955.00	133,785,000
積水化学工業	359,500	1,868.00	671,546,000
日本ゼオン	154,900	1,503.00	232,814,700
アイカ工業	47,900	3,585.00	171,721,500
宇部興産	86,800	2,214.00	192,175,200
積水樹脂	25,900	2,174.00	56,306,600
タキロンシーアイ	37,200	620.00	23,064,000
旭有機材	9,700	1,383.00	13,415,100
ニチバン	9,000	1,844.00	16,596,000
リケンテクノス	41,900	549.00	23,003,100
大倉工業	8,800	2,147.00	18,893,600
積水化成品工業	23,000	579.00	13,317,000
群栄化学工業	3,900	3,125.00	12,187,500
タイガースポリマー	9,000	426.00	3,834,000
ミライアル	5,500	1,595.00	8,772,500
ダイキアクシス	6,600	952.00	6,283,200
ダイキョーニシカワ	36,200	678.00	24,543,600
竹本容器	6,100	906.00	5,526,600
森六ホールディングス	9,200	1,989.00	18,298,800
恵和	4,300	4,625.00	19,887,500
日本化薬	106,300	1,217.00	129,367,100
カーリットホールディングス	17,000	773.00	13,141,000
日本精化	12,400	2,274.00	28,197,600
扶桑化学工業	13,500	5,230.00	70,605,000
トリケミカル研究所	15,900	3,365.00	53,503,500
A D E K A	79,100	2,530.00	200,123,000
日油	64,700	5,860.00	379,142,000
新日本理化	28,400	324.00	9,201,600
ハリマ化成グループ	12,800	874.00	11,187,200
花王	388,100	6,555.00	2,543,995,500

第一工業製薬	5,800	3,215.00	18,647,000
石原ケミカル	8,700	1,396.00	12,145,200
日華化学	5,800	977.00	5,666,600
ニイタカ	3,600	2,350.00	8,460,000
三洋化成工業	10,300	5,580.00	57,474,000
有機合成薬品工業	13,200	322.00	4,250,400
大日本塗料	19,400	861.00	16,703,400
日本ペイントホールディングス	645,500	1,194.00	770,727,000
関西ペイント	193,000	2,674.00	516,082,000
神東塗料	13,500	190.00	2,565,000
中国塗料	37,100	901.00	33,427,100
日本特殊塗料	12,900	1,006.00	12,977,400
藤倉化成	23,200	534.00	12,388,800
太陽ホールディングス	25,300	2,812.00	71,143,600
D I C	72,600	3,100.00	225,060,000
サカタインクス	34,100	1,114.00	37,987,400
東洋インキＳＣホールディングス	36,300	2,032.00	73,761,600
T & K T O K A	12,000	810.00	9,720,000
富士フィルムホールディングス	308,300	8,811.00	2,716,431,300
資生堂	326,800	7,482.00	2,445,117,600
ライオン	211,800	1,908.00	404,114,400
高砂香料工業	11,000	2,977.00	32,747,000
マンダム	36,800	1,667.00	61,345,600
ミルボン	21,600	6,820.00	147,312,000
ファンケル	63,900	3,580.00	228,762,000
コーセー	33,000	14,040.00	463,320,000
コタ	11,100	1,615.00	17,926,500
シーボン	2,300	1,830.00	4,209,000
ポーラ・オルビスホールディングス	74,900	2,543.00	190,470,700
ノエビアホールディングス	14,900	5,560.00	82,844,000
アジュバンホールディングス	3,900	1,145.00	4,465,500
新日本製薬	4,800	1,777.00	8,529,600
エステー	11,300	1,702.00	19,232,600
アグロ カネショウ	5,800	1,551.00	8,995,800
コニシ	28,800	1,802.00	51,897,600
長谷川香料	30,200	2,838.00	85,707,600
星光P M C	9,900	804.00	7,959,600
小林製薬	49,200	8,720.00	429,024,000
荒川化学工業	14,600	1,231.00	17,972,600
メック	13,100	3,150.00	41,265,000
日本高純度化学	4,800	2,899.00	13,915,200
タカラバイオ	45,900	3,035.00	139,306,500



J C U	19,700	4,500.00	88,650,000
新田ゼラチン	11,000	624.00	6,864,000
O A Tアグリオ	3,600	2,071.00	7,455,600
デクセリアルズ	49,100	2,224.00	109,198,400
アース製薬	14,400	7,110.00	102,384,000
北興化学工業	16,300	1,038.00	16,919,400
大成ラミック	5,400	2,741.00	14,801,400
クミアイ化学工業	65,300	848.00	55,374,400
日本農薬	31,200	538.00	16,785,600
アキレス	12,100	1,356.00	16,407,600
有沢製作所	23,800	895.00	21,301,000
日東電工	106,000	8,090.00	857,540,000
レック	20,800	1,089.00	22,651,200
三光合成	18,400	418.00	7,691,200
きもと	26,800	242.00	6,485,600
藤森工業	15,700	4,660.00	73,162,000
前澤化成工業	11,100	1,278.00	14,185,800
未来工業	6,300	1,617.00	10,187,100
ウェーブロックホールディングス	6,100	676.00	4,123,600
J S P	10,300	1,605.00	16,531,500
エフピコ	32,200	3,875.00	124,775,000
天馬	13,100	2,779.00	36,404,900
信越ポリマー	27,000	1,015.00	27,405,000
東リ	43,700	237.00	10,356,900
ニフコ	64,400	3,650.00	235,060,000
バルカー	14,300	2,130.00	30,459,000
ユニ・チャーム	338,100	4,546.00	1,537,002,600
ショーエイコーポレーション	3,800	814.00	3,093,200
協和キリン	205,900	3,775.00	777,272,500
武田薬品工業	1,459,500	3,246.00	4,737,537,000
アステラス製薬	1,521,000	1,950.50	2,966,710,500
大日本住友製薬	130,000	1,916.00	249,080,000
塩野義製薬	220,600	7,618.00	1,680,530,800
わかもと製薬	20,900	337.00	7,043,300
日本新薬	49,700	8,910.00	442,827,000
中外製薬	548,700	3,968.00	2,177,241,600
科研製薬	30,000	4,475.00	134,250,000
エーザイ	193,800	8,251.00	1,599,043,800
ロート製薬	83,600	3,450.00	288,420,000
小野薬品工業	402,900	2,441.50	983,680,350
久光製薬	51,000	4,195.00	213,945,000
持田製薬	24,300	3,285.00	79,825,500

参天製薬	305,300	1,644.00	501,913,200
扶桑薬品工業	5,700	2,579.00	14,700,300
日本ケミファ	2,100	2,159.00	4,533,900
ツムラ	58,500	3,525.00	206,212,500
日医工	49,700	882.00	43,835,400
キッセイ薬品工業	31,000	2,433.00	75,423,000
生化学工業	30,900	1,027.00	31,734,300
栄研化学	30,800	1,995.00	61,446,000
日水製薬	6,400	992.00	6,348,800
鳥居薬品	9,400	2,947.00	27,701,800
JCRファーマ	49,400	2,940.00	145,236,000
東和薬品	25,300	3,450.00	87,285,000
富士製薬工業	10,800	1,126.00	12,160,800
ゼリア新薬工業	31,800	2,027.00	64,458,600
第一三共	1,378,600	2,760.00	3,804,936,000
キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,810.00	70,047,000
大幸薬品	26,400	854.00	22,545,600
ダイト	11,200	3,265.00	36,568,000
大塚ホールディングス	364,600	4,725.00	1,722,735,000
大正製薬ホールディングス	43,200	6,410.00	276,912,000
ペプチドリーム	92,100	2,741.00	252,446,100
あすか製薬ホールディングス	20,000	1,007.00	20,140,000
サワイグループホールディングス	38,400	5,060.00	194,304,000
日本コークス工業	148,200	147.00	21,785,400
ニチレキ	20,700	1,345.00	27,841,500
ユシロ化学工業	9,800	1,172.00	11,485,600
ビーピー・カストロール	6,300	1,439.00	9,065,700
富士石油	42,600	283.00	12,055,800
MORESCO	6,300	1,268.00	7,988,400
出光興産	194,700	3,265.00	635,695,500
ENEOSホールディングス	2,639,000	466.00	1,229,774,000
コスモエネルギーホールディングス	55,400	2,497.00	138,333,800
横浜ゴム	101,600	1,996.00	202,793,600
TOYO TIRE	92,300	1,888.00	174,262,400
ブリヂストン	505,300	5,097.00	2,575,514,100
住友ゴム工業	157,600	1,446.00	227,889,600
藤倉コンポジット	15,300	822.00	12,576,600
オカモト	10,400	4,040.00	42,016,000
フコク	7,700	1,006.00	7,746,200
ニッタ	18,100	2,670.00	48,327,000
住友理工	34,000	760.00	25,840,000
三ツ星ベルト	21,300	1,934.00	41,194,200

バンドー化学	30,900	882.00	27,253,800
日東紡績	26,100	3,625.00	94,612,500
A G C	161,100	5,800.00	934,380,000
日本板硝子	89,100	633.00	56,400,300
石塚硝子	3,000	2,273.00	6,819,000
日本山村硝子	7,400	912.00	6,748,800
日本電気硝子	70,500	2,839.00	200,149,500
オハラ	7,000	1,435.00	10,045,000
住友大阪セメント	31,600	3,325.00	105,070,000
太平洋セメント	99,700	2,414.00	240,675,800
日本ヒューム	16,100	759.00	12,219,900
日本コンクリート工業	38,100	300.00	11,430,000
三谷セキサン	8,200	7,090.00	58,138,000
アジアパイルホールディングス	27,200	468.00	12,729,600
東海カーボン	147,100	1,463.00	215,207,300
日本カーボン	9,000	4,345.00	39,105,000
東洋炭素	11,500	3,025.00	34,787,500
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	4,930.00	47,821,000
T O T O	125,300	5,760.00	721,728,000
日本碍子	193,100	1,951.00	376,738,100
日本特殊陶業	133,500	1,721.00	229,753,500
M A R U W A	6,100	11,190.00	68,259,000
品川リフラクトリーズ	4,100	4,075.00	16,707,500
黒崎播磨	3,000	4,640.00	13,920,000
ヨータイ	12,600	1,268.00	15,976,800
イソライト工業	7,800	927.00	7,230,600
東京窯業	22,600	328.00	7,412,800
ニッカトー	8,100	796.00	6,447,600
フジミインコーポレーテッド	14,100	7,000.00	98,700,000
クニミネ工業	5,600	1,103.00	6,176,800
エーアンドエーマテリアル	3,400	967.00	3,287,800
ニチアス	44,400	2,709.00	120,279,600
ニチハ	24,400	3,225.00	78,690,000
日本製鉄	828,200	1,986.50	1,645,219,300
神戸製鋼所	317,600	658.00	208,980,800
中山製鋼所	24,300	424.00	10,303,200
合同製鐵	9,400	1,517.00	14,259,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	502,000	1,735.00	870,970,000
東京製鐵	67,600	1,099.00	74,292,400
共英製鋼	19,600	1,355.00	26,558,000
大和工業	36,900	3,545.00	130,810,500
東京鐵鋼	6,700	1,517.00	10,163,900

大阪製鐵	9,300	1,119.00	10,406,700
淀川製鋼所	22,800	2,467.00	56,247,600
丸一鋼管	56,300	2,601.00	146,436,300
モリ工業	5,200	2,437.00	12,672,400
大同特殊鋼	28,400	4,750.00	134,900,000
日本高周波鋼業	6,600	412.00	2,719,200
日本冶金工業	13,500	2,649.00	35,761,500
山陽特殊製鋼	20,800	1,735.00	36,088,000
愛知製鋼	9,800	2,688.00	26,342,400
日立金属	163,600	2,164.00	354,030,400
日本金属	4,400	1,201.00	5,284,400
大平洋金属	11,800	2,076.00	24,496,800
新日本電工	112,200	370.00	41,514,000
栗本鐵工所	7,900	1,656.00	13,082,400
虹技	2,500	1,090.00	2,725,000
三菱製鋼	12,900	1,126.00	14,525,400
日亜鋼業	25,700	290.00	7,453,000
日本精線	2,500	4,920.00	12,300,000
エンビプロ・ホールディングス	7,400	2,541.00	18,803,400
シンニッタン	21,300	233.00	4,962,900
新家工業	4,300	1,733.00	7,451,900
大紀アルミニウム工業所	26,200	1,854.00	48,574,800
日本軽金属ホールディングス	47,300	1,978.00	93,559,400
三井金属鉱業	46,800	3,450.00	161,460,000
東邦亜鉛	9,700	3,480.00	33,756,000
三菱マテリアル	114,600	2,279.00	261,173,400
住友金属鉱山	221,800	4,488.00	995,438,400
D O W Aホールディングス	43,900	4,920.00	215,988,000
古河機械金属	28,700	1,274.00	36,563,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,200	806.00	14,669,200
東邦チタニウム	31,200	1,233.00	38,469,600
U A C J	26,400	2,845.00	75,108,000
C Kサンエツ	3,700	3,350.00	12,395,000
古河電気工業	53,900	2,545.00	137,175,500
住友電気工業	605,500	1,552.00	939,736,000
フジクラ	209,700	661.00	138,611,700
昭和電線ホールディングス	16,800	2,173.00	36,506,400
東京特殊電線	2,300	2,936.00	6,752,800
タツタ電線	30,800	536.00	16,508,800
カナレ電気	2,700	1,725.00	4,657,500
平河ヒューテック	9,700	1,180.00	11,446,000
リョービ	21,400	1,228.00	26,279,200

アーレスティ	21,600	431.00	9,309,600
アサヒホールディングス	65,200	2,188.00	142,657,600
稲葉製作所	9,800	1,348.00	13,210,400
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,605.00	14,848,500
トーカロ	44,700	1,327.00	59,316,900
アルファC o	6,100	1,274.00	7,771,400
SUMCO	267,000	2,199.00	587,133,000
川田テクノロジーズ	3,500	3,930.00	13,755,000
RS Technologies	5,600	6,080.00	34,048,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,207.00	4,193,300
信和	9,200	724.00	6,660,800
東洋製罐グループホールディングス	110,500	1,345.00	148,622,500
ホッカカンホールディングス	8,800	1,490.00	13,112,000
コロナ	9,600	915.00	8,784,000
横河ブリッジホールディングス	29,800	2,310.00	68,838,000
駒井ハルテック	3,500	1,690.00	5,915,000
高田機工	1,600	2,777.00	4,443,200
三和ホールディングス	163,600	1,447.00	236,729,200
文化シャッター	51,100	1,124.00	57,436,400
三協立山	22,300	759.00	16,925,700
アルインコ	11,500	1,004.00	11,546,000
東洋シャッター	3,800	662.00	2,515,600
LIXIL	238,900	3,115.00	744,173,500
日本フィルコン	12,100	550.00	6,655,000
ノーリツ	33,200	1,863.00	61,851,600
長府製作所	17,600	2,067.00	36,379,200
リンナイ	33,700	11,920.00	401,704,000
ダイニチ工業	8,300	770.00	6,391,000
日東精工	21,800	659.00	14,366,200
三洋工業	2,100	1,871.00	3,929,100
岡部	35,200	687.00	24,182,400
ジーテクト	21,500	1,456.00	31,304,000
東プレ	32,400	1,352.00	43,804,800
高周波熱錬	33,400	638.00	21,309,200
東京製綱	12,400	880.00	10,912,000
サンコール	14,800	455.00	6,734,000
モリテック スチール	13,500	439.00	5,926,500
パイオラックス	25,700	1,615.00	41,505,500
エイチワン	17,000	739.00	12,563,000
日本発條	172,800	858.00	148,262,400
中央発條	8,300	1,039.00	8,623,700
アドバネクス	2,500	1,201.00	3,002,500

立川ブラインド工業	7,600	1,267.00	9,629,200
三益半導体工業	13,500	2,486.00	33,561,000
日本ドライケミカル	4,400	2,150.00	9,460,000
日本製鋼所	52,800	3,290.00	173,712,000
三浦工業	75,200	4,400.00	330,880,000
タクマ	59,100	1,545.00	91,309,500
ツガミ	36,200	1,553.00	56,218,600
オークマ	20,300	5,470.00	111,041,000
芝浦機械	18,100	2,658.00	48,109,800
アマダ	254,600	1,159.00	295,081,400
アイダエンジニアリング	45,800	1,032.00	47,265,600
滝澤鉄工所	5,100	1,110.00	5,661,000
F U J I	69,300	2,638.00	182,813,400
牧野フライス製作所	20,400	4,200.00	85,680,000
オーエスジー	80,500	1,823.00	146,751,500
ダイジェット工業	2,300	1,190.00	2,737,000
旭ダイヤモンド工業	46,100	688.00	31,716,800
D M G 森精機	103,100	1,977.00	203,828,700
ソディック	38,600	873.00	33,697,800
ディスコ	23,600	30,750.00	725,700,000
日東工器	8,400	1,952.00	16,396,800
日進工具	13,700	1,550.00	21,235,000
パンチ工業	14,700	603.00	8,864,100
富士ダイス	8,900	643.00	5,722,700
豊和工業	10,100	819.00	8,271,900
O K K	6,700	312.00	2,090,400
東洋機械金属	12,600	521.00	6,564,600
津田駒工業	3,300	830.00	2,739,000
エンシュウ	4,700	701.00	3,294,700
島精機製作所	25,500	2,246.00	57,273,000
オプトラン	21,800	2,294.00	50,009,200
N C ホールディングス	5,300	1,413.00	7,488,900
イワキポンプ	11,200	983.00	11,009,600
フリー	17,000	1,641.00	27,897,000
ヤマシンフィルタ	35,200	683.00	24,041,600
日阪製作所	21,500	852.00	18,318,000
やまびこ	33,700	1,205.00	40,608,500
野村マイクロ・サイエンス	3,800	5,000.00	19,000,000
平田機工	8,200	7,020.00	57,564,000
ペガサスミシン製造	17,800	465.00	8,277,000
マルマエ	7,200	2,246.00	16,171,200
タツモ	8,200	1,647.00	13,505,400

ナブテスコ	99,000	3,965.00	392,535,000
三井海洋開発	18,500	1,991.00	36,833,500
レオン自動機	17,100	1,452.00	24,829,200
S M C	51,400	66,640.00	3,425,296,000
ホソカワミクロン	12,200	3,245.00	39,589,000
ユニオンツール	6,500	3,820.00	24,830,000
オイレス工業	24,400	1,706.00	41,626,400
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,860.00	22,774,000
サトーホールディングス	22,900	2,644.00	60,547,600
技研製作所	15,300	4,445.00	68,008,500
日本エアーテック	8,100	1,259.00	10,197,900
カワタ	4,800	1,032.00	4,953,600
日精樹脂工業	13,700	1,102.00	15,097,400
オカダアイヨン	5,600	1,301.00	7,285,600
ワイエイシイホールディングス	6,900	944.00	6,513,600
小松製作所	795,000	2,830.00	2,249,850,000
住友重機械工業	100,600	2,923.00	294,053,800
日立建機	82,100	3,375.00	277,087,500
日工	26,800	664.00	17,795,200
巴工業	6,900	2,523.00	17,408,700
井関農機	16,500	1,639.00	27,043,500
T O W A	16,400	2,428.00	39,819,200
丸山製作所	3,800	1,535.00	5,833,000
北川鉄工所	8,200	1,585.00	12,997,000
ローツェ	7,700	10,750.00	82,775,000
タカキタ	6,300	696.00	4,384,800
クボタ	855,900	2,400.00	2,054,160,000
荏原実業	8,200	2,870.00	23,534,000
三菱化工機	5,800	2,430.00	14,094,000
月島機械	32,700	1,151.00	37,637,700
帝国電機製作所	12,300	1,450.00	17,835,000
新東工業	42,200	752.00	31,734,400
澁谷工業	15,500	3,065.00	47,507,500
アイチ コーポレーション	30,400	787.00	23,924,800
小森コーポレーション	45,000	785.00	35,325,000
鶴見製作所	13,700	1,748.00	23,947,600
住友精密工業	2,700	2,348.00	6,339,600
日本ギア工業	7,400	307.00	2,271,800
酒井重工業	3,200	2,511.00	8,035,200
荏原製作所	72,900	6,140.00	447,606,000
石井鐵工所	2,600	2,972.00	7,727,200
西島製作所	17,900	906.00	16,217,400

北越工業	18,200	944.00	17,180,800
ダイキン工業	223,500	25,730.00	5,750,655,000
オルガノ	5,700	6,780.00	38,646,000
トーヨーカネツ	6,800	2,610.00	17,748,000
栗田工業	95,000	5,640.00	535,800,000
椿本チエイン	25,100	3,350.00	84,085,000
大同工業	8,700	1,052.00	9,152,400
木村化工機	15,200	773.00	11,749,600
アネスト岩田	29,700	923.00	27,413,100
ダイフク	96,600	10,300.00	994,980,000
サムコ	4,400	2,847.00	12,526,800
加藤製作所	10,100	850.00	8,585,000
油研工業	3,200	1,743.00	5,577,600
タダノ	85,000	1,233.00	104,805,000
フジテック	60,400	2,515.00	151,906,000
C K D	40,700	2,242.00	91,249,400
キトー	14,800	1,651.00	24,434,800
平和	49,000	2,076.00	101,724,000
理想科学工業	12,900	2,409.00	31,076,100
S A N K Y O	41,700	2,787.00	116,217,900
日本金銭機械	19,500	761.00	14,839,500
マースグループホールディングス	11,200	1,639.00	18,356,800
フクシマガリレイ	12,000	4,680.00	56,160,000
オーイズミ	7,700	381.00	2,933,700
ダイコク電機	8,200	1,191.00	9,766,200
竹内製作所	29,400	2,898.00	85,201,200
アマノ	46,000	2,688.00	123,648,000
J U K I	24,400	851.00	20,764,400
ジャノメ	16,100	747.00	12,026,700
マックス	23,400	1,801.00	42,143,400
グローリー	45,100	2,414.00	108,871,400
新晃工業	16,400	2,090.00	34,276,000
大和冷機工業	25,400	1,260.00	32,004,000
セガサミーホールディングス	159,600	1,628.00	259,828,800
日本ピストンリング	6,500	1,376.00	8,944,000
リケン	8,200	2,728.00	22,369,600
T P R	23,700	1,480.00	35,076,000
ツバキ・ナカシマ	38,600	1,602.00	61,837,200
ホシザキ	51,300	9,810.00	503,253,000
大豊工業	14,400	840.00	12,096,000
日本精工	360,400	818.00	294,807,200
N T N	406,000	264.00	107,184,000



ジェイテクト	168,400	1,029.00	173,283,600
不二越	15,000	4,230.00	63,450,000
日本トムソン	48,300	547.00	26,420,100
THK	102,100	2,532.00	258,517,200
ユーシン精機	11,800	777.00	9,168,600
前澤給装工業	12,300	1,058.00	13,013,400
イーグル工業	21,800	1,212.00	26,421,600
前澤工業	10,700	697.00	7,457,900
日本ピラー工業	17,800	2,580.00	45,924,000
キッツ	59,200	767.00	45,406,400
マキタ	228,800	5,770.00	1,320,176,000
三井E & Sホールディングス	67,900	564.00	38,295,600
日立造船	139,600	900.00	125,640,000
三菱重工業	275,800	3,061.00	844,223,800
IHI	118,100	2,713.00	320,405,300
スター精密	27,100	1,516.00	41,083,600
日清紡ホールディングス	107,300	898.00	96,355,400
イビデン	84,600	6,180.00	522,828,000
コニカミノルタ	357,700	609.00	217,839,300
ブラザー工業	214,700	2,353.00	505,189,100
ミネベアミツミ	302,800	2,855.00	864,494,000
日立製作所	843,400	6,830.00	5,760,422,000
東芝	347,200	4,890.00	1,697,808,000
三菱電機	1,754,200	1,606.50	2,818,122,300
富士電機	105,700	5,130.00	542,241,000
東洋電機製造	6,900	1,103.00	7,610,700
安川電機	188,800	5,070.00	957,216,000
シンフォニアテクノロジー	22,700	1,199.00	27,217,300
明電舎	29,800	2,449.00	72,980,200
オリジン	4,700	1,277.00	6,001,900
山洋電気	8,700	6,460.00	56,202,000
デンヨー	14,900	2,046.00	30,485,400
東芝テック	18,800	4,715.00	88,642,000
芝浦メカトロニクス	3,300	7,130.00	23,529,000
マブチモーター	41,400	3,960.00	163,944,000
日本電産	422,300	12,620.00	5,329,426,000
トレックス・セミコンダクター	9,900	2,545.00	25,195,500
東光高岳	9,600	1,473.00	14,140,800
ダイヘン	19,200	4,665.00	89,568,000
ヤーマン	29,500	1,229.00	36,255,500
JVCケンウッド	157,200	206.00	32,383,200
ミマキエンジニアリング	16,900	911.00	15,395,900

I - P E X	8,700	2,038.00	17,730,600
日新電機	41,100	1,378.00	56,635,800
大崎電気工業	34,900	553.00	19,299,700
オムロン	146,000	10,960.00	1,600,160,000
日東工業	25,800	1,707.00	44,040,600
I D E C	23,500	2,273.00	53,415,500
正興電機製作所	6,300	1,413.00	8,901,900
不二電機工業	3,800	1,270.00	4,826,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,500	2,591.00	164,528,500
サクサホールディングス	4,100	1,428.00	5,854,800
メルコホールディングス	6,300	4,765.00	30,019,500
テクノメディカ	4,600	1,589.00	7,309,400
日本電気	222,900	6,320.00	1,408,728,000
富士通	157,800	21,460.00	3,386,388,000
沖電気工業	71,300	967.00	68,947,100
岩崎通信機	7,700	878.00	6,760,600
電気興業	8,400	2,529.00	21,243,600
サンケン電気	20,500	5,340.00	109,470,000
ナカヨ	3,400	1,400.00	4,760,000
アイホン	9,900	2,421.00	23,967,900
ルネサスエレクトロニクス	950,000	1,372.00	1,303,400,000
セイコーエプソン	217,700	2,160.00	470,232,000
ワコム	128,600	732.00	94,135,200
アルバック	32,300	6,340.00	204,782,000
アクセル	8,900	737.00	6,559,300
E I Z O	14,900	4,295.00	63,995,500
日本信号	40,900	968.00	39,591,200
京三製作所	37,700	481.00	18,133,700
能美防災	23,700	2,086.00	49,438,200
ホーチキ	13,700	1,202.00	16,467,400
星和電機	10,100	524.00	5,292,400
エレコム	40,800	1,776.00	72,460,800
パナソニック	1,870,800	1,396.00	2,611,636,800
シャープ	233,300	1,379.00	321,720,700
アンリツ	105,500	2,035.00	214,692,500
富士通ゼネラル	53,600	2,837.00	152,063,200
ソニーグループ	1,098,900	12,820.00	14,087,898,000
T D K	254,400	4,000.00	1,017,600,000
帝国通信工業	8,600	1,386.00	11,919,600
タムラ製作所	63,100	771.00	48,650,100
アルプスアルパイン	144,300	1,185.00	170,995,500
池上通信機	5,600	787.00	4,407,200

鈴木	9,100	903.00	8,217,300
メイコー	13,500	3,155.00	42,592,500
日本トリム	4,100	3,455.00	14,165,500
ローランド ディー・ジー	10,700	2,960.00	31,672,000
フォスター電機	17,700	893.00	15,806,100
SMK	4,500	2,208.00	9,936,000
ヨコオ	14,800	2,566.00	37,976,800
ホシデン	47,000	963.00	45,261,000
ヒロセ電機	27,000	18,660.00	503,820,000
日本航空電子工業	40,200	1,642.00	66,008,400
TOA	20,700	821.00	16,994,700
マクセル	35,700	1,317.00	47,016,900
古野電気	23,500	1,249.00	29,351,500
ユニデンホールディングス	4,200	3,095.00	12,999,000
スミダコーポレーション	17,300	1,363.00	23,579,900
アイコム	7,300	2,412.00	17,607,600
リオン	7,800	2,460.00	19,188,000
本多通信工業	16,100	462.00	7,438,200
横河電機	175,600	2,214.00	388,778,400
新電元工業	6,800	3,920.00	26,656,000
アズビル	118,600	4,795.00	568,687,000
東亜ディーケーケー	9,900	910.00	9,009,000
日本光電工業	72,800	3,650.00	265,720,000
チノー	5,500	1,418.00	7,799,000
共和電業	16,800	398.00	6,686,400
日本電子材料	7,200	1,872.00	13,478,400
堀場製作所	32,400	7,560.00	244,944,000
アドバンテスト	130,400	9,250.00	1,206,200,000
小野測器	9,400	525.00	4,935,000
エスペック	16,000	2,340.00	37,440,000
キーエンス	172,200	68,410.00	11,780,202,000
日置電機	8,500	8,210.00	69,785,000
シスメックス	137,000	14,030.00	1,922,110,000
日本マイクロニクス	31,400	1,441.00	45,247,400
メガチップス	17,900	3,500.00	62,650,000
OBARA GROUP	8,300	3,640.00	30,212,000
澤藤電機	2,400	2,023.00	4,855,200
原田工業	8,200	965.00	7,913,000
コーセル	22,600	934.00	21,108,400
イリソ電子工業	15,000	4,995.00	74,925,000
オブテックスグループ	29,600	1,485.00	43,956,000
千代田インテグレ	7,900	2,170.00	17,143,000

アイ・オー・データ機器	7,700	935.00	7,199,500
レーザーテック	77,100	26,800.00	2,066,280,000
スタンレー電気	123,200	2,851.00	351,243,200
岩崎電気	6,900	2,064.00	14,241,600
ウシオ電機	90,500	2,107.00	190,683,500
岡谷電機産業	15,700	350.00	5,495,000
ハリオス テクノ ホールディング	19,600	325.00	6,370,000
エノモト	5,500	1,875.00	10,312,500
日本セラミック	16,700	3,025.00	50,517,500
遠藤照明	9,900	1,171.00	11,592,900
古河電池	13,200	1,591.00	21,001,200
双信電機	10,000	769.00	7,690,000
山一電機	12,100	1,689.00	20,436,900
図研	11,700	4,220.00	49,374,000
日本電子	33,400	8,580.00	286,572,000
カシオ計算機	141,100	1,680.00	237,048,000
ファナック	154,000	24,890.00	3,833,060,000
日本シイエムケイ	40,500	431.00	17,455,500
エンプラス	8,300	3,195.00	26,518,500
大真空	6,200	4,220.00	26,164,000
ローム	73,000	10,130.00	739,490,000
浜松ホトニクス	126,000	6,670.00	840,420,000
三井ハイテック	17,400	7,630.00	132,762,000
新光電気工業	59,200	3,865.00	228,808,000
京セラ	267,500	6,819.00	1,824,082,500
太陽誘電	78,200	5,590.00	437,138,000
村田製作所	515,400	8,652.00	4,459,240,800
双葉電子工業	31,500	770.00	24,255,000
北陸電気工業	7,600	1,043.00	7,926,800
ニチコン	56,300	1,083.00	60,972,900
日本ケミコン	17,700	2,108.00	37,311,600
K O A	24,900	1,719.00	42,803,100
市光工業	22,900	581.00	13,304,900
小糸製作所	105,300	6,810.00	717,093,000
ミツバ	32,300	659.00	21,285,700
S C R E E Nホールディングス	30,400	9,300.00	282,720,000
キャノン電子	16,800	1,643.00	27,602,400
キャノン	871,700	2,904.00	2,531,416,800
リコー	446,300	1,163.00	519,046,900
象印マホービン	48,200	1,571.00	75,722,200
M U T O Hホールディングス	2,900	1,630.00	4,727,000
東京エレクトロン	102,700	50,960.00	5,233,592,000

トヨタ紡織	51,100	2,101.00	107,361,100
芦森工業	3,300	1,004.00	3,313,200
ユニプレス	28,800	942.00	27,129,600
豊田自動織機	142,000	9,700.00	1,377,400,000
モリタホールディングス	28,100	1,438.00	40,407,800
三櫻工業	24,300	1,038.00	25,223,400
デンソー	386,200	7,878.00	3,042,483,600
東海理化電機製作所	46,200	1,637.00	75,629,400
川崎重工業	137,200	2,347.00	322,008,400
名村造船所	52,700	232.00	12,226,400
日本車輛製造	6,400	2,082.00	13,324,800
三菱ロジスネクスト	23,200	1,118.00	25,937,600
近畿車輛	3,000	1,105.00	3,315,000
日産自動車	2,068,900	604.00	1,249,615,600
いすゞ自動車	465,800	1,568.00	730,374,400
トヨタ自動車	8,885,800	2,031.50	18,051,502,700
日野自動車	219,100	1,140.00	249,774,000
三菱自動車工業	649,300	380.00	246,734,000
エフテック	12,200	636.00	7,759,200
レシップホールディングス	6,900	576.00	3,974,400
G M B	3,200	877.00	2,806,400
ファルテック	3,100	737.00	2,284,700
武蔵精密工業	39,100	2,146.00	83,908,600
日産車体	25,700	804.00	20,662,800
新明和工業	49,600	954.00	47,318,400
極東開発工業	30,300	1,635.00	49,540,500
トピー工業	14,400	1,203.00	17,323,200
ティラド	5,500	3,075.00	16,912,500
曙ブレーキ工業	96,300	245.00	23,593,500
タチエス	26,900	1,353.00	36,395,700
N O K	84,900	1,351.00	114,699,900
フタバ産業	43,900	477.00	20,940,300
K Y B	19,600	3,065.00	60,074,000
大同メタル工業	36,200	627.00	22,697,400
プレス工業	86,900	336.00	29,198,400
ミクニ	22,300	319.00	7,113,700
太平洋工業	36,700	1,221.00	44,810,700
河西工業	23,700	359.00	8,508,300
アイシン	128,400	4,175.00	536,070,000
マツダ	550,600	1,061.00	584,186,600
今仙電機製作所	15,300	677.00	10,358,100
本田技研工業	1,381,200	3,489.00	4,819,006,800

スズキ	347,700	5,250.00	1,825,425,000
S U B A R U	502,700	2,304.00	1,158,220,800
安永	8,500	1,193.00	10,140,500
ヤマハ発動機	228,900	3,120.00	714,168,000
T B K	20,800	412.00	8,569,600
エクセディ	23,800	1,747.00	41,578,600
豊田合成	56,600	2,348.00	132,896,800
愛三工業	27,500	835.00	22,962,500
盟和産業	2,700	1,018.00	2,748,600
日本プラスト	14,800	637.00	9,427,600
ヨロズ	15,000	1,195.00	17,925,000
エフ・シー・シー	28,700	1,621.00	46,522,700
シマノ	70,700	30,110.00	2,128,777,000
テイ・エス テック	81,500	1,508.00	122,902,000
ジャムコ	10,200	1,014.00	10,342,800
テルモ	537,800	5,103.00	2,744,393,400
クリエートメディック	5,300	984.00	5,215,200
日機装	52,600	1,014.00	53,336,400
日本エム・ディ・エム	10,100	2,185.00	22,068,500
島津製作所	225,800	4,700.00	1,061,260,000
J M S	14,900	773.00	11,517,700
長野計器	12,700	1,353.00	17,183,100
ブイ・テクノロジー	8,200	4,490.00	36,818,000
東京計器	11,200	1,018.00	11,401,600
愛知時計電機	2,300	4,830.00	11,109,000
インターアクション	8,800	2,500.00	22,000,000
オーバル	15,900	254.00	4,038,600
東京精密	29,600	4,570.00	135,272,000
マニー	69,900	2,007.00	140,289,300
ニコン	267,900	1,288.00	345,055,200
トプコン	88,400	1,979.00	174,943,600
オリンパス	920,000	2,525.00	2,323,000,000
理研計器	15,500	3,125.00	48,437,500
タムロン	13,600	2,606.00	35,441,600
H O Y A	342,300	17,445.00	5,971,423,500
シード	6,900	670.00	4,623,000
ノーリツ鋼機	15,800	2,449.00	38,694,200
エー・アンド・デイ	14,800	1,037.00	15,347,600
朝日インテック	192,300	2,993.00	575,553,900
シチズン時計	222,700	520.00	115,804,000
リズム	5,500	1,452.00	7,986,000
大研医器	13,900	588.00	8,173,200

メニコン	54,000	4,095.00	221,130,000
シンシア	1,900	617.00	1,172,300
松風	8,100	2,140.00	17,334,000
セイコーホールディングス	24,800	2,398.00	59,470,400
ニプロ	130,800	1,153.00	150,812,400
中本パックス	4,500	1,773.00	7,978,500
スノーピーク	11,400	5,420.00	61,788,000
パラマウントベッドホールディングス	33,600	2,154.00	72,374,400
トランザクション	9,600	1,132.00	10,867,200
粧美堂	5,100	409.00	2,085,900
ニホンフラッシュ	15,000	1,101.00	16,515,000
前田工織	19,300	3,320.00	64,076,000
永大産業	22,900	297.00	6,801,300
アートネイチャー	16,900	740.00	12,506,000
バンダイナムコホールディングス	145,100	8,788.00	1,275,138,800
アイフィスジャパン	4,500	705.00	3,172,500
共立印刷	29,400	178.00	5,233,200
SHOEI	16,500	5,010.00	82,665,000
フランスベッドホールディングス	22,500	908.00	20,430,000
パイロットコーポレーション	29,600	4,270.00	126,392,000
萩原工業	11,400	1,576.00	17,966,400
トッパン・フォームズ	31,300	1,049.00	32,833,700
フジシールインターナショナル	36,000	2,507.00	90,252,000
タカラトミー	78,700	1,112.00	87,514,400
広済堂ホールディングス	12,200	1,019.00	12,431,800
エステールホールディングス	4,700	654.00	3,073,800
タカノ	6,000	738.00	4,428,000
プロネクサス	13,600	1,093.00	14,864,800
ホクシン	10,800	177.00	1,911,600
ウッドワン	5,900	1,139.00	6,720,100
大建工業	11,800	2,399.00	28,308,200
凸版印刷	266,700	1,861.00	496,328,700
大日本印刷	207,300	2,821.00	584,793,300
共同印刷	5,400	2,638.00	14,245,200
NISSHA	36,000	1,815.00	65,340,000
光村印刷	1,500	1,610.00	2,415,000
TAKARA & COMPANY	8,600	1,780.00	15,308,000
アシックス	155,100	2,865.00	444,361,500
ツツミ	4,400	2,212.00	9,732,800
ローランド	12,200	5,210.00	63,562,000
小松ウオール工業	5,300	1,939.00	10,276,700
ヤマハ	104,300	7,230.00	754,089,000

河合楽器製作所	4,900	3,590.00	17,591,000
クリナップ	16,300	550.00	8,965,000
ピジョン	106,000	2,630.00	278,780,000
兼松サステック	1,100	1,787.00	1,965,700
キングジム	14,100	877.00	12,365,700
リンテック	37,600	2,503.00	94,112,800
イトーキ	32,300	374.00	12,080,200
任天堂	100,400	50,300.00	5,050,120,000
三菱鉛筆	28,900	1,391.00	40,199,900
タカラスタンダード	36,200	1,540.00	55,748,000
コクヨ	84,100	1,802.00	151,548,200
ナカバヤシ	17,300	575.00	9,947,500
グローブライド	17,000	4,220.00	71,740,000
オカムラ	60,300	1,530.00	92,259,000
美津濃	17,400	2,618.00	45,553,200
東京電力ホールディングス	1,487,900	342.00	508,861,800
中部電力	536,700	1,303.00	699,320,100
関西電力	664,700	1,079.00	717,211,300
中国電力	253,000	996.00	251,988,000
北陸電力	160,400	580.00	93,032,000
東北電力	410,800	780.00	320,424,000
四国電力	145,800	756.00	110,224,800
九州電力	387,400	839.00	325,028,600
北海道電力	164,200	517.00	84,891,400
沖縄電力	34,100	1,423.00	48,524,300
電源開発	139,600	1,595.00	222,662,000
エフオン	10,600	876.00	9,285,600
イーレックス	25,800	2,682.00	69,195,600
レノバ	29,900	5,030.00	150,397,000
東京瓦斯	336,300	1,926.50	647,881,950
大阪瓦斯	317,700	1,915.00	608,395,500
東邦瓦斯	86,300	3,690.00	318,447,000
北海道瓦斯	9,400	1,516.00	14,250,400
広島ガス	36,200	370.00	13,394,000
西部ガスホールディングス	19,700	2,339.00	46,078,300
静岡ガス	45,600	1,248.00	56,908,800
メタウォーター	19,700	1,875.00	36,937,500
SBSホールディングス	13,000	4,180.00	54,340,000
東武鉄道	182,800	2,880.00	526,464,000
相鉄ホールディングス	60,100	2,185.00	131,318,500
東急	442,400	1,616.00	714,918,400
京浜急行電鉄	225,300	1,308.00	294,692,400



小田急電鉄	281,000	2,522.00	708,682,000
京王電鉄	98,000	5,880.00	576,240,000
京成電鉄	131,500	3,710.00	487,865,000
富士急行	23,900	4,680.00	111,852,000
新京成電鉄	4,500	2,040.00	9,180,000
東日本旅客鉄道	308,800	7,414.00	2,289,443,200
西日本旅客鉄道	196,000	5,369.00	1,052,324,000
東海旅客鉄道	145,900	17,215.00	2,511,668,500
西武ホールディングス	211,400	1,279.00	270,380,600
鴻池運輸	27,900	1,257.00	35,070,300
西日本鉄道	48,600	2,742.00	133,261,200
ハマキョウレックス	13,500	3,310.00	44,685,000
サカイ引越センター	8,100	4,775.00	38,677,500
近鉄グループホールディングス	166,100	3,625.00	602,112,500
阪急阪神ホールディングス	221,600	3,475.00	770,060,000
南海電気鉄道	78,700	2,284.00	179,750,800
京阪ホールディングス	74,000	3,060.00	226,440,000
神戸電鉄	4,000	3,470.00	13,880,000
名古屋鉄道	136,600	1,971.00	269,238,600
山陽電気鉄道	11,900	1,983.00	23,597,700
アルプス物流	11,600	1,045.00	12,122,000
日本通運	57,500	7,480.00	430,100,000
ヤマトホールディングス	232,800	2,806.00	653,236,800
山九	42,600	5,370.00	228,762,000
丸運	9,500	268.00	2,546,000
丸全昭和運輸	13,500	3,355.00	45,292,500
センコーグループホールディングス	91,600	1,026.00	93,981,600
トナミホールディングス	4,000	4,835.00	19,340,000
ニッコンホールディングス	55,700	2,280.00	126,996,000
日本石油輸送	1,800	2,696.00	4,852,800
福山通運	21,300	4,765.00	101,494,500
セイノーホールディングス	124,400	1,379.00	171,547,600
エスライン	4,500	921.00	4,144,500
神奈川中央交通	4,100	3,440.00	14,104,000
日立物流	34,200	4,775.00	163,305,000
丸和運輸機関	35,100	1,573.00	55,212,300
C & F ロジホールディングス	16,800	1,655.00	27,804,000
九州旅客鉄道	128,500	2,624.00	337,184,000
S Gホールディングス	313,900	2,901.00	910,623,900
日本郵船	139,300	7,800.00	1,086,540,000
商船三井	99,000	6,690.00	662,310,000
川崎汽船	51,200	5,220.00	267,264,000

N Sユニテッド海運	8,600	3,785.00	32,551,000
飯野海運	82,100	553.00	45,401,300
共栄タンカー	5,600	1,012.00	5,667,200
乾汽船	11,400	2,324.00	26,493,600
日本航空	404,700	2,517.00	1,018,629,900
A N Aホールディングス	448,400	2,753.00	1,234,445,200
パスコ	3,100	1,500.00	4,650,000
ランコム	5,100	8,720.00	44,472,000
日新	13,200	1,648.00	21,753,600
三菱倉庫	57,500	3,225.00	185,437,500
三井倉庫ホールディングス	17,600	2,315.00	40,744,000
住友倉庫	58,700	1,848.00	108,477,600
澁澤倉庫	9,100	2,198.00	20,001,800
東陽倉庫	27,800	329.00	9,146,200
日本トランスシティ	36,600	604.00	22,106,400
ケイヒン	3,200	1,406.00	4,499,200
中央倉庫	10,100	982.00	9,918,200
川西倉庫	3,000	1,162.00	3,486,000
安田倉庫	13,600	975.00	13,260,000
ファイズホールディングス	2,900	714.00	2,070,600
東洋埠頭	5,100	1,407.00	7,175,700
宇徳	11,800	537.00	6,336,600
上組	91,400	2,364.00	216,069,600
サンリツ	4,300	800.00	3,440,000
キムラユニティー	4,400	1,412.00	6,212,800
キューソー流通システム	4,100	1,875.00	7,687,500
近鉄エクスプレス	31,400	2,712.00	85,156,800
東海運	9,500	333.00	3,163,500
エーアイティー	10,400	1,125.00	11,700,000
内外トランスライン	6,400	2,130.00	13,632,000
日本コンセプト	5,300	1,759.00	9,322,700
N E C ネットエスアイ	57,000	2,088.00	119,016,000
クロスキャット	4,700	1,311.00	6,161,700
システナ	61,500	2,151.00	132,286,500
デジタルアーツ	10,000	9,610.00	96,100,000
日鉄ソリューションズ	25,000	3,760.00	94,000,000
キューブシステム	8,900	1,013.00	9,015,700
W O W W O R L D	2,800	1,808.00	5,062,400
コア	7,400	1,524.00	11,277,600
ラクーンホールディングス	12,300	1,596.00	19,630,800
ソリトンシステムズ	8,700	1,463.00	12,728,100
ソフトクリエイティブホールディングス	6,800	3,890.00	26,452,000

T I S	172,200	3,150.00	542,430,000
J N S ホールディングス	8,500	547.00	4,649,500
グリー	105,800	947.00	100,192,600
G M O ペパボ	1,900	2,814.00	5,346,600
コーエーテクモホールディングス	45,800	5,170.00	236,786,000
三菱総合研究所	7,400	4,385.00	32,449,000
電算	2,000	2,339.00	4,678,000
A G S	9,000	903.00	8,127,000
ファインデックス	14,700	985.00	14,479,500
ブレインパッド	4,500	5,540.00	24,930,000
K L a b	31,600	647.00	20,445,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,100	1,039.00	24,000,900
イーブックイニシアティブジャパン	2,800	4,775.00	13,370,000
ネクソン	387,800	1,995.00	773,661,000
アイスタイル	53,000	419.00	22,207,000
エムアップホールディングス	4,500	3,575.00	16,087,500
エイチーム	12,000	1,628.00	19,536,000
エニグモ	16,400	1,139.00	18,679,600
テクノスジャパン	13,700	601.00	8,233,700
コロプラ	56,800	821.00	46,632,800
ブロードリーフ	85,700	564.00	48,334,800
クロス・マーケティンググループ	6,800	878.00	5,970,400
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,915.00	15,128,500
システム情報	13,100	938.00	12,287,800
メディアドゥ	6,700	4,200.00	28,140,000
じげん	43,100	407.00	17,541,700
ブイキューブ	17,600	1,615.00	28,424,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,400	604.00	2,053,600
サイバーリンクス	5,800	1,302.00	7,551,600
フィックスターズ	18,600	770.00	14,322,000
C A R T A H O L D I N G S	7,000	2,566.00	17,962,000
オブティム	12,100	1,890.00	22,869,000
セレス	6,400	3,070.00	19,648,000
S H I F T	8,700	24,450.00	212,715,000
ティーガイア	18,400	2,057.00	37,848,800
セック	2,600	2,336.00	6,073,600
テクマトリックス	26,800	1,843.00	49,392,400
プロシップ	5,200	1,792.00	9,318,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	46,800	2,123.00	99,356,400
G M O ペイメントゲートウェイ	33,400	14,510.00	484,634,000
ザッパラス	7,100	531.00	3,770,100
システムリサーチ	5,100	1,953.00	9,960,300

インターネットイニシアティブ	45,900	3,990.00	183,141,000
さくらインターネット	18,800	608.00	11,430,400
ヴィンクス	5,000	947.00	4,735,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,700.00	18,330,000
SRAホールディングス	9,200	2,853.00	26,247,600
システムインテグレータ	5,200	636.00	3,307,200
朝日ネット	14,200	716.00	10,167,200
eBASE	20,800	800.00	16,640,000
アバント	18,600	1,701.00	31,638,600
アドソル日進	6,200	2,180.00	13,516,000
ODKソリューションズ	3,900	701.00	2,733,900
フリービット	10,400	1,278.00	13,291,200
コムチュア	15,900	3,060.00	48,654,000
サイバーコム	2,800	1,265.00	3,542,000
アステリア	12,700	713.00	9,055,100
アイル	9,700	1,763.00	17,101,100
マークライنز	8,700	3,180.00	27,666,000
メディカル・データ・ビジョン	21,900	1,522.00	33,331,800
gumi	24,100	904.00	21,786,400
ショーケース	4,100	605.00	2,480,500
モバイルファクトリー	4,100	1,074.00	4,403,400
テラスカイ	5,700	2,206.00	12,574,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	1,760.00	13,552,000
PCIホールディングス	7,900	1,054.00	8,326,600
パイプドHD	3,600	3,070.00	11,052,000
アイビーシー	3,000	929.00	2,787,000
ネオジャパン	3,400	1,345.00	4,573,000
PR TIMES	3,700	3,755.00	13,893,500
ラクス	51,900	3,405.00	176,719,500
ランドコンピュータ	4,200	825.00	3,465,000
ダブルスタンダード	4,500	3,745.00	16,852,500
オープンドア	10,300	2,619.00	26,975,700
マイネット	6,200	668.00	4,141,600
アカツキ	7,000	3,215.00	22,505,000
ベネフィットジャパン	1,400	2,749.00	3,848,600
Ubicomホールディングス	4,600	2,804.00	12,898,400
カナミックネットワーク	18,700	627.00	11,724,900
ノムラシステムコーポレーション	9,500	295.00	2,802,500
チェンジ	31,800	2,269.00	72,154,200
シンクロ・フード	10,800	390.00	4,212,000
オークネット	9,200	2,382.00	21,914,400
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	900.00	3,330,000

セグエグループ	4,700	777.00	3,651,900
エイトレッド	3,300	2,537.00	8,372,100
マクロミル	35,400	834.00	29,523,600
ビーグリー	4,200	1,596.00	6,703,200
オロ	5,500	3,715.00	20,432,500
ユーザーローカル	5,300	1,851.00	9,810,300
テモナ	4,000	753.00	3,012,000
ニーズウェル	4,000	713.00	2,852,000
マネーフォワード	26,100	7,020.00	183,222,000
サインポスト	4,100	1,368.00	5,608,800
電算システムホールディングス	7,100	2,601.00	18,467,100
ソルクシーズ	15,000	540.00	8,100,000
フェイス	5,600	702.00	3,931,200
プロトコーポレーション	20,700	1,534.00	31,753,800
ハイマックス	5,000	1,249.00	6,245,000
野村総合研究所	299,100	4,190.00	1,253,229,000
サイバネットシステム	12,600	634.00	7,988,400
C Eホールディングス	9,500	559.00	5,310,500
日本システム技術	3,400	2,120.00	7,208,000
インテージホールディングス	21,600	1,742.00	37,627,200
東邦システムサイエンス	4,700	1,052.00	4,944,400
ソースネクスト	82,600	217.00	17,924,200
インフォコム	15,800	2,408.00	38,046,400
HEROZ	5,000	1,958.00	9,790,000
ラクスル	18,800	6,200.00	116,560,000
I P S	4,200	2,024.00	8,500,800
F I G	19,400	289.00	5,606,600
システムサポート	5,200	1,333.00	6,931,600
イーソル	10,800	883.00	9,536,400
アルテリア・ネットワークス	19,200	1,645.00	31,584,000
E d u L a b	1,700	1,755.00	2,983,500
東海ソフト	2,900	1,232.00	3,572,800
ウイングアーク1st	9,800	2,165.00	21,217,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,041.00	8,164,000
サーバーワークス	1,700	4,275.00	7,267,500
東名	1,800	1,302.00	2,343,600
ヴィッツ	1,700	1,666.00	2,832,200
トビラシステムズ	3,600	1,183.00	4,258,800
S a n s a n	15,300	12,340.00	188,802,000
L i n k - U	3,200	1,280.00	4,096,000
ギフティ	15,000	4,100.00	61,500,000
ベース	3,000	4,690.00	14,070,000

フォーカスシステムズ	11,800	997.00	11,764,600
クレスコ	11,400	2,037.00	23,221,800
フジ・メディア・ホールディングス	178,700	1,201.00	214,618,700
オービック	54,300	22,110.00	1,200,573,000
ジャストシステム	24,500	5,970.00	146,265,000
TDCソフト	15,200	1,317.00	20,018,400
Zホールディングス	2,365,500	701.30	1,658,925,150
トレンドマイクロ	92,000	6,370.00	586,040,000
IDホールディングス	10,100	936.00	9,453,600
日本オラクル	34,900	10,560.00	368,544,000
アルファシステムズ	4,600	4,310.00	19,826,000
フューチャー	18,200	2,858.00	52,015,600
CAC Holdings	10,200	1,641.00	16,738,200
SBテクノロジー	6,300	2,923.00	18,414,900
トーセ	4,900	778.00	3,812,200
オービックビジネスコンサルタント	16,500	5,890.00	97,185,000
伊藤忠テクノソリューションズ	78,500	3,635.00	285,347,500
アイティフォー	22,700	881.00	19,998,700
東計電算	2,100	4,740.00	9,954,000
エクスネット	2,900	1,023.00	2,966,700
大塚商会	93,200	5,760.00	536,832,000
サイボウズ	23,100	2,514.00	58,073,400
電通国際情報サービス	24,900	4,040.00	100,596,000
ACCESS	21,700	918.00	19,920,600
デジタルガレージ	28,500	5,070.00	144,495,000
EMシステムズ	28,700	771.00	22,127,700
ウェザーニューズ	5,200	8,340.00	43,368,000
CIJ	11,400	852.00	9,712,800
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,490.00	6,282,000
日本エンタープライズ	18,500	203.00	3,755,500
WOWOW	8,300	2,394.00	19,870,200
スカラ	15,600	722.00	11,263,200
インテリジェント ウェイブ	10,400	620.00	6,448,000
IMAGICA GROUP	15,000	490.00	7,350,000
ネットワンシステムズ	70,300	3,875.00	272,412,500
システムソフト	38,100	147.00	5,600,700
アルゴグラフィックス	13,500	3,215.00	43,402,500
マーベラス	27,400	730.00	20,002,000
エイベックス	29,800	1,596.00	47,560,800
日本ユニシス	59,800	3,180.00	190,164,000
兼松エレクトロニクス	9,400	3,705.00	34,827,000
都築電気	7,800	1,762.00	13,743,600

TBSホールディングス	114,300	1,828.00	208,940,400
日本テレビホールディングス	143,900	1,271.00	182,896,900
朝日放送グループホールディングス	17,400	731.00	12,719,400
テレビ朝日ホールディングス	53,300	1,793.00	95,566,900
スカパーJ S A Tホールディングス	113,800	442.00	50,299,600
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,219.00	27,515,600
日本BS放送	6,000	1,103.00	6,618,000
ビジョン	29,500	1,497.00	44,161,500
スマートバリュー	4,800	637.00	3,057,600
USEN-NEXT HOLDINGS	16,400	2,920.00	47,888,000
ワイヤレスゲート	7,600	387.00	2,941,200
コネクシオ	9,900	1,581.00	15,651,900
クロップス	3,400	974.00	3,311,600
日本電信電話	2,013,500	3,138.00	6,318,363,000
KDDI	1,380,500	3,668.00	5,063,674,000
ソフトバンク	1,564,500	1,533.50	2,399,160,750
光通信	20,300	17,930.00	363,979,000
エムティーアイ	17,000	720.00	12,240,000
GMOインターネット	61,000	3,105.00	189,405,000
ファイバーゲート	5,700	1,386.00	7,900,200
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	370.00	1,850,000
KADOKAWA	44,600	6,010.00	268,046,000
学研ホールディングス	24,500	1,166.00	28,567,000
ゼンリン	31,400	1,052.00	33,032,800
昭文社ホールディングス	7,300	499.00	3,642,700
インプレスホールディングス	14,200	269.00	3,819,800
アイネット	9,000	1,301.00	11,709,000
松竹	11,400	13,000.00	148,200,000
東宝	101,600	5,480.00	556,768,000
東映	5,600	22,450.00	125,720,000
エヌ・ティ・ティ・データ	458,400	2,239.00	1,026,357,600
ピー・シー・エー	7,700	1,978.00	15,230,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,798.00	10,788,000
DTS	35,800	2,560.00	91,648,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,400	5,930.00	435,262,000
シーイーシー	18,600	1,365.00	25,389,000
カブコン	147,600	3,250.00	479,700,000
アイ・エス・ビー	8,200	1,262.00	10,348,400
ジャステック	10,100	1,297.00	13,099,700
SCSK	119,200	2,349.00	280,000,800
日本システムウエア	5,800	2,485.00	14,413,000
アイネス	17,100	1,628.00	27,838,800

T K C	29,200	3,440.00	100,448,000
富士ソフト	18,400	5,850.00	107,640,000
N S D	55,400	2,001.00	110,855,400
コナミホールディングス	62,600	6,650.00	416,290,000
福井コンピュータホールディングス	7,900	4,190.00	33,101,000
J B C Cホールディングス	11,700	1,620.00	18,954,000
ミロク情報サービス	17,200	1,749.00	30,082,800
ソフトバンクグループ	1,366,000	6,712.00	9,168,592,000
ハウスイ	1,400	923.00	1,292,200
高千穂交易	6,700	1,202.00	8,053,400
オルパヘルスケアホールディングス	2,800	1,562.00	4,373,600
伊藤忠食品	4,200	5,080.00	21,336,000
エレマテック	13,900	1,137.00	15,804,300
J A L U X	4,900	1,710.00	8,379,000
あらた	13,800	4,000.00	55,200,000
トーメンデバイス	2,200	5,300.00	11,660,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	7,400.00	42,180,000
フィールズ	15,100	512.00	7,731,200
双日	190,800	1,934.00	369,007,200
アルフレッサ ホールディングス	179,200	1,655.00	296,576,000
横浜冷凍	48,500	878.00	42,583,000
ラサ商事	9,200	951.00	8,749,200
アルコニックス	18,400	1,734.00	31,905,600
神戸物産	134,100	3,890.00	521,649,000
ハイパー	4,400	551.00	2,424,400
あい ホールディングス	24,700	2,168.00	53,549,600
ディーブイエックス	5,300	1,129.00	5,983,700
ダイワボウホールディングス	78,700	1,993.00	156,849,100
マクニカ・富士エレホールディングス	41,200	2,563.00	105,595,600
ラクト・ジャパン	5,900	2,793.00	16,478,700
グリムス	5,100	2,729.00	13,917,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,100	775.00	23,327,500
八洲電機	13,400	966.00	12,944,400
メディアスホールディングス	9,800	897.00	8,790,600
レスターホールディングス	18,000	1,897.00	34,146,000
ジュテックホールディングス	4,000	1,105.00	4,420,000
大光	6,700	704.00	4,716,800
O C H Iホールディングス	5,000	1,264.00	6,320,000
T O K A Iホールディングス	83,700	885.00	74,074,500
黒谷	4,700	730.00	3,431,000
C o m i n i x	3,100	726.00	2,250,600
三洋貿易	17,400	1,132.00	19,696,800



ビューティガレージ	2,800	3,960.00	11,088,000
ウイン・パートナーズ	12,500	968.00	12,100,000
ミタチ産業	4,800	1,002.00	4,809,600
シップヘルスケアホールディングス	60,900	2,959.00	180,203,100
明治電機工業	5,900	1,327.00	7,829,300
デリカフーズホールディングス	6,800	620.00	4,216,000
スターティアホールディングス	3,400	1,489.00	5,062,600
コメダホールディングス	37,700	2,090.00	78,793,000
ピーバンドットコム	2,400	681.00	1,634,400
アセンテック	4,500	1,349.00	6,070,500
富士興産	5,300	1,041.00	5,517,300
協栄産業	1,900	1,404.00	2,667,600
フルサト・マルカホールディングス	16,500	2,010.00	33,165,000
ヤマエグループホールディングス	12,600	1,072.00	13,507,200
小野建	15,600	1,672.00	26,083,200
南陽	3,500	2,069.00	7,241,500
佐島電機	10,800	956.00	10,324,800
エコートレーディング	3,700	631.00	2,334,700
伯東	10,500	1,897.00	19,918,500
コンドーテック	13,300	980.00	13,034,000
中山福	10,000	410.00	4,100,000
ナガイレーベン	22,900	2,352.00	53,860,800
三菱食品	19,000	2,949.00	56,031,000
松田産業	12,600	3,520.00	44,352,000
第一興商	32,800	4,090.00	134,152,000
メディバルホールディングス	173,200	2,136.00	369,955,200
S P K	7,400	1,378.00	10,197,200
萩原電気ホールディングス	6,400	2,219.00	14,201,600
アズワン	12,400	15,840.00	196,416,000
スズデン	6,000	1,649.00	9,894,000
尾家産業	5,100	1,099.00	5,604,900
シモジマ	10,600	1,144.00	12,126,400
ドウシシャ	16,300	1,733.00	28,247,900
小津産業	3,800	1,921.00	7,299,800
高速	9,200	1,572.00	14,462,400
たけびし	6,500	1,460.00	9,490,000
リックス	3,900	1,488.00	5,803,200
丸文	15,300	784.00	11,995,200
ハピネット	14,400	1,499.00	21,585,600
橋本総業ホールディングス	3,500	2,197.00	7,689,500
日本ライフライン	55,900	1,315.00	73,508,500
タカショー	13,200	823.00	10,863,600

I D O M	58,300	806.00	46,989,800
進和	10,200	2,227.00	22,715,400
エスケイジャパン	4,200	475.00	1,995,000
ダイترون	7,300	2,228.00	16,264,400
シークス	24,700	1,266.00	31,270,200
田中商事	5,400	667.00	3,601,800
オーハシテクニカ	8,900	1,538.00	13,688,200
白銅	6,200	3,060.00	18,972,000
ダイコー通産	2,100	1,159.00	2,433,900
伊藤忠商事	1,208,500	3,330.00	4,024,305,000
丸紅	1,703,800	959.30	1,634,455,340
高島	2,700	1,903.00	5,138,100
長瀬産業	94,900	1,922.00	182,397,800
蝶理	11,000	1,862.00	20,482,000
豊田通商	173,600	5,050.00	876,680,000
三共生興	26,200	581.00	15,222,200
兼松	69,000	1,342.00	92,598,000
ツカモトコーポレーション	2,900	1,335.00	3,871,500
三井物産	1,341,600	2,591.00	3,476,085,600
日本紙パルプ商事	9,000	3,785.00	34,065,000
カメイ	22,600	1,170.00	26,442,000
東都水産	2,000	6,030.00	12,060,000
O U Gホールディングス	2,700	2,716.00	7,333,200
スターゼン	12,800	2,189.00	28,019,200
山善	67,500	1,066.00	71,955,000
椿本興業	3,200	3,855.00	12,336,000
住友商事	1,090,400	1,612.00	1,757,724,800
内田洋行	7,400	5,020.00	37,148,000
三菱商事	1,051,900	3,609.00	3,796,307,100
第一実業	7,900	5,160.00	40,764,000
キャノンマーケティングジャパン	42,900	2,535.00	108,751,500
西華産業	9,100	1,674.00	15,233,400
佐藤商事	14,300	1,194.00	17,074,200
菱洋エレクトロ	13,200	2,371.00	31,297,200
東京産業	15,700	699.00	10,974,300
ユアサ商事	17,700	3,030.00	53,631,000
神鋼商事	3,900	3,335.00	13,006,500
トルク	9,300	230.00	2,139,000
阪和興業	34,600	3,275.00	113,315,000
正栄食品工業	11,200	4,140.00	46,368,000
カナデン	14,100	1,035.00	14,593,500
菱電商事	12,500	1,743.00	21,787,500

岩谷産業	41,500	6,780.00	281,370,000
ナイス	6,800	1,755.00	11,934,000
ニチモウ	2,700	1,976.00	5,335,200
極東貿易	5,000	2,580.00	12,900,000
アステナホールディングス	24,400	564.00	13,761,600
三愛石油	42,600	1,487.00	63,346,200
稲畑産業	41,500	1,710.00	70,965,000
G S I クレオス	8,500	1,011.00	8,593,500
明和産業	16,000	849.00	13,584,000
クワザワホールディングス	6,200	653.00	4,048,600
ワキタ	34,000	1,042.00	35,428,000
東邦ホールディングス	55,400	1,849.00	102,434,600
サンゲツ	46,100	1,592.00	73,391,200
ミツウロコグループホールディングス	25,500	1,414.00	36,057,000
シナネンホールディングス	6,400	3,490.00	22,336,000
伊藤忠エネクス	38,200	1,027.00	39,231,400
サンリオ	48,500	2,712.00	131,532,000
サンワテクノス	11,400	1,492.00	17,008,800
リョーサン	19,100	2,303.00	43,987,300
新光商事	23,300	898.00	20,923,400
トーヨー	7,800	1,540.00	12,012,000
三信電気	9,300	1,659.00	15,428,700
東陽テクニカ	17,100	1,126.00	19,254,600
モスフードサービス	24,400	3,150.00	76,860,000
加賀電子	15,600	3,035.00	47,346,000
ソーダニッカ	16,500	630.00	10,395,000
立花エレテック	12,800	1,551.00	19,852,800
フォーバル	6,100	1,164.00	7,100,400
P A L T A C	27,700	5,140.00	142,378,000
三谷産業	22,800	371.00	8,458,800
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	3,880.00	15,132,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,004.00	3,206,400
コア商事ホールディングス	13,000	697.00	9,061,000
国際紙パルプ商事	36,900	368.00	13,579,200
ヤマタネ	7,400	1,616.00	11,958,400
丸紅建材リース	1,700	1,838.00	3,124,600
日鉄物産	12,300	5,090.00	62,607,000
泉州電業	4,900	4,790.00	23,471,000
トラスコ中山	36,000	2,784.00	100,224,000
オートバックスセブン	62,600	1,535.00	96,091,000
モリト	12,600	695.00	8,757,000
加藤産業	24,900	3,245.00	80,800,500

北恵	4,400	1,018.00	4,479,200
イノテック	9,700	1,403.00	13,609,100
イエローハット	32,700	1,928.00	63,045,600
J Kホールディングス	15,700	836.00	13,125,200
日伝	14,300	2,300.00	32,890,000
北沢産業	11,800	252.00	2,973,600
杉本商事	8,700	2,439.00	21,219,300
因幡電機産業	46,100	2,721.00	125,438,100
東テク	5,700	2,630.00	14,991,000
ミスミグループ本社	216,800	4,840.00	1,049,312,000
アルテック	11,700	316.00	3,697,200
タキヒヨー	5,700	1,790.00	10,203,000
蔵王産業	3,400	1,762.00	5,990,800
スズケン	73,200	3,290.00	240,828,000
ジェコス	12,000	878.00	10,536,000
グローセル	18,800	408.00	7,670,400
ローソン	43,700	5,350.00	233,795,000
サンエー	13,200	4,120.00	54,384,000
カワチ薬品	12,200	2,246.00	27,401,200
エービーシー・マート	27,000	5,630.00	152,010,000
ハードオフコーポレーション	8,100	784.00	6,350,400
アスクル	28,200	1,651.00	46,558,200
ゲオホールディングス	23,400	1,202.00	28,126,800
アダストリア	24,100	1,947.00	46,922,700
くら寿司	18,200	3,650.00	66,430,000
キャンドゥ	8,400	2,536.00	21,302,400
アイケイ	5,700	554.00	3,157,800
パルグループホールディングス	15,400	1,610.00	24,794,000
エディオン	73,600	1,083.00	79,708,800
サーラコーポレーション	35,700	616.00	21,991,200
ワッツ	8,900	765.00	6,808,500
ハローズ	7,100	2,781.00	19,745,100
フジオフードグループ本社	14,600	1,384.00	20,206,400
あみやき亭	3,900	3,035.00	11,836,500
大黒天物産	5,600	6,380.00	35,728,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,056.00	14,889,600
ファーマライズホールディングス	4,700	814.00	3,825,800
アルペン	13,400	2,906.00	38,940,400
ハブ	6,100	766.00	4,672,600
クオールホールディングス	23,600	1,659.00	39,152,400
ジーンズホールディングス	11,800	7,310.00	86,258,000
ビックカメラ	102,900	1,006.00	103,517,400

D C Mホールディングス	107,000	1,152.00	123,264,000
M o n o t a R O	218,600	2,623.00	573,387,800
東京一番フーズ	5,100	589.00	3,003,900
きちりホールディングス	4,600	661.00	3,040,600
アークランドサービスホールディングス	12,800	2,284.00	29,235,200
J . フロント リテイリング	206,700	1,072.00	221,582,400
ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,731.00	47,775,600
マツキヨココカラ&カンパニー	97,600	5,160.00	503,616,000
ブロンコピリー	10,000	2,471.00	24,710,000
Z O Z O	101,900	4,240.00	432,056,000
トレジャー・ファクトリー	5,500	897.00	4,933,500
物語コーポレーション	9,300	7,460.00	69,378,000
三越伊勢丹ホールディングス	302,900	838.00	253,830,200
H a m e e	4,700	1,394.00	6,551,800
マーケットエンタープライズ	1,600	712.00	1,139,200
ウエルシアホールディングス	91,400	4,215.00	385,251,000
クリエイトSDホールディングス	25,600	3,620.00	92,672,000
丸善C H Iホールディングス	20,200	378.00	7,635,600
ミサワ	4,100	669.00	2,742,900
ティーライフ	2,600	1,442.00	3,749,200
チムニー	5,300	1,478.00	7,833,400
シュッピン	12,100	1,323.00	16,008,300
オイシックス・ラ・大地	22,900	5,060.00	115,874,000
ネクステージ	35,100	2,133.00	74,868,300
ジョイフル本田	50,900	1,596.00	81,236,400
鳥貴族ホールディングス	6,500	2,025.00	13,162,500
ホットランド	13,200	1,375.00	18,150,000
すかいらーくホールディングス	223,300	1,573.00	351,250,900
S F Pホールディングス	8,400	1,573.00	13,213,200
綿半ホールディングス	13,300	1,232.00	16,385,600
ヨシックスホールディングス	3,600	2,249.00	8,096,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,600	1,064.00	53,838,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,299.00	12,080,700
B E E N O S	8,800	3,265.00	28,732,000
あさひ	13,200	1,325.00	17,490,000
日本調剤	10,700	1,662.00	17,783,400
コスモス薬品	17,500	17,960.00	314,300,000
トーエル	8,800	854.00	7,515,200
セブン&アイ・ホールディングス	676,000	4,765.00	3,221,140,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	92,900	1,060.00	98,474,000
ツルハホールディングス	37,700	13,850.00	522,145,000

サンマルクホールディングス	13,900	1,571.00	21,836,900
フェリシモ	4,100	1,406.00	5,764,600
トリドールホールディングス	43,000	2,797.00	120,271,000
TOKYO BASE	16,400	740.00	12,136,000
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,000.00	3,100,000
JMホールディングス	11,800	1,902.00	22,443,600
サツドラホールディングス	2,800	2,243.00	6,280,400
アレンザホールディングス	13,500	1,206.00	16,281,000
串カツ田中ホールディングス	4,800	2,325.00	11,160,000
パロックジャパンリミテッド	12,400	851.00	10,552,400
クスリのアオキホールディングス	17,200	7,550.00	129,860,000
力の源ホールディングス	7,900	625.00	4,937,500
FOOD & LIFE COMPANIES	101,200	4,915.00	497,398,000
メディカルシステムネットワーク	15,600	717.00	11,185,200
はるやまホールディングス	8,800	575.00	5,060,000
ノジマ	30,900	2,824.00	87,261,600
カップ・クリエイト	24,200	1,368.00	33,105,600
ライトオン	12,900	692.00	8,926,800
良品計画	199,000	2,321.00	461,879,000
三城ホールディングス	22,900	260.00	5,954,000
アドヴァングループ	18,000	966.00	17,388,000
アルビス	5,700	2,364.00	13,474,800
コナカ	20,400	335.00	6,834,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,655.00	3,972,000
G-7ホールディングス	17,000	2,172.00	36,924,000
イオン北海道	23,000	1,200.00	27,600,000
コジマ	30,400	580.00	17,632,000
ヒマラヤ	6,400	1,070.00	6,848,000
コーナン商事	24,700	3,655.00	90,278,500
エコス	6,600	1,911.00	12,612,600
ワタミ	22,700	1,018.00	23,108,600
マルシェ	4,500	479.00	2,155,500
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	345,500	2,501.00	864,095,500
西松屋チェーン	38,200	1,448.00	55,313,600
ゼンショーホールディングス	92,900	2,663.00	247,392,700
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,496.00	16,456,000
ハークスレイ	8,000	474.00	3,792,000
サイゼリヤ	25,800	3,115.00	80,367,000
VTホールディングス	65,800	518.00	34,084,400
魚力	5,600	2,027.00	11,351,200
フジ・コーポレーション	9,500	1,227.00	11,656,500

ユナイテッドアローズ	19,900	2,157.00	42,924,300
ハイデイ日高	25,200	1,639.00	41,302,800
YU-WA Creation Holdings	12,600	245.00	3,087,000
コロワイド	65,000	1,691.00	109,915,000
ピーシーデポコーポレーション	21,000	453.00	9,513,000
壱番屋	12,300	4,595.00	56,518,500
PLANT	4,900	769.00	3,768,100
スギホールディングス	34,500	8,340.00	287,730,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,399.00	18,472,300
スクロール	25,200	875.00	22,050,000
ヨンドシーホールディングス	16,100	1,737.00	27,965,700
木曽路	22,800	2,171.00	49,498,800
SRSホールディングス	23,700	756.00	17,917,200
リテールパートナーズ	21,300	1,182.00	25,176,600
ケーヨー	32,200	821.00	26,436,200
上新電機	20,000	2,443.00	48,860,000
日本瓦斯	84,300	1,440.00	121,392,000
ロイヤルホールディングス	29,700	2,163.00	64,241,100
いなげや	19,400	1,365.00	26,481,000
チヨダ	17,300	773.00	13,372,900
ライフコーポレーション	16,200	3,860.00	62,532,000
リンガーハット	21,300	2,214.00	47,158,200
MrMaxHD	24,400	634.00	15,469,600
AOKIホールディングス	34,000	698.00	23,732,000
オークワ	27,300	1,117.00	30,494,100
コメリ	26,800	2,731.00	73,190,800
青山商事	38,900	819.00	31,859,100
しまむら	20,100	9,670.00	194,367,000
はせがわ	10,700	272.00	2,910,400
高島屋	126,000	1,128.00	142,128,000
松屋	37,900	1,083.00	41,045,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,000	919.00	75,358,000
近鉄百貨店	6,800	2,562.00	17,421,600
丸井グループ	146,300	2,260.00	330,638,000
アクシアル リテイリング	14,400	3,600.00	51,840,000
イオン	664,900	2,629.50	1,748,354,550
イズミ	35,200	3,665.00	129,008,000
平和堂	32,000	1,985.00	63,520,000
フジ	21,000	2,062.00	43,302,000
ヤオコー	19,600	6,650.00	130,340,000
ゼビオホールディングス	21,300	1,104.00	23,515,200
ケースホールディングス	147,400	1,200.00	176,880,000

Olympicグループ	9,500	725.00	6,887,500
日産東京販売ホールディングス	27,100	247.00	6,693,700
シルバーライフ	3,800	1,491.00	5,665,800
Genky DrugStores	7,700	5,270.00	40,579,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	1,069.00	3,955,300
ブックオフグループホールディングス	10,100	980.00	9,898,000
ギフト	2,900	2,870.00	8,323,000
アインホールディングス	25,100	6,890.00	172,939,000
元気寿司	5,000	2,788.00	13,940,000
ヤマダホールディングス	580,000	462.00	267,960,000
アークランドサカモト	27,300	1,719.00	46,928,700
ニトリホールディングス	68,600	20,655.00	1,416,933,000
グルメ杵屋	12,700	1,000.00	12,700,000
愛眼	13,800	219.00	3,022,200
ケーユーホールディングス	9,400	1,062.00	9,982,800
吉野家ホールディングス	56,900	2,219.00	126,261,100
松屋フーズホールディングス	8,400	3,700.00	31,080,000
サガミホールディングス	26,800	1,010.00	27,068,000
関西スーパーマーケット	13,200	1,983.00	26,175,600
王将フードサービス	11,500	5,970.00	68,655,000
プレナス	19,500	1,990.00	38,805,000
ミニストップ	12,900	1,391.00	17,943,900
アークス	33,200	2,216.00	73,571,200
パローホールディングス	35,500	2,432.00	86,336,000
ベルク	8,600	5,540.00	47,644,000
大庄	9,600	1,038.00	9,964,800
ファーストリテイリング	23,100	75,500.00	1,744,050,000
サンドラッグ	65,100	3,510.00	228,501,000
サックスパーホールディングス	15,400	561.00	8,639,400
ヤマザワ	4,300	1,696.00	7,292,800
やまや	3,500	2,424.00	8,484,000
ベルーナ	37,600	819.00	30,794,400
島根銀行	6,000	587.00	3,522,000
じもとホールディングス	11,700	656.00	7,675,200
めぶきフィナンシャルグループ	899,000	240.00	215,760,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	1,498.00	32,506,600
九州フィナンシャルグループ	353,300	399.00	140,966,700
ゆうちょ銀行	490,200	934.00	457,846,800
富山第一銀行	41,200	293.00	12,071,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,054,100	474.00	499,643,400
西日本フィナンシャルホールディングス	113,000	706.00	79,778,000
三十三フィナンシャルグループ	15,000	1,410.00	21,150,000



第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,586.00	72,925,200
ひろぎんホールディングス	255,200	643.00	164,093,600
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,517.00	39,265,200
十六フィナンシャルグループ	21,700	2,089.00	45,331,300
北國フィナンシャルホールディングス	16,100	2,039.00	32,827,900
新生銀行	141,100	1,896.00	267,525,600
あおぞら銀行	103,100	2,718.00	280,225,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,835,700	664.00	7,858,904,800
りそなホールディングス	1,926,800	442.80	853,187,040
三井住友トラスト・ホールディングス	327,000	3,915.00	1,280,205,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,197,400	3,915.00	4,687,821,000
千葉銀行	577,400	741.00	427,853,400
群馬銀行	356,100	365.00	129,976,500
武蔵野銀行	25,800	1,782.00	45,975,600
千葉興業銀行	44,100	273.00	12,039,300
筑波銀行	71,900	174.00	12,510,600
七十七銀行	54,300	1,242.00	67,440,600
青森銀行	13,400	2,075.00	27,805,000
秋田銀行	10,300	1,448.00	14,914,400
山形銀行	19,400	840.00	16,296,000
岩手銀行	11,300	1,657.00	18,724,100
東邦銀行	154,700	208.00	32,177,600
東北銀行	8,300	1,005.00	8,341,500
みちのく銀行	11,100	879.00	9,756,900
ふくおかフィナンシャルグループ	156,200	2,133.00	333,174,600
静岡銀行	421,400	950.00	400,330,000
スルガ銀行	151,700	413.00	62,652,100
八十二銀行	389,700	395.00	153,931,500
山梨中央銀行	20,100	840.00	16,884,000
大垣共立銀行	34,200	1,943.00	66,450,600
福井銀行	14,800	1,455.00	21,534,000
清水銀行	7,100	1,583.00	11,239,300
富山銀行	3,300	2,093.00	6,906,900
滋賀銀行	34,700	1,895.00	65,756,500
南都銀行	25,200	1,975.00	49,770,000
百五銀行	155,700	327.00	50,913,900
京都銀行	62,000	5,270.00	326,740,000
紀陽銀行	61,300	1,541.00	94,463,300
ほくほくフィナンシャルグループ	115,200	850.00	97,920,000
山陰合同銀行	109,000	558.00	60,822,000
中国銀行	148,900	848.00	126,267,200
鳥取銀行	5,500	1,125.00	6,187,500

伊予銀行	229,200	576.00	132,019,200
百十四銀行	18,400	1,500.00	27,600,000
四国銀行	24,500	753.00	18,448,500
阿波銀行	26,500	2,170.00	57,505,000
大分銀行	10,000	1,870.00	18,700,000
宮崎銀行	10,800	2,075.00	22,410,000
佐賀銀行	9,800	1,463.00	14,337,400
琉球銀行	37,600	787.00	29,591,200
セブン銀行	578,100	247.00	142,790,700
みずほフィナンシャルグループ	2,351,100	1,565.00	3,679,471,500
高知銀行	6,300	780.00	4,914,000
山口フィナンシャルグループ	216,000	667.00	144,072,000
長野銀行	5,700	1,120.00	6,384,000
名古屋銀行	13,900	2,534.00	35,222,600
北洋銀行	260,800	246.00	64,156,800
愛知銀行	5,800	3,560.00	20,648,000
中京銀行	6,200	1,383.00	8,574,600
大光銀行	5,900	1,341.00	7,911,900
愛媛銀行	24,200	781.00	18,900,200
トマト銀行	6,700	1,062.00	7,115,400
京葉銀行	73,800	441.00	32,545,800
栃木銀行	83,600	180.00	15,048,000
北日本銀行	5,400	1,565.00	8,451,000
東和銀行	30,400	518.00	15,747,200
福島銀行	19,800	245.00	4,851,000
大東銀行	8,300	695.00	5,768,500
トモニホールディングス	133,800	318.00	42,548,400
フィデアホールディングス	16,700	1,222.00	20,407,400
池田泉州ホールディングス	199,000	165.00	32,835,000
F P G	58,500	707.00	41,359,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,306.00	17,761,600
マーキュリアホールディングス	6,100	737.00	4,495,700
S B I ホールディングス	213,400	3,035.00	647,669,000
ジャフコ グループ	22,100	7,500.00	165,750,000
大和証券グループ本社	1,296,100	677.60	878,237,360
野村ホールディングス	2,642,100	570.30	1,506,789,630
岡三証券グループ	148,000	397.00	58,756,000
丸三証券	51,800	618.00	32,012,400
東洋証券	58,500	171.00	10,003,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,100	402.00	74,410,200
光世証券	4,500	577.00	2,596,500
水戸証券	47,000	299.00	14,053,000

いちよし証券	35,000	684.00	23,940,000
松井証券	85,000	834.00	70,890,000
マネックスグループ	155,500	780.00	121,290,000
極東証券	23,500	797.00	18,729,500
岩井コスモホールディングス	17,900	1,408.00	25,203,200
アイザワ証券グループ	31,300	1,093.00	34,210,900
マネーパートナーズグループ	19,500	248.00	4,836,000
スパークス・グループ	80,700	293.00	23,645,100
かんぽ生命保険	214,500	1,912.00	410,124,000
S O M P Oホールディングス	305,000	4,970.00	1,515,850,000
アニコム ホールディングス	48,700	939.00	45,729,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	420,200	3,725.00	1,565,245,000
第一生命ホールディングス	851,500	2,459.50	2,094,264,250
東京海上ホールディングス	569,800	6,111.00	3,482,047,800
T & Dホールディングス	517,100	1,537.00	794,782,700
アドバンスクリエイト	8,300	1,062.00	8,814,600
全国保証	45,100	5,500.00	248,050,000
あんしん保証	7,400	314.00	2,323,600
イントラスト	5,500	808.00	4,444,000
日本モーゲージサービス	9,300	1,059.00	9,848,700
C a s a	5,300	936.00	4,960,800
アルヒ	25,900	1,326.00	34,343,400
プレミアグループ	8,100	3,215.00	26,041,500
クレディセゾン	101,300	1,470.00	148,911,000
芙蓉総合リース	18,200	7,610.00	138,502,000
みずほリース	26,800	3,545.00	95,006,000
東京センチュリー	40,300	6,530.00	263,159,000
日本証券金融	73,800	871.00	64,279,800
アイフル	291,600	386.00	112,557,600
リコーリース	13,700	3,600.00	49,320,000
イオンフィナンシャルサービス	106,200	1,483.00	157,494,600
アコム	342,500	390.00	133,575,000
ジャックス	19,300	3,010.00	58,093,000
オリエントコーポレーション	471,100	161.00	75,847,100
オリックス	1,050,600	2,191.50	2,302,389,900
三菱H C キャピタル	599,200	586.00	351,131,200
九州リースサービス	9,300	608.00	5,654,400
日本取引所グループ	467,600	2,861.50	1,338,037,400
イー・ギャランティ	20,500	2,560.00	52,480,000
アサックス	9,700	706.00	6,848,200
N E C キャピタルソリューション	7,300	2,070.00	15,111,000
いちご	198,700	336.00	66,763,200

日本駐車場開発	204,700	151.00	30,909,700
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	1,418.00	15,598,000
S R Eホールディングス	2,800	8,040.00	22,512,000
A Dワークスグループ	34,200	162.00	5,540,400
ヒューリック	415,100	1,128.00	468,232,800
三栄建築設計	8,000	1,857.00	14,856,000
野村不動産ホールディングス	100,100	2,954.00	295,695,400
三重交通グループホールディングス	39,100	532.00	20,801,200
サムティ	25,600	2,358.00	60,364,800
ディア・ライフ	26,100	565.00	14,746,500
日本商業開発	12,200	1,760.00	21,472,000
プレサンスコーポレーション	29,600	1,872.00	55,411,200
ハウスコム	4,700	1,290.00	6,063,000
日本管理センター	10,100	1,178.00	11,897,800
サンセイランディック	7,700	837.00	6,444,900
フージャースホールディングス	28,200	697.00	19,655,400
オープンハウス	55,300	7,090.00	392,077,000
東急不動産ホールディングス	473,700	675.00	319,747,500
飯田グループホールディングス	145,100	2,799.00	406,134,900
イーランド	4,200	1,584.00	6,652,800
ムゲンエステート	15,200	498.00	7,569,600
ハウズドゥ	8,500	981.00	8,338,500
シーアールイー	5,600	1,835.00	10,276,000
グッドコムアセット	9,000	1,435.00	12,915,000
ジェイ・エス・ビー	4,300	2,974.00	12,788,200
テンポイノベーション	7,100	966.00	6,858,600
フェイスネットワーク	3,200	1,273.00	4,073,600
パーク24	94,100	1,808.00	170,132,800
パラカ	5,800	1,651.00	9,575,800
三井不動産	789,400	2,635.00	2,080,069,000
三菱地所	1,137,900	1,771.50	2,015,789,850
平和不動産	30,200	3,615.00	109,173,000
東京建物	172,200	1,708.00	294,117,600
ダイビル	45,300	1,554.00	70,396,200
京阪神ビルディング	31,400	1,414.00	44,399,600
住友不動産	389,500	4,154.00	1,617,983,000
テーオーシー	34,600	650.00	22,490,000
東京楽天地	3,400	4,000.00	13,600,000
スターツコーポレーション	21,400	2,810.00	60,134,000
フジ住宅	23,300	684.00	15,937,200
空港施設	21,200	559.00	11,850,800
明和地所	11,700	618.00	7,230,600

ゴールドクレスト	16,900	1,682.00	28,425,800
エスリード	8,100	1,662.00	13,462,200
日神グループホールディングス	29,800	509.00	15,168,200
日本エスコン	32,200	809.00	26,049,800
タカラレーベン	72,500	313.00	22,692,500
A V A N T I A	11,400	875.00	9,975,000
イオンモール	88,000	1,732.00	152,416,000
毎日コムネット	8,700	760.00	6,612,000
ファースト住建	8,100	1,301.00	10,538,100
カチタス	43,400	4,170.00	180,978,000
トーセイ	25,800	1,169.00	30,160,200
穴吹興産	4,900	2,039.00	9,991,100
サンフロンティア不動産	23,300	1,091.00	25,420,300
F Jネクストホールディングス	19,200	1,016.00	19,507,200
インテリックス	3,900	740.00	2,886,000
ランドビジネス	7,300	269.00	1,963,700
サンネクスタグループ	7,600	1,019.00	7,744,400
グランディハウス	16,300	493.00	8,035,900
日本空港ビルデング	60,500	5,570.00	336,985,000
明豊ファシリティワークス	8,000	932.00	7,456,000
日本工営	9,900	3,470.00	34,353,000
L I F U L L	52,100	373.00	19,433,300
ミクシィ	42,700	2,635.00	112,514,500
ジェイエシーリクルートメント	13,700	2,254.00	30,879,800
日本M & Aセンターホールディングス	275,100	3,395.00	933,964,500
メンバーズ	5,100	3,240.00	16,524,000
中広	3,200	367.00	1,174,400
UTグループ	24,300	3,570.00	86,751,000
アイティメディア	5,800	2,329.00	13,508,200
E・Jホールディングス	9,000	1,212.00	10,908,000
夢真ビーネックスグループ	44,800	1,385.00	62,048,000
コシダカホールディングス	45,300	712.00	32,253,600
アルトナー	4,400	870.00	3,828,000
パソナグループ	18,300	3,100.00	56,730,000
C D S	4,400	1,554.00	6,837,600
リンクアンドモチベーション	36,900	1,122.00	41,401,800
エス・エム・エス	57,000	4,320.00	246,240,000
サニーサイドアップグループ	6,200	779.00	4,829,800
パーソルホールディングス	167,700	2,960.00	496,392,000
リニカル	9,900	755.00	7,474,500
クックパッド	54,100	237.00	12,821,700
アイ・ケイ・ケイ	8,700	690.00	6,003,000

学情	7,100	1,200.00	8,520,000
スタジオアリス	8,600	2,160.00	18,576,000
シミックホールディングス	9,500	1,496.00	14,212,000
エプロ	4,000	838.00	3,352,000
N J S	3,900	2,003.00	7,811,700
総合警備保障	66,800	5,010.00	334,668,000
カカクコム	123,900	3,820.00	473,298,000
アイロムグループ	6,000	2,023.00	12,138,000
セントケア・ホールディング	12,600	891.00	11,226,600
サイネックス	3,300	669.00	2,207,700
ルネサンス	10,800	1,201.00	12,970,800
ディップ	26,300	4,215.00	110,854,500
デジタルホールディングス	11,900	1,826.00	21,729,400
新日本科学	20,800	1,157.00	24,065,600
キャリアデザインセンター	4,500	1,114.00	5,013,000
ベネフィット・ワン	61,000	5,490.00	334,890,000
エムスリー	295,800	7,379.00	2,182,708,200
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	339.00	3,627,300
アウトソーシング	96,200	2,043.00	196,536,600
ウェルネット	17,600	509.00	8,958,400
ワールドホールディングス	6,800	2,887.00	19,631,600
ディー・エヌ・エー	71,100	2,185.00	155,353,500
博報堂D Yホールディングス	233,500	1,891.00	441,548,500
ぐるなび	29,800	548.00	16,330,400
タカミヤ	21,000	454.00	9,534,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	1,078.00	12,181,400
ファンコミュニケーションズ	42,700	466.00	19,898,200
ライク	4,600	1,695.00	7,797,000
ビジネス・ブレークスルー	7,800	444.00	3,463,200
エスプール	47,600	1,229.00	58,500,400
W D Bホールディングス	7,700	3,600.00	27,720,000
手間いらず	2,200	5,960.00	13,112,000
ティア	10,500	492.00	5,166,000
C D G	1,800	1,510.00	2,718,000
アドウェイズ	27,700	835.00	23,129,500
バリューコマース	13,200	4,625.00	61,050,000
インフォマート	184,000	1,110.00	204,240,000
J Pホールディングス	49,200	259.00	12,742,800
エコナックホールディングス	34,100	92.00	3,137,200
レッグス	3,700	1,686.00	6,238,200
プレステージ・インターナショナル	63,200	782.00	49,422,400
アミューズ	9,300	2,315.00	21,529,500

ドリームインキュベータ	5,500	833.00	4,581,500
クイック	10,700	1,384.00	14,808,800
T A C	10,500	237.00	2,488,500
電通グループ	172,900	4,275.00	739,147,500
イオンファンタジー	6,600	1,885.00	12,441,000
シーティーエス	19,300	803.00	15,497,900
ネクシィーズグループ	6,200	896.00	5,555,200
H . U . グループホールディングス	47,000	2,861.00	134,467,000
アルプス技研	15,000	2,032.00	30,480,000
ダイオーズ	3,600	1,004.00	3,614,400
日本空調サービス	18,000	811.00	14,598,000
オリエンタルランド	178,300	17,955.00	3,201,376,500
ダスキン	39,000	2,687.00	104,793,000
明光ネットワークジャパン	20,200	615.00	12,423,000
ファルコホールディングス	8,200	1,690.00	13,858,000
ラウンドワン	57,400	1,406.00	80,704,400
リゾートトラスト	77,000	2,045.00	157,465,000
ビー・エム・エル	21,700	4,060.00	88,102,000
りらいあコミュニケーションズ	25,800	1,227.00	31,656,600
リソー教育	85,800	512.00	43,929,600
早稲田アカデミー	7,400	1,030.00	7,622,000
ユー・エス・エス	187,900	1,837.00	345,172,300
東京個別指導学院	15,300	737.00	11,276,100
サイバーエージェント	413,300	2,081.00	860,077,300
楽天グループ	860,700	1,233.00	1,061,243,100
クリーク・アンド・リバー社	9,000	2,034.00	18,306,000
モーニングスター	25,100	528.00	13,252,800
テー・オー・ダブリュー	30,300	337.00	10,211,100
山田コンサルティンググループ	10,100	1,150.00	11,615,000
セントラルスポーツ	6,400	2,461.00	15,750,400
フルキャストホールディングス	14,400	2,614.00	37,641,600
エン・ジャパン	29,900	4,555.00	136,194,500
リソルホールディングス	1,900	4,050.00	7,695,000
テクノプロ・ホールディングス	100,500	3,600.00	361,800,000
アトラグループ	3,700	304.00	1,124,800
インターワークス	5,600	413.00	2,312,800
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	11,430.00	77,724,000
K e e P e r 技研	10,900	3,370.00	36,733,000
ファーストロジック	3,700	801.00	2,963,700
三機サービス	3,600	1,061.00	3,819,600
G u n o s y	11,000	696.00	7,656,000
デザインワン・ジャパン	5,500	233.00	1,281,500

イー・ガーディアン	6,900	3,165.00	21,838,500
リブセンス	10,800	231.00	2,494,800
ジャパンマテリアル	51,800	1,523.00	78,891,400
ベクトル	21,200	1,234.00	26,160,800
ウチヤマホールディングス	9,200	369.00	3,394,800
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,765.00	22,415,500
キャリアリンク	5,700	1,608.00	9,165,600
I B J	14,000	1,106.00	15,484,000
アサンテ	6,300	1,761.00	11,094,300
バリューHR	6,900	1,841.00	12,702,900
M & Aキャピタルパートナーズ	13,900	6,470.00	89,933,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,485.00	9,949,500
E R Iホールディングス	4,900	1,453.00	7,119,700
アビスト	2,700	2,859.00	7,719,300
シグマクシス・ホールディングス	9,300	2,676.00	24,886,800
ウィルグループ	12,600	1,303.00	16,417,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	26,400	215.00	5,676,000
メドピア	13,000	3,660.00	47,580,000
レアジョブ	3,400	1,315.00	4,471,000
リクルートホールディングス	1,200,800	7,232.00	8,684,185,600
エラン	23,400	1,250.00	29,250,000
土木管理総合試験所	8,700	351.00	3,053,700
ネットマーケティング	8,800	541.00	4,760,800
日本郵政	1,268,700	904.30	1,147,285,410
ベルシステム24ホールディングス	28,300	1,600.00	45,280,000
鎌倉新書	17,300	875.00	15,137,500
S M N	4,100	725.00	2,972,500
グローバルキッズCOMPANY	3,500	927.00	3,244,500
エアトリ	10,700	4,175.00	44,672,500
アトラエ	11,800	2,456.00	28,980,800
ストライク	6,400	4,265.00	27,296,000
ソラスト	41,400	1,409.00	58,332,600
セラク	5,500	2,001.00	11,005,500
インソース	16,400	2,305.00	37,802,000
ベイカレント・コンサルティング	11,000	45,100.00	496,100,000
Orchestra Holdings	3,300	4,480.00	14,784,000
アイモバイル	5,000	1,516.00	7,580,000
キャリアインデックス	7,200	994.00	7,156,800
MS - Japan	7,100	1,028.00	7,298,800
船場	3,800	781.00	2,967,800
グレイステクノロジー	17,300	1,087.00	18,805,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,500	2,473.00	119,940,500



フルテック	2,600	1,446.00	3,759,600
GameWith	5,600	516.00	2,889,600
ソウルドアウト	4,200	1,544.00	6,484,800
MS&Consulting	3,200	716.00	2,291,200
ウェルビー	6,500	1,575.00	10,237,500
エル・ティー・エス	2,200	3,275.00	7,205,000
ミダックホールディングス	7,400	5,840.00	43,216,000
日総工産	13,600	738.00	10,036,800
キュービーネットホールディングス	7,900	1,861.00	14,701,900
RPAホールディングス	20,800	517.00	10,753,600
スプリックス	5,000	1,227.00	6,135,000
マネジメントソリューションズ	8,300	3,515.00	29,174,500
プロレド・パートナーズ	3,900	1,440.00	5,616,000
テノ・ホールディングス	2,400	890.00	2,136,000
フロンティア・マネジメント	4,700	991.00	4,657,700
ピアラ	3,200	740.00	2,368,000
コプロ・ホールディングス	2,500	1,226.00	3,065,000
ギークス	3,100	1,460.00	4,526,000
カーブスホールディングス	46,400	961.00	44,590,400
フォーラムエンジニアリング	12,000	932.00	11,184,000
ダイレクトマーケティングミックス	9,000	4,475.00	40,275,000
ポピンズホールディングス	4,000	3,295.00	13,180,000
LITALICO	13,600	3,105.00	42,228,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	989.00	8,703,200
リログループ	91,800	2,367.00	217,290,600
東祥	10,600	1,839.00	19,493,400
TREホールディングス	23,400	1,794.00	41,979,600
人・夢・技術グループ	6,800	2,015.00	13,702,000
エイチ・アイ・エス	37,400	2,641.00	98,773,400
ラックランド	4,900	2,875.00	14,087,500
共立メンテナンス	27,900	4,165.00	116,203,500
イチネンホールディングス	17,700	1,288.00	22,797,600
建設技術研究所	10,200	2,727.00	27,815,400
スペース	12,300	947.00	11,648,100
燦ホールディングス	7,500	1,477.00	11,077,500
スバル興業	1,100	8,060.00	8,866,000
東京テアトル	6,500	1,252.00	8,138,000
タナベ経営	6,900	743.00	5,126,700
ナガワ	5,400	12,490.00	67,446,000
東京都競馬	12,600	4,455.00	56,133,000
カナモト	29,700	2,533.00	75,230,100
西尾レントオール	15,600	2,842.00	44,335,200

トランス・コスモス	16,000	3,525.00	56,400,000	
乃村工藝社	72,200	1,115.00	80,503,000	
藤田観光	7,300	2,492.00	18,191,600	
KNT-CTホールディングス	8,900	1,723.00	15,334,700	
日本管財	18,100	2,760.00	49,956,000	
トーカイ	16,300	2,245.00	36,593,500	
セコム	165,200	8,080.00	1,334,816,000	
セントラル警備保障	8,200	2,886.00	23,665,200	
丹青社	32,000	947.00	30,304,000	
メイテック	20,300	6,550.00	132,965,000	
応用地質	19,100	1,689.00	32,259,900	
船井総研ホールディングス	34,400	3,100.00	106,640,000	
進学会ホールディングス	7,400	412.00	3,048,800	
オオバ	12,200	802.00	9,784,400	
いであ	4,700	1,999.00	9,395,300	
学究社	5,000	1,395.00	6,975,000	
ベネッセホールディングス	61,600	2,636.00	162,377,600	
イオンディライト	20,800	3,405.00	70,824,000	
ナック	8,300	977.00	8,109,100	
ダイセキ	33,800	5,380.00	181,844,000	
ステップ	6,300	1,912.00	12,045,600	
合 計	190,421,300		487,846,566,730	

## (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】

## 【i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

## 【純資産額計算書】

（2021年11月30日現在）

資産総額	173,649,945円
負債総額	945,197円
純資産総額（ - ）	172,704,748円
発行済口数	154,614,130口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1170円
（1万口当たり純資産額）	（11,170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11月30日現在）

資産総額	477,439,238,150円
負債総額	3,269,935,740円
純資産総額（ - ）	474,169,302,410円
発行済口数	252,496,810,383口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8779円
（1万口当たり純資産額）	（18,779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11月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ 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2022年 1月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年11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	15,597,102
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	74	251,989
単位型公社債投資信託	54	308,957
合計	658	16,158,048

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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



## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

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

（単位：百万円）

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

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	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いません。

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

### 資産の部

#### 流動資産

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

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

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

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



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

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

## 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

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

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

## 重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>  子会社株式     移動平均法による原価法によっております。</p> <p>  その他有価証券</p> <p>    市場価格のない株式等以外のもの       時価法によっております。     （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>    市場価格のない株式等       移動平均法による原価法によっております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産   定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産   定額法によっております。   ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法</p>

によっております。

## 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 6. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

## 7. 収益及び費用の計上基準

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

### (1) 投資信託委託業務

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

### (2) 投資一任業務

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

### (3) 投資助言業務

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

### (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

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

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

## (会計方針の変更)

第36期中間会計期間

(自 2021年4月1日

至 2021年9月30日)

## 1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

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

## 2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

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

## (追加情報)

第36期中間会計期間

(自 2021年4月1日

至 2021年9月30日)

## 退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

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

## (中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

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

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

## （２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

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

### 金銭の信託

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

### デリバティブ取引

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

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

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

## （有価証券関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

### 1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

### 2．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
----	----------	------	----

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

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

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

## （収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

## 3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

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

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

## （関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。



（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常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

2022年1月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

## 第3【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
2021年 1月20日	有価証券届出書
2021年 1月20日	有価証券報告書
2021年 7月20日	有価証券届出書
2021年 7月20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12月20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 松崎雅則 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i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2020年10月21日から2021年10月20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、i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2021年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

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

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

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。