

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

日本株式インデックス・オープン

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（１）に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1％）（２）を加えた価額（販売基準価額）とします。

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

2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有益証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有益証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の販売基準価額に、1.1％（税抜 1.0％）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

**（ 6 ） 【 申込単位 】**

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

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

**（ 7 ） 【 申込期間 】**

2022年 3月 1日から2022年 8月30日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**（ 8 ） 【 申込取扱場所 】**

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**（ 10 ） 【 払込取扱場所 】**

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

**（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 12 ） 【 その他 】**

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の

振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 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  TOPIX  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

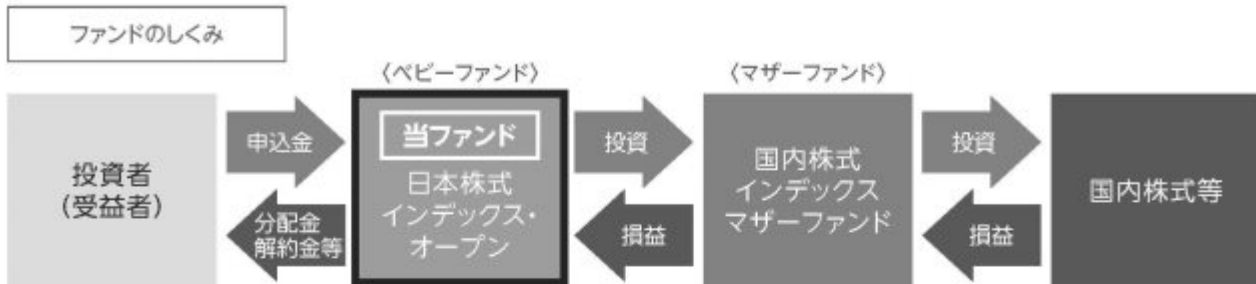
(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

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



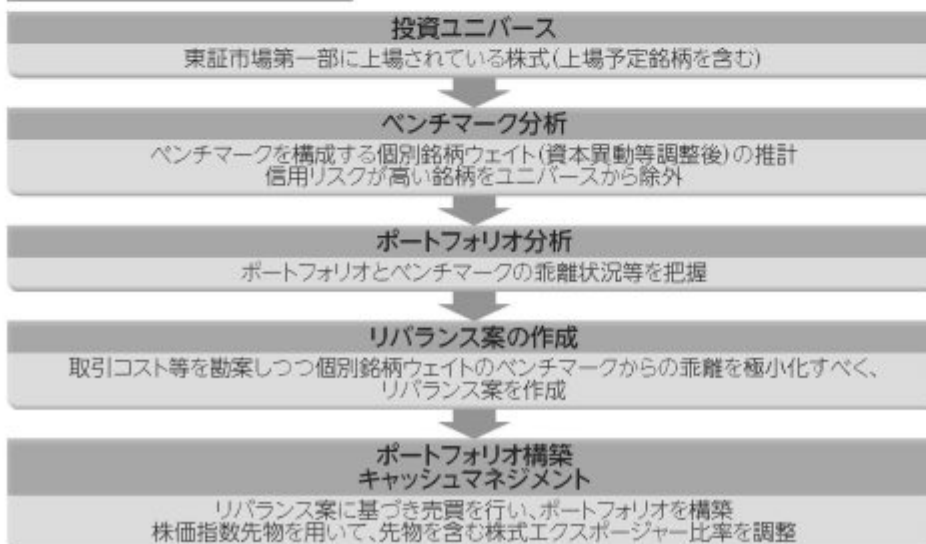
## ? ファミリーファンド方式とは

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

### 〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

### ? TOPIX(東証株価指数)とは

インデックスの概要 (2021年12月末現在)		東証一部時価総額上位10銘柄		
構成国	1ヵ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,183銘柄	1	トヨタ自動車	171,756
時価総額	約439兆円	2	ソニーグループ	146,033
※上記時価総額は浮動株ベース		3	キーエンス	105,474
		4	リクルートホールディングス	82,770
		5	東京エレクトロン	67,730
		6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	62,249
		7	日本電産	56,432
		8	信越化学工業	53,949
		9	HOYA	53,768
		10	ダイキン工業	53,531
		※上記時価総額は浮動株ベース		
(出所)株式会社東京証券取引所のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成				
※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。				
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。

**分配方針**

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

**主な投資制限**

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

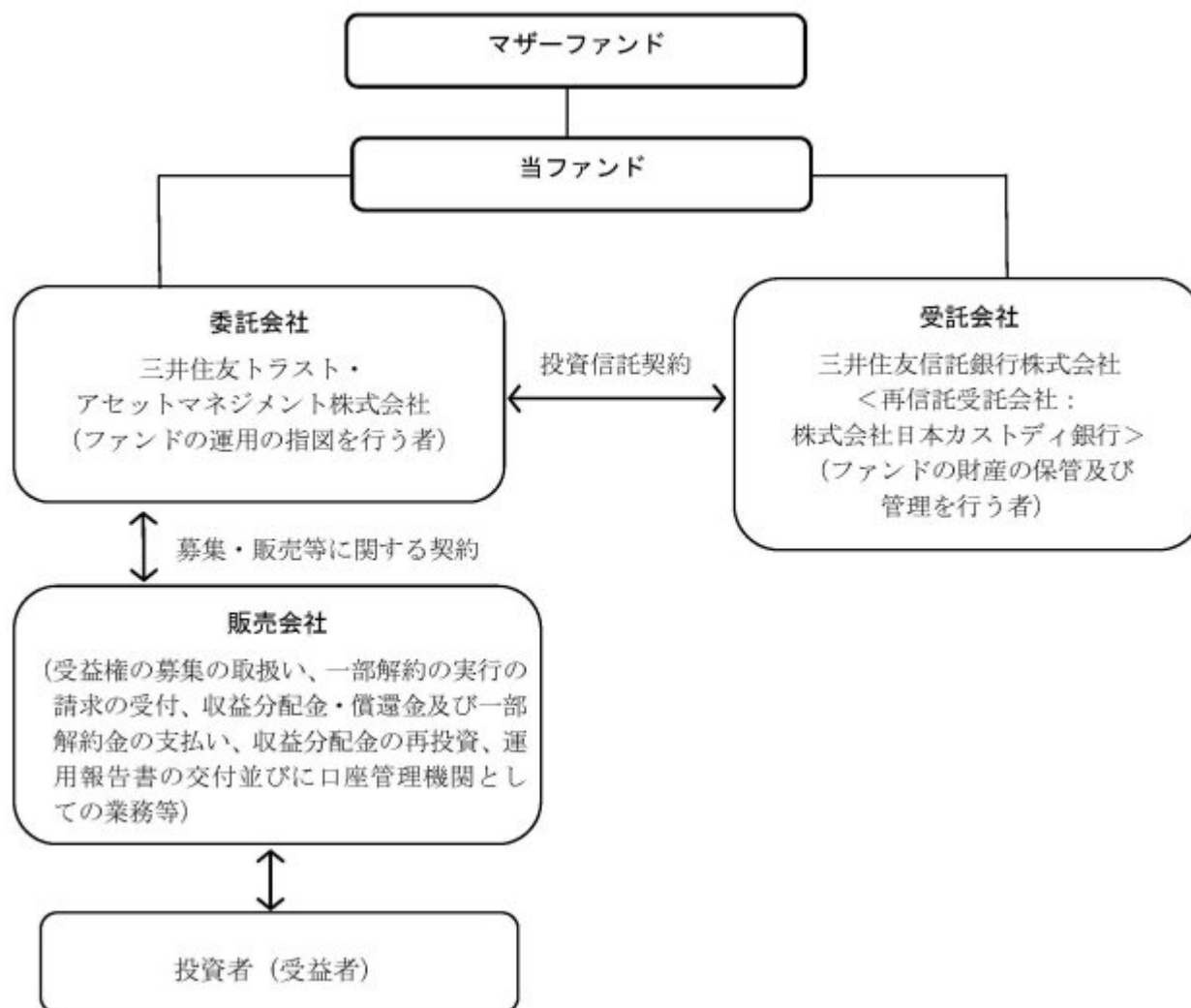
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

**(2) 【ファンドの沿革】**

2000年5月30日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月1日	当ファンドの名称を「すみしん 日本株式インデックス・オープン」から「日本株式インデックス・オープン」に変更 当ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

**(3) 【ファンドの仕組み】**

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2021年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

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

## 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、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。

### 投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

### 投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- 5)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 6)国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

## （２）【投資対象】

### 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マザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 株券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. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券又は外国投資証券（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。
  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。
  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号ならびに第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号ならびに第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を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券を以下「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、前記 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. 第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果



を目標として運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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

新株引受権証券及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ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

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及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。

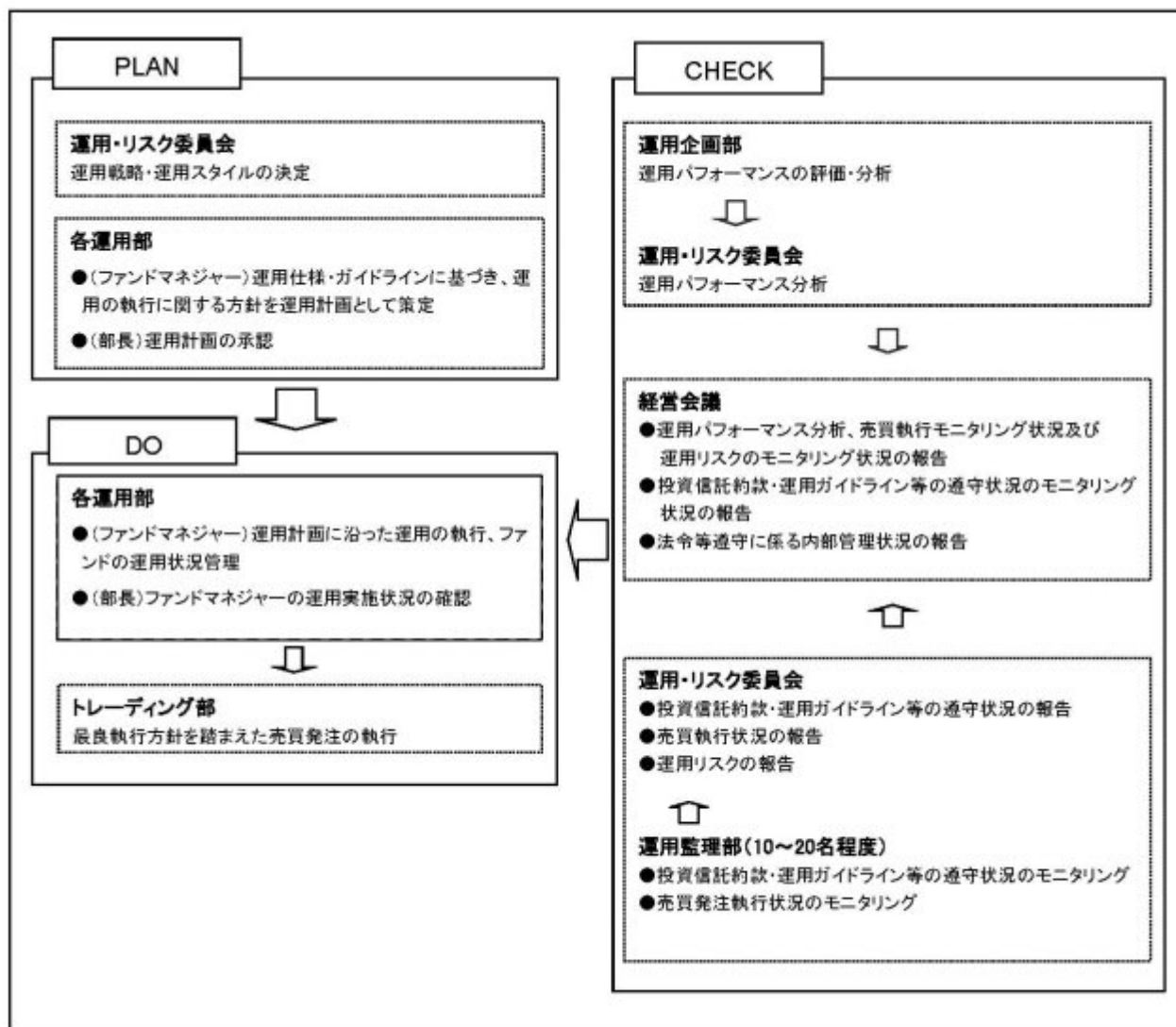
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の

純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### （３）【運用体制】

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



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

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

### （４）【配分方針】

毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下

の方針にもとづき、収益分配を行います。

・分配対象額の範囲

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

・分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

・留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託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>

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。

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、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実質投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の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、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。

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、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。前文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。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し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。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転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券

6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券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

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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します。

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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとしします。当該資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとしします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内

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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## &lt; 関連法令に基づく投資制限 &gt;

## イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資

信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部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がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

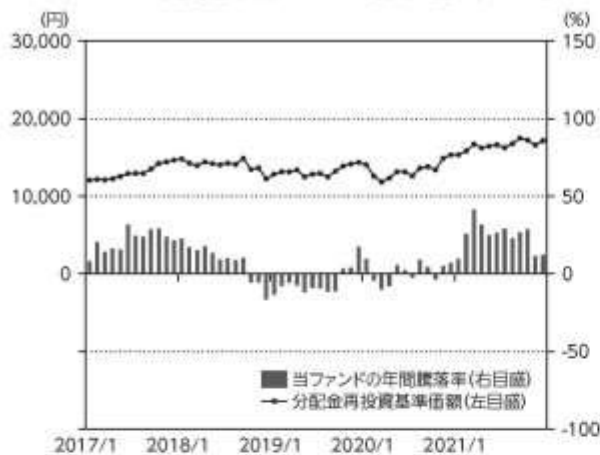
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

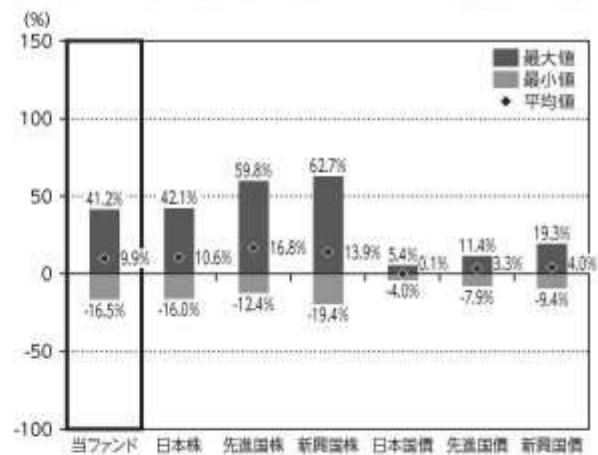
## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2017年1月～2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株の全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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、同指数を用いられる当社の事業活動・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、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、印刷または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 イモビリティ・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

取得申込受付日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1%）（1）を加えた価額（販売基準価額）に、1.1%（税抜 1.0%）（2）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対

価として、販売会社に支払われます。

1：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入る有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

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

「分配金再投資コース」（3）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.66%（税抜 0.6%）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 0.275% (税抜 0.25%)	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 0.308% (税抜 0.28%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。



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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 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12月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【日本株式インデックス・オープン】

#### （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	6,571,228,626	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,298,246	0.05
合計(純資産総額)		6,574,526,872	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	3,381,479,250	1.8549	6,272,305,861	1.9433	6,571,228,626	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12期計算期間末 (2012年 5月29日)	9,761,446,513	9,962,605,897	4,853	4,953
第13期計算期間末 (2013年 5月29日)	16,149,042,625	16,415,608,284	7,876	8,006
第14期計算期間末 (2014年 5月29日)	17,400,449,893	17,704,638,692	8,008	8,148
第15期計算期間末 (2015年 5月29日)	14,183,983,200	14,387,249,961	11,165	11,325
第16期計算期間末 (2016年 5月30日)	19,406,872,905	19,770,121,114	9,082	9,252
第17期計算期間末 (2017年 5月29日)	13,150,557,546	13,390,299,930	10,422	10,612
第18期計算期間末 (2018年 5月29日)	9,342,486,878	9,518,864,739	11,653	11,873
第19期計算期間末 (2019年 5月29日)	7,565,731,261	7,753,241,662	10,087	10,337
第20期計算期間末 (2020年 5月29日)	6,159,474,683	6,310,173,054	10,218	10,468
第21期計算期間末 (2021年 5月31日)	6,552,196,518	6,677,844,116	12,515	12,755
2020年12月末日	6,522,266,636		11,886	
2021年 1月末日	6,445,919,425		11,907	
2月末日	6,560,766,826		12,271	
3月末日	6,834,701,689		12,963	
4月末日	6,607,393,283		12,590	
5月末日	6,552,196,518		12,515	
6月末日	6,657,507,966		12,657	
7月末日	6,386,261,607		12,375	
8月末日	6,568,174,902		12,759	
9月末日	6,800,273,510		13,306	
10月末日	6,659,548,129		13,111	
11月末日	6,388,651,213		12,628	
12月末日	6,574,526,872		13,061	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第12期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	100
第13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	130
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	140
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	160
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	170
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	190

第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	220
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	250
第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	250
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	240

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第12期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	10.2
第13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	65.0
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	3.5
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	41.4
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	17.1
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	16.8
第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	13.9
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	11.3
第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	3.8
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	24.8
第22期中間計算期間	2021年 6月 1日～2021年11月30日	0.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第12期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	3,371,188,833	3,731,726,430	20,115,938,410
第13期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	16,829,693,387	16,440,581,046	20,505,050,751
第14期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	23,786,924,244	22,564,203,585	21,727,771,410
第15期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	16,329,909,593	25,353,508,387	12,704,172,616
第16期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	17,645,482,093	8,982,112,982	21,367,541,727
第17期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	4,557,255,174	13,306,776,663	12,618,020,238
第18期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	163,236,204	4,764,080,905	8,017,175,537
第19期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	115,634,723	632,394,206	7,500,416,054
第20期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	148,606,297	1,621,087,474	6,027,934,877
第21期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	113,236,909	905,855,186	5,235,316,600
第22期中間計算期間	2021年 6月 1日～2021年11月30日	76,315,691	252,667,080	5,058,965,211

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	489,327,104,570	98.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,531,440,023	1.12
合計(純資産総額)		494,858,544,593	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,098,200	1,832.35	16,671,113,557	2,105.50	19,156,260,100	3.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,125,200	10,864.23	12,224,438,406	14,475.00	16,287,270,000	3.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	162,800	54,452.13	8,864,807,101	72,280.00	11,767,184,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,324,100	5,730.91	7,588,298,919	6,972.00	9,231,625,200	1.87
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	114,000	49,128.86	5,600,690,421	66,280.00	7,555,920,000	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,126,600	619.46	6,892,483,636	624.90	6,953,012,340	1.41
日本	株式	日本電産	電気機器	465,600	12,534.37	5,836,003,443	13,520.00	6,294,912,000	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	302,100	18,847.73	5,693,902,203	19,920.00	6,017,832,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	350,500	14,478.89	5,074,852,796	17,110.00	5,997,055,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	228,800	21,734.40	4,972,832,535	26,090.00	5,969,392,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,846,600	2,935.27	5,420,269,582	3,150.00	5,816,790,000	1.18
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,056,900	8,160.40	8,624,732,619	5,434.00	5,743,194,600	1.16

日本	株式	任天堂	その他製品	101,400	67,042.40	6,798,099,727	53,650.00	5,440,110,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	863,900	5,777.00	4,990,755,004	6,230.00	5,382,097,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,325,600	3,107.79	4,119,699,373	3,652.00	4,841,091,200	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,226,300	3,942.99	4,835,292,428	3,943.00	4,835,300,900	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	527,700	8,300.99	4,380,433,215	9,157.00	4,832,148,900	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,414,200	3,354.95	4,744,570,485	3,230.00	4,567,866,000	0.92
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,411,800	3,702.58	5,227,307,139	3,137.00	4,428,816,600	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,237,400	3,252.01	4,024,040,969	3,518.00	4,353,173,200	0.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,285,000	3,700.76	4,755,479,170	3,362.00	4,320,170,000	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	1,411,500	2,533.01	3,575,349,134	2,925.00	4,128,637,500	0.83
日本	株式	S M C	機械	52,600	65,733.47	3,457,581,037	77,590.00	4,081,234,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	202,800	16,502.71	3,346,750,137	19,395.00	3,933,306,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,669,700	1,465.46	3,912,352,292	1,454.50	3,883,078,650	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	157,600	26,201.40	4,129,340,692	24,380.00	3,842,288,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	395,500	7,529.10	2,977,759,442	9,529.00	3,768,719,500	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	1,373,800	2,421.67	3,326,890,554	2,723.50	3,741,544,300	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	583,500	5,202.21	3,035,491,713	6,392.00	3,729,732,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	692,100	4,746.21	3,284,855,798	5,056.00	3,499,257,600	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.23
		建設業	2.15
		食料品	3.23
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.68
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.40
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.74
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.63
		機械	5.49
電気機器	19.93		

輸送用機器	8.03
精密機器	2.88
その他製品	2.19
電気・ガス業	1.05
陸運業	2.89
海運業	0.51
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	7.90
卸売業	5.22
小売業	4.04
銀行業	4.69
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	1.95
その他金融業	1.13
不動産業	1.82
サービス業	6.23
小計	98.88
合計	98.88

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2000年5月30日

作成基準日：2021年12月30日

### 基準価額・純資産の推移



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

基準価額 13,061円

純資産総額 65.75億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年5月	190円
2018年5月	220円
2019年5月	250円
2020年5月	250円
2021年5月	240円

設定来 分配金合計額	2,470円
---------------	--------

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

### 主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.9%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3.3%
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%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.4%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.3%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.2%
HOYA	日本	株式	精密機器	1.2%
ダイキン工業	日本	株式	機械	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

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口単位とします。）。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に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

$$\begin{aligned} \text{販売基準価額} &= \text{取得申込受付日の基準価額} + \text{追加設定時信託財産留保額} \\ &= \text{取得申込受付日の基準価額} + (\text{取得申込受付日の基準価額} \times 0.1\%) \end{aligned}$$

（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販売基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、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から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の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>

イ．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。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

#### < 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。（2000年5月30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5月30日から翌年5月29日までとします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎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21期計算期間(2020年5月30日から2021年5月31日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【日本株式インデックス・オープン】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第20期 ( 2020年 5月29日現在 )	第21期 ( 2021年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,622,905	-
コール・ローン	20,286,423	25,494,077
親投資信託受益証券	6,306,990,038	6,674,462,789
未収入金	10,472,536	1,390,055
流動資産合計	6,342,371,902	6,701,346,921
資産合計	6,342,371,902	6,701,346,921
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	150,698,371	125,647,598
未払解約金	10,371,409	1,052,890
未払受託者報酬	2,500,856	2,577,629
未払委託者報酬	18,934,997	19,516,251
未払利息	55	45
その他未払費用	391,531	355,990
流動負債合計	182,897,219	149,150,403
負債合計	182,897,219	149,150,403
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,027,934,877	5,235,316,600
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	131,539,806	1,316,879,918
( 分配準備積立金 )	1,184,642,042	1,544,158,493
元本等合計	6,159,474,683	6,552,196,518
純資産合計	6,159,474,683	6,552,196,518
負債純資産合計	6,342,371,902	6,701,346,921

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自 2019年 5月30日	至 2020年 5月29日	自 2020年 5月30日	至 2021年 5月31日
営業収益				
受取利息		37		31
有価証券売買等損益		414,575,454		1,471,538,245
営業収益合計		414,575,491		1,471,538,276
営業費用				
支払利息		8,351		4,918
受託者報酬		5,483,081		4,985,783
委託者報酬		41,514,616		37,749,356
その他費用		391,536		356,029
営業費用合計		47,397,584		43,096,086
営業利益又は営業損失（ ）		367,177,907		1,428,442,190
経常利益又は経常損失（ ）		367,177,907		1,428,442,190
当期純利益又は当期純損失（ ）		367,177,907		1,428,442,190
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（ ）		138,915,373		101,717,878
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		65,315,207		131,539,806
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,871,185		3,472,578
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,871,185		3,472,578
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,210,749		19,209,180
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,210,749		19,209,180
分配金		150,698,371		125,647,598
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		131,539,806		1,316,879,918

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第21期計算期間は2020年 5月30日から2021年 5月31日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第20期 (2020年 5月29日現在)	第21期 (2021年 5月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,027,934,877口	5,235,316,600口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0218円 (10,218円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2515円 (12,515円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自 2019年 5月30日 至 2020年 5月29日			第21期 自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31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	126,600,184円	費用控除後の配当等収益額	A	125,647,458円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	533,771,265円
収益調整金額	C	3,482,404,934円	収益調整金額	C	3,043,653,115円
分配準備積立金額	D	1,208,740,229円	分配準備積立金額	D	1,010,387,368円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,817,745,347円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,713,459,206円
当ファンドの期末残存口数	F	6,027,934,877口	当ファンドの期末残存口数	F	5,235,316,600口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,992円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,003円
1万口当たり分配金額	H	250円	1万口当たり分配金額	H	240円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	150,698,371円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	125,647,598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21期 自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31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21期 (2021年 5月31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20期	第21期
	自 2019年 5月30日 至 2020年 5月29日	自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,500,416,054円	6,027,934,877円
期中追加設定元本額	148,606,297円	113,236,909円
期中一部解約元本額	1,621,087,474円	905,855,186円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第20期 (2020年 5月29日現在)	第21期 (2021年 5月31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	270,018,811	1,364,037,111
合計	270,018,811	1,364,037,111

## （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	3,598,093,148	6,674,462,789	
合計		3,598,093,148	6,674,462,789	

(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 5月31日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,303,888,136
株式	455,964,175,980
派生商品評価勘定	14,054,950
未収入金	404,451,849
未収配当金	4,047,569,256
前払金	101,084,900
差入委託証拠金	217,701,600
流動資産合計	466,052,926,671
資産合計	466,052,926,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,159,650
未払金	3,002,226,043
未払解約金	99,825,660
未払利息	9,487
流動負債合計	3,217,220,840
負債合計	3,217,220,840
純資産の部	
元本等	
元本	249,503,103,457
剰余金	

	2021年 5月31日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	213,332,602,374
元本等合計	462,835,705,831
純資産合計	462,835,705,831
負債純資産合計	466,052,926,671

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 5月31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 5月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	249,503,103,457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 1.8550円 (1万口当たり純資産額) (18,550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 5月31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 5月31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 5月31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 5月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 5月30日
期首元本額	212,335,378,830円
期中追加設定元本額	91,146,447,303円
期中一部解約元本額	53,978,722,676円
期末元本額	249,503,103,457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）	425,421,036円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,861,892,511円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,712,867円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,403,753,770円
世界経済インデックスファンド	2,683,336,435円
日本株式インデックス・オープン	3,598,093,148円
DCマイセレクション25	6,050,615,568円
DCマイセレクション50	17,856,939,441円
DCマイセレクション75	17,462,256,715円
DC日本株式インデックス・オープン	5,795,526,637円

区分	2021年 5月31日現在
DCマイセレクションS25	2,854,636,452円
DCマイセレクションS50	8,420,319,159円
DCマイセレクションS75	5,940,925,341円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,493,326,205円
DCターゲット・イヤーフンド2025	248,443,863円
DCターゲット・イヤーフンド2035	649,975,544円
DCターゲット・イヤーフンド2045	463,116,992円
DC世界経済インデックスファンド	3,182,301,074円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,525,588,405円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	6,195,294円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,725,162円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	25,297,047円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	198,868,482円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,358,345円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	52,282,962円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	170,954,225円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	30,614,108円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	98,131,095円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,174,226,556円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	484,894,150円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,102,276,547円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	279,324,640円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	29,119,791円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	558,309,169円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	318,403,754円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	403,509,178円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	41,853,585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)	653,344,546円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,731,672,493円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,859,449,520円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,637,915,929円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,195,855,155円
分散投資コア戦略ファンドA	2,047,093,068円
分散投資コア戦略ファンドS	7,197,643,246円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	394,131,292円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	383,058,796円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,005,334,416円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	202,558,578円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,309,323円
SMT インデックスバランス・オープン	59,576,799円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	24,216,585,712円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	622,042,108円
SMT 世界経済インデックス・オープン	33,560,024円

区分	2021年 5月31日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	109,285,845円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	19,525,758円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,778,508円
グローバル経済コア	235,932,236円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	22,433,643円
i - S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	52,924,180円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	7,621,865円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,165,542,032円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	127,725,155円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	3,968,204円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2,713,907円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,143,472円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	801,202円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,587,150,766円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,203,380,236円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	165,260,518円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	26,682,640円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	43,456,736円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,538,120,296円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月31日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	65,263,178,483
合計	65,263,178,483

(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 5月31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	6,850,834,900	-	6,749,750,000	101,084,900
合計		6,850,834,900	-	6,749,750,000	101,084,900

(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	7,600	2,896.00	22,009,600	
日本水産	217,900	507.00	110,475,300	
マルハニチロ	36,700	2,395.00	87,896,500	
雪国まいたけ	19,300	1,723.00	33,253,900	
カネコ種苗	7,100	1,476.00	10,479,600	
サカタのタネ	28,000	3,715.00	104,020,000	
ホクト	19,700	1,933.00	38,080,100	
ホクリヨウ	3,600	767.00	2,761,200	
住石ホールディングス	41,100	129.00	5,301,900	
日鉄鉱業	5,400	6,250.00	33,750,000	
三井松島ホールディングス	9,800	949.00	9,300,200	
I N P E X	862,800	753.00	649,688,400	
石油資源開発	30,700	1,972.00	60,540,400	
K & O エナジーグループ	11,400	1,360.00	15,504,000	
ヒノキヤグループ	5,800	2,499.00	14,494,200	
ショーボンドホールディングス	33,500	4,575.00	153,262,500	
ミライト・ホールディングス	81,300	1,930.00	156,909,000	
タマホーム	14,200	2,104.00	29,876,800	
サンヨーホームズ	2,700	715.00	1,930,500	
日本アクア	9,300	538.00	5,003,400	
ファーストコーポレーション	7,200	751.00	5,407,200	
ベステラ	4,500	1,580.00	7,110,000	
R o b o t H o m e	44,000	261.00	11,484,000	
キャンディル	4,000	542.00	2,168,000	
スペースバリューホールディングス	28,600	733.00	20,963,800	
ダイセキ環境ソリューション	4,500	957.00	4,306,500	
第一カッター興業	5,800	1,360.00	7,888,000	
安藤・間	150,400	819.00	123,177,600	
東急建設	68,700	702.00	48,227,400	
コムシスホールディングス	83,200	3,090.00	257,088,000	
ビーアールホールディングス	31,400	504.00	15,825,600	

高松コンストラクショングループ	14,600	2,048.00	29,900,800
東建コーポレーション	7,200	9,540.00	68,688,000
ソネック	2,400	912.00	2,188,800
ヤマウラ	10,200	906.00	9,241,200
オリエンタル白石	78,900	279.00	22,013,100
大成建設	168,600	3,820.00	644,052,000
大林組	541,800	922.00	499,539,600
清水建設	507,500	897.00	455,227,500
飛鳥建設	15,500	1,060.00	16,430,000
長谷工コーポレーション	177,500	1,535.00	272,462,500
松井建設	21,300	737.00	15,698,100
銭高組	2,400	4,380.00	10,512,000
鹿島建設	397,000	1,515.00	601,455,000
不動テトラ	13,300	1,793.00	23,846,900
大末建設	6,800	991.00	6,738,800
鉄建建設	10,900	1,845.00	20,110,500
西松建設	38,800	3,360.00	130,368,000
三井住友建設	130,900	468.00	61,261,200
大豊建設	11,900	4,070.00	48,433,000
前田建設工業	135,700	955.00	129,593,500
佐田建設	12,500	463.00	5,787,500
ナカノフドー建設	13,000	402.00	5,226,000
奥村組	29,800	2,862.00	85,287,600
東鉄工業	23,200	2,357.00	54,682,400
イチケン	3,900	1,821.00	7,101,900
富士ピー・エス	7,000	547.00	3,829,000
浅沼組	6,500	4,485.00	29,152,500
戸田建設	225,000	777.00	174,825,000
熊谷組	25,100	2,975.00	74,672,500
北野建設	3,300	2,375.00	7,837,500
植木組	4,800	1,484.00	7,123,200
矢作建設工業	23,900	705.00	16,849,500
ピーエス三菱	17,800	651.00	11,587,800
日本ハウスホールディングス	37,000	342.00	12,654,000
大東建託	59,100	11,520.00	680,832,000
新日本建設	23,000	853.00	19,619,000
N I P P O	44,800	2,837.00	127,097,600
東亜道路工業	3,400	4,525.00	15,385,000
前田道路	33,500	2,151.00	72,058,500
日本道路	5,200	7,520.00	39,104,000
東亜建設工業	14,500	2,456.00	35,612,000
日本国土開発	52,700	564.00	29,722,800

若築建設	9,700	1,372.00	13,308,400
東洋建設	60,700	560.00	33,992,000
五洋建設	230,100	773.00	177,867,300
世紀東急工業	26,000	841.00	21,866,000
福田組	6,300	5,010.00	31,563,000
住友林業	127,400	2,216.00	282,318,400
日本基礎技術	16,500	504.00	8,316,000
巴コーポレーション	24,100	390.00	9,399,000
大和ハウス工業	500,300	3,206.00	1,603,961,800
ライト工業	31,000	1,817.00	56,327,000
積水ハウス	587,600	2,278.00	1,338,552,800
日特建設	14,100	759.00	10,701,900
北陸電気工事	9,400	1,194.00	11,223,600
ユアテック	31,000	735.00	22,785,000
日本リーテック	11,300	1,621.00	18,317,300
四電工	2,900	3,395.00	9,845,500
中電工	24,900	2,329.00	57,992,100
関電工	88,100	906.00	79,818,600
きんでん	110,000	1,841.00	202,510,000
東京エネシス	18,000	960.00	17,280,000
トーエネック	5,400	3,695.00	19,953,000
住友電設	15,300	2,282.00	34,914,600
日本電設工業	29,700	1,789.00	53,133,300
協和エクシオ	82,100	2,690.00	220,849,000
新日本空調	14,300	2,034.00	29,086,200
九電工	38,000	3,385.00	128,630,000
三機工業	38,400	1,384.00	53,145,600
日揮ホールディングス	180,700	1,044.00	188,650,800
中外炉工業	5,900	2,079.00	12,266,100
ヤマト	17,300	781.00	13,511,300
太平電業	12,000	2,655.00	31,860,000
高砂熱学工業	49,000	1,798.00	88,102,000
三晃金属工業	2,100	2,396.00	5,031,600
朝日工業社	4,000	2,962.00	11,848,000
明星工業	35,000	741.00	25,935,000
大気社	26,300	3,150.00	82,845,000
ダイダン	12,000	2,665.00	31,980,000
日比谷総合設備	17,400	1,815.00	31,581,000
フィル・カンパニー	3,100	2,973.00	9,216,300
テスホールディングス	9,900	1,747.00	17,295,300
東洋エンジニアリング	22,800	683.00	15,572,400
レイズネクスト	29,100	1,159.00	33,726,900

ニッポン	50,700	1,555.00	78,838,500
日清製粉グループ本社	195,900	1,644.00	322,059,600
日東富士製粉	1,300	7,180.00	9,334,000
昭和産業	14,600	2,974.00	43,420,400
鳥越製粉	15,400	807.00	12,427,800
中部飼料	21,200	1,185.00	25,122,000
フィード・ワン	23,300	757.00	17,638,100
東洋精糖	2,900	1,188.00	3,445,200
日本甜菜製糖	9,000	1,616.00	14,544,000
D M三井製糖ホールディングス	13,700	1,818.00	24,906,600
塩水港精糖	20,700	225.00	4,657,500
日新製糖	8,200	1,713.00	14,046,600
森永製菓	40,700	3,380.00	137,566,000
中村屋	4,200	3,790.00	15,918,000
江崎グリコ	47,700	4,180.00	199,386,000
名糖産業	7,600	1,526.00	11,597,600
井村屋グループ	9,800	2,344.00	22,971,200
不二家	11,100	2,103.00	23,343,300
山崎製パン	130,000	1,638.00	212,940,000
第一屋製パン	3,300	951.00	3,138,300
モロゾフ	2,800	5,300.00	14,840,000
亀田製菓	9,900	4,450.00	44,055,000
寿スピリッツ	16,700	6,950.00	116,065,000
カルビー	79,000	2,525.00	199,475,000
森永乳業	32,100	5,660.00	181,686,000
六甲バター	11,500	1,526.00	17,549,000
ヤクルト本社	119,300	5,910.00	705,063,000
明治ホールディングス	114,700	6,800.00	779,960,000
雪印メグミルク	41,700	2,103.00	87,695,100
プリマハム	24,400	3,005.00	73,322,000
日本ハム	66,300	4,375.00	290,062,500
林兼産業	5,700	611.00	3,482,700
丸大食品	17,100	1,672.00	28,591,200
S Foods	15,600	3,215.00	50,154,000
柿安本店	6,000	2,487.00	14,922,000
伊藤ハム米久ホールディングス	111,600	709.00	79,124,400
サッポロホールディングス	59,200	2,147.00	127,102,400
アサヒグループホールディングス	378,800	5,219.00	1,976,957,200
キリンホールディングス	735,400	2,211.50	1,626,337,100
宝ホールディングス	128,500	1,450.00	186,325,000
オエノンホールディングス	49,300	377.00	18,586,100
養命酒製造	5,300	1,781.00	9,439,300



コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,800	1,804.00	239,571,200
サントリー食品インターナショナル	116,000	4,035.00	468,060,000
ダイドーグループホールディングス	9,800	4,940.00	48,412,000
伊藤園	52,600	6,060.00	318,756,000
キーコーヒー	17,000	2,074.00	35,258,000
ユニカフェ	5,200	998.00	5,189,600
ジャパンフーズ	2,500	1,210.00	3,025,000
日清オイリオグループ	22,200	2,998.00	66,555,600
不二製油グループ本社	42,300	2,757.00	116,621,100
かどや製油	1,900	4,075.00	7,742,500
J - オイルミルズ	16,200	1,865.00	30,213,000
キッコーマン	124,800	7,110.00	887,328,000
味の素	412,400	2,516.00	1,037,598,400
ブルドックソース	7,900	2,279.00	18,004,100
キューピー	96,500	2,505.00	241,732,500
ハウス食品グループ本社	64,800	3,200.00	207,360,000
カゴメ	70,900	2,905.00	205,964,500
焼津水産化学工業	8,400	970.00	8,148,000
アリアケジャパン	15,800	6,380.00	100,804,000
ピエトロ	2,300	1,665.00	3,829,500
エバラ食品工業	3,800	2,489.00	9,458,200
やまみ	1,900	2,040.00	3,876,000
ニチレイ	82,600	2,813.00	232,353,800
東洋水産	89,200	4,390.00	391,588,000
イトアンドホールディングス	6,000	1,863.00	11,178,000
大冷	1,900	1,950.00	3,705,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,700	768.00	7,449,600
日清食品ホールディングス	68,000	7,930.00	539,240,000
永谷園ホールディングス	8,500	2,177.00	18,504,500
一正蒲鉾	6,700	946.00	6,338,200
フジッコ	18,800	1,909.00	35,889,200
ロック・フィールド	18,700	1,570.00	29,359,000
日本たばこ産業	929,700	2,162.50	2,010,476,250
ケンコーマヨネーズ	10,600	1,670.00	17,702,000
わらべや日洋ホールディングス	11,300	1,907.00	21,549,100
なとり	9,700	1,873.00	18,168,100
イフジ産業	2,700	911.00	2,459,700
ピクルスコーポレーション	4,100	3,105.00	12,730,500
ファーマフーズ	16,400	3,155.00	51,742,000
北の達人コーポレーション	60,500	476.00	28,798,000
ユーグレナ	88,300	825.00	72,847,500
紀文食品	10,100	1,628.00	16,442,800

ミヨシ油脂	6,100	1,238.00	7,551,800
理研ビタミン	16,400	1,440.00	23,616,000
片倉工業	23,000	1,529.00	35,167,000
ゲンゼ	12,500	4,365.00	54,562,500
東洋紡	67,200	1,352.00	90,854,400
ユニチカ	50,900	360.00	18,324,000
富士紡ホールディングス	8,300	4,030.00	33,449,000
倉敷紡績	15,900	1,821.00	28,953,900
シキボウ	9,500	931.00	8,844,500
日本毛織	56,200	945.00	53,109,000
トーア紡コーポレーション	6,700	457.00	3,061,900
帝国繊維	19,300	2,029.00	39,159,700
帝人	159,500	1,767.00	281,836,500
東レ	1,225,800	710.60	871,053,480
サカイオーベックス	4,600	2,958.00	13,606,800
住江織物	3,700	1,900.00	7,030,000
日本フェルト	10,700	451.00	4,825,700
イチカワ	2,600	1,370.00	3,562,000
日東製網	1,800	1,528.00	2,750,400
アツギ	13,300	622.00	8,272,600
ダイニック	6,400	785.00	5,024,000
セーレン	41,800	2,031.00	84,895,800
ソトー	7,000	797.00	5,579,000
東海染工	2,300	1,126.00	2,589,800
小松マテーレ	28,000	909.00	25,452,000
ワコールホールディングス	42,300	2,500.00	105,750,000
ホギメディカル	22,900	3,295.00	75,455,500
T S Iホールディングス	52,100	302.00	15,734,200
マツオカコーポレーション	5,500	1,739.00	9,564,500
ワールド	22,300	1,382.00	30,818,600
三陽商会	8,800	909.00	7,999,200
ナイガイ	6,800	326.00	2,216,800
オンワードホールディングス	102,400	298.00	30,515,200
ルックホールディングス	5,900	1,465.00	8,643,500
ゴールドウイン	28,000	6,050.00	169,400,000
デサント	29,000	1,903.00	55,187,000
キング	9,400	509.00	4,784,600
ヤマトインターナショナル	15,500	335.00	5,192,500
特種東海製紙	10,400	4,330.00	45,032,000
王子ホールディングス	761,700	649.00	494,343,300
日本製紙	74,800	1,292.00	96,641,600
三菱製紙	24,000	359.00	8,616,000

北越コーポレーション	121,000	590.00	71,390,000
中越パルプ工業	6,400	1,198.00	7,667,200
巴川製紙所	5,600	796.00	4,457,600
大王製紙	81,600	1,687.00	137,659,200
阿波製紙	4,400	426.00	1,874,400
レンゴー	174,500	918.00	160,191,000
トーモク	10,400	1,915.00	19,916,000
ザ・パック	12,800	2,745.00	35,136,000
クラレ	266,500	1,136.00	302,744,000
旭化成	1,121,500	1,205.00	1,351,407,500
共和レザー	9,200	701.00	6,449,200
昭和電工	128,500	3,405.00	437,542,500
住友化学	1,331,900	600.00	799,140,000
住友精化	8,200	3,525.00	28,905,000
日産化学	93,300	5,670.00	529,011,000
ラサ工業	5,500	1,883.00	10,356,500
クレハ	14,500	6,370.00	92,365,000
多木化学	6,600	5,450.00	35,970,000
テイカ	12,400	1,223.00	15,165,200
石原産業	30,300	952.00	28,845,600
片倉コープアグリ	4,400	1,237.00	5,442,800
日本曹達	23,600	3,350.00	79,060,000
東ソー	261,500	1,913.00	500,249,500
トクヤマ	50,300	2,294.00	115,388,200
セントラル硝子	32,300	2,091.00	67,539,300
東亜合成	103,200	1,184.00	122,188,800
大阪ソーダ	17,200	2,464.00	42,380,800
関東電化工業	40,100	968.00	38,816,800
デンカ	61,700	4,060.00	250,502,000
信越化学工業	312,900	18,855.00	5,899,729,500
日本カーバイド工業	6,200	1,284.00	7,960,800
堺化学工業	11,900	1,786.00	21,253,400
第一稀元素化学工業	17,000	1,523.00	25,891,000
エア・ウォーター	172,500	1,832.00	316,020,000
日本酸素ホールディングス	139,400	2,160.00	301,104,000
日本化学工業	4,800	2,739.00	13,147,200
東邦アセチレン	2,500	1,202.00	3,005,000
日本パーカライジング	85,400	1,092.00	93,256,800
高圧ガス工業	26,800	657.00	17,607,600
チタン工業	2,100	1,895.00	3,979,500
四国化成工業	22,500	1,229.00	27,652,500
戸田工業	3,600	2,300.00	8,280,000

ステラ ケミファ	9,200	2,904.00	26,716,800
保土谷化学工業	5,000	3,985.00	19,925,000
日本触媒	30,600	5,550.00	169,830,000
大日精化工業	14,000	2,302.00	32,228,000
カネカ	43,800	4,465.00	195,567,000
三菱瓦斯化学	169,500	2,553.00	432,733,500
三井化学	146,100	3,670.00	536,187,000
J S R	169,800	3,225.00	547,605,000
東京応化工業	29,000	6,780.00	196,620,000
大阪有機化学工業	15,600	4,070.00	63,492,000
三菱ケミカルホールディングス	1,131,100	875.60	990,391,160
K Hネオケム	27,900	2,806.00	78,287,400
ダイセル	227,500	871.00	198,152,500
住友ベークライト	26,600	4,445.00	118,237,000
積水化学工業	357,800	1,865.00	667,297,000
日本ゼオン	152,600	1,607.00	245,228,200
アイカ工業	47,100	3,895.00	183,454,500
宇部興産	85,400	2,304.00	196,761,600
積水樹脂	27,900	2,073.00	57,836,700
タキロンシーアイ	36,600	589.00	21,557,400
旭有機材	9,600	1,310.00	12,576,000
ニチバン	8,900	1,730.00	15,397,000
リケンテクノス	41,300	566.00	23,375,800
大倉工業	8,000	2,283.00	18,264,000
積水化成成品工業	22,700	581.00	13,188,700
群栄化学工業	3,900	2,450.00	9,555,000
タイガースポリマー	8,900	448.00	3,987,200
ミライアル	5,400	1,351.00	7,295,400
ダイキアクシス	6,500	864.00	5,616,000
ダイキョーニシカワ	35,700	759.00	27,096,300
竹本容器	6,000	973.00	5,838,000
森六ホールディングス	9,100	2,213.00	20,138,300
恵和	3,300	3,100.00	10,230,000
日本化薬	104,700	1,022.00	107,003,400
カーリットホールディングス	16,800	683.00	11,474,400
日本精化	12,200	1,423.00	17,360,600
扶桑化学工業	13,300	3,930.00	52,269,000
トリケミカル研究所	15,700	3,435.00	53,929,500
A D E K A	77,900	1,934.00	150,658,600
日油	63,700	5,670.00	361,179,000
新日本理化	28,000	287.00	8,036,000
ハリマ化成グループ	12,600	904.00	11,390,400

花王	413,700	6,695.00	2,769,721,500
第一工業製薬	5,700	3,590.00	20,463,000
石原ケミカル	4,300	2,223.00	9,558,900
日華化学	5,700	1,199.00	6,834,300
ニイタカ	3,500	2,650.00	9,275,000
三洋化成工業	10,100	5,560.00	56,156,000
有機合成薬品工業	13,000	297.00	3,861,000
大日本塗料	19,100	838.00	16,005,800
日本ペイントホールディングス	698,000	1,584.00	1,105,632,000
関西ペイント	190,100	2,955.00	561,745,500
神東塗料	13,300	193.00	2,566,900
中国塗料	40,800	858.00	35,006,400
日本特殊塗料	12,700	1,020.00	12,954,000
藤倉化成	22,800	527.00	12,015,600
太陽ホールディングス	12,400	5,010.00	62,124,000
D I C	71,500	2,795.00	199,842,500
サカタインクス	36,900	1,019.00	37,601,100
東洋インキS Cホールディングス	35,800	2,029.00	72,638,200
T & K T O K A	11,800	819.00	9,664,200
富士フィルムホールディングス	303,600	7,626.00	2,315,253,600
資生堂	343,300	7,929.00	2,722,025,700
ライオン	224,600	1,917.00	430,558,200
高砂香料工業	10,800	2,697.00	29,127,600
マンダム	36,200	1,921.00	69,540,200
ミルボン	23,100	6,230.00	143,913,000
ファンケル	62,900	3,450.00	217,005,000
コーセー	32,500	17,170.00	558,025,000
コタ	10,900	1,450.00	15,805,000
シーボン	2,200	1,947.00	4,283,400
ポーラ・オルビスホールディングス	73,700	2,848.00	209,897,600
ノエビアホールディングス	14,700	5,050.00	74,235,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,020.00	3,978,000
新日本製薬	4,700	2,057.00	9,667,900
エステー	11,100	1,727.00	19,169,700
アグロ カネショウ	6,500	1,439.00	9,353,500
コニシ	28,400	1,531.00	43,480,400
長谷川香料	29,800	2,107.00	62,788,600
星光P M C	9,900	779.00	7,712,100
小林製薬	48,400	9,720.00	470,448,000
荒川化学工業	14,400	1,189.00	17,121,600
メック	11,800	2,829.00	33,382,200
日本高純度化学	4,700	2,869.00	13,484,300

タカラバイオ	45,200	2,987.00	135,012,400
J C U	19,400	3,570.00	69,258,000
新田ゼラチン	10,800	644.00	6,955,200
O A T アグリオ	3,300	1,469.00	4,847,700
デクセリアルズ	48,300	2,232.00	107,805,600
アース製薬	13,000	6,300.00	81,900,000
北興化学工業	16,100	915.00	14,731,500
大成ラミック	5,300	2,746.00	14,553,800
クミアイ化学工業	71,400	829.00	59,190,600
日本農薬	30,800	522.00	16,077,600
アキレス	11,900	1,388.00	16,517,200
有沢製作所	24,000	911.00	21,864,000
日東電工	104,400	8,490.00	886,356,000
レック	20,500	1,102.00	22,591,000
三光合成	18,100	412.00	7,457,200
きもと	26,400	256.00	6,758,400
藤森工業	15,500	4,125.00	63,937,500
前澤化成工業	11,000	1,234.00	13,574,000
未来工業	6,200	1,729.00	10,719,800
ウェーブロックホールディングス	6,000	709.00	4,254,000
J S P	10,100	1,665.00	16,816,500
エフピコ	31,800	4,215.00	134,037,000
天馬	12,900	2,411.00	31,101,900
信越ポリマー	26,600	1,058.00	28,142,800
東リ	43,000	248.00	10,664,000
ニフコ	63,400	3,735.00	236,799,000
バルカー	14,000	2,075.00	29,050,000
ユニ・チャーム	366,300	4,323.00	1,583,514,900
ショーエイコーポレーション	3,800	964.00	3,663,200
協和キリン	173,800	3,310.00	575,278,000
武田薬品工業	1,437,400	3,719.00	5,345,690,600
アステラス製薬	1,497,900	1,797.50	2,692,475,250
大日本住友製薬	128,100	2,086.00	267,216,600
塩野義製薬	217,300	5,557.00	1,207,536,100
わかもと製薬	20,600	326.00	6,715,600
日本新薬	49,000	7,840.00	384,160,000
バイオフェルミン製薬	2,900	3,085.00	8,946,500
中外製薬	540,400	4,198.00	2,268,599,200
科研製薬	29,600	4,530.00	134,088,000
エーザイ	190,900	7,358.00	1,404,642,200
ロート製薬	82,300	2,700.00	222,210,000
小野薬品工業	396,700	2,477.00	982,625,900

久光製薬	50,200	6,000.00	301,200,000
持田製薬	24,000	3,570.00	85,680,000
参天製薬	300,600	1,463.00	439,777,800
扶桑薬品工業	5,600	2,204.00	12,342,400
日本ケミファ	2,100	2,327.00	4,886,700
ツムラ	57,600	3,450.00	198,720,000
日医工	48,900	873.00	42,689,700
キッセイ薬品工業	30,600	2,117.00	64,780,200
生化学工業	30,500	1,152.00	35,136,000
栄研化学	30,400	2,144.00	65,177,600
日水製薬	6,300	961.00	6,054,300
鳥居薬品	10,800	2,431.00	26,254,800
JCRファーマ	48,700	3,325.00	161,927,500
東和薬品	24,900	2,369.00	58,988,100
富士製薬工業	10,600	1,135.00	12,031,000
ゼリア新薬工業	31,300	2,092.00	65,479,600
第一三共	1,357,700	2,530.00	3,434,981,000
キョーリン製薬ホールディングス	38,100	1,709.00	65,112,900
大幸薬品	21,200	1,053.00	22,323,600
ダイト	11,000	3,280.00	36,080,000
大塚ホールディングス	359,100	4,516.00	1,621,695,600
大正製薬ホールディングス	41,100	6,220.00	255,642,000
ペプチドリーム	89,100	5,130.00	457,083,000
あすか製薬ホールディングス	19,700	1,050.00	20,685,000
サワイグループホールディングス	37,800	4,780.00	180,684,000
日本コークス工業	146,000	106.00	15,476,000
ニチレキ	20,400	1,336.00	27,254,400
ユシロ化学工業	9,700	1,164.00	11,290,800
ビーピー・カストロール	6,200	1,395.00	8,649,000
富士石油	41,900	270.00	11,313,000
MORESCO	6,200	1,090.00	6,758,000
出光興産	191,700	2,585.00	495,544,500
ENEOSホールディングス	2,599,000	452.50	1,176,047,500
コスモエネルギーホールディングス	54,600	2,281.00	124,542,600
横浜ゴム	100,000	2,206.00	220,600,000
TOYO TIRE	90,900	2,199.00	199,889,100
ブリヂストン	459,400	4,806.00	2,207,876,400
住友ゴム工業	155,200	1,416.00	219,763,200
藤倉コンポジット	15,100	498.00	7,519,800
オカモト	10,500	4,075.00	42,787,500
フコク	7,600	924.00	7,022,400
ニッタ	17,900	2,582.00	46,217,800

住友理工	33,500	670.00	22,445,000
三ツ星ベルト	21,000	1,754.00	36,834,000
バンドー化学	30,400	831.00	25,262,400
日東紡績	25,700	3,450.00	88,665,000
A G C	158,600	4,780.00	758,108,000
日本板硝子	87,700	607.00	53,233,900
石塚硝子	2,900	1,943.00	5,634,700
日本山村硝子	7,300	933.00	6,810,900
日本電気硝子	64,100	2,622.00	168,070,200
オハラ	6,900	1,563.00	10,784,700
住友大阪セメント	31,100	3,030.00	94,233,000
太平洋セメント	102,300	2,521.00	257,898,300
日本ヒューム	15,900	730.00	11,607,000
日本コンクリート工業	37,600	340.00	12,784,000
三谷セキサン	8,100	3,975.00	32,197,500
アジアパイルホールディングス	26,800	489.00	13,105,200
東海カーボン	169,000	1,614.00	272,766,000
日本カーボン	9,600	4,300.00	41,280,000
東洋炭素	10,200	2,443.00	24,918,600
ノリタケカンパニーリミテド	9,600	4,185.00	40,176,000
T O T O	123,400	5,900.00	728,060,000
日本碍子	190,200	1,918.00	364,803,600
日本特殊陶業	131,500	1,724.00	226,706,000
M A R U W A	6,000	10,760.00	64,560,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,630.00	14,883,000
黒崎播磨	3,000	4,475.00	13,425,000
ヨータイ	12,500	1,125.00	14,062,500
イソライト工業	7,800	603.00	4,703,400
東京窯業	22,400	317.00	7,100,800
ニッカトー	8,000	694.00	5,552,000
フジミインコーポレーテッド	13,900	5,020.00	69,778,000
クニミネ工業	5,500	1,168.00	6,424,000
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,020.00	3,366,000
ニチアス	43,700	2,723.00	118,995,100
ニチハ	24,100	2,903.00	69,962,300
日本製鉄	815,600	2,055.00	1,676,058,000
神戸製鋼所	312,800	742.00	232,097,600
中山製鋼所	23,900	414.00	9,894,600
合同製鐵	9,300	1,676.00	15,586,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	494,400	1,458.00	720,835,200
東京製鐵	66,600	1,117.00	74,392,200
共英製鋼	19,300	1,417.00	27,348,100



大和工業	36,300	3,580.00	129,954,000
東京鐵鋼	6,600	1,560.00	10,296,000
大阪製鐵	9,100	1,129.00	10,273,900
淀川製鋼所	22,500	2,315.00	52,087,500
丸一鋼管	55,500	2,762.00	153,291,000
モリ工業	5,100	2,408.00	12,280,800
大同特殊鋼	28,000	5,410.00	151,480,000
日本高周波鋼業	6,500	413.00	2,684,500
日本冶金工業	13,300	2,257.00	30,018,100
山陽特殊製鋼	20,500	1,610.00	33,005,000
愛知製鋼	9,600	3,090.00	29,664,000
日立金属	161,100	2,121.00	341,693,100
日本金属	4,300	977.00	4,201,100
大平洋金属	11,600	1,942.00	22,527,200
新日本電工	110,500	318.00	35,139,000
栗本鐵工所	7,800	1,686.00	13,150,800
虹技	2,400	1,218.00	2,923,200
三菱製鋼	12,700	871.00	11,061,700
日亜鋼業	25,300	296.00	7,488,800
日本精線	2,500	4,375.00	10,937,500
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,127.00	8,339,800
シンニッタン	21,000	249.00	5,229,000
新家工業	4,300	1,619.00	6,961,700
大紀アルミニウム工業所	25,900	1,198.00	31,028,200
日本輕金属ホールディングス	46,600	1,874.00	87,328,400
三井金属鋁業	46,100	3,235.00	149,133,500
東邦亜鉛	9,500	2,029.00	19,275,500
三菱マテリアル	112,900	2,320.00	261,928,000
住友金属鋁山	218,400	4,908.00	1,071,907,200
D O W Aホールディングス	43,300	4,535.00	196,365,500
古河機械金属	28,300	1,257.00	35,573,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,900	830.00	14,857,000
東邦チタニウム	30,700	947.00	29,072,900
U A C J	26,000	2,334.00	60,684,000
C Kサンエツ	3,600	3,610.00	12,996,000
古河電気工業	53,100	2,913.00	154,680,300
住友電気工業	596,300	1,676.50	999,696,950
フジクラ	206,300	468.00	96,548,400
昭和電線ホールディングス	16,600	1,696.00	28,153,600
東京特殊電線	2,200	2,511.00	5,524,200
タツタ電線	30,400	570.00	17,328,000
カナレ電気	2,900	1,814.00	5,260,600

平河ヒューテック	9,600	1,218.00	11,692,800
リョービ	21,100	1,586.00	33,464,600
アーレスティ	21,300	423.00	9,009,900
アサヒホールディングス	64,200	2,389.00	153,373,800
稲葉製作所	9,600	1,480.00	14,208,000
宮地エンジニアリンググループ	5,600	2,168.00	12,140,800
トーカロ	44,100	1,403.00	61,872,300
アルファC o	6,000	1,118.00	6,708,000
SUMCO	217,900	2,541.00	553,683,900
川田テクノロジーズ	3,500	3,850.00	13,475,000
RS Technologies	5,500	5,330.00	29,315,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,050.00	5,795,000
信和	9,100	769.00	6,997,900
東洋製罐グループホールディングス	108,800	1,500.00	163,200,000
ホッカンホールディングス	8,700	1,403.00	12,206,100
コロナ	9,400	931.00	8,751,400
横河ブリッジホールディングス	29,300	2,000.00	58,600,000
駒井ハルテック	3,500	1,724.00	6,034,000
高田機工	1,600	2,680.00	4,288,000
三和ホールディングス	161,100	1,326.00	213,618,600
文化シャッター	50,300	1,085.00	54,575,500
三協立山	22,000	787.00	17,314,000
アルインコ	11,300	996.00	11,254,800
東洋シャッター	3,800	664.00	2,523,200
LIXIL	235,300	2,877.00	676,958,100
日本フィルコン	11,900	498.00	5,926,200
ノーリツ	35,400	1,913.00	67,720,200
長府製作所	17,400	2,025.00	35,235,000
リンナイ	33,200	10,660.00	353,912,000
ダイニチ工業	8,200	797.00	6,535,400
日東精工	21,400	543.00	11,620,200
三洋工業	2,100	1,873.00	3,933,300
岡部	34,600	661.00	22,870,600
ジーテクト	21,200	1,500.00	31,800,000
東プレ	31,900	1,642.00	52,379,800
高周波熱錬	32,900	555.00	18,259,500
東京製綱	12,200	1,208.00	14,737,600
サンコール	14,600	455.00	6,643,000
モリテック スチール	13,300	514.00	6,836,200
パイオラックス	25,300	1,457.00	36,862,100
エイチワン	16,800	772.00	12,969,600
日本発條	170,200	876.00	149,095,200

中央発條	8,200	1,206.00	9,889,200
アドバネクス	2,500	1,344.00	3,360,000
立川ブラインド工業	7,500	1,314.00	9,855,000
三益半導体工業	13,300	2,562.00	34,074,600
日本ドライケミカル	4,300	1,705.00	7,331,500
日本製鋼所	51,900	2,842.00	147,499,800
三浦工業	74,000	5,030.00	372,220,000
タクマ	58,000	1,860.00	107,880,000
ツガミ	35,500	1,674.00	59,427,000
オークマ	20,000	5,660.00	113,200,000
芝浦機械	17,800	2,499.00	44,482,200
アマダ	250,600	1,164.00	291,698,400
アイダエンジニアリング	45,000	870.00	39,150,000
滝澤鉄工所	5,000	1,124.00	5,620,000
F U J I	68,300	2,718.00	185,639,400
牧野フライス製作所	20,100	4,340.00	87,234,000
オーエスジー	84,400	1,751.00	147,784,400
ダイジェット工業	2,100	1,336.00	2,805,600
旭ダイヤモンド工業	45,300	515.00	23,329,500
D M G 森精機	108,200	1,890.00	204,498,000
ソディック	41,100	1,123.00	46,155,300
ディスコ	23,200	33,600.00	779,520,000
日東工器	8,200	1,869.00	15,325,800
日進工具	13,500	1,451.00	19,588,500
パンチ工業	14,400	575.00	8,280,000
富士ダイス	8,700	654.00	5,689,800
豊和工業	9,700	809.00	7,847,300
O K K	6,600	387.00	2,554,200
東洋機械金属	12,400	523.00	6,485,200
津田駒工業	3,300	884.00	2,917,200
エンシュウ	4,400	857.00	3,770,800
島精機製作所	25,100	2,118.00	53,161,800
オプトラン	21,500	2,709.00	58,243,500
N C ホールディングス	5,300	949.00	5,029,700
イワキポンプ	11,000	945.00	10,395,000
フリー	16,800	1,135.00	19,068,000
ヤマシンフィルタ	34,600	802.00	27,749,200
日阪製作所	21,200	808.00	17,129,600
やまびこ	33,200	1,219.00	40,470,800
平田機工	8,100	6,470.00	52,407,000
ペガサスミシン製造	17,500	490.00	8,575,000
マルマエ	7,100	1,904.00	13,518,400

タツモ	7,300	1,630.00	11,899,000
ナブテスコ	100,700	5,020.00	505,514,000
三井海洋開発	18,200	2,124.00	38,656,800
レオン自動機	16,800	1,273.00	21,386,400
S M C	50,600	65,520.00	3,315,312,000
ホソカワミクロン	6,000	6,030.00	36,180,000
ユニオンツール	6,400	3,725.00	23,840,000
オイレス工業	24,000	1,546.00	37,104,000
日精エー・エス・ビー機械	5,800	5,290.00	30,682,000
サトーホールディングス	22,500	2,561.00	57,622,500
技研製作所	15,100	4,470.00	67,497,000
日本エアーテック	5,700	1,294.00	7,375,800
カワタ	4,800	894.00	4,291,200
日精樹脂工業	13,300	1,237.00	16,452,100
オカダアイヨン	5,500	1,303.00	7,166,500
ワイエイシイホールディングス	6,800	1,014.00	6,895,200
小松製作所	782,800	3,203.00	2,507,308,400
住友重機械工業	99,000	3,385.00	335,115,000
日立建機	80,800	3,630.00	293,304,000
日工	26,100	702.00	18,322,200
巴工業	6,800	2,108.00	14,334,400
井関農機	17,400	1,363.00	23,716,200
T O W A	16,200	2,037.00	32,999,400
丸山製作所	3,600	1,807.00	6,505,200
北川鉄工所	7,900	1,678.00	13,256,200
ローツェ	7,600	9,900.00	75,240,000
タカキタ	6,200	637.00	3,949,400
クボタ	907,600	2,488.00	2,258,108,800
荏原実業	4,400	6,370.00	28,028,000
三菱化工機	5,600	2,726.00	15,265,600
月島機械	32,000	1,159.00	37,088,000
帝国電機製作所	12,100	1,254.00	15,173,400
新東工業	41,300	777.00	32,090,100
澁谷工業	15,200	3,295.00	50,084,000
アイチ コーポレーション	29,600	871.00	25,781,600
小森コーポレーション	44,100	793.00	34,971,300
鶴見製作所	13,400	1,728.00	23,155,200
住友精密工業	2,600	2,456.00	6,385,600
日本ギア工業	7,200	327.00	2,354,400
酒井重工業	3,100	2,046.00	6,342,600
荏原製作所	71,700	5,400.00	387,180,000
石井鐵工所	2,500	2,970.00	7,425,000

西島製作所	17,700	885.00	15,664,500
北越工業	17,900	1,131.00	20,244,900
ダイキン工業	220,100	21,605.00	4,755,260,500
オルガノ	5,600	6,400.00	35,840,000
トーヨーカネツ	6,600	2,372.00	15,655,200
栗田工業	93,500	5,030.00	470,305,000
椿本チエイン	24,700	3,075.00	75,952,500
大同工業	8,400	1,093.00	9,181,200
木村化工機	14,600	917.00	13,388,200
アネスト岩田	29,200	1,010.00	29,492,000
ダイフク	95,100	9,200.00	874,920,000
サムコ	4,300	3,180.00	13,674,000
加藤製作所	9,700	989.00	9,593,300
油研工業	3,000	1,734.00	5,202,000
タダノ	83,600	1,058.00	88,448,800
フジテック	59,500	2,408.00	143,276,000
C K D	40,100	2,606.00	104,500,600
キトー	14,600	1,695.00	24,747,000
平和	48,200	1,821.00	87,772,200
理想科学工業	12,700	1,729.00	21,958,300
S A N K Y O	41,100	2,668.00	109,654,800
日本金銭機械	19,300	559.00	10,788,700
マースグループホールディングス	11,000	1,601.00	17,611,000
フクシマガリレイ	11,900	4,220.00	50,218,000
オーイズミ	7,500	387.00	2,902,500
ダイコク電機	8,000	892.00	7,136,000
竹内製作所	28,900	2,898.00	83,752,200
アマノ	45,300	2,865.00	129,784,500
J U K I	24,000	770.00	18,480,000
蛇の目マシン工業	15,800	815.00	12,877,000
マックス	23,200	1,677.00	38,906,400
グローリー	44,400	2,248.00	99,811,200
新晃工業	16,100	1,904.00	30,654,400
大和冷機工業	27,800	1,054.00	29,301,200
セガサミーホールディングス	157,200	1,393.00	218,979,600
日本ピストンリング	6,400	1,184.00	7,577,600
リケン	8,000	2,450.00	19,600,000
T P R	23,300	1,456.00	33,924,800
ツバキ・ナカシマ	33,300	1,758.00	58,541,400
ホシザキ	54,400	9,730.00	529,312,000
大豊工業	14,200	892.00	12,666,400
日本精工	354,900	1,039.00	368,741,100

N T N	399,800	307.00	122,738,600
ジェイテクト	165,800	1,141.00	189,177,800
不二越	16,100	4,165.00	67,056,500
日本トムソン	47,500	612.00	29,070,000
T H K	107,700	3,560.00	383,412,000
ユーシン精機	11,600	826.00	9,581,600
前澤給装工業	12,100	1,095.00	13,249,500
イーグル工業	21,400	1,121.00	23,989,400
前澤工業	10,500	601.00	6,310,500
日本ピラー工業	17,500	1,934.00	33,845,000
キッツ	53,500	758.00	40,553,000
マキタ	225,300	5,280.00	1,189,584,000
日立造船	137,300	717.00	98,444,100
三菱重工業	271,500	3,315.00	900,022,500
I H I	116,200	2,662.00	309,324,400
スター精密	26,700	1,803.00	48,140,100
日清紡ホールディングス	105,700	904.00	95,552,800
イビデン	83,300	5,080.00	423,164,000
コニカミノルタ	352,200	598.00	210,615,600
ブラザー工業	211,400	2,287.00	483,471,800
ミネベアミツミ	298,200	2,980.00	888,636,000
日立製作所	830,700	5,736.00	4,764,895,200
東芝	341,900	4,595.00	1,571,030,500
三菱電機	1,727,600	1,692.00	2,923,099,200
富士電機	104,100	5,130.00	534,033,000
東洋電機製造	7,000	1,176.00	8,232,000
安川電機	186,000	5,310.00	987,660,000
シンフォニアテクノロジー	22,500	1,278.00	28,755,000
明電舎	29,400	2,254.00	66,267,600
オリジン	4,900	1,332.00	6,526,800
山洋電気	8,500	7,640.00	64,940,000
デンヨー	14,800	2,026.00	29,984,800
東芝テック	18,600	4,235.00	78,771,000
芝浦メカトロニクス	3,200	6,480.00	20,736,000
マブチモーター	48,100	4,315.00	207,551,500
日本電産	415,900	12,530.00	5,211,227,000
トレックス・セミコンダクター	9,800	2,209.00	21,648,200
東光高岳	9,500	1,426.00	13,547,000
ダイヘン	18,900	4,975.00	94,027,500
ヤーマン	28,900	1,492.00	43,118,800
J V C ケンウッド	154,100	232.00	35,751,200
ミマキエンジニアリング	17,000	679.00	11,543,000

I - P E X	8,500	2,430.00	20,655,000
日新電機	40,600	1,289.00	52,333,400
大崎電気工業	34,600	598.00	20,690,800
オムロン	143,800	8,620.00	1,239,556,000
日東工業	25,400	1,774.00	45,059,600
I D E C	23,200	2,044.00	47,420,800
正興電機製作所	6,100	1,658.00	10,113,800
不二電機工業	3,700	1,285.00	4,754,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62,400	3,095.00	193,128,000
サクサホールディングス	4,200	1,395.00	5,859,000
メルコホールディングス	6,200	4,730.00	29,326,000
テクノメディカ	4,500	1,612.00	7,254,000
日本電気	219,500	5,110.00	1,121,645,000
富士通	155,500	17,785.00	2,765,567,500
沖電気工業	70,300	978.00	68,753,400
岩崎通信機	7,600	939.00	7,136,400
電気興業	8,400	2,308.00	19,387,200
サンケン電気	20,200	5,340.00	107,868,000
ナカヨ	3,500	1,491.00	5,218,500
アイホン	9,900	2,062.00	20,413,800
ルネサスエレクトロニクス	744,700	1,114.00	829,595,800
セイコーエプソン	214,400	1,935.00	414,864,000
ワコム	126,600	666.00	84,315,600
アルバック	31,800	5,150.00	163,770,000
アクセル	8,300	902.00	7,486,600
E I Z O	14,700	4,710.00	69,237,000
日本信号	40,400	940.00	37,976,000
京三製作所	37,500	425.00	15,937,500
能美防災	23,400	2,053.00	48,040,200
ホーチキ	13,400	1,213.00	16,254,200
星和電機	10,400	555.00	5,772,000
エレコム	40,100	2,088.00	83,728,800
パナソニック	1,842,600	1,247.00	2,297,722,200
シャープ	229,800	1,998.00	459,140,400
アンリツ	103,900	2,091.00	217,254,900
富士通ゼネラル	52,800	2,691.00	142,084,800
ソニーグループ	1,082,300	10,785.00	11,672,605,500
T D K	83,500	13,940.00	1,163,990,000
帝国通信工業	8,600	1,166.00	10,027,600
タムラ製作所	62,400	558.00	34,819,200
アルプスアルパイン	142,000	1,177.00	167,134,000
池上通信機	5,500	820.00	4,510,000

鈴木	8,800	1,066.00	9,380,800
日本トリム	4,000	3,560.00	14,240,000
ローランド ディー・ジー・	10,700	2,105.00	22,523,500
フォスター電機	17,600	1,026.00	18,057,600
S M K	4,500	2,593.00	11,668,500
ヨコオ	13,900	2,301.00	31,983,900
ホシデン	48,200	1,011.00	48,730,200
ヒロセ電機	26,600	15,590.00	414,694,000
日本航空電子工業	39,700	1,933.00	76,740,100
T O A	20,600	880.00	18,128,000
マクセルホールディングス	35,200	1,241.00	43,683,200
古野電気	23,200	1,038.00	24,081,600
ユニデンホールディングス	4,500	2,430.00	10,935,000
スミダコーポレーション	15,700	1,032.00	16,202,400
アイコム	7,200	2,420.00	17,424,000
リオン	7,700	2,539.00	19,550,300
本多通信工業	15,600	480.00	7,488,000
横河電機	173,000	1,733.00	299,809,000
新電元工業	6,700	3,740.00	25,058,000
アズビル	116,900	4,385.00	512,606,500
東亜ディーケーケー	9,800	821.00	8,045,800
日本光電工業	71,700	3,100.00	222,270,000
チノー	5,600	1,464.00	8,198,400
共和電業	18,700	404.00	7,554,800
日本電子材料	7,200	2,050.00	14,760,000
堀場製作所	34,200	7,040.00	240,768,000
アドバンテスト	128,500	9,890.00	1,270,865,000
小野測器	9,200	542.00	4,986,400
エスベック	15,800	2,013.00	31,805,400
キーエンス	169,600	53,870.00	9,136,352,000
日置電機	8,500	5,120.00	43,520,000
シスメックス	134,900	11,160.00	1,505,484,000
日本マイクロニクス	30,700	1,545.00	47,431,500
メガチップス	17,600	3,280.00	57,728,000
O B A R A G R O U P	8,100	3,810.00	30,861,000
澤藤電機	2,300	2,234.00	5,138,200
原田工業	8,200	890.00	7,298,000
コーセル	22,000	1,083.00	23,826,000
イリソ電子工業	14,700	4,625.00	67,987,500
オブテックスグループ	28,900	1,927.00	55,690,300
千代田インテグレ	7,800	1,831.00	14,281,800
アイ・オー・データ機器	7,300	1,091.00	7,964,300



レーザーテック	75,900	20,600.00	1,563,540,000
スタンレー電気	121,200	3,260.00	395,112,000
岩崎電気	7,000	1,727.00	12,089,000
ウシオ電機	89,200	1,579.00	140,846,800
岡谷電機産業	15,300	354.00	5,416,200
ハリオス テクノ ホールディング	18,900	344.00	6,501,600
エノモト	5,400	1,750.00	9,450,000
日本セラミック	17,900	2,806.00	50,227,400
遠藤照明	10,100	779.00	7,867,900
古河電池	13,000	1,562.00	20,306,000
双信電機	10,500	607.00	6,373,500
山一電機	11,900	1,670.00	19,873,000
図研	11,600	3,150.00	36,540,000
日本電子	31,600	5,620.00	177,592,000
カシオ計算機	139,000	1,905.00	264,795,000
ファナック	151,600	26,300.00	3,987,080,000
日本シイエムケイ	39,400	457.00	18,005,800
エンプラス	8,100	4,105.00	33,250,500
大真空	6,200	3,500.00	21,700,000
ローム	71,900	10,370.00	745,603,000
浜松ホトニクス	124,100	6,660.00	826,506,000
三井ハイテック	17,200	4,120.00	70,864,000
新光電気工業	58,300	3,570.00	208,131,000
京セラ	263,500	6,722.00	1,771,247,000
太陽誘電	77,000	5,270.00	405,790,000
村田製作所	507,600	8,279.00	4,202,420,400
双葉電子工業	30,800	835.00	25,718,000
北陸電気工業	7,600	1,035.00	7,866,000
ニチコン	55,300	1,152.00	63,705,600
日本ケミコン	17,400	2,564.00	44,613,600
K O A	24,600	1,608.00	39,556,800
市光工業	27,300	719.00	19,628,700
小糸製作所	103,600	7,110.00	736,596,000
ミツバ	31,800	918.00	29,192,400
S C R E E Nホールディングス	30,000	10,420.00	312,600,000
キャノン電子	16,500	1,701.00	28,066,500
キャノン	858,500	2,560.00	2,197,760,000
リコー	439,600	1,298.00	570,600,800
象印マホービン	47,400	1,670.00	79,158,000
M U T O Hホールディングス	2,900	1,591.00	4,613,900
東京エレクトロン	101,200	48,660.00	4,924,392,000
トヨタ紡織	50,400	2,113.00	106,495,200

芦森工業	3,300	1,040.00	3,432,000
ユニプレス	28,400	944.00	26,809,600
豊田自動織機	139,800	9,340.00	1,305,732,000
モリタホールディングス	27,700	1,538.00	42,602,600
三櫻工業	24,000	1,100.00	26,400,000
デンソー	380,400	7,503.00	2,854,141,200
東海理化電機製作所	45,500	1,759.00	80,034,500
三井E & Sホールディングス	66,900	494.00	33,048,600
川崎重工業	134,400	2,632.00	353,740,800
名村造船所	51,900	167.00	8,667,300
日本車輛製造	6,300	2,188.00	13,784,400
三菱ロジスネクスト	22,900	1,020.00	23,358,000
近畿車輛	3,000	1,250.00	3,750,000
日産自動車	2,037,500	539.10	1,098,416,250
いすゞ自動車	458,700	1,443.00	661,904,100
トヨタ自動車	1,750,200	9,115.00	15,953,073,000
日野自動車	215,700	1,018.00	219,582,600
三菱自動車工業	639,500	304.00	194,408,000
エフテック	12,200	795.00	9,699,000
レシップホールディングス	6,800	586.00	3,984,800
G M B	3,200	918.00	2,937,600
ファルテック	3,100	770.00	2,387,000
武蔵精密工業	38,500	2,204.00	84,854,000
日産車体	25,300	709.00	17,937,700
新明和工業	48,800	972.00	47,433,600
極東開発工業	29,800	1,730.00	51,554,000
トピー工業	14,300	1,328.00	18,990,400
ティラド	5,400	2,686.00	14,504,400
曙ブレーキ工業	94,800	174.00	16,495,200
タチエス	26,500	1,279.00	33,893,500
N O K	83,600	1,345.00	112,442,000
フタバ産業	43,400	498.00	21,613,200
K Y B	19,300	3,825.00	73,822,500
大同メタル工業	35,800	574.00	20,549,200
プレス工業	85,900	323.00	27,745,700
ミクニ	22,200	284.00	6,304,800
太平洋工業	36,300	1,183.00	42,942,900
河西工業	23,500	395.00	9,282,500
アイシン	126,500	4,800.00	607,200,000
マツダ	542,200	935.00	506,957,000
今仙電機製作所	15,200	698.00	10,609,600
本田技研工業	1,360,300	3,353.00	4,561,085,900

スズキ	342,400	4,743.00	1,624,003,200
S U B A R U	495,100	2,130.50	1,054,810,550
安永	8,400	1,145.00	9,618,000
ヤマハ発動機	244,100	3,195.00	779,899,500
T B K	20,700	415.00	8,590,500
エクセディ	23,500	1,605.00	37,717,500
豊田合成	55,800	2,788.00	155,570,400
愛三工業	27,200	791.00	21,515,200
盟和産業	2,700	948.00	2,559,600
日本プラスト	14,700	692.00	10,172,400
ヨロズ	14,900	1,218.00	18,148,200
エフ・シー・シー	28,300	1,699.00	48,081,700
シマノ	64,700	24,800.00	1,604,560,000
テイ・エス テック	80,300	1,569.00	125,990,700
ジャムコ	10,100	1,002.00	10,120,200
テルモ	529,600	4,217.00	2,233,323,200
クリエートメディック	5,700	1,008.00	5,745,600
日機装	55,800	1,195.00	66,681,000
日本エム・ディ・エム	10,000	2,016.00	20,160,000
島津製作所	222,300	3,835.00	852,520,500
J M S	14,600	869.00	12,687,400
長野計器	12,500	1,197.00	14,962,500
ブイ・テクノロジー	8,100	5,260.00	42,606,000
東京計器	11,000	1,054.00	11,594,000
愛知時計電機	2,300	4,290.00	9,867,000
インターアクション	8,700	2,333.00	20,297,100
オーバル	15,600	285.00	4,446,000
東京精密	29,100	5,440.00	158,304,000
マニー	68,800	2,409.00	165,739,200
ニコン	263,900	1,122.00	296,095,800
トプコン	87,000	1,717.00	149,379,000
オリンパス	955,900	2,351.00	2,247,320,900
理研計器	15,200	2,755.00	41,876,000
タムロン	13,900	2,442.00	33,943,800
H O Y A	340,000	14,350.00	4,879,000,000
シード	6,800	768.00	5,222,400
ノーリツ鋼機	15,500	2,279.00	35,324,500
エー・アンド・デイ	14,600	1,037.00	15,140,200
朝日インテック	181,900	2,708.00	492,585,200
シチズン時計	219,300	431.00	94,518,300
リズム	5,500	824.00	4,532,000
大研医器	13,700	555.00	7,603,500

メニコン	26,600	6,840.00	181,944,000
シンシア	1,900	648.00	1,231,200
松風	7,900	1,859.00	14,686,100
セイコーホールディングス	24,500	2,139.00	52,405,500
ニプロ	128,800	1,332.00	171,561,600
中本パックス	4,400	1,600.00	7,040,000
スノーピーク	10,200	3,520.00	35,904,000
パラマウントベッドホールディングス	33,100	2,005.00	66,365,500
トランザクション	9,500	1,365.00	12,967,500
粧美堂	5,000	422.00	2,110,000
ニホンフラッシュ	14,800	1,259.00	18,633,200
前田工織	19,000	3,425.00	65,075,000
永大産業	22,600	303.00	6,847,800
アートネイチャー	16,600	644.00	10,690,400
バンダイナムコホールディングス	142,900	7,841.00	1,120,478,900
アイフィスジャパン	4,400	719.00	3,163,600
共立印刷	28,900	141.00	4,074,900
SHOEI	16,200	3,935.00	63,747,000
フランスベッドホールディングス	22,200	925.00	20,535,000
パイロットコーポレーション	29,200	3,415.00	99,718,000
萩原工業	9,600	1,431.00	13,737,600
トッパン・フォームズ	30,800	1,098.00	33,818,400
フジシールインターナショナル	35,500	2,369.00	84,099,500
タカラトミー	77,500	952.00	73,780,000
廣済堂	12,000	1,118.00	13,416,000
エステールホールディングス	4,600	641.00	2,948,600
タカノ	5,900	624.00	3,681,600
プロネクサス	13,900	1,030.00	14,317,000
ホクシン	10,700	175.00	1,872,500
ウッドワン	5,800	1,238.00	7,180,400
大建工業	11,600	1,944.00	22,550,400
凸版印刷	262,600	1,918.00	503,666,800
大日本印刷	208,700	2,359.00	492,323,300
共同印刷	5,300	2,806.00	14,871,800
NISSHA	35,500	1,525.00	54,137,500
光村印刷	1,500	1,709.00	2,563,500
TAKARA & COMPANY	8,500	1,716.00	14,586,000
アシックス	152,800	2,625.00	401,100,000
ツツミ	4,300	2,433.00	10,461,900
ローランド	13,400	6,380.00	85,492,000
小松ウオール工業	5,300	1,924.00	10,197,200
ヤマハ	102,700	6,570.00	674,739,000

河合楽器製作所	4,800	3,785.00	18,168,000
クリナップ	16,100	522.00	8,404,200
ピジョン	110,900	3,085.00	342,126,500
オリバー	3,700	3,155.00	11,673,500
兼松サステック	1,100	1,762.00	1,938,200
キングジム	14,300	942.00	13,470,600
リンテック	37,000	2,418.00	89,466,000
イトーキ	34,300	359.00	12,313,700
任天堂	98,900	67,700.00	6,695,530,000
三菱鉛筆	28,400	1,437.00	40,810,800
タカラスタンダード	35,700	1,600.00	57,120,000
コクヨ	82,900	1,695.00	140,515,500
ナカバヤシ	17,000	602.00	10,234,000
グローブライド	8,400	4,140.00	34,776,000
オカムラ	59,400	1,402.00	83,278,800
美津濃	17,100	2,245.00	38,389,500
東京電力ホールディングス	1,465,400	339.00	496,770,600
中部電力	528,500	1,311.00	692,863,500
関西電力	654,600	1,038.00	679,474,800
中国電力	249,200	1,064.00	265,148,800
北陸電力	157,900	625.00	98,687,500
東北電力	404,600	890.00	360,094,000
四国電力	143,600	736.00	105,689,600
九州電力	381,500	885.00	337,627,500
北海道電力	161,700	500.00	80,850,000
沖縄電力	33,600	1,400.00	47,040,000
電源開発	137,500	1,550.00	213,125,000
エフオン	10,400	1,012.00	10,524,800
イーレックス	25,400	1,843.00	46,812,200
レノバ	29,300	3,640.00	106,652,000
東京瓦斯	332,200	2,166.50	719,711,300
大阪瓦斯	312,900	2,062.00	645,199,800
東邦瓦斯	85,000	6,000.00	510,000,000
北海道瓦斯	9,300	1,537.00	14,294,100
広島ガス	35,600	371.00	13,207,600
西部ガスホールディングス	19,400	2,450.00	47,530,000
静岡ガス	49,000	1,045.00	51,205,000
メタウォーター	19,400	2,016.00	39,110,400
SBSホールディングス	12,800	3,100.00	39,680,000
東武鉄道	180,100	2,787.00	501,938,700
相鉄ホールディングス	59,200	2,126.00	125,859,200
東急	435,700	1,466.00	638,736,200

京浜急行電鉄	221,900	1,412.00	313,322,800
小田急電鉄	276,700	2,827.00	782,230,900
京王電鉄	96,500	6,800.00	656,200,000
京成電鉄	129,500	3,375.00	437,062,500
富士急行	23,600	5,110.00	120,596,000
新京成電鉄	4,400	2,147.00	9,446,800
東日本旅客鉄道	304,100	7,650.00	2,326,365,000
西日本旅客鉄道	153,900	6,230.00	958,797,000
東海旅客鉄道	143,600	16,265.00	2,335,654,000
西武ホールディングス	208,200	1,266.00	263,581,200
鴻池運輸	27,500	1,127.00	30,992,500
西日本鉄道	47,900	2,724.00	130,479,600
ハマキョウレックス	13,300	3,030.00	40,299,000
サカイ引越センター	7,900	5,580.00	44,082,000
近鉄グループホールディングス	163,600	3,860.00	631,496,000
阪急阪神ホールディングス	218,200	3,420.00	746,244,000
南海電気鉄道	77,600	2,343.00	181,816,800
京阪ホールディングス	72,900	3,465.00	252,598,500
神戸電鉄	3,900	3,470.00	13,533,000
名古屋鉄道	134,500	2,100.00	282,450,000
山陽電気鉄道	11,700	1,880.00	21,996,000
アルプス物流	11,400	935.00	10,659,000
日本通運	56,600	8,770.00	496,382,000
ヤマトホールディングス	229,300	3,010.00	690,193,000
山九	42,000	4,745.00	199,290,000
丸運	9,300	261.00	2,427,300
丸全昭和運輸	13,300	3,525.00	46,882,500
センコーグループホールディングス	90,200	1,007.00	90,831,400
トナミホールディングス	3,900	4,970.00	19,383,000
ニッコンホールディングス	54,900	2,330.00	127,917,000
日本石油輸送	1,800	2,572.00	4,629,600
福山通運	20,900	4,060.00	84,854,000
セイノーホールディングス	122,500	1,540.00	188,650,000
エスライン	4,500	894.00	4,023,000
神奈川中央交通	4,100	3,635.00	14,903,500
日立物流	36,000	3,490.00	125,640,000
丸和運輸機関	34,500	1,535.00	52,957,500
C & F ロジホールディングス	16,500	1,646.00	27,159,000
九州旅客鉄道	126,600	2,497.00	316,120,200
S Gホールディングス	309,100	2,446.00	756,058,600
日本郵船	137,200	4,515.00	619,458,000
商船三井	97,400	4,395.00	428,073,000

川崎汽船	50,400	2,954.00	148,881,600
N Sユナイテッド海運	8,400	2,112.00	17,740,800
飯野海運	79,400	435.00	34,539,000
共栄タンカー	4,700	850.00	3,995,000
乾汽船	11,200	1,114.00	12,476,800
日本航空	398,600	2,499.00	996,101,400
A N Aホールディングス	441,600	2,655.00	1,172,448,000
パスコ	3,200	1,474.00	4,716,800
トランコム	5,000	8,410.00	42,050,000
日新	13,000	1,444.00	18,772,000
三菱倉庫	56,600	3,300.00	186,780,000
三井倉庫ホールディングス	17,400	2,284.00	39,741,600
住友倉庫	57,800	1,469.00	84,908,200
澁澤倉庫	9,000	2,066.00	18,594,000
東陽倉庫	27,400	324.00	8,877,600
日本トランスシティ	36,000	513.00	18,468,000
ケイヒン	3,200	1,363.00	4,361,600
中央倉庫	10,000	1,106.00	11,060,000
川西倉庫	3,000	1,145.00	3,435,000
安田倉庫	13,400	935.00	12,529,000
ファイズホールディングス	2,900	849.00	2,462,100
東洋埠頭	5,000	1,511.00	7,555,000
宇徳	11,700	499.00	5,838,300
上組	90,000	2,168.00	195,120,000
サンリツ	4,200	741.00	3,112,200
キムラユニティー	4,400	1,310.00	5,764,000
キューソー流通システム	4,100	1,599.00	6,555,900
近鉄エクスプレス	30,900	2,480.00	76,632,000
東海運	9,300	306.00	2,845,800
エーアイティー	10,300	993.00	10,227,900
内外トランスライン	5,700	1,771.00	10,094,700
日本コンセプト	5,200	1,683.00	8,751,600
N E C ネットズエスアイ	56,300	1,751.00	98,581,300
クロスキャット	4,800	1,019.00	4,891,200
システナ	60,700	1,929.00	117,090,300
デジタルアーツ	9,900	8,040.00	79,596,000
日鉄ソリューションズ	24,700	3,195.00	78,916,500
キューブシステム	9,400	1,042.00	9,794,800
エイジア	2,800	2,096.00	5,868,800
コア	7,400	1,436.00	10,626,400
ラクーンホールディングス	12,100	2,687.00	32,512,700
ソリトンシステムズ	8,700	1,730.00	15,051,000

ソフトクリエイティブホールディングス	6,800	2,255.00	15,334,000
T I S	169,700	2,815.00	477,705,500
J N Sホールディングス	8,300	540.00	4,482,000
電算システム	6,500	2,927.00	19,025,500
グリー	104,600	565.00	59,099,000
G M Oペパボ	1,500	5,290.00	7,935,000
コーエーテクモホールディングス	45,100	5,190.00	234,069,000
三菱総合研究所	7,400	3,900.00	28,860,000
電算	2,000	2,441.00	4,882,000
A G S	9,100	846.00	7,698,600
ファインデックス	14,600	1,056.00	15,417,600
ブレインパッド	4,500	4,820.00	21,690,000
K L a b	31,100	681.00	21,179,100
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	22,900	1,071.00	24,525,900
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	2,600.00	7,540,000
ネクソン	429,100	2,584.00	1,108,794,400
アイスタイル	52,400	516.00	27,038,400
エムアップホールディングス	4,500	2,705.00	12,172,500
エイチーム	11,900	1,664.00	19,801,600
エニグモ	16,300	1,324.00	21,581,200
テクノスジャパン	13,800	601.00	8,293,800
コロプラ	56,200	795.00	44,679,000
ブロードリーフ	84,700	524.00	44,382,800
クロス・マーケティンググループ	8,200	690.00	5,658,000
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,460.00	11,680,000
システム情報	13,100	913.00	11,960,300
メディアドゥ	6,700	5,590.00	37,453,000
じげん	42,900	399.00	17,117,100
ブイキューブ	9,400	2,413.00	22,682,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	637.00	2,293,200
サイバーリンクス	5,800	1,633.00	9,471,400
フィックスターズ	18,500	860.00	15,910,000
C A R T A H O L D I N G S	7,100	1,606.00	11,402,600
オブティム	12,000	2,442.00	29,304,000
セレス	5,700	3,720.00	21,204,000
S H I F T	8,500	15,490.00	131,665,000
ティーガイア	18,200	1,866.00	33,961,200
セック	2,600	2,635.00	6,851,000
日本アジアグループ	16,400	943.00	15,465,200
テクマトリックス	26,500	1,740.00	46,110,000
プロシップ	5,200	1,310.00	6,812,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,000	2,044.00	83,804,000



GMOペイメントゲートウェイ	32,500	13,140.00	427,050,000
ザッパラス	7,300	551.00	4,022,300
システムリサーチ	5,100	2,056.00	10,485,600
インターネットイニシアティブ	45,300	3,015.00	136,579,500
さくらインターネット	18,800	620.00	11,656,000
ヴィンクス	5,200	982.00	5,106,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,800	5,080.00	19,304,000
SRAホールディングス	9,100	2,597.00	23,632,700
システムインテグレータ	5,400	626.00	3,380,400
朝日ネット	14,300	701.00	10,024,300
eBASE	20,700	868.00	17,967,600
アバント	18,400	1,501.00	27,618,400
アドソル日進	6,200	2,413.00	14,960,600
ODKソリューションズ	4,000	869.00	3,476,000
フリービット	10,500	896.00	9,408,000
コムチュア	15,700	2,286.00	35,890,200
サイバーコム	3,300	1,501.00	4,953,300
アステリア	12,700	823.00	10,452,100
アイル	9,600	1,556.00	14,937,600
マークライنز	7,200	2,946.00	21,211,200
メディカル・データ・ビジョン	19,500	2,020.00	39,390,000
gumi	23,800	1,140.00	27,132,000
ショーケース	4,200	757.00	3,179,400
モバイルファクトリー	4,100	1,268.00	5,198,800
テラスカイ	5,600	2,511.00	14,061,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	2,080.00	16,016,000
PCIホールディングス	6,700	1,270.00	8,509,000
パイプドHD	3,700	1,572.00	5,816,400
アイビーシー	3,100	998.00	3,093,800
ネオジャパン	3,400	1,668.00	5,671,200
PR TIMES	3,700	3,250.00	12,025,000
ラクス	51,200	2,026.00	103,731,200
ランドコンピュータ	2,900	1,056.00	3,062,400
ダブルスタンダード	2,300	4,855.00	11,166,500
オープンドア	10,200	2,634.00	26,866,800
マイネット	5,500	737.00	4,053,500
アカツキ	6,900	3,510.00	24,219,000
ベネフィットジャパン	1,500	2,032.00	3,048,000
Ubicomホールディングス	4,600	3,105.00	14,283,000
カナミックネットワーク	18,700	660.00	12,342,000
ノムラシステムコーポレーション	8,700	294.00	2,557,800
チェンジ	31,300	2,966.00	92,835,800

シンクロ・フード	11,100	380.00	4,218,000
オークネット	9,200	1,372.00	12,622,400
キャピタル・アセット・プランニング	3,700	1,066.00	3,944,200
セグエグループ	4,700	1,153.00	5,419,100
エイトレッド	3,400	2,239.00	7,612,600
A O I T Y O H o l d i n g s	17,600	898.00	15,804,800
マクロミル	35,100	852.00	29,905,200
ビーグリー	3,600	1,289.00	4,640,400
オロ	5,500	3,565.00	19,607,500
ユーザーローカル	2,600	4,100.00	10,660,000
テモナ	4,000	1,022.00	4,088,000
ニーズウェル	4,100	615.00	2,521,500
サインポスト	4,100	900.00	3,690,000
ソルクシーズ	6,900	982.00	6,775,800
フェイス	5,600	846.00	4,737,600
プロトコーポレーション	20,600	1,163.00	23,957,800
ハイマックス	5,200	1,065.00	5,538,000
野村総合研究所	294,600	3,490.00	1,028,154,000
サイバネットシステム	12,500	804.00	10,050,000
C E ホールディングス	9,700	540.00	5,238,000
日本システム技術	3,300	1,539.00	5,078,700
インテージホールディングス	21,400	1,549.00	33,148,600
東邦システムサイエンス	4,900	925.00	4,532,500
ソースネクスト	81,700	294.00	24,019,800
インフォコム	15,600	2,541.00	39,639,600
H E R O Z	5,000	2,442.00	12,210,000
ラクスル	18,500	4,705.00	87,042,500
I P S	4,100	2,730.00	11,193,000
F I G	19,700	288.00	5,673,600
システムサポート	5,300	1,345.00	7,128,500
イーソル	9,500	1,141.00	10,839,500
アルテリア・ネットワークス	19,000	1,586.00	30,134,000
E d u L a b	1,700	5,560.00	9,452,000
東海ソフト	2,900	1,310.00	3,799,000
ウイングアーク1st	9,000	2,397.00	21,573,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,000	2,038.00	8,152,000
サーバーワークス	1,700	3,800.00	6,460,000
東名	1,900	1,067.00	2,027,300
ヴィッツ	1,800	1,918.00	3,452,400
トビラシステムズ	2,500	1,302.00	3,255,000
S a n s a n	15,100	8,260.00	124,726,000
L i n k - U	3,400	1,105.00	3,757,000

ギフトィ	10,300	3,405.00	35,071,500
ベース	2,000	5,330.00	10,660,000
フォーカスシステムズ	11,800	882.00	10,407,600
クレスコ	11,300	1,679.00	18,972,700
フジ・メディア・ホールディングス	176,200	1,238.00	218,135,600
オービック	53,400	20,520.00	1,095,768,000
ジャストシステム	24,200	5,900.00	142,780,000
TDCソフト	15,200	1,018.00	15,473,600
Zホールディングス	2,329,700	514.60	1,198,863,620
トレンドマイクロ	90,600	5,550.00	502,830,000
IDホールディングス	6,700	1,336.00	8,951,200
日本オラクル	34,400	9,970.00	342,968,000
アルファシステムズ	4,600	3,600.00	16,560,000
フューチャー	20,600	2,025.00	41,715,000
CAC Holdings	11,300	1,425.00	16,102,500
SBテクノロジー	6,200	3,035.00	18,817,000
トーセ	5,100	819.00	4,176,900
オービックビジネスコンサルタント	17,300	5,990.00	103,627,000
伊藤忠テクノソリューションズ	77,300	3,450.00	266,685,000
アイティフォー	22,600	773.00	17,469,800
東計電算	2,600	4,555.00	11,843,000
エクスネット	3,000	1,022.00	3,066,000
大塚商会	91,800	5,860.00	537,948,000
サイボウズ	20,000	2,432.00	48,640,000
電通国際情報サービス	21,100	3,835.00	80,918,500
ACCESS	21,600	875.00	18,900,000
デジタルガレージ	28,100	4,485.00	126,028,500
EMシステムズ	28,400	828.00	23,515,200
ウェザーニューズ	5,200	5,320.00	27,664,000
CIJ	12,000	843.00	10,116,000
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,265.00	5,877,000
日本エンタープライズ	19,000	216.00	4,104,000
WOWOW	8,300	2,325.00	19,297,500
スカラ	15,600	801.00	12,495,600
インテリジェント ウェイブ	10,500	673.00	7,066,500
IMAGICA GROUP	15,200	511.00	7,767,200
ネットワンシステムズ	69,300	3,325.00	230,422,500
システムソフト	37,500	153.00	5,737,500
アルゴグラフィックス	13,300	2,992.00	39,793,600
マーベラス	27,200	810.00	22,032,000
エイベックス	29,400	1,507.00	44,305,800
日本ユニシス	58,900	3,170.00	186,713,000

兼松エレクトロニクス	9,300	3,585.00	33,340,500
都築電気	7,800	1,877.00	14,640,600
TBSホールディングス	112,700	1,837.00	207,029,900
日本テレビホールディングス	141,800	1,307.00	185,332,600
朝日放送グループホールディングス	17,400	709.00	12,336,600
テレビ朝日ホールディングス	52,600	1,875.00	98,625,000
スカパーJSAホールディングス	112,500	433.00	48,712,500
テレビ東京ホールディングス	12,300	2,138.00	26,297,400
日本BS放送	6,100	1,099.00	6,703,900
ビジョン	21,400	1,003.00	21,464,200
スマートバリュー	4,900	818.00	4,008,200
ワイヤレスゲート	7,800	425.00	3,315,000
コネクシオ	9,900	1,466.00	14,513,400
クロップス	3,500	842.00	2,947,000
日本電信電話	1,983,000	2,931.50	5,813,164,500
KDDI	1,359,600	3,717.00	5,053,633,200
ソフトバンク	1,540,900	1,406.50	2,167,275,850
光通信	20,000	21,780.00	435,600,000
エムティーアイ	17,000	701.00	11,917,000
GMOインターネット	60,100	2,957.00	177,715,700
ファイバーゲート	5,800	1,331.00	7,719,800
アйдママーケティングコミュニケーション	5,300	421.00	2,231,300
KADOKAWA	44,000	4,355.00	191,620,000
学研ホールディングス	24,200	1,332.00	32,234,400
ゼンリン	31,100	1,165.00	36,231,500
昭文社ホールディングス	7,600	475.00	3,610,000
インプレスホールディングス	14,000	216.00	3,024,000
アイネット	9,000	1,439.00	12,951,000
松竹	11,200	12,740.00	142,688,000
東宝	100,100	4,535.00	453,953,500
東映	5,600	22,700.00	127,120,000
エヌ・ティ・ティ・データ	451,600	1,780.00	803,848,000
ピー・シー・エー	2,600	4,205.00	10,933,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	1,793.00	10,758,000
DTS	35,300	2,543.00	89,767,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,400	5,850.00	423,540,000
シーイーシー	18,400	1,388.00	25,539,200
カブコン	145,400	3,600.00	523,440,000
アイ・エス・ビー	8,100	1,319.00	10,683,900
ジャステック	11,100	1,303.00	14,463,300
SCSK	39,200	6,350.00	248,920,000
日本システムウエア	5,800	2,277.00	13,206,600

アイネス	17,000	1,310.00	22,270,000	
T K C	28,800	3,400.00	97,920,000	
富士ソフト	18,100	5,480.00	99,188,000	
N S D	54,700	1,774.00	97,037,800	
コナミホールディングス	61,600	7,020.00	432,432,000	
福井コンピュータホールディングス	7,900	4,320.00	34,128,000	
J B C Cホールディングス	11,700	1,330.00	15,561,000	
ミロク情報サービス	17,000	1,599.00	27,183,000	
ソフトバンクグループ	1,345,200	8,256.00	11,105,971,200	
ハウスイ	1,400	958.00	1,341,200	
高千穂交易	6,600	1,149.00	7,583,400	
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,726.00	4,832,800	
伊藤忠食品	4,100	4,990.00	20,459,000	
エレマテック	13,600	1,228.00	16,700,800	
J A L U X	4,800	1,725.00	8,280,000	
あらた	13,500	4,230.00	57,105,000	
トーメンデバイス	2,200	3,950.00	8,690,000	
東京エレクトロン デバイス	5,600	6,080.00	34,048,000	
フィールズ	14,900	466.00	6,943,400	
双日	939,800	338.00	317,652,400	
アルフレッサ ホールディングス	176,500	1,692.00	298,638,000	
横浜冷凍	47,700	874.00	41,689,800	
ラサ商事	9,000	918.00	8,262,000	
アルコニックス	18,100	1,531.00	27,711,100	
神戸物産	117,400	2,764.00	324,493,600	
ハイパー	3,500	548.00	1,918,000	
あい ホールディングス	24,300	2,168.00	52,682,400	
ディーブイエックス	5,200	961.00	4,997,200	
ダイワボウホールディングス	77,500	1,709.00	132,447,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	40,600	2,426.00	98,495,600	
ラクト・ジャパン	7,400	2,690.00	19,906,000	
グリムス	5,100	1,818.00	9,271,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,600	713.00	21,104,800	
八洲電機	13,200	964.00	12,724,800	
メディアスホールディングス	9,700	1,099.00	10,660,300	
レスターホールディングス	17,700	1,819.00	32,196,300	
ジュテックホールディングス	3,900	1,035.00	4,036,500	
大光	6,600	677.00	4,468,200	
O C H Iホールディングス	5,000	1,285.00	6,425,000	
T O K A Iホールディングス	82,500	880.00	72,600,000	
黒谷	4,700	987.00	4,638,900	
C o m i n i x	3,000	746.00	2,238,000	

三洋貿易	17,200	1,269.00	21,826,800
ビューティガレージ	2,700	3,660.00	9,882,000
ウイン・パートナーズ	12,300	987.00	12,140,100
ミタチ産業	4,700	645.00	3,031,500
シップヘルスケアホールディングス	60,000	2,587.00	155,220,000
明治電機工業	5,900	1,378.00	8,130,200
デリカフーズホールディングス	6,700	639.00	4,281,300
スターティアホールディングス	3,300	1,460.00	4,818,000
コメダホールディングス	37,100	2,018.00	74,867,800
ピーバンドットコム	2,400	826.00	1,982,400
アセンテック	4,400	1,319.00	5,803,600
富士興産	5,200	1,247.00	6,484,400
協栄産業	1,900	1,375.00	2,612,500
小野建	15,300	1,300.00	19,890,000
南陽	3,500	1,896.00	6,636,000
佐島電機	10,600	777.00	8,236,200
エコートレーディング	3,600	615.00	2,214,000
伯東	10,400	1,563.00	16,255,200
コンドーテック	13,200	1,002.00	13,226,400
中山福	9,900	443.00	4,385,700
ナガイレーベン	22,600	2,574.00	58,172,400
三菱食品	18,700	2,874.00	53,743,800
松田産業	12,400	2,240.00	27,776,000
第一興商	33,800	4,275.00	144,495,000
メディバルホールディングス	170,500	2,094.00	357,027,000
S P K	7,300	1,348.00	9,840,400
萩原電気ホールディングス	6,300	2,398.00	15,107,400
アズワン	12,200	12,490.00	152,378,000
スズデン	5,900	1,442.00	8,507,800
尾家産業	5,000	1,198.00	5,990,000
シモジマ	10,400	1,081.00	11,242,400
ドウシシャ	16,100	1,663.00	26,774,300
小津産業	3,800	1,935.00	7,353,000
高速	9,000	1,420.00	12,780,000
たけびし	6,000	1,571.00	9,426,000
リックス	3,900	1,530.00	5,967,000
丸文	15,100	592.00	8,939,200
ハピネット	14,200	1,436.00	20,391,200
橋本総業ホールディングス	3,400	2,672.00	9,084,800
日本ライフライン	55,000	1,385.00	76,175,000
タカショー	11,100	787.00	8,735,700
マルカ	5,500	2,340.00	12,870,000

I D O M	57,400	605.00	34,727,000
進和	10,100	2,104.00	21,250,400
エスケイジャパン	4,200	436.00	1,831,200
ダイترون	7,200	1,959.00	14,104,800
シークス	21,700	1,562.00	33,895,400
田中商事	5,300	653.00	3,460,900
オーハシテクニカ	8,700	1,536.00	13,363,200
白銅	6,100	1,821.00	11,108,100
ダイコー通産	2,000	1,554.00	3,108,000
伊藤忠商事	1,190,100	3,249.00	3,866,634,900
丸紅	1,678,000	967.30	1,623,129,400
高島	2,700	1,723.00	4,652,100
長瀬産業	93,400	1,607.00	150,093,800
蝶理	10,900	1,716.00	18,704,400
豊田通商	170,900	4,905.00	838,264,500
三共生興	25,800	520.00	13,416,000
兼松	68,000	1,463.00	99,484,000
ツカモトコーポレーション	2,800	1,359.00	3,805,200
三井物産	1,357,400	2,414.00	3,276,763,600
日本紙パルプ商事	8,900	3,545.00	31,550,500
カメイ	22,200	1,153.00	25,596,600
東都水産	2,000	4,480.00	8,960,000
O U Gホールディングス	2,700	2,787.00	7,524,900
スターゼン	12,600	2,094.00	26,384,400
山善	66,500	964.00	64,106,000
椿本興業	3,100	3,435.00	10,648,500
住友商事	1,073,800	1,528.00	1,640,766,400
内田洋行	7,300	4,740.00	34,602,000
三菱商事	1,036,000	2,984.00	3,091,424,000
第一実業	7,700	4,280.00	32,956,000
キャノンマーケティングジャパン	42,200	2,556.00	107,863,200
西華産業	9,000	1,773.00	15,957,000
佐藤商事	14,100	1,112.00	15,679,200
菱洋エレクトロ	13,000	2,670.00	34,710,000
東京産業	15,500	605.00	9,377,500
ユアサ商事	17,400	3,005.00	52,287,000
神鋼商事	3,800	2,326.00	8,838,800
トルク	10,300	241.00	2,482,300
阪和興業	34,100	3,095.00	105,539,500
正栄食品工業	11,000	3,965.00	43,615,000
カナデン	13,800	1,080.00	14,904,000
菱電商事	12,300	1,590.00	19,557,000

フルサト工業	8,600	1,802.00	15,497,200
岩谷産業	40,800	6,460.00	263,568,000
ナイス	6,700	2,028.00	13,587,600
ニチモウ	2,700	2,067.00	5,580,900
極東貿易	4,900	2,170.00	10,633,000
イワキ	24,500	695.00	17,027,500
三愛石油	41,900	1,180.00	49,442,000
稲畑産業	40,900	1,710.00	69,939,000
G S I クレオス	8,400	1,019.00	8,559,600
明和産業	15,800	468.00	7,394,400
クワザワホールディングス	6,100	574.00	3,501,400
ヤマエ久野	12,400	1,129.00	13,999,600
ワキタ	33,500	1,112.00	37,252,000
東邦ホールディングス	54,600	1,715.00	93,639,000
サンゲツ	45,900	1,527.00	70,089,300
ミツウロコグループホールディングス	25,100	1,216.00	30,521,600
シナネンホールディングス	6,300	2,763.00	17,406,900
伊藤忠エネクス	37,700	1,005.00	37,888,500
サンリオ	47,800	1,812.00	86,613,600
サンワテクノス	11,200	1,218.00	13,641,600
リョーサン	18,800	2,024.00	38,051,200
新光商事	23,000	734.00	16,882,000
トーヨー	7,700	1,681.00	12,943,700
三信電気	9,100	2,135.00	19,428,500
東陽テクニカ	16,800	1,100.00	18,480,000
モスフードサービス	24,100	3,070.00	73,987,000
加賀電子	15,400	2,954.00	45,491,600
ソーダニッカ	16,300	580.00	9,454,000
立花エレテック	12,600	1,465.00	18,459,000
フォーバル	6,000	887.00	5,322,000
P A L T A C	27,300	5,780.00	157,794,000
三谷産業	22,500	392.00	8,820,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	2,790.00	10,881,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	2,007.00	3,010,500
コア商事ホールディングス	12,800	713.00	9,126,400
国際紙パルプ商事	36,400	247.00	8,990,800
ヤマタネ	7,300	1,496.00	10,920,800
丸紅建材リース	1,700	1,799.00	3,058,300
日鉄物産	12,100	4,300.00	52,030,000
泉州電業	4,800	3,345.00	16,056,000
トラスコ中山	39,000	2,754.00	107,406,000
オートバックスセブン	63,100	1,460.00	92,126,000



モリト	12,500	603.00	7,537,500
加藤産業	24,600	3,290.00	80,934,000
北恵	4,300	908.00	3,904,400
イノテック	9,600	1,320.00	12,672,000
イエローハット	32,200	1,934.00	62,274,800
J Kホールディングス	15,400	787.00	12,119,800
日伝	14,100	1,990.00	28,059,000
北沢産業	11,700	249.00	2,913,300
杉本商事	8,600	2,212.00	19,023,200
因幡電機産業	45,400	2,554.00	115,951,600
東テク	5,600	2,776.00	15,545,600
ミスミグループ本社	213,500	3,520.00	751,520,000
アルテック	12,600	354.00	4,460,400
タキヒヨー	5,700	1,809.00	10,311,300
蔵王産業	3,300	1,461.00	4,821,300
スズケン	72,100	3,460.00	249,466,000
ジェコス	11,800	875.00	10,325,000
グローセル	18,500	416.00	7,696,000
ローソン	43,100	4,930.00	212,483,000
サンエー	13,000	4,245.00	55,185,000
カワチ薬品	12,000	2,220.00	26,640,000
エービーシー・マート	26,600	6,250.00	166,250,000
ハードオフコーポレーション	8,000	760.00	6,080,000
アスクル	27,700	1,785.00	49,444,500
ゲオホールディングス	23,100	1,106.00	25,548,600
アダストリア	23,800	1,890.00	44,982,000
くら寿司	20,100	3,870.00	77,787,000
キャンドウ	8,300	1,963.00	16,292,900
アイケイ	5,400	765.00	4,131,000
パルグループホールディングス	15,100	1,589.00	23,993,900
エディオン	72,500	1,082.00	78,445,000
サーラコーポレーション	35,200	587.00	20,662,400
ワッツ	8,700	908.00	7,899,600
ハローズ	7,000	2,762.00	19,334,000
フジオフードグループ本社	14,300	1,317.00	18,833,100
あみやき亭	3,800	2,864.00	10,883,200
大黒天物産	5,500	7,590.00	41,745,000
ハニーズホールディングス	13,900	1,000.00	13,900,000
ファーマライズホールディングス	4,600	775.00	3,565,000
アルペン	13,200	2,686.00	35,455,200
ハブ	6,000	713.00	4,278,000
クオールホールディングス	23,200	1,483.00	34,405,600

ジーンズホールディングス	11,600	8,010.00	92,916,000
ビックカメラ	101,300	1,082.00	109,606,600
D C Mホールディングス	105,400	1,020.00	107,508,000
MonotaRO	242,100	2,542.00	615,418,200
東京一番フーズ	5,000	584.00	2,920,000
きちりホールディングス	4,500	588.00	2,646,000
アークランドサービスホールディングス	14,400	2,273.00	32,731,200
J.フロント リテイリング	203,500	1,076.00	218,966,000
ドトール・日レスホールディングス	27,200	1,631.00	44,363,200
マツモトキヨシホールディングス	70,400	4,725.00	332,640,000
ブロンコピリー	9,100	2,298.00	20,911,800
Z O Z O	100,400	3,705.00	371,982,000
トレジャー・ファクトリー	5,400	1,033.00	5,578,200
物語コーポレーション	9,100	6,600.00	60,060,000
ココカラファイン	15,200	7,940.00	120,688,000
三越伊勢丹ホールディングス	298,200	785.00	234,087,000
Hamee	4,600	1,494.00	6,872,400
マーケットエンタープライズ	1,400	1,083.00	1,516,200
ウエルシアホールディングス	90,100	3,345.00	301,384,500
クリエイトSDホールディングス	25,200	3,220.00	81,144,000
丸善CHIホールディングス	19,900	400.00	7,960,000
ミサワ	4,000	689.00	2,756,000
ティーライフ	2,600	1,431.00	3,720,600
チムニー	5,200	1,319.00	6,858,800
シュッピン	12,000	909.00	10,908,000
オイシックス・ラ・大地	22,500	3,100.00	69,750,000
ネクステージ	30,200	1,605.00	48,471,000
ジョイフル本田	50,100	1,307.00	65,480,700
鳥貴族ホールディングス	6,500	1,778.00	11,557,000
ホットランド	13,000	1,389.00	18,057,000
すかいらーくホールディングス	190,900	1,542.00	294,367,800
SFPホールディングス	8,300	1,320.00	10,956,000
綿半ホールディングス	13,100	1,221.00	15,995,100
ヨシックス	3,500	2,078.00	7,273,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49,800	1,078.00	53,684,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	1,350.00	12,285,000
B E E N O S	8,700	3,635.00	31,624,500
あさひ	12,900	1,402.00	18,085,800
日本調剤	10,600	1,598.00	16,938,800
コスモス薬品	17,200	15,230.00	261,956,000
トーエル	8,800	762.00	6,705,600
オンリー	3,800	455.00	1,729,000

セブン&アイ・ホールディングス	665,700	4,736.00	3,152,755,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	91,500	802.00	73,383,000	
ツルハホールディングス	37,100	13,300.00	493,430,000	
サンマルクホールディングス	13,700	1,543.00	21,139,100	
フェリシモ	4,100	1,333.00	5,465,300	
トリドールホールディングス	42,300	1,700.00	71,910,000	
TOKYO BASE	15,900	673.00	10,700,700	
ウイルプラスホールディングス	3,000	1,288.00	3,864,000	
JMホールディングス	11,600	2,064.00	23,942,400	
サツドラホールディングス	2,700	2,061.00	5,564,700	
アレンザホールディングス	13,300	1,203.00	15,999,900	
串カツ田中ホールディングス	4,700	1,830.00	8,601,000	
バロックジャパンリミテッド	12,300	782.00	9,618,600	
クスリのアオキホールディングス	17,000	7,680.00	130,560,000	
力の源ホールディングス	7,700	625.00	4,812,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	99,700	4,920.00	490,524,000	
メディカルシステムネットワーク	15,300	720.00	11,016,000	
はるやまホールディングス	8,500	667.00	5,669,500	
ノジマ	30,400	3,010.00	91,504,000	
カッパ・クリエイト	23,900	1,453.00	34,726,700	
ライトオン	12,700	671.00	8,521,700	
良品計画	196,000	2,079.00	407,484,000	
三城ホールディングス	22,500	267.00	6,007,500	
アドヴァン	17,700	939.00	16,620,300	
アルビス	5,600	2,287.00	12,807,200	
コナカ	20,000	342.00	6,840,000	
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,640.00	3,772,000	
G - 7ホールディングス	8,400	2,970.00	24,948,000	
イオン北海道	22,600	1,022.00	23,097,200	
コジマ	29,700	801.00	23,789,700	
ヒマラヤ	6,300	1,011.00	6,369,300	
コーナン商事	24,300	2,995.00	72,778,500	
エコス	6,500	1,851.00	12,031,500	
ワタミ	22,400	911.00	20,406,400	
マルシェ	4,500	485.00	2,182,500	
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	340,300	2,156.00	733,686,800	
西松屋チェーン	37,600	1,532.00	57,603,200	
ゼンショーホールディングス	91,500	2,729.00	249,703,500	
幸楽苑ホールディングス	10,800	1,569.00	16,945,200	
ハークスレイ	4,000	924.00	3,696,000	

サイゼリヤ	25,400	2,424.00	61,569,600
V Tホールディングス	64,900	463.00	30,048,700
魚力	5,500	1,959.00	10,774,500
フジ・コーポレーション	9,300	1,234.00	11,476,200
ユナイテッドアローズ	19,700	1,854.00	36,523,800
ハイデイ日高	24,800	1,726.00	42,804,800
京都きもの友禅	12,300	264.00	3,247,200
コロワイド	56,500	1,911.00	107,971,500
ピーシーデポコーポレーション	20,600	440.00	9,064,000
壱番屋	12,100	4,715.00	57,051,500
P L A N T	4,900	720.00	3,528,000
スギホールディングス	34,000	8,620.00	293,080,000
薬王堂ホールディングス	7,600	2,378.00	18,072,800
スクロール	24,700	902.00	22,279,400
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,844.00	29,319,600
木曽路	22,400	2,318.00	51,923,200
S R Sホールディングス	22,400	813.00	18,211,200
リテールパートナーズ	21,000	1,137.00	23,877,000
ケーヨー	31,700	730.00	23,141,000
上新電機	19,700	2,640.00	52,008,000
日本瓦斯	84,300	1,689.00	142,382,700
ロイヤルホールディングス	29,700	2,036.00	60,469,200
いなげや	19,100	1,477.00	28,210,700
チヨダ	18,200	873.00	15,888,600
ライフコーポレーション	17,100	3,365.00	57,541,500
リンガーハット	21,000	2,222.00	46,662,000
M r M a x H D	24,000	616.00	14,784,000
A O K Iホールディングス	34,600	637.00	22,040,200
オークワ	26,900	1,106.00	29,751,400
コメリ	26,400	2,585.00	68,244,000
青山商事	38,300	858.00	32,861,400
しまむら	19,800	10,420.00	206,316,000
はせがわ	10,300	294.00	3,028,200
高島屋	124,100	1,244.00	154,380,400
松屋	37,400	919.00	34,370,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	80,800	878.00	70,942,400
近鉄百貨店	6,600	3,085.00	20,361,000
丸井グループ	144,000	2,085.00	300,240,000
アクシアル リテイリング	14,200	3,900.00	55,380,000
イオン	654,800	2,932.00	1,919,873,600
イズミ	34,600	4,095.00	141,687,000
平和堂	31,500	2,329.00	73,363,500

フジ	20,600	2,038.00	41,982,800
ヤオコー	19,300	6,270.00	121,011,000
ゼビオホールディングス	21,000	941.00	19,761,000
ケーズホールディングス	145,100	1,300.00	188,630,000
Olympicグループ	9,300	764.00	7,105,200
日産東京販売ホールディングス	26,600	247.00	6,570,200
シルバーライフ	3,600	2,490.00	8,964,000
Genky DrugStores	7,600	3,330.00	25,308,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	1,134.00	4,082,400
ブックオフグループホールディングス	9,900	935.00	9,256,500
ギフト	2,300	2,295.00	5,278,500
アインホールディングス	24,800	6,720.00	166,656,000
元気寿司	4,900	2,626.00	12,867,400
ヤマダホールディングス	571,000	532.00	303,772,000
アークランドサカモト	26,900	1,466.00	39,435,400
ニトリホールディングス	67,500	18,965.00	1,280,137,500
グルメ杵屋	12,500	967.00	12,087,500
愛眼	13,600	229.00	3,114,400
ケーユーホールディングス	9,300	947.00	8,807,100
吉野家ホールディングス	56,100	2,007.00	112,592,700
松屋フーズホールディングス	8,300	3,450.00	28,635,000
サガミホールディングス	24,400	1,032.00	25,180,800
関西スーパーマーケット	13,200	980.00	12,936,000
王将フードサービス	11,300	5,550.00	62,715,000
プレナス	19,300	1,935.00	37,345,500
ミニストップ	12,700	1,348.00	17,119,600
アークス	32,600	2,388.00	77,848,800
パローホールディングス	34,900	2,223.00	77,582,700
ベルク	8,500	5,510.00	46,835,000
大庄	9,500	983.00	9,338,500
ファーストリテイリング	22,800	89,170.00	2,033,076,000
サンドラッグ	64,100	3,670.00	235,247,000
サックスパーホールディングス	15,100	614.00	9,271,400
ヤマザワ	4,200	1,700.00	7,140,000
やまや	3,500	2,278.00	7,973,000
ベルーナ	36,900	1,088.00	40,147,200
島根銀行	5,900	647.00	3,817,300
じもとホールディングス	11,500	655.00	7,532,500
めぶきフィナンシャルグループ	885,400	232.00	205,412,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,400	1,353.00	28,954,200
九州フィナンシャルグループ	348,000	410.00	142,680,000
ゆうちょ銀行	482,700	931.00	449,393,700

富山第一銀行	40,600	274.00	11,124,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,038,100	401.00	416,278,100
西日本フィナンシャルホールディングス	111,300	674.00	75,016,200
三十三フィナンシャルグループ	14,700	1,311.00	19,271,700
第四北越フィナンシャルグループ	27,700	2,369.00	65,621,300
ひろぎんホールディングス	251,300	586.00	147,261,800
新生銀行	138,900	1,700.00	236,130,000
あおぞら銀行	101,500	2,473.00	251,009,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,656,200	620.00	7,226,844,000
りそなホールディングス	1,966,400	467.20	918,702,080
三井住友トラスト・ホールディングス	322,100	3,771.00	1,214,639,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,179,200	3,951.00	4,659,019,200
千葉銀行	568,700	696.00	395,815,200
群馬銀行	350,700	352.00	123,446,400
武蔵野銀行	25,400	1,698.00	43,129,200
千葉興業銀行	43,400	263.00	11,414,200
筑波銀行	70,800	171.00	12,106,800
七十七銀行	53,500	1,324.00	70,834,000
青森銀行	13,200	2,169.00	28,630,800
秋田銀行	10,200	1,395.00	14,229,000
山形銀行	19,100	888.00	16,960,800
岩手銀行	11,200	1,804.00	20,204,800
東邦銀行	152,400	205.00	31,242,000
東北銀行	8,200	1,028.00	8,429,600
みちのく銀行	10,900	997.00	10,867,300
ふくおかフィナンシャルグループ	153,800	2,002.00	307,907,600
静岡銀行	415,000	867.00	359,805,000
十六銀行	21,400	1,980.00	42,372,000
スルガ銀行	149,400	354.00	52,887,600
八十二銀行	383,800	371.00	142,389,800
山梨中央銀行	19,800	814.00	16,117,200
大垣共立銀行	33,700	1,865.00	62,850,500
福井銀行	14,600	1,508.00	22,016,800
北國銀行	15,800	2,316.00	36,592,800
清水銀行	7,000	1,567.00	10,969,000
富山銀行	3,300	2,587.00	8,537,100
滋賀銀行	34,200	2,019.00	69,049,800
南都銀行	24,800	1,856.00	46,028,800
百五銀行	153,300	312.00	47,829,600
京都銀行	61,000	5,390.00	328,790,000
紀陽銀行	60,300	1,448.00	87,314,400
ほくほくフィナンシャルグループ	113,400	875.00	99,225,000

山陰合同銀行	107,400	524.00	56,277,600
中国銀行	146,600	858.00	125,782,800
鳥取銀行	5,400	1,126.00	6,080,400
伊予銀行	225,800	577.00	130,286,600
百十四銀行	18,100	1,452.00	26,281,200
四国銀行	24,200	688.00	16,649,600
阿波銀行	26,100	2,057.00	53,687,700
大分銀行	9,800	1,704.00	16,699,200
宮崎銀行	10,600	2,023.00	21,443,800
佐賀銀行	9,700	1,385.00	13,434,500
沖縄銀行	15,600	2,589.00	40,388,400
琉球銀行	37,000	701.00	25,937,000
セブン銀行	569,300	227.00	129,231,100
みずほフィナンシャルグループ	2,315,400	1,673.00	3,873,664,200
高知銀行	6,200	824.00	5,108,800
山口フィナンシャルグループ	212,700	639.00	135,915,300
長野銀行	5,600	1,126.00	6,305,600
名古屋銀行	13,700	2,651.00	36,318,700
北洋銀行	256,900	244.00	62,683,600
愛知銀行	5,700	2,787.00	15,885,900
中京銀行	6,100	1,473.00	8,985,300
大光銀行	5,800	1,369.00	7,940,200
愛媛銀行	23,800	818.00	19,468,400
トマト銀行	6,600	1,046.00	6,903,600
京葉銀行	72,700	411.00	29,879,700
栃木銀行	82,300	174.00	14,320,200
北日本銀行	5,300	1,722.00	9,126,600
東和銀行	29,900	551.00	16,474,900
福島銀行	19,500	221.00	4,309,500
大東銀行	8,200	606.00	4,969,200
トモニホールディングス	131,700	297.00	39,114,900
フィデアホールディングス	165,400	120.00	19,848,000
池田泉州ホールディングス	195,900	160.00	31,344,000
F P G	57,600	730.00	42,048,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,600	1,445.00	16,762,000
マーキュリアインベストメント	6,900	741.00	5,112,900
S B Iホールディングス	210,000	2,763.00	580,230,000
ジャフコ グループ	26,200	7,940.00	208,028,000
大和証券グループ本社	1,276,500	629.80	803,939,700
野村ホールディングス	2,602,000	601.00	1,563,802,000
岡三証券グループ	145,700	435.00	63,379,500
丸三証券	50,900	653.00	33,237,700

東洋証券	57,600	164.00	9,446,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	182,200	407.00	74,155,400
光世証券	4,400	661.00	2,908,400
水戸証券	46,200	301.00	13,906,200
いちよし証券	34,500	604.00	20,838,000
松井証券	83,700	833.00	69,722,100
マネックスグループ	153,100	816.00	124,929,600
極東証券	23,100	816.00	18,849,600
岩井コスモホールディングス	17,600	1,683.00	29,620,800
藍澤証券	30,800	1,090.00	33,572,000
マネーパートナーズグループ	19,100	236.00	4,507,600
スパークス・グループ	79,500	281.00	22,339,500
かんぽ生命保険	211,200	2,100.00	443,520,000
S O M P Oホールディングス	300,400	4,404.00	1,322,961,600
アニコム ホールディングス	47,900	963.00	46,127,700
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	413,800	3,343.00	1,383,333,400
第一生命ホールディングス	900,200	2,233.00	2,010,146,600
東京海上ホールディングス	561,200	5,179.00	2,906,454,800
T & Dホールディングス	509,300	1,490.00	758,857,000
アドバンスクリエイト	8,100	870.00	7,047,000
全国保証	44,400	4,505.00	200,022,000
イントラスト	5,200	683.00	3,551,600
日本モーゲージサービス	9,000	957.00	8,613,000
C a s a	5,000	954.00	4,770,000
アルヒ	25,300	1,570.00	39,721,000
プレミアグループ	8,000	3,240.00	25,920,000
クレディセゾン	99,700	1,349.00	134,495,300
芙蓉総合リース	17,900	7,260.00	129,954,000
みずほリース	26,400	3,460.00	91,344,000
東京センチュリー	39,600	6,440.00	255,024,000
日本証券金融	72,400	892.00	64,580,800
アイフル	286,700	361.00	103,498,700
リコーリース	13,500	3,385.00	45,697,500
イオンフィナンシャルサービス	104,500	1,273.00	133,028,500
アコム	343,000	489.00	167,727,000
ジャックス	18,900	2,506.00	47,363,400
オリエントコーポレーション	462,700	153.00	70,793,100
オリックス	1,034,600	1,931.50	1,998,329,900
三菱HCキャピタル	589,800	610.00	359,778,000
九州リースサービス	8,800	667.00	5,869,600
日本取引所グループ	460,400	2,530.00	1,164,812,000
イー・ギャランティ	19,700	2,129.00	41,941,300



アサックス	9,200	682.00	6,274,400
NECキャピタルソリューション	7,100	2,039.00	14,476,900
いちご	194,100	349.00	67,740,900
日本駐車場開発	196,800	152.00	29,913,600
スター・マイカ・ホールディングス	10,200	1,048.00	10,689,600
SREホールディングス	2,800	5,550.00	15,540,000
ADワークスグループ	34,200	162.00	5,540,400
ヒューリック	362,700	1,231.00	446,483,700
三栄建築設計	7,600	1,998.00	15,184,800
野村不動産ホールディングス	104,100	2,807.00	292,208,700
三重交通グループホールディングス	37,600	476.00	17,897,600
サムティ	25,000	1,928.00	48,200,000
ディア・ライフ	25,200	458.00	11,541,600
日本商業開発	11,600	1,805.00	20,938,000
プレサンスコーポレーション	28,900	1,668.00	48,205,200
ハウスコム	4,200	1,186.00	4,981,200
日本管理センター	10,400	1,249.00	12,989,600
サンセイランディック	6,800	862.00	5,861,600
フージャースホールディングス	27,800	735.00	20,433,000
オープンハウス	54,400	5,090.00	276,896,000
東急不動産ホールディングス	465,600	650.00	302,640,000
飯田グループホールディングス	142,600	2,916.00	415,821,600
イーランド	4,300	974.00	4,188,200
ムゲンエステート	13,500	507.00	6,844,500
ハウズドゥ	8,400	1,045.00	8,778,000
シーアールイー	5,500	1,492.00	8,206,000
グッドコムアセット	9,200	1,359.00	12,502,800
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,475.00	12,510,000
テンポイノベーション	6,600	855.00	5,643,000
フェイスネットワーク	2,500	1,328.00	3,320,000
パーク24	92,100	2,286.00	210,540,600
パラカ	5,300	1,611.00	8,538,300
三井不動産	777,200	2,549.50	1,981,471,400
三菱地所	1,120,200	1,773.50	1,986,674,700
平和不動産	29,500	4,145.00	122,277,500
東京建物	169,200	1,628.00	275,457,600
ダイビル	44,400	1,249.00	55,455,600
京阪神ビルディング	30,500	1,356.00	41,358,000
住友不動産	383,400	3,639.00	1,395,192,600
テーオーシー	35,500	705.00	25,027,500
東京楽天地	3,200	4,005.00	12,816,000
スターツコーポレーション	20,800	2,734.00	56,867,200

フジ住宅	22,200	621.00	13,786,200
空港施設	19,500	623.00	12,148,500
明和地所	10,500	613.00	6,436,500
ゴールドクレスト	16,200	1,736.00	28,123,200
エスリード	7,600	1,626.00	12,357,600
日神グループホールディングス	28,400	462.00	13,120,800
日本エスコン	30,900	765.00	23,638,500
タカラレーベン	71,400	343.00	24,490,200
A V A N T I A	10,500	888.00	9,324,000
イオンモール	86,300	1,779.00	153,527,700
毎日コムネット	8,000	697.00	5,576,000
ファースト住建	8,500	1,247.00	10,599,500
カチタス	42,700	3,055.00	130,448,500
トーセイ	24,900	1,040.00	25,896,000
穴吹興産	4,400	2,173.00	9,561,200
サンフロンティア不動産	22,600	922.00	20,837,200
エフ・ジェー・ネクスト	18,200	1,022.00	18,600,400
インテリックス	3,800	782.00	2,971,600
ランドビジネス	7,200	368.00	2,649,600
サンネクスタグループ	6,900	1,006.00	6,941,400
グランディハウス	15,100	425.00	6,417,500
日本空港ビルデング	59,500	4,875.00	290,062,500
明豊ファシリティワークス	7,900	832.00	6,572,800
日本工営	10,400	3,155.00	32,812,000
L I F U L L	51,200	367.00	18,790,400
ミクシィ	42,100	2,654.00	111,733,400
ジェイエシーリクルートメント	11,500	1,790.00	20,585,000
日本M&Aセンター	270,900	2,620.00	709,758,000
メンバーズ	5,000	2,895.00	14,475,000
中広	3,000	356.00	1,068,000
UTグループ	23,900	2,969.00	70,959,100
アイティメディア	5,700	1,742.00	9,929,400
タケエイ	18,600	1,289.00	23,975,400
E・Jホールディングス	8,900	1,067.00	9,496,300
夢真ビーネックスグループ	44,100	1,283.00	56,580,300
コシダカホールディングス	44,600	637.00	28,410,200
アルトナー	4,300	810.00	3,483,000
パソナグループ	18,000	1,898.00	34,164,000
C D S	4,300	1,501.00	6,454,300
リンクアンドモチベーション	30,300	551.00	16,695,300
G C A	21,900	884.00	19,359,600
エス・エム・エス	56,200	2,926.00	164,441,200

サニーサイドアップグループ	6,100	777.00	4,739,700
パーソルホールディングス	165,200	2,075.00	342,790,000
リニカル	9,700	733.00	7,110,100
クックパッド	52,900	256.00	13,542,400
アイ・ケイ・ケイ	8,400	676.00	5,678,400
学情	6,000	1,428.00	8,568,000
スタジオアリス	8,400	2,237.00	18,790,800
シミックホールディングス	9,300	1,504.00	13,987,200
エプコ	4,300	953.00	4,097,900
N J S	4,200	2,093.00	8,790,600
総合警備保障	65,700	5,010.00	329,157,000
カカクコム	122,000	3,335.00	406,870,000
アイロムグループ	5,900	2,068.00	12,201,200
セントケア・ホールディング	12,300	1,003.00	12,336,900
サイネックス	3,200	699.00	2,236,800
ルネサンス	10,600	1,212.00	12,847,200
ディップ	25,900	3,235.00	83,786,500
デジタルホールディングス	11,600	2,296.00	26,633,600
新日本科学	20,500	778.00	15,949,000
キャリアデザインセンター	4,400	1,098.00	4,831,200
ベネフィット・ワン	60,200	3,110.00	187,222,000
エムスリー	291,300	7,407.00	2,157,659,100
ツカダ・グローバルホールディング	13,100	387.00	5,069,700
アウトソーシング	94,700	2,021.00	191,388,700
ウェルネット	17,200	511.00	8,789,200
ワールドホールディングス	5,800	2,597.00	15,062,600
ディー・エヌ・エー	70,000	2,194.00	153,580,000
博報堂D Yホールディングス	229,900	1,813.00	416,808,700
ぐるなび	29,200	581.00	16,965,200
タカミヤ	20,500	511.00	10,475,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	696.00	7,795,200
ファンコミュニケーションズ	46,100	384.00	17,702,400
ライク	4,500	2,124.00	9,558,000
ビジネス・ブレークスルー	7,500	436.00	3,270,000
エスプール	42,700	856.00	36,551,200
W D Bホールディングス	7,600	2,550.00	19,380,000
手間いらず	2,100	6,550.00	13,755,000
ティア	10,200	472.00	4,814,400
C D G	1,700	1,586.00	2,696,200
アドウェイズ	27,100	881.00	23,875,100
バリューコマース	11,200	3,000.00	33,600,000
インフォマート	167,300	920.00	153,916,000

J Pホールディングス	48,100	289.00	13,900,900
エコナックホールディングス	32,900	89.00	2,928,100
E P Sホールディングス	25,000	1,798.00	44,950,000
レッグス	4,200	2,533.00	10,638,600
プレステージ・インターナショナル	62,300	686.00	42,737,800
アミューズ	9,100	2,180.00	19,838,000
ドリームインキュベータ	5,300	974.00	5,162,200
クイック	10,500	1,226.00	12,873,000
T A C	10,100	243.00	2,454,300
電通グループ	185,700	3,760.00	698,232,000
イオンファンタジー	6,500	2,176.00	14,144,000
シーティーエス	18,900	871.00	16,461,900
ネクシィーズグループ	6,100	929.00	5,666,900
H . U . グループホールディングス	46,300	2,945.00	136,353,500
アルプス技研	14,700	1,950.00	28,665,000
ダイオーズ	3,500	990.00	3,465,000
日本空調サービス	17,700	730.00	12,921,000
オリエンタルランド	175,600	16,310.00	2,864,036,000
ダスキン	38,400	2,551.00	97,958,400
明光ネットワークジャパン	19,900	577.00	11,482,300
ファルコホールディングス	8,000	1,739.00	13,912,000
ラウンドワン	56,500	1,496.00	84,524,000
リゾートトラスト	75,800	1,729.00	131,058,200
ビー・エム・エル	21,300	3,735.00	79,555,500
りらいあコミュニケーションズ	25,300	1,208.00	30,562,400
リソー教育	84,700	308.00	26,087,600
早稲田アカデミー	7,300	901.00	6,577,300
ユー・エス・エス	185,000	1,914.00	354,090,000
東京個別指導学院	15,000	593.00	8,895,000
サイバーエージェント	407,000	2,198.00	894,586,000
楽天グループ	770,700	1,255.00	967,228,500
クリーク・アンド・リバー社	8,800	1,481.00	13,032,800
モーニングスター	24,700	435.00	10,744,500
テー・オー・ダブリュー	29,700	335.00	9,949,500
山田コンサルティンググループ	9,800	1,172.00	11,485,600
セントラルスポーツ	6,300	2,479.00	15,617,700
フルキャストホールディングス	14,200	2,059.00	29,237,800
エン・ジャパン	29,400	3,835.00	112,749,000
リソルホールディングス	1,900	4,060.00	7,714,000
テクノプロ・ホールディングス	33,000	7,860.00	259,380,000
アトラグループ	3,800	338.00	1,284,400
インターワークス	5,400	408.00	2,203,200

アイ・アールジャパンホールディングス	6,700	13,800.00	92,460,000
K e e P e r 技研	10,700	2,308.00	24,695,600
ファーストロジック	3,600	723.00	2,602,800
三機サービス	3,400	1,068.00	3,631,200
G u n o s y	10,600	954.00	10,112,400
デザインワン・ジャパン	5,300	228.00	1,208,400
イー・ガーディアン	6,800	2,496.00	16,972,800
リブセンス	10,300	223.00	2,296,900
ジャパンマテリアル	51,000	1,259.00	64,209,000
ベクトル	20,900	911.00	19,039,900
ウチヤマホールディングス	8,900	369.00	3,284,100
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,152.00	14,400,000
キャリアリンク	5,500	2,240.00	12,320,000
I B J	13,800	1,046.00	14,434,800
アサンテ	6,100	1,792.00	10,931,200
バリューHR	6,700	1,657.00	11,101,900
M & A キャピタルパートナーズ	13,600	4,625.00	62,900,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,456.00	9,609,600
E R I ホールディングス	5,100	587.00	2,993,700
アビスト	2,700	2,910.00	7,857,000
シグマクシス	9,200	2,047.00	18,832,400
ウィルグループ	12,400	954.00	11,829,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	25,600	244.00	6,246,400
メドピア	12,800	4,695.00	60,096,000
レアジョブ	3,200	1,834.00	5,868,800
リクルートホールディングス	1,182,600	5,555.00	6,569,343,000
エラン	23,000	1,395.00	32,085,000
土木管理総合試験所	8,800	383.00	3,370,400
ネットマーケティング	8,700	405.00	3,523,500
日本郵政	1,249,300	910.80	1,137,862,440
ベルシステム24ホールディングス	27,800	1,632.00	45,369,600
鎌倉新書	16,900	1,220.00	20,618,000
S M N	3,900	801.00	3,123,900
グローバルキッズCOMPANY	3,300	999.00	3,296,700
エアトリ	10,300	2,927.00	30,148,100
アトラエ	11,600	1,663.00	19,290,800
ストライク	6,300	4,200.00	26,460,000
ソラスト	40,700	1,305.00	53,113,500
セラク	5,300	2,121.00	11,241,300
インソース	16,100	2,144.00	34,518,400
ベイカレント・コンサルティング	10,800	33,400.00	360,720,000
O r c h e s t r a H o l d i n g s	3,800	2,917.00	11,084,600

アイモバイル	4,900	1,379.00	6,757,100
キャリアインデックス	7,200	687.00	4,946,400
MS - J a p a n	7,000	1,074.00	7,518,000
船場	3,600	828.00	2,980,800
グレイステクノロジー	16,900	1,952.00	32,988,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,700	2,296.00	109,519,200
フルテック	2,500	1,390.00	3,475,000
グリーンズ	6,200	576.00	3,571,200
GameWith	5,400	610.00	3,294,000
ソウルドアウト	4,100	1,623.00	6,654,300
MS&Consulting	3,100	615.00	1,906,500
ウェルビー	6,300	1,440.00	9,072,000
エル・ティー・エス	1,700	3,505.00	5,958,500
ミダック	3,600	6,050.00	21,780,000
日総工産	13,300	798.00	10,613,400
キュービーネットホールディングス	7,700	1,800.00	13,860,000
RPAホールディングス	19,600	734.00	14,386,400
スプリックス	4,900	1,274.00	6,242,600
マネジメントソリューションズ	8,200	2,020.00	16,564,000
プロレド・パートナーズ	3,100	2,980.00	9,238,000
テノ・ホールディングス	2,000	1,156.00	2,312,000
フロンティア・マネジメント	3,900	1,300.00	5,070,000
ピアラ	1,400	1,125.00	1,575,000
コプロ・ホールディングス	2,400	1,372.00	3,292,800
ギークス	3,000	1,945.00	5,835,000
カーブスホールディングス	45,600	855.00	38,988,000
フォーラムエンジニアリング	11,700	944.00	11,044,800
ダイレクトマーケティングミックス	8,900	3,630.00	32,307,000
ポピンズホールディングス	4,400	4,450.00	19,580,000
LITALICO	6,700	5,340.00	35,778,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,700	815.00	7,090,500
リログループ	90,400	2,225.00	201,140,000
東祥	10,400	1,805.00	18,772,000
エイチ・アイ・エス	25,800	2,525.00	65,145,000
ラックランド	4,800	2,563.00	12,302,400
共立メンテナンス	27,400	3,670.00	100,558,000
イチネンホールディングス	17,400	1,213.00	21,106,200
建設技術研究所	10,700	2,498.00	26,728,600
スペース	11,000	904.00	9,944,000
長大	6,700	1,987.00	13,312,900
燦ホールディングス	7,400	1,191.00	8,813,400
スバル興業	1,000	8,260.00	8,260,000

東京テアトル	6,400	1,260.00	8,064,000	
タナベ経営	3,400	1,418.00	4,821,200	
ナガワ	5,300	8,360.00	44,308,000	
東京都競馬	10,900	5,380.00	58,642,000	
カナモト	29,200	2,676.00	78,139,200	
西尾レントオール	15,300	3,225.00	49,342,500	
トランス・コスモス	15,800	2,988.00	47,210,400	
乃村工藝社	71,100	886.00	62,994,600	
藤田観光	6,500	2,289.00	14,878,500	
KNT-CTホールディングス	8,800	1,362.00	11,985,600	
日本管財	17,800	2,351.00	41,847,800	
トーカイ	16,100	2,402.00	38,672,200	
セコム	162,700	8,570.00	1,394,339,000	
セントラル警備保障	8,000	2,922.00	23,376,000	
丹青社	31,500	855.00	26,932,500	
メイテック	20,000	6,110.00	122,200,000	
応用地質	18,800	1,265.00	23,782,000	
船井総研ホールディングス	33,900	2,322.00	78,715,800	
進学会ホールディングス	7,100	413.00	2,932,300	
オオバ	11,900	779.00	9,270,100	
いであ	4,200	1,806.00	7,585,200	
学究社	5,000	1,323.00	6,615,000	
ベネッセホールディングス	60,600	2,514.00	152,348,400	
イオンディライト	20,400	3,305.00	67,422,000	
ナック	8,100	913.00	7,395,300	
ダイセキ	27,700	4,145.00	114,816,500	
ステップ	6,200	1,576.00	9,771,200	
合 計	181,054,400		455,964,175,980	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期中間計算期間(2021年6月1日から2021年11月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。



## 【日本株式インデックス・オープン】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第21期 ( 2021年 5月31日現在 )	第22期中間計算期間 ( 2021年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	25,494,077	25,185,498
親投資信託受益証券	6,674,462,789	6,385,422,939
未収入金	1,390,055	1,766,018
流動資産合計	6,701,346,921	6,412,374,455
資産合計	6,701,346,921	6,412,374,455
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	125,647,598	-
未払解約金	1,052,890	1,493,879
未払受託者報酬	2,577,629	2,571,998
未払委託者報酬	19,516,251	19,473,656
未払利息	45	55
その他未払費用	355,990	183,654
流動負債合計	149,150,403	23,723,242
負債合計	149,150,403	23,723,242
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,235,316,600	5,058,965,211
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	1,316,879,918	1,329,686,002
( 分配準備積立金 )	1,544,158,493	1,470,938,939
元本等合計	6,552,196,518	6,388,651,213
純資産合計	6,552,196,518	6,388,651,213
負債純資産合計	6,701,346,921	6,412,374,455

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期中間計算期間 自 2020年 5月30日 至 2020年11月29日	第22期中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日
<b>営業収益</b>		
受取利息	17	40
有価証券売買等損益	906,524,299	88,875,460
営業収益合計	906,524,316	88,875,500
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,199	3,794
受託者報酬	2,408,154	2,571,998
委託者報酬	18,233,105	19,473,656
その他費用	171,981	183,654
営業費用合計	20,816,439	22,233,102
営業利益又は営業損失（ ）	885,707,877	66,642,398
経常利益又は経常損失（ ）	885,707,877	66,642,398
中間純利益又は中間純損失（ ）	885,707,877	66,642,398
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	25,673,380	9,916,598
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	131,539,806	1,316,879,918
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,599,051	19,373,764
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,599,051	19,373,764
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,385,220	63,293,480
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,385,220	63,293,480
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	982,788,134	1,329,686,002

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第22期中間計算期間は2021年 6月 1日から2021年11月30日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第21期 (2021年 5月31日現在)	第22期中間計算期間 (2021年11月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,235,316,600口	5,058,965,211口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2515円 (12,515円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2628円 (12,628円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第22期中間計算期間 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第22期中間計算期間 (2021年11月30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>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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21期 自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日	第22期中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,027,934,877円	5,235,316,600円
期中追加設定元本額	113,236,909円	76,315,691円
期中一部解約元本額	905,855,186円	252,667,080円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年11月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,029,488,786
株式	468,547,544,500
未収入金	76,600
未収配当金	3,273,110,464
前払金	381,065,800
差入委託証拠金	207,952,000
流動資産合計	477,439,238,150
資産合計	477,439,238,150
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	381,124,650
未払金	2,864,337,130
未払解約金	24,462,908
未払利息	11,052
流動負債合計	3,269,935,740
負債合計	3,269,935,740
純資産の部	
元本等	
元本	252,496,810,383
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	221,672,492,027
元本等合計	474,169,302,410
純資産合計	474,169,302,410
負債純資産合計	477,439,238,150

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年11月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2021年11月30日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年11月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	252,496,810,383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 1.8779円 (1万口当たり純資産額) (18,779円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2021年11月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年11月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月 1日
期首元本額	249,503,103,457円
期中追加設定元本額	15,097,372,368円
期中一部解約元本額	12,103,665,442円
期末元本額	252,496,810,383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）	411,913,276円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,899,083,434円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,937,230円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,094,914,585円
世界経済インデックスファンド	3,334,984,780円
日本株式インデックス・オープン	3,400,299,771円
DCマイセレクション25	6,071,164,873円
DCマイセレクション50	18,090,935,401円
DCマイセレクション75	18,203,578,680円
DC日本株式インデックス・オープン	5,992,991,897円
DCマイセレクションS25	2,996,308,831円
DCマイセレクションS50	8,650,904,112円
DCマイセレクションS75	6,340,925,127円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,953,763,552円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	224,145,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	695,854,939円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	497,661,569円
DC世界経済インデックスファンド	3,414,009,520円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,694,034,380円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,293,353円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	21,712,749円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,260,254円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	190,546,593円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	34,373,227円

区分	2021年11月30日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	146,755,090円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	26,316,407円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	85,275,716円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,001,857,242円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	449,824,318円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,947,677,334円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	89,963,236円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,300,951円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	521,371,933円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	287,295,701円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	372,124,921円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	37,320,584円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	595,218,582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	1,907,986,409円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,370,121,973円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,746,727,045円
分散投資コア戦略ファンドA	1,322,664,148円
分散投資コア戦略ファンドS	5,718,049,945円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	443,092,238円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	404,112,032円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,986,012,249円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	213,731,147円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,631,011円
SMT インデックスバランス・オープン	59,376,476円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,071,569,191円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	559,164,334円
SMT 世界経済インデックス・オープン	40,008,274円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	141,304,290円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	26,656,511円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,904,842円
グローバル経済コア	217,800,446円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	24,584,038円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	91,920,486円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	20,182,352円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,485,976円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	160,652,345円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	5,678,616円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,977,496円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,047,186円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,357,852円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,143,863,879円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,062,411,897円



区分	2021年11月30日現在
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	239,156,507円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	37,400,453円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	47,748,507,331円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,536,827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)	81,341,098円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2021年11月30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	6,505,145,800	-	6,124,080,000	381,065,800
	合計	6,505,145,800	-	6,124,080,000	381,065,800

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【日本株式インデックス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2021年12月30日現在)

資産総額	6,592,653,104円
負債総額	18,126,232円
純資産総額（ - ）	6,574,526,872円
発行済口数	5,033,757,036口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3061円
（1万口当たり純資産額）	（13,061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12月30日現在)

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

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2021年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
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			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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



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

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020年3月31日）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

## 3. 確定拠出制度

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 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     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441項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

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

## 2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

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

## （追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

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

## （中間損益計算書関係）

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

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

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

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

### 金銭の信託

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

### デリバティブ取引

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

## (有価証券関係)

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

### 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

### 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

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

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

（デリバティブ取引関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

## （収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

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

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

## （関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

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

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



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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年 2月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。

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。
-----------	--------	-------------------------------

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

## 第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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7月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 中島紀子 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープンの2020年5月30日から2021年5月31日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス・オープンの2021年5月31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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年1月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープンの2021年6月1日から2021年11月30日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日本株式インデックス・オープンの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月1日から2021年11月30日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。