

## 【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3月18日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	国内株式SMTBセレクション（SMA専用）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

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

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

### （７）【申込期間】

2022年 3月19日から2022年 9月20日までとします。

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

#### ( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

#### ( 9 ) 【払込期日】

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

#### ( 10 ) 【払込取扱場所】

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

#### ( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

#### ( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般	年1回	グロ ー バ ル	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
	年4回	日本	ファンド・ オブ・ファ ンズ	なし	その他 ( )	ロ ン グ ・ ショ ー ト型 / 絶対収益追求 型
債券 一般	年6回 (隔月)	北米				
公債 社債		欧州				
その他債券 クレジット属 性 ( )	年12回 (毎月)	アジア				その他 ( )
	日々	オセアニ ア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))		アフリカ				
		中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

ないファンドをいう。

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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



資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

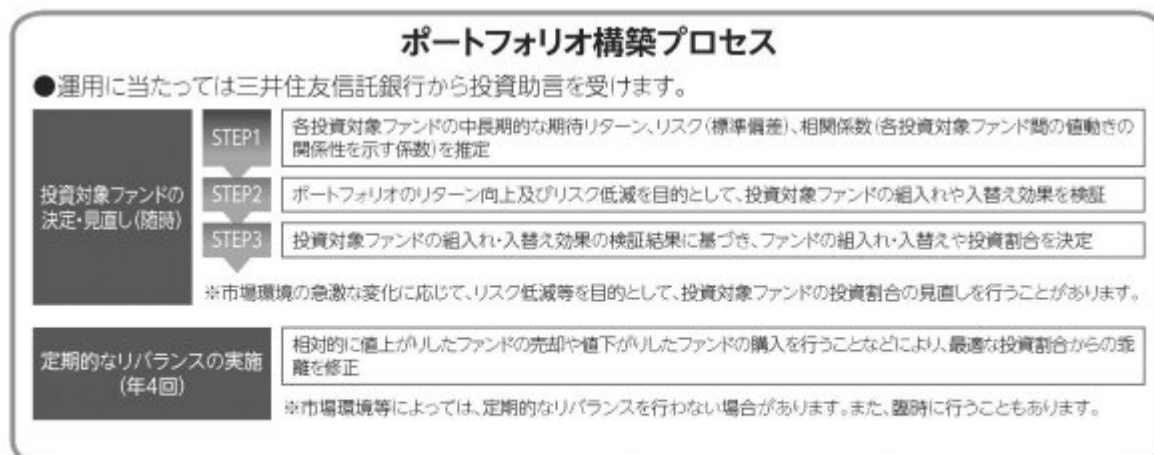
## 1. 主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド<sup>\*</sup>」)に投資します。

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

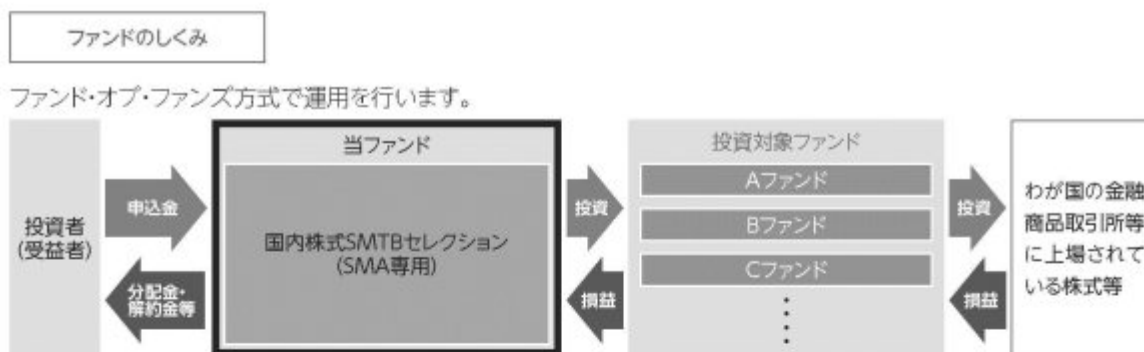
投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

### 分配方針

- 原則として12月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

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

### 投資対象

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

### 投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。
- ロ．各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ハ．投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。
- ニ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- ホ．投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する株式以外の資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ヘ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

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

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

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

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

#### （参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2022年1月31日（（ ）のファンドに関しては2022年3月17日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

#### 1. JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等の上場されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

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

J P X日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。採用される400銘柄は、企業の健全性や流動性の観点から1,000銘柄に絞り込まれた上で、R O E（自己資本利益率）、営業利益、時価総額の定量評価に定性評価を加味し、選定されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

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

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

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

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

- ・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。

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

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



主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

- ・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。

### 3. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>主として、わが国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます）のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞り込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>株式への投資比率は、原則として高位（80%以上）を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができるものとします。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>

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

## 4. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・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。

#### 5. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行ないません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

- ・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。

#### 6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げられる場合もあります。）。</p> <p>信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

## 7.FOFs用国内株式EVIバリュウファンド（適格機関投資家専用）（ ）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)（ ）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・日本の株式を主要投資対象とします。</li> <li>・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュウ指標（PBR、PER、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。</li> </ul> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数、配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、委託者が収益分配方針に従っ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等には、分配を行わないことがあります。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日



信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、東京証券取引所は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

- ・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。

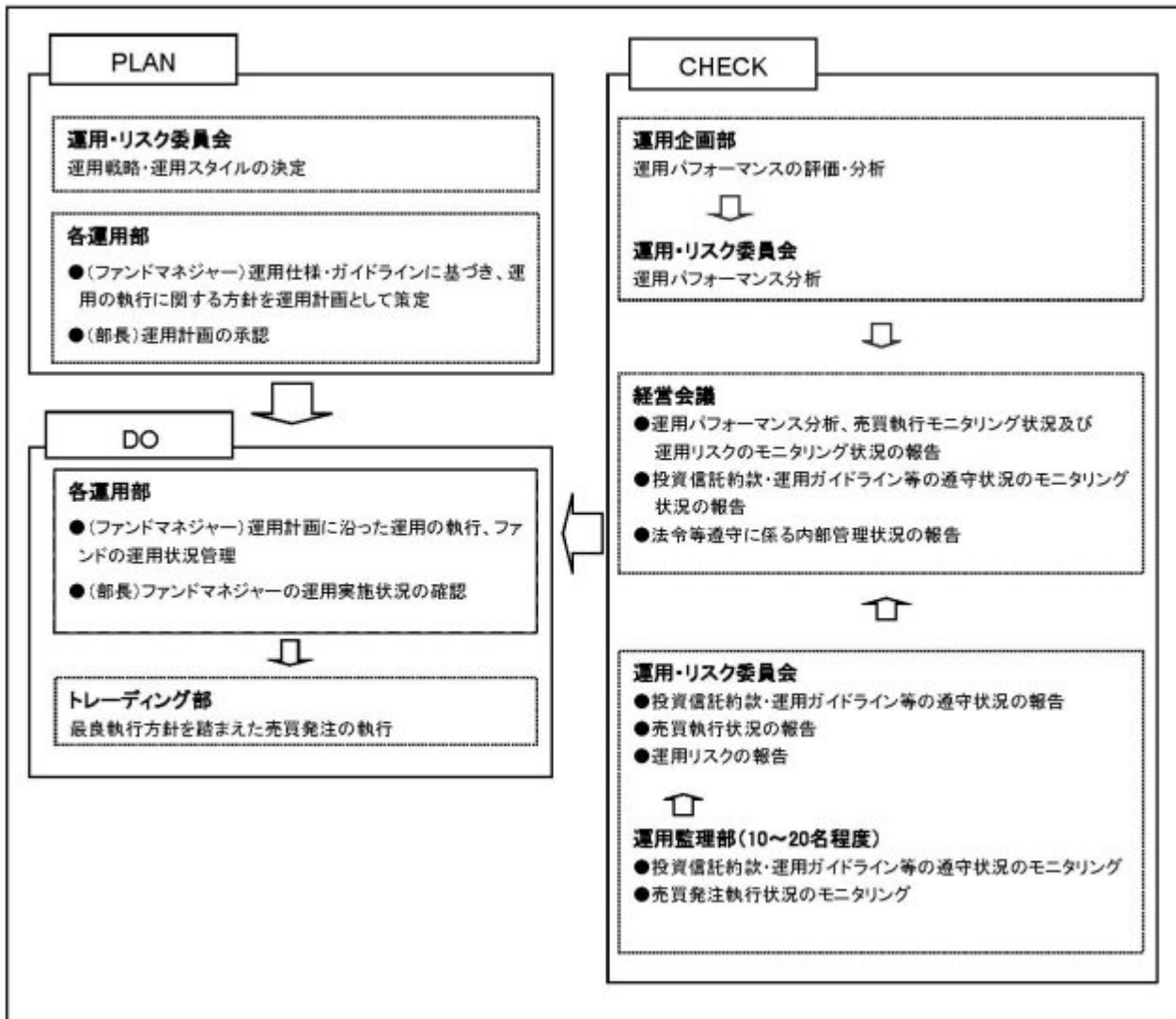
## 8. マネープールマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。
投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2010年2月26日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

### ハ．外貨建資産への投資

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

### ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

### ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

### ヘ．資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

### <その他の投資制限>

イ.当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

## 3【投資リスク】

### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

が小さかった場合も同様です。

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

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

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

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

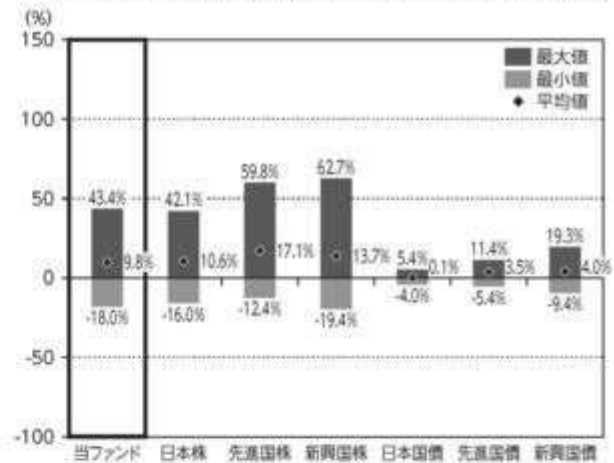
### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2017年2月～2022年1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

<b>日本株</b> TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式を銘柄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、単一の知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
<b>先進国株</b> MSCI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。
<b>新興国株</b> MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI指数	NOMURA-BPI指数とは、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・サービスに關し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> J.P. Morganグローバル・エマージング・マーケット・ロー・レバレッジ・ハイ・リターン・インデックス	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成されていますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

### (2)【換金(解約)手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

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

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

## (3) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜0.55%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.352% (税抜 0.32%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% (税抜 0.03%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

## (参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
JPX日経インデックス400 マザーファンド	ありません。
FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	年率 0.374% (税抜 0.34%)
中小型株式 マザーファンド	ありません。
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.517% (税抜 0.47%)
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	年率 0.7095% (税抜 0.645%)



FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495% （税抜 0.45%）
マネープールマザーファンド	ありません。

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま  
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ます。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当  
該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配  
金）について」をご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

上記は、2022年 1月31日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2022年1月31日現在の状況について記載してあります。

### 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	55,987,357,804	39.61
親投資信託受益証券	日本	84,061,632,810	59.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,305,989,792	0.92
合計(純資産総額)		141,354,980,406	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	26,873,725,211	1.8916	50,835,347,150	1.8495	49,702,954,777	35.16
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	25,024,966,142	1.1784	29,491,063,126	1.1505	28,791,223,546	20.37
日本	親投資信託受益証券	J P X日経インデックス400 マザーファンド	12,002,433,317	1.7947	21,541,682,352	1.7490	20,992,255,871	14.85
日本	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9,213,355,064	1.5713	14,476,944,812	1.5108	13,919,536,830	9.85
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	2,848,523,612	5.2586	14,979,441,130	4.6924	13,366,412,196	9.46
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	6,204,017,490	2.4169	14,994,824,431	2.14	13,276,597,428	9.39
日本	親投資信託受益証券	マネーパールマザーファンド	9,953	1.0015	9,967	1.0014	9,966	0.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	39.61

親投資信託受益証券	59.47
合計	99.08

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末 (2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末 (2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末 (2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282
第5期計算期間末 (2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
第6期計算期間末 (2020年12月21日)	142,930,348,485	142,930,348,485	13,862	13,862
第7期計算期間末 (2021年12月20日)	144,548,292,355	144,548,292,355	15,531	15,531
2021年 1月末日	132,796,762,277		14,121	
2月末日	133,982,846,757		14,577	
3月末日	139,649,659,579		15,379	
4月末日	129,699,984,764		14,965	
5月末日	132,349,604,786		15,172	
6月末日	133,140,622,745		15,294	
7月末日	133,298,156,372		15,031	
8月末日	143,580,336,290		15,374	
9月末日	149,631,851,707		16,101	
10月末日	144,804,974,612		15,886	
11月末日	141,056,261,062		15,424	
12月末日	148,481,312,352		15,869	
2022年 1月末日	141,354,980,406		14,861	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	0
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	0
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	0
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	10.5
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	1.1
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	19.7
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	15.6
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	15.9
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	6.0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	12.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	81,752,097,825	11,939,046,387	69,813,051,438
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	32,549,745,987	26,264,044,984	76,098,752,441
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	25,222,310,539	24,029,412,202	77,291,650,778
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	39,648,856,359	16,087,379,469	100,853,127,668
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	35,149,470,870	24,542,896,159	111,459,702,379
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	23,651,763,751	31,999,573,730	103,111,892,400
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	27,063,834,005	37,106,762,396	93,068,964,009

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

J P X日経インデックス400 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	35,104,459,110	98.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		386,875,954	1.09
合計(純資産総額)		35,491,335,064	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	379,842,000	1.07

(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	東京エレクトロン	電気機器	11,900	51,570.47	613,688,659	54,730.00	651,287,000	1.84
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	50,100	12,864.88	644,530,912	12,720.00	637,272,000	1.80
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	279,200	2,036.49	568,589,099	2,245.50	626,943,600	1.77
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	106,700	7,213.68	769,700,328	5,595.00	596,986,500	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	828,300	662.59	548,830,635	691.10	572,438,130	1.61
日本	株式	ダイキン工業	機械	23,800	25,678.68	611,152,630	23,825.00	567,035,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	167,500	3,139.89	525,932,000	3,267.00	547,222,500	1.54
日本	株式	HOYA	精密機器	36,500	17,428.87	636,154,100	14,755.00	538,557,500	1.52
日本	株式	三菱商事	卸売業	138,100	3,600.62	497,245,740	3,877.00	535,413,700	1.51
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	127,800	3,915.01	500,339,096	4,113.00	525,641,400	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,900	68,457.28	609,269,880	58,230.00	518,247,000	1.46
日本	株式	信越化学工業	化学	27,100	19,492.93	528,258,430	19,040.00	515,984,000	1.45
日本	株式	日立製作所	電気機器	85,300	6,817.92	581,569,140	5,939.00	506,596,700	1.43
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	147,300	3,474.75	511,830,700	3,354.00	494,044,200	1.39
日本	株式	KDDI	情報・通信業	133,900	3,653.85	489,251,164	3,645.00	488,065,500	1.38
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	128,900	3,336.16	430,031,967	3,667.00	472,676,300	1.33
日本	株式	村田製作所	電気機器	55,000	8,646.96	475,583,019	8,539.00	469,645,000	1.32

日本	株式	任天堂	その他製品	8,300	50,497.39	419,128,416	56,160.00	466,128,000	1.31
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	137,700	3,240.57	446,226,672	3,328.00	458,265,600	1.29
日本	株式	日本電産	電気機器	45,300	12,598.94	570,732,065	10,090.00	457,077,000	1.29
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	21,100	17,977.60	379,327,368	19,880.00	419,468,000	1.18
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	60,800	6,115.36	371,814,238	6,830.00	415,264,000	1.17
日本	株式	三井物産	卸売業	143,100	2,595.90	371,474,245	2,853.50	408,335,850	1.15
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	72,100	4,774.04	344,208,340	5,593.00	403,255,300	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	147,100	2,761.91	406,276,986	2,565.00	377,311,500	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	16,400	24,782.66	406,435,650	22,460.00	368,344,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	236,000	1,559.66	368,079,886	1,550.00	365,800,000	1.03
日本	株式	デンソー	輸送用機器	41,200	7,924.98	326,509,548	8,494.00	349,952,800	0.99
日本	株式	S M C	機械	5,500	66,851.45	367,683,000	63,390.00	348,645,000	0.98
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	162,200	1,944.28	315,363,714	1,850.50	300,151,100	0.85

(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	0.04
		鉱業	0.33
		建設業	2.45
		食料品	3.80
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.50
		医薬品	6.09
		石油・石炭製品	0.57
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	0.78
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.33
		機械	5.96
		電気機器	17.94
		輸送用機器	6.73
		精密機器	3.28
		その他製品	1.96
		電気・ガス業	1.21
		陸運業	1.62
海運業	0.61		
倉庫・運輸関連業	0.03		

	情報・通信業	7.14
	卸売業	6.40
	小売業	3.78
	銀行業	5.43
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.97
	その他金融業	1.44
	不動産業	2.29
	サービス業	5.07
	小計	98.91
合計		98.91

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	J P X日経インデックス400先物	買建	222	円	384,001,740	379,842,000	1.07

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

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

#### 中小型株式 マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	26,781,254,000	92.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,319,955,052	7.97
合計(純資産総額)		29,101,209,052	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細



国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	MARUWA	ガラス・ 土石製品	67,000	10,940.32	733,001,440	14,980.00	1,003,660,000	3.45
日本	株式	富士電機	電気機器	156,000	5,229.56	815,812,037	6,090.00	950,040,000	3.26
日本	株式	ダイセキ	サービス 業	200,000	4,114.35	822,871,470	4,555.00	911,000,000	3.13
日本	株式	ニフコ	化学	260,000	4,074.20	1,059,293,825	3,320.00	863,200,000	2.97
日本	株式	KADOKAWA	情報・通 信業	340,000	2,360.53	802,582,710	2,359.00	802,060,000	2.76
日本	株式	イビデン	電気機器	110,000	6,016.09	661,770,819	6,300.00	693,000,000	2.38
日本	株式	インターネットイニシア ティブ	情報・通 信業	170,000	3,491.34	593,528,367	3,755.00	638,350,000	2.19
日本	株式	東宝	情報・通 信業	140,000	4,807.54	673,056,357	4,425.00	619,500,000	2.13
日本	株式	エスプール	サービス 業	590,000	996.00	587,640,000	1,032.00	608,880,000	2.09
日本	株式	SBIホールディングス	証券、商 品先物取 引業	200,000	3,027.00	605,400,933	2,942.00	588,400,000	2.02
日本	株式	スタンレー電気	電気機器	220,000	3,115.24	685,352,804	2,664.00	586,080,000	2.01
日本	株式	デクセリアルズ	化学	180,000	3,449.02	620,823,741	3,120.00	561,600,000	1.93
日本	株式	物語コーポレーション	小売業	90,000	7,284.30	655,587,851	6,190.00	557,100,000	1.91
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス 業	335,000	1,343.01	449,908,801	1,659.00	555,765,000	1.91
日本	株式	SHOEI	その他製 品	124,000	4,098.20	508,176,800	4,385.00	543,740,000	1.87
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	175,000	3,370.81	589,892,630	3,065.00	536,375,000	1.84
日本	株式	東急	陸運業	345,000	1,649.04	568,921,803	1,519.00	524,055,000	1.80
日本	株式	良品計画	小売業	320,000	2,181.68	698,139,688	1,636.00	523,520,000	1.80
日本	株式	セーレン	繊維製品	230,000	2,179.72	501,336,559	2,160.00	496,800,000	1.71
日本	株式	KHネオケム	化学	165,000	2,535.75	418,398,750	2,923.00	482,295,000	1.66
日本	株式	シュッピン	小売業	450,000	1,118.20	503,190,753	1,053.00	473,850,000	1.63
日本	株式	ネクソン	情報・通 信業	220,000	2,355.46	518,201,219	2,152.00	473,440,000	1.63
日本	株式	日本セラミック	電気機器	190,000	2,897.29	550,486,189	2,442.00	463,980,000	1.59
日本	株式	神戸物産	卸売業	120,000	3,854.74	462,569,756	3,560.00	427,200,000	1.47
日本	株式	アズワン	卸売業	75,000	6,981.67	523,625,961	5,650.00	423,750,000	1.46
日本	株式	日本製鋼所	機械	110,000	4,061.32	446,745,401	3,775.00	415,250,000	1.43
日本	株式	サイバーエージェント	サービス 業	310,000	2,312.17	716,773,564	1,325.00	410,750,000	1.41
日本	株式	インターアクション	精密機器	210,000	2,482.35	521,294,945	1,926.00	404,460,000	1.39
日本	株式	恵和	化学	75,000	5,205.72	390,429,508	5,360.00	402,000,000	1.38
日本	株式	インソース	サービス 業	220,000	2,369.26	521,237,200	1,817.00	399,740,000	1.37

(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	建設業	1.04
		食料品	1.00
		繊維製品	1.71
		化学	10.85
		医薬品	0.35
		ガラス・土石製品	3.45
		金属製品	2.31
		機械	4.31
		電気機器	10.73
		精密機器	1.91
		その他製品	2.39
		陸運業	1.80
		倉庫・運輸関連業	1.26
		情報・通信業	12.89
		卸売業	2.92
		小売業	8.65
		証券、商品先物取引業	2.55
		保険業	1.04
		その他金融業	1.29
		不動産業	1.71
サービス業	17.86		
	小計	92.03	
合計		92.03	

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	469,555,700,120	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,011,367,539	0.85
合計(純資産総額)		473,567,067,659	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,891,925,000	0.82

(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	9,178,400	1,835.78	16,849,565,457	2,245.50	20,610,097,200	4.35
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,135,100	10,890.26	12,361,535,906	12,720.00	14,438,472,000	3.05
日本	株式	キーエンス	電気機器	164,200	54,558.75	8,958,547,101	58,230.00	9,561,366,000	2.02
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,208,200	619.77	6,946,578,406	691.10	7,745,987,020	1.64
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,335,800	5,736.81	7,663,241,919	5,595.00	7,473,801,000	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	115,000	49,248.67	5,663,597,421	54,730.00	6,293,950,000	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,860,200	2,937.24	5,463,864,282	3,267.00	6,077,273,400	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	304,700	18,854.04	5,744,827,203	19,040.00	5,801,488,000	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	102,300	66,934.97	6,847,447,727	56,160.00	5,745,168,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	230,900	21,766.34	5,025,848,035	23,825.00	5,501,192,500	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,066,300	8,135.02	8,674,374,919	5,011.00	5,343,229,300	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	353,600	14,495.40	5,125,576,796	14,755.00	5,217,368,000	1.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,337,300	3,113.40	4,163,561,773	3,877.00	5,184,712,100	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	871,500	5,781.75	5,038,797,304	5,939.00	5,175,838,500	1.09
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,237,100	3,944.10	4,879,251,128	4,113.00	5,088,192,300	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,426,700	3,354.83	4,786,347,785	3,354.00	4,785,151,800	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,424,200	3,698.64	5,267,608,739	3,328.00	4,739,737,600	1.00
日本	株式	日本電産	電気機器	469,700	12,533.10	5,886,799,943	10,090.00	4,739,273,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,296,300	3,698.95	4,794,949,770	3,645.00	4,725,013,500	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,248,300	3,254.86	4,063,048,469	3,667.00	4,577,516,100	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	532,400	8,306.60	4,422,438,015	8,539.00	4,546,163,600	0.96

日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,600	16,524.45	3,380,903,637	19,880.00	4,067,448,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	588,600	5,214.91	3,069,498,013	6,830.00	4,020,138,000	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	1,385,900	2,424.81	3,360,551,854	2,853.50	3,954,665,650	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	698,200	4,750.43	3,316,753,798	5,593.00	3,905,032,600	0.82
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,693,200	1,465.31	3,946,381,442	1,434.00	3,862,048,800	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	1,424,000	2,535.27	3,610,238,034	2,565.00	3,652,560,000	0.77
日本	株式	ファナック	電気機器	159,000	26,181.70	4,162,891,192	22,460.00	3,571,140,000	0.75
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,285,600	1,663.68	3,802,520,768	1,550.00	3,542,680,000	0.75
日本	株式	デンソー	輸送用機器	399,000	7,543.83	3,009,991,542	8,494.00	3,389,106,000	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.25
		食料品	3.36
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.66
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.61
		機械	5.36
		電気機器	18.15
		輸送用機器	8.64
		精密機器	2.67
		その他製品	2.28
		電気・ガス業	1.11
陸運業	2.97		
海運業	0.55		
空運業	0.40		
倉庫・運輸関連業	0.18		
情報・通信業	7.79		

	卸売業	5.52
	小売業	4.19
	銀行業	5.29
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.24
	その他金融業	1.18
	不動産業	1.93
	サービス業	5.79
	小計	99.15
合計		99.15

(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	205	円	4,017,264,300	3,891,925,000	0.82

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

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

#### マネープールマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		373,307,776,385	100.00
合計(純資産総額)		373,307,776,385	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

## ロ.種類別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件


該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

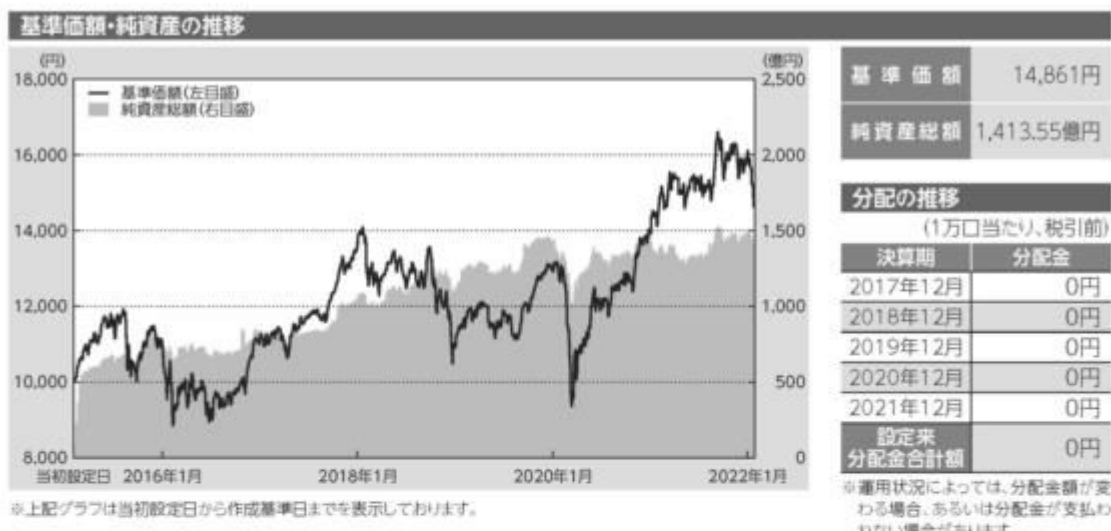
該当事項はありません。

## 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2015年2月6日  
作成基準日：2022年1月31日



**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	35.2%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	20.4%
JPX日経インデックス400 マザーファンド	14.9%
FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9.8%
中小型株式 マザーファンド	9.5%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	9.4%
マネーパールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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



した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場

合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記〈解約価額〉の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

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

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

## ・公社債等

計算日における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

## &lt; 基準価額の照会方法 &gt;

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

2015年 2月 6日（設定日）から2024年12月20日までとします。

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

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

## （4）【計算期間】

原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

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

## （5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

## (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・ 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）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2020年12月22日から2021年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2020年12月21日現在）	第7期 （2021年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,078,881,377	1,867,981,695
投資信託受益証券	42,934,880,439	57,922,832,369
親投資信託受益証券	99,517,577,636	85,306,480,599
未収入金	352,352,480	-
流動資産合計	143,883,691,932	145,097,294,663
資産合計	143,883,691,932	145,097,294,663
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	541,745,951	118,327,380
未払受託者報酬	22,389,661	23,429,533
未払委託者報酬	388,087,396	406,111,780
未払利息	822	2,786
その他未払費用	1,119,617	1,130,829
流動負債合計	953,343,447	549,002,308
負債合計	953,343,447	549,002,308
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	103,111,892,400	93,068,964,009
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,818,456,085	51,479,328,346
（分配準備積立金）	22,605,290,138	26,979,732,800
元本等合計	142,930,348,485	144,548,292,355
純資産合計	142,930,348,485	144,548,292,355
負債純資産合計	143,883,691,932	145,097,294,663



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第6期		第7期	
	自 至	2019年12月21日 2020年12月21日	自 至	2020年12月22日 2021年12月20日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		-		237,372,901
受取利息		8,341		6,833
有価証券売買等損益		10,175,433,767		16,602,263,477
<b>営業収益合計</b>		<b>10,175,442,108</b>		<b>16,839,643,211</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		801,770		670,464
受託者報酬		43,509,154		45,767,947
委託者報酬		754,158,577		793,310,871
その他費用		2,216,054		2,243,473
<b>営業費用合計</b>		<b>800,685,555</b>		<b>841,992,755</b>
営業利益又は営業損失 ( )		9,374,756,553		15,997,650,456
経常利益又は経常損失 ( )		9,374,756,553		15,997,650,456
当期純利益又は当期純損失 ( )		9,374,756,553		15,997,650,456
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		1,420,490,598		4,156,311,285
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		34,335,618,880		39,818,456,085
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,056,288,852		14,519,890,494
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,056,288,852		14,519,890,494
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,368,698,798		14,700,357,404
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,368,698,798		14,700,357,404
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		39,818,456,085		51,479,328,346

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2020年12月21日現在)	第7期 (2021年12月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	103,111,892,400口	93,068,964,009口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3862円 (13,862円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5531円 (15,531円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日																								
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,597,658,898円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>9,197,588,253円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>21,059,735,429円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,597,658,898円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	9,197,588,253円	収益調整金額	C	21,059,735,429円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,739,815,870円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>10,101,523,301円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>24,499,595,546円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,739,815,870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	10,101,523,301円	収益調整金額	C	24,499,595,546円
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	1,597,658,898円																							
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	9,197,588,253円																							
収益調整金額	C	21,059,735,429円																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	1,739,815,870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	10,101,523,301円																							
収益調整金額	C	24,499,595,546円																							

第6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日			第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日		
分配準備積立金額	D	11,810,042,987円	分配準備積立金額	D	15,138,393,629円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	43,665,025,567円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	51,479,328,346円
当ファンドの期末残存口数	F	103,111,892,400口	当ファンドの期末残存口数	F	93,068,964,009口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,234円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,531円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (2021年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第7期 (2021年12月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <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>

## ( 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6期 自 2019年12月21日 至 2020年12月21日	第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	111,459,702,379円	103,111,892,400円
期中追加設定元本額	23,651,763,751円	27,063,834,005円
期中一部解約元本額	31,999,573,730円	37,106,762,396円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	第6期 (2020年12月21日現在)	第7期 (2021年12月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	2,755,351,036	6,131,032,106
親投資信託受益証券	9,389,841,480	6,693,849,798

合計	12,145,192,516	12,824,881,904
----	----------------	----------------

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	24,771,777,942	29,191,063,126	
	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,213,355,064	14,476,944,812	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	5,875,855,083	14,254,824,431	
投資信託受益証券合計		39,860,988,089	57,922,832,369	
親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	2,619,510,007	13,829,441,130	
	国内株式インデックス マザーファンド	26,458,329,623	50,035,347,150	
	J P X 日経インデックス400 マザーファンド	11,946,558,030	21,441,682,352	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,967	
親投資信託受益証券合計		41,024,407,613	85,306,480,599	
合計			143,229,312,968	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託

受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## J P X日経インデックス400 マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年12月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	359,815,003
株式	35,850,106,870
未収配当金	2,181,450
前払金	8,101,700
差入委託証拠金	3,862,000
流動資産合計	36,224,067,023
資産合計	36,224,067,023
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,120,070
未払解約金	71,774,803
未払利息	536
流動負債合計	79,895,409
負債合計	79,895,409
純資産の部	
元本等	
元本	20,138,826,825
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,005,344,789
元本等合計	36,144,171,614
純資産合計	36,144,171,614
負債純資産合計	36,224,067,023

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

	2021年12月20日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2021年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,138,826,825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 1.7948円 (1万口当たり純資産額) (17,948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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	



区分	2021年12月20日現在
期首	2020年12月22日
期首元本額	29,602,777,090円
期中追加設定元本額	6,695,261,583円
期中一部解約元本額	16,159,211,848円
期末元本額	20,138,826,825円
期末元本額の内訳	
SMT JPX日経インデックス400・オープン	5,029,305,787円
SMTAM JPX日経インデックス400オープン	751,196,082円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	11,946,558,030円
JPX日経インデックス400・オープン(SMA専用)	648,074,176円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	247,527,246円
JPX日経400オープン(適格機関投資家専用)	1,516,165,504円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		1,382,188,052
合計		1,382,188,052

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「JPX日経インデックス400 マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2021年12月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	300,685,700	-	292,584,000	8,101,700
	合計	300,685,700	-	292,584,000	8,101,700

## (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)	
日本水産	25,200	532.00	13,406,400	
I N P E X	101,000	971.00	98,071,000	
ミライト・ホールディングス	8,100	1,894.00	15,341,400	
安藤・間	13,800	870.00	12,006,000	
東急建設	7,400	638.00	4,721,200	
コムシスホールディングス	8,100	2,539.00	20,565,900	
東建コーポレーション	800	9,090.00	7,272,000	
大成建設	16,800	3,470.00	58,296,000	
大林組	58,100	882.00	51,244,200	
清水建設	54,500	709.00	38,640,500	
長谷工コーポレーション	17,300	1,386.00	23,977,800	
鹿島建設	42,600	1,313.00	55,933,800	
西松建設	3,500	3,585.00	12,547,500	
三井住友建設	13,100	419.00	5,488,900	
戸田建設	24,100	718.00	17,303,800	
熊谷組	3,000	2,851.00	8,553,000	
大東建託	6,000	13,050.00	78,300,000	
N I P P O	4,800	3,985.00	19,128,000	
五洋建設	23,000	658.00	15,134,000	
住友林業	14,900	2,233.00	33,271,700	
大和ハウス工業	53,700	3,238.00	173,880,600	
積水ハウス	63,100	2,336.50	147,433,150	
関電工	9,500	839.00	7,970,500	
エクシオグループ	8,800	2,430.00	21,384,000	
九電工	4,500	3,430.00	15,435,000	
インフロニア・ホールディングス	24,400	1,000.00	24,400,000	
森永製菓	4,400	3,770.00	16,588,000	
カルビー	8,500	2,719.00	23,111,500	
森永乳業	3,400	5,430.00	18,462,000	
ヤクルト本社	13,800	6,130.00	84,594,000	
明治ホールディングス	12,300	7,040.00	86,592,000	
プリマハム	2,300	2,403.00	5,526,900	
日本ハム	7,100	4,060.00	28,826,000	
アサヒグループホールディングス	43,800	4,500.00	197,100,000	
キリンホールディングス	68,400	1,885.50	128,968,200	
サントリー食品インターナショナル	12,500	4,230.00	52,875,000	
伊藤園	5,600	6,110.00	34,216,000	

キッコーマン	13,400	9,170.00	122,878,000
味の素	41,100	3,457.00	142,082,700
キューピー	9,800	2,487.00	24,372,600
カゴメ	7,100	3,000.00	21,300,000
アリアケジャパン	1,700	6,430.00	10,931,000
ニチレイ	8,900	2,705.00	24,074,500
東洋水産	8,900	4,860.00	43,254,000
日清食品ホールディングス	7,300	8,770.00	64,021,000
日本たばこ産業	99,800	2,378.00	237,324,400
帝人	17,100	1,374.00	23,495,400
東レ	131,500	666.80	87,684,200
ゴールドウイン	3,300	6,370.00	21,021,000
王子ホールディングス	75,900	550.00	41,745,000
大王製紙	8,800	1,835.00	16,148,000
レンゴー	17,200	850.00	14,620,000
クラレ	26,600	990.00	26,334,000
旭化成	120,400	1,063.50	128,045,400
昭和電工	15,700	2,397.00	37,632,900
住友化学	133,400	517.00	68,967,800
日産化学	9,900	6,470.00	64,053,000
東ソー	26,200	1,666.00	43,649,200
トクヤマ	5,800	1,778.00	10,312,400
デンカ	6,600	3,570.00	23,562,000
信越化学工業	26,800	19,225.00	515,230,000
エア・ウォーター	17,200	1,770.00	30,444,000
日本酸素ホールディングス	17,500	2,523.00	44,152,500
三菱瓦斯化学	16,900	1,874.00	31,670,600
三井化学	16,500	3,045.00	50,242,500
三菱ケミカルホールディングス	121,400	828.10	100,531,340
ダイセル	26,200	776.00	20,331,200
積水化学工業	38,000	1,891.00	71,858,000
日本ゼオン	16,400	1,240.00	20,336,000
アイカ工業	5,100	3,435.00	17,518,500
宇部興産	8,600	1,943.00	16,709,800
日油	6,200	5,610.00	34,782,000
花王	41,000	6,062.00	248,542,000
日本ペイントホールディングス	68,200	1,207.00	82,317,400
関西ペイント	18,800	2,538.00	47,714,400
D I C	7,700	2,875.00	22,137,500
富士フイルムホールディングス	32,600	8,405.00	274,003,000
資生堂	34,500	6,508.00	224,526,000
ライオン	22,400	1,605.00	35,952,000

ファンケル	7,500	3,475.00	26,062,500
コーセー	3,500	13,270.00	46,445,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,900	1,994.00	15,752,600
小林製薬	5,200	9,170.00	47,684,000
日東電工	11,200	8,530.00	95,536,000
エフピコ	3,400	3,865.00	13,141,000
ニフコ	6,200	3,380.00	20,956,000
ユニ・チャーム	35,700	4,870.00	173,859,000
協和キリン	21,800	3,160.00	68,888,000
武田薬品工業	136,400	3,126.00	426,386,400
アステラス製薬	160,800	1,837.50	295,470,000
大日本住友製薬	11,500	1,335.00	15,352,500
塩野義製薬	23,300	7,712.00	179,689,600
日本新薬	4,900	7,960.00	39,004,000
中外製薬	58,000	3,617.00	209,786,000
科研製薬	2,900	4,225.00	12,252,500
エーザイ	22,200	6,876.00	152,647,200
ロート製薬	9,500	3,400.00	32,300,000
小野薬品工業	42,600	2,821.00	120,174,600
参天製薬	34,600	1,391.00	48,128,600
JCRファーマ	5,200	2,198.00	11,429,600
東和薬品	2,700	2,680.00	7,236,000
第一三共	145,700	2,771.00	403,734,700
大塚ホールディングス	38,500	4,204.00	161,854,000
ペプチドリーム	9,700	2,727.00	26,451,900
サワイグループホールディングス	4,100	4,440.00	18,204,000
出光興産	20,600	2,881.00	59,348,600
ENEOSホールディングス	278,900	424.40	118,365,160
コスモエネルギーホールディングス	5,400	2,240.00	12,096,000
横浜ゴム	10,700	1,762.00	18,853,400
TOYO TIRE	9,800	1,729.00	16,944,200
ブリヂストン	53,400	4,748.00	253,543,200
住友ゴム工業	16,700	1,137.00	18,987,900
AGC	17,000	5,400.00	91,800,000
太平洋セメント	10,500	2,261.00	23,740,500
東海カーボン	15,500	1,187.00	18,398,500
TOTO	13,200	5,170.00	68,244,000
日本碍子	20,100	1,878.00	37,747,800
日本特殊陶業	14,100	1,947.00	27,452,700
ニチアス	4,300	2,655.00	11,416,500
三井金属鉱業	4,900	3,010.00	14,749,000
住友金属鉱山	23,400	4,304.00	100,713,600

住友電気工業	68,600	1,461.00	100,224,600
アサヒホールディングス	7,300	1,987.00	14,505,100
SUMCO	28,200	2,225.00	62,745,000
三和ホールディングス	17,300	1,179.00	20,396,700
リンナイ	3,500	10,340.00	36,190,000
日本製鋼所	5,600	3,520.00	19,712,000
三浦工業	7,900	3,935.00	31,086,500
アマダ	28,900	1,078.00	31,154,200
FUJII	8,400	2,572.00	21,604,800
オーエスジー	8,500	1,708.00	14,518,000
DMG森精機	10,900	1,860.00	20,274,000
ディスコ	2,700	32,900.00	88,830,000
オプトラン	2,300	2,337.00	5,375,100
ナブテスコ	10,500	3,155.00	33,127,500
SMC	5,400	75,120.00	405,648,000
小松製作所	84,000	2,597.00	218,148,000
住友重機械工業	10,600	2,587.00	27,422,200
日立建機	7,400	3,175.00	23,495,000
クボタ	90,400	2,480.00	224,192,000
荏原製作所	7,700	6,090.00	46,893,000
ダイキン工業	23,600	25,035.00	590,826,000
ダイフク	10,200	9,540.00	97,308,000
竹内製作所	2,800	2,608.00	7,302,400
ホンザキ	5,400	8,480.00	45,792,000
日本精工	34,900	725.00	25,302,500
マキタ	22,600	4,894.00	110,604,400
三菱重工業	29,100	2,587.00	75,281,700
IHI	11,600	2,171.00	25,183,600
ブラザー工業	22,600	2,089.00	47,211,400
ミネベアミツミ	32,000	3,085.00	98,720,000
日立製作所	84,500	6,165.00	520,942,500
三菱電機	185,400	1,451.00	269,015,400
富士電機	11,200	5,900.00	66,080,000
安川電機	20,000	5,560.00	111,200,000
日本電産	44,900	13,275.00	596,047,500
オムロン	15,400	11,440.00	176,176,000
MCJ	6,400	1,060.00	6,784,000
日本電気	23,600	5,150.00	121,540,000
富士通	16,700	19,130.00	319,471,000
ルネサスエレクトロニクス	100,500	1,354.00	136,077,000
セイコーエプソン	23,000	1,974.00	45,402,000
ワコム	14,400	910.00	13,104,000

アルバック	3,400	6,920.00	23,528,000
エレコム	4,200	1,451.00	6,094,200
パナソニック	197,700	1,222.00	241,589,400
アンリツ	11,900	1,740.00	20,706,000
ソニーグループ	49,700	13,440.00	667,968,000
T D K	26,900	4,415.00	118,763,500
横河電機	18,600	2,033.00	37,813,800
アズビル	10,900	4,935.00	53,791,500
日本光電工業	7,700	3,210.00	24,717,000
堀場製作所	3,400	6,570.00	22,338,000
アドバンテスト	13,800	10,200.00	140,760,000
キーエンス	8,800	71,580.00	629,904,000
シスメックス	15,700	14,775.00	231,967,500
レーザーテック	8,100	30,230.00	244,863,000
スタンレー電気	13,000	2,852.00	37,076,000
カシオ計算機	13,400	1,459.00	19,550,600
ファナック	16,300	23,535.00	383,620,500
浜松ホトニクス	13,300	7,140.00	94,962,000
京セラ	26,100	7,105.00	185,440,500
太陽誘電	9,000	6,300.00	56,700,000
村田製作所	54,500	9,102.00	496,059,000
小糸製作所	10,200	5,940.00	60,588,000
S C R E E Nホールディングス	3,200	11,420.00	36,544,000
東京エレクトロン	11,800	59,600.00	703,280,000
トヨタ紡織	7,600	2,144.00	16,294,400
豊田自動織機	15,000	9,030.00	135,450,000
デンソー	40,800	9,031.00	368,464,800
いすゞ自動車	58,200	1,432.00	83,342,400
トヨタ自動車	276,600	2,051.00	567,306,600
日野自動車	23,200	923.00	21,413,600
アイシン	13,600	4,275.00	58,140,000
本田技研工業	146,000	3,086.00	450,556,000
スズキ	42,400	4,319.00	183,125,600
S U B A R U	53,100	2,010.50	106,757,550
ヤマハ発動機	24,200	2,700.00	65,340,000
豊田合成	6,000	2,341.00	14,046,000
シマノ	7,500	32,030.00	240,225,000
テイ・エス テック	7,800	1,333.00	10,397,400
テルモ	52,500	4,721.00	247,852,500
島津製作所	23,900	4,815.00	115,078,500
ブイ・テクノロジー	800	3,335.00	2,668,000
東京精密	3,100	4,720.00	14,632,000

オリンパス	97,200	2,449.00	238,042,800
H O Y A	36,200	16,550.00	599,110,000
朝日インテック	20,300	2,501.00	50,770,300
バンダイナムコホールディングス	16,600	8,936.00	148,337,600
パイロットコーポレーション	3,100	4,150.00	12,865,000
ヤマハ	11,000	5,650.00	62,150,000
ピジョン	11,200	2,345.00	26,264,000
任天堂	8,200	53,510.00	438,782,000
中部電力	56,700	1,204.00	68,266,800
関西電力	70,200	1,064.00	74,692,800
中国電力	29,000	944.00	27,376,000
東北電力	43,400	815.00	35,371,000
九州電力	38,200	861.00	32,890,200
北海道電力	16,100	509.00	8,194,900
電源開発	15,800	1,547.00	24,442,600
イーレックス	2,700	2,196.00	5,929,200
レノバ	3,600	4,645.00	16,722,000
東京瓦斯	35,500	2,090.00	74,195,000
大阪瓦斯	33,600	1,918.00	64,444,800
東海旅客鉄道	15,400	15,545.00	239,393,000
阪急阪神ホールディングス	22,000	3,340.00	73,480,000
日本通運	6,100	6,730.00	41,053,000
ヤマトホールディングス	24,600	2,654.00	65,288,400
山九	4,900	4,750.00	23,275,000
センコーグループホールディングス	8,800	932.00	8,201,600
日立物流	3,400	5,240.00	17,816,000
丸和運輸機関	3,700	1,402.00	5,187,400
九州旅客鉄道	13,600	2,377.00	32,327,200
S Gホールディングス	33,200	2,616.00	86,851,200
日本郵船	14,700	8,350.00	122,745,000
商船三井	9,700	7,910.00	76,727,000
近鉄エクスプレス	3,300	3,025.00	9,982,500
N E C ネットズエスアイ	6,000	1,720.00	10,320,000
システナ	26,000	432.00	11,232,000
日鉄ソリューションズ	2,600	3,480.00	9,048,000
T I S	17,300	3,435.00	59,425,500
コーエーテクモホールディングス	5,800	4,670.00	27,086,000
ネクソン	41,000	2,226.00	91,266,000
ティーガイア	1,600	1,588.00	2,540,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,900	2,627.00	12,872,300
G M O ペイメントゲートウェイ	3,500	13,510.00	47,285,000
ラクス	8,300	3,025.00	25,107,500

アカツキ	800	2,545.00	2,036,000
野村総合研究所	35,200	4,835.00	170,192,000
インフォコム	2,000	1,976.00	3,952,000
オービック	5,700	21,130.00	120,441,000
ジャストシステム	2,600	5,400.00	14,040,000
Zホールディングス	264,400	642.20	169,797,680
トレンドマイクロ	9,700	6,710.00	65,087,000
日本オラクル	3,700	10,190.00	37,703,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,300	3,710.00	30,793,000
大塚商会	9,800	5,480.00	53,704,000
電通国際情報サービス	2,600	3,730.00	9,698,000
東映アニメーション	700	13,690.00	9,583,000
デジタルガレージ	3,000	4,715.00	14,145,000
日本ユニシス	5,700	3,220.00	18,354,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	2,991.00	5,084,700
日本電信電話	185,600	3,183.00	590,764,800
KDDI	132,600	3,363.00	445,933,800
光通信	2,100	17,600.00	36,960,000
東宝	10,700	4,970.00	53,179,000
エヌ・ティ・ティ・データ	48,400	2,338.00	113,159,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,500	6,090.00	51,765,000
カブコン	17,200	2,699.00	46,422,800
SCSK	12,600	2,228.00	28,072,800
コナミホールディングス	6,600	5,580.00	36,828,000
ソフトバンクグループ	52,200	5,344.00	278,956,800
双日	20,200	1,653.00	33,390,600
アルフレッサホールディングス	20,300	1,550.00	31,465,000
神戸物産	14,200	4,060.00	57,652,000
ダイワボウホールディングス	8,900	1,779.00	15,833,100
TOKAIホールディングス	8,800	844.00	7,427,200
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,606.00	15,375,400
コメダホールディングス	4,000	1,996.00	7,984,000
メディカルホールディングス	19,700	2,119.00	41,744,300
日本ライフライン	5,400	1,043.00	5,632,200
伊藤忠商事	127,700	3,417.00	436,350,900
丸紅	180,100	1,053.50	189,735,350
豊田通商	18,300	5,050.00	92,415,000
兼松	6,800	1,251.00	8,506,800
三井物産	141,800	2,599.00	368,538,200
住友商事	115,300	1,628.50	187,766,050
三菱商事	136,800	3,594.00	491,659,200
岩谷産業	4,400	5,730.00	25,212,000



PAL TAC	2,600	4,610.00	11,986,000
日鉄物産	1,300	4,750.00	6,175,000
ミスミグループ本社	22,900	4,615.00	105,683,500
ローソン	4,000	5,800.00	23,200,000
エービーシー・マート	2,900	4,915.00	14,253,500
日本マクドナルドホールディングス	8,400	5,140.00	43,176,000
セリア	4,400	3,270.00	14,388,000
ビックカメラ	10,800	935.00	10,098,000
MonotaRO	23,100	2,037.00	47,054,700
マツキヨココカラ&カンパニー	8,200	4,380.00	35,916,000
ZOZO	12,600	3,425.00	43,155,000
ウエルシアホールディングス	9,700	3,855.00	37,393,500
クリエイティブSDホールディングス	2,700	3,260.00	8,802,000
コスモス薬品	1,800	17,540.00	31,572,000
セブン&アイ・ホールディングス	71,400	4,883.00	348,646,200
ツルハホールディングス	4,000	11,960.00	47,840,000
クスリのアオキホールディングス	1,800	7,380.00	13,284,000
FOOD & LIFE COMPANIES	10,700	4,090.00	43,763,000
ノジマ	3,000	2,311.00	6,933,000
良品計画	21,000	1,750.00	36,750,000
コーナン商事	2,600	3,275.00	8,515,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	36,500	1,606.00	58,619,000
ゼンショーホールディングス	8,900	2,647.00	23,558,300
ワークマン	2,400	5,540.00	13,296,000
スギホールディングス	3,600	6,830.00	24,588,000
ライフコーポレーション	1,700	3,425.00	5,822,500
丸井グループ	15,400	2,105.00	32,417,000
イズミ	3,300	3,230.00	10,659,000
ヤオコー	2,100	6,940.00	14,574,000
ケーズホールディングス	16,800	1,097.00	18,429,600
アインホールディングス	2,700	5,710.00	15,417,000
ニトリホールディングス	7,200	18,255.00	131,436,000
ファーストリテイリング	2,400	66,560.00	159,744,000
サンドラッグ	6,900	3,090.00	21,321,000
めぶきフィナンシャルグループ	95,000	230.00	21,850,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	104,400	415.00	43,326,000
新生銀行	11,900	1,831.00	21,788,900
あおぞら銀行	10,200	2,516.00	25,663,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	839,200	617.40	518,122,080
りそなホールディングス	209,300	436.50	91,359,450
三井住友トラスト・ホールディングス	34,600	3,803.00	131,583,800

三井住友フィナンシャルグループ	126,600	3,812.00	482,599,200
千葉銀行	61,000	661.00	40,321,000
ふくおかフィナンシャルグループ	15,400	1,902.00	29,290,800
セブン銀行	54,300	235.00	12,760,500
みずほフィナンシャルグループ	233,900	1,442.00	337,283,800
F P G	6,200	556.00	3,447,200
G M Oフィナンシャルホールディングス	3,400	829.00	2,818,600
S B Iホールディングス	22,600	2,897.00	65,472,200
ジャフコ グループ	2,300	6,350.00	14,605,000
大和証券グループ本社	136,900	636.00	87,068,400
野村ホールディングス	279,200	488.30	136,333,360
S O M P Oホールディングス	32,200	4,937.00	158,971,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	41,000	3,500.00	143,500,000
第一生命ホールディングス	90,000	2,337.00	210,330,000
東京海上ホールディングス	60,200	6,242.00	375,768,400
T & Dホールディングス	47,500	1,425.00	67,687,500
全国保証	4,400	4,880.00	21,472,000
芙蓉総合リース	1,900	7,770.00	14,763,000
みずほリース	2,800	3,055.00	8,554,000
東京センチュリー	3,500	5,360.00	18,760,000
イオンフィナンシャルサービス	9,900	1,214.00	12,018,600
アコム	36,100	327.00	11,804,700
オリエントコーポレーション	49,500	119.00	5,890,500
オリックス	111,000	2,239.50	248,584,500
三菱H C キャピタル	67,600	552.00	37,315,200
日本取引所グループ	46,300	2,415.00	111,814,500
いちご	20,400	278.00	5,671,200
ヒューリック	43,700	1,083.00	47,327,100
野村不動産ホールディングス	9,500	2,488.00	23,636,000
サムティ	2,900	2,153.00	6,243,700
プレサンスコーポレーション	2,400	1,916.00	4,598,400
オープンハウス	5,800	5,870.00	34,046,000
東急不動産ホールディングス	53,900	596.00	32,124,400
飯田グループホールディングス	15,300	2,478.00	37,913,400
三井不動産	83,400	2,211.50	184,439,100
三菱地所	120,100	1,563.00	187,716,300
東京建物	18,100	1,611.00	29,159,100
住友不動産	38,400	3,283.00	126,067,200
スターツコーポレーション	2,500	2,393.00	5,982,500
日本エスコン	3,400	785.00	2,669,000
イオンモール	9,200	1,591.00	14,637,200
カチタス	4,500	4,080.00	18,360,000

ミクシィ	4,100	1,995.00	8,179,500	
日本M&Aセンターホールディングス	29,100	3,025.00	88,027,500	
UTグループ	2,600	4,035.00	10,491,000	
エス・エム・エス	6,000	4,215.00	25,290,000	
パーソルホールディングス	17,700	3,200.00	56,640,000	
総合警備保障	7,000	4,595.00	32,165,000	
カカクコム	13,000	3,075.00	39,975,000	
ディップ	3,100	3,705.00	11,485,500	
ベネフィット・ワン	6,400	4,765.00	30,496,000	
エムスリー	31,300	5,573.00	174,434,900	
アウトソーシング	10,100	1,602.00	16,180,200	
博報堂DYホールディングス	24,700	1,848.00	45,645,600	
オリエンタルランド	20,900	19,260.00	402,534,000	
ユー・エス・エス	19,800	1,763.00	34,907,400	
フルキャストホールディングス	1,500	2,417.00	3,625,500	
エン・ジャパン	2,900	3,280.00	9,512,000	
テクノプロ・ホールディングス	10,600	3,320.00	35,192,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	800	6,480.00	5,184,000	
ジャパンマテリアル	5,400	1,783.00	9,628,200	
リクルートホールディングス	105,800	6,480.00	685,584,000	
ベルシステム24ホールディングス	2,500	1,206.00	3,015,000	
ベйкаレント・コンサルティング	1,300	44,000.00	57,200,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,600	1,902.00	10,651,200	
リログループ	9,700	2,054.00	19,923,800	
カナモト	3,100	2,302.00	7,136,200	
セコム	17,500	7,932.00	138,810,000	
メイテック	2,100	6,530.00	13,713,000	
イオンディライト	2,200	3,305.00	7,271,000	
合 計	12,465,300		35,850,106,870	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 中小型株式 マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年12月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,650,034,748
株式	29,952,117,000
未収入金	152,081,212
未収配当金	25,428,000
流動資産合計	31,779,660,960
資産合計	31,779,660,960
負債の部	
流動負債	
未払金	138,943,604
未払解約金	15,596,882
未払利息	2,461
流動負債合計	154,542,947
負債合計	154,542,947
純資産の部	
元本等	
元本	5,990,300,623
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	25,634,817,390
元本等合計	31,625,118,013
純資産合計	31,625,118,013
負債純資産合計	31,779,660,960

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2021年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		5,990,300,623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)	5.2794円 (52,794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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	

	2021年12月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	2021年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	7,134,569,073円
期中追加設定元本額	527,156,613円
期中一部解約元本額	1,671,425,063円
期末元本額	5,990,300,623円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,991,519,525円
中小型株式オープン（SMA専用）	326,121,714円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,619,510,007円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	53,149,377円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		126,027,083
合計		126,027,083

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
寿スピリッツ	63,000	5,570.00	350,910,000	
セーレン	210,000	2,335.00	490,350,000	
KHネオケム	165,000	2,979.00	491,535,000	
恵和	75,000	5,110.00	383,250,000	
トリケミカル研究所	175,000	3,495.00	611,625,000	
ミルボン	78,000	5,720.00	446,160,000	
デクセリアルズ	155,000	3,775.00	585,125,000	
ニフコ	230,000	3,380.00	777,400,000	
JCRファーマ	50,000	2,198.00	109,900,000	
MARUWA	80,000	14,860.00	1,188,800,000	
横河ブリッジホールディングス	140,000	2,160.00	302,400,000	
三益半導体工業	135,000	2,382.00	321,570,000	
芝浦機械	120,000	3,580.00	429,600,000	
ヒラノテクシード	98,000	2,760.00	270,480,000	
技研製作所	55,000	4,175.00	229,625,000	
イビデン	110,000	6,530.00	718,300,000	
富士電機	150,000	5,900.00	885,000,000	
大泉製作所	160,000	782.00	125,120,000	
ローランド ディー・ジー	120,000	2,909.00	349,080,000	
マクセル	20,000	1,414.00	28,280,000	
スタンレー電気	180,000	2,852.00	513,360,000	
日本セラミック	190,000	2,737.00	520,030,000	
インターアクション	210,000	2,341.00	491,610,000	
メニコン	60,000	3,470.00	208,200,000	
SHOEI	124,000	4,540.00	562,960,000	
レノバ	35,000	4,645.00	162,575,000	
東急	335,000	1,545.00	517,575,000	

トランコム	45,000	8,590.00	386,550,000
ネクソン	220,000	2,226.00	489,720,000
F F R Iセキュリティ	32,000	1,296.00	41,472,000
S H I F T	9,000	23,070.00	207,630,000
GMOペイメントゲートウェイ	35,000	13,510.00	472,850,000
インターネットイニシアティブ	170,000	4,565.00	776,050,000
カナミックネットワーク	260,000	474.00	123,240,000
ニューラルポケット	70,000	1,509.00	105,630,000
ヤプリ	65,000	3,500.00	227,500,000
スパイダープラス	52,000	1,255.00	65,260,000
ビジョナル	28,000	9,470.00	265,160,000
セーフィー	55,000	1,876.00	103,180,000
S a n s a n	100,000	2,336.00	233,600,000
J T O W E R	24,000	9,600.00	230,400,000
ビザスク	32,000	4,935.00	157,920,000
ウェザーニューズ	61,000	8,980.00	547,780,000
K A D O K A W A	160,000	5,610.00	897,600,000
東宝	100,000	4,970.00	497,000,000
神戸物産	100,000	4,060.00	406,000,000
アズワン	29,000	14,370.00	416,730,000
サンエー	95,000	4,240.00	402,800,000
物語コーポレーション	85,000	6,410.00	544,850,000
シュッピン	450,000	1,008.00	453,600,000
オイシックス・ラ・大地	145,000	2,917.00	422,965,000
良品計画	290,000	1,750.00	507,500,000
ウェルスナビ	85,000	2,032.00	172,720,000
S B Iホールディングス	160,000	2,897.00	463,520,000
アニコムホールディングス	420,000	761.00	319,620,000
イー・ギャランティ	200,000	2,342.00	468,400,000
スター・マイカ・ホールディングス	202,000	1,288.00	260,176,000
S R Eホールディングス	50,000	7,390.00	369,500,000
日本M&Aセンターホールディングス	160,000	3,025.00	484,000,000
エス・エム・エス	115,000	4,215.00	484,725,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	88,000	591.00	52,008,000
カカクコム	105,000	3,075.00	322,875,000
エスプール	590,000	1,163.00	686,170,000
手間いらず	90,000	4,975.00	447,750,000
サイバーエージェント	300,000	1,852.00	555,600,000
弁護士ドットコム	52,000	6,030.00	313,560,000
ジャパンマテリアル	335,000	1,783.00	597,305,000
エラン	235,000	1,108.00	260,380,000
アトラエ	112,000	2,438.00	273,056,000



インソース	240,000	2,724.00	653,760,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	70,000	1,902.00	133,140,000	
ユーピーアール	55,000	2,629.00	144,595,000	
LITALICO	170,000	3,865.00	657,050,000	
ダイセキ	160,000	4,865.00	778,400,000	
合 計	10,229,000		29,952,117,000	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年12月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,110,807,981
株式	476,982,165,290
未収配当金	45,986,538
前払金	60,370,500
差入委託証拠金	48,255,000
流動資産合計	480,247,585,309
資産合計	480,247,585,309
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,378,200
未払解約金	320,465,096
未払利息	4,640
流動負債合計	380,847,936
負債合計	380,847,936
純資産の部	
元本等	
元本	253,747,260,881
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	226,119,476,492
元本等合計	479,866,737,373
純資産合計	479,866,737,373
負債純資産合計	480,247,585,309

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	253,747,260,881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 1.8911円 (1万口当たり純資産額) (18,911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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年12月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	217,632,289,463円
期中追加設定元本額	71,131,633,413円
期中一部解約元本額	35,016,661,995円
期末元本額	253,747,260,881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）	410,793,271円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,909,349,650円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,963,496円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,111,349,557円
世界経済インデックスファンド	3,398,921,894円
日本株式インデックス・オープン	3,390,958,579円
DCマイセレクション25	6,063,025,965円
DCマイセレクション50	18,101,402,960円
DCマイセレクション75	18,267,942,985円
DC日本株式インデックス・オープン	6,017,305,336円
DCマイセレクションS25	3,003,239,486円
DCマイセレクションS50	8,684,665,467円
DCマイセレクションS75	6,386,024,795円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,970,088,572円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	222,844,246円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	696,272,080円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	498,020,442円
DC世界経済インデックスファンド	3,415,150,395円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,698,869,569円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,293,353円

区分	2021年12月20日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,858,291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)	190,478,882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)	34,255,987円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	144,474,839円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	26,742,415円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	86,463,213円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	989,974,222円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	447,702,135円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,932,533,471円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	88,181,610円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	26,849,437円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	517,118,065円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	284,917,415円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	369,438,229円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	37,133,693円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	595,129,030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	1,907,687,828円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,344,624,777円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,711,030,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドS	5,791,455,986円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	443,631,118円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	404,065,822円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,844,765,769円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,335,274円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,688,712円
SMT インデックスバランス・オープン	59,260,852円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	26,458,329,623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	40,587,095円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	144,691,312円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	27,133,922円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,088,955円
グローバル経済コア	217,219,599円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	24,998,489円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	82,380,269円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	20,289,419円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,262,895,499円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	164,351,489円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	5,823,527円

区分	2021年12月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,001,676円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,155,732円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,306,024円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,714,527,339円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,059,668,797円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	243,923,756円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,609,411円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	85,775,952円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	47,753,953,883円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,357,691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）	102,495,873円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	4,714,280,659	
合計	4,714,280,659	

(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12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,911,435,500	-	2,851,065,000	60,370,500
合計		2,911,435,500	-	2,851,065,000	60,370,500

## (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	8,500	3,020.00	25,670,000	
日本水産	243,500	532.00	129,542,000	
マルハニチロ	38,100	2,365.00	90,106,500	
雪国まいたけ	17,800	1,160.00	20,648,000	
カネコ種苗	7,400	1,445.00	10,693,000	
サカタのタネ	29,000	3,270.00	94,830,000	
ホクト	20,400	1,887.00	38,494,800	
ホクリヨウ	3,300	681.00	2,247,300	
住石ホールディングス	42,600	129.00	5,495,400	
日鉄鉱業	5,600	6,100.00	34,160,000	
三井松島ホールディングス	10,200	1,468.00	14,973,600	
I N P E X	976,800	971.00	948,472,800	
石油資源開発	28,600	2,491.00	71,242,600	
K & O エナジーグループ	11,800	1,450.00	17,110,000	
ヒノキヤグループ	5,300	2,204.00	11,681,200	
ショーボンドホールディングス	34,700	5,130.00	178,011,000	
ミライト・ホールディングス	78,400	1,894.00	148,489,600	
タマホーム	14,800	2,208.00	32,678,400	
サンヨーホームズ	2,800	727.00	2,035,600	
日本アクア	9,700	671.00	6,508,700	
ファーストコーポレーション	7,400	697.00	5,157,800	
ベステラ	4,900	1,230.00	6,027,000	
Robot Home	40,600	213.00	8,647,800	
キャンディル	4,200	494.00	2,074,800	
スペースバリューホールディングス	26,500	1,148.00	30,422,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,700	1,509.00	7,092,300	
第一カッター興業	6,000	1,309.00	7,854,000	
安藤・間	133,800	870.00	116,406,000	
東急建設	71,300	638.00	45,489,400	
コムシスホールディングス	78,500	2,539.00	199,311,500	
ビーアールホールディングス	33,100	335.00	11,088,500	
高松コンストラクショングループ	15,100	1,954.00	29,505,400	
東建コーポレーション	7,500	9,090.00	68,175,000	
ソネック	2,500	999.00	2,497,500	
ヤマウラ	11,700	952.00	11,138,400	
オリエンタル白石	81,800	227.00	18,568,600	
大成建設	162,500	3,470.00	563,875,000	
大林組	562,300	882.00	495,948,600	
清水建設	526,700	709.00	373,430,300	

飛島建設	15,000	995.00	14,925,000
長谷工コーポレーション	167,400	1,386.00	232,016,400
松井建設	22,100	740.00	16,354,000
銭高組	2,500	3,830.00	9,575,000
鹿島建設	412,000	1,313.00	540,956,000
不動テトラ	11,900	1,665.00	19,813,500
大末建設	5,900	1,274.00	7,516,600
鉄建建設	12,200	1,799.00	21,947,800
西松建設	34,000	3,585.00	121,890,000
三井住友建設	126,800	419.00	53,129,200
大豊建設	8,200	3,710.00	30,422,000
佐田建設	12,200	469.00	5,721,800
ナカノフドー建設	13,400	322.00	4,314,800
奥村組	33,100	3,220.00	106,582,000
東鉄工業	26,100	2,432.00	63,475,200
イチケン	4,100	1,837.00	7,531,700
富士ピー・エス	7,200	493.00	3,549,600
浅沼組	6,300	5,260.00	33,138,000
戸田建設	233,500	718.00	167,653,000
熊谷組	28,700	2,851.00	81,823,700
北野建設	3,400	2,074.00	7,051,600
植木組	5,000	1,474.00	7,370,000
矢作建設工業	24,800	734.00	18,203,200
ピーエス三菱	18,500	588.00	10,878,000
日本ハウスホールディングス	38,400	454.00	17,433,600
大東建託	57,500	13,050.00	750,375,000
新日本建設	23,900	819.00	19,574,100
N I P P O	46,500	3,985.00	185,302,500
東亜道路工業	2,900	4,625.00	13,412,500
日本道路	5,400	8,100.00	43,740,000
東亜建設工業	13,800	2,392.00	33,009,600
日本国土開発	54,700	554.00	30,303,800
若築建設	9,400	1,856.00	17,446,400
東洋建設	63,000	566.00	35,658,000
五洋建設	222,900	658.00	146,668,200
世紀東急工業	27,000	818.00	22,086,000
福田組	6,000	4,190.00	25,140,000
住友林業	143,800	2,233.00	321,105,400
日本基礎技術	15,500	572.00	8,866,000
巴コーポレーション	25,000	450.00	11,250,000
大和ハウス工業	519,200	3,238.00	1,681,169,600
ライト工業	35,400	1,971.00	69,773,400



積水ハウス	609,800	2,336.50	1,424,797,700
日特建設	11,600	651.00	7,551,600
北陸電気工事	9,700	1,065.00	10,330,500
ユアテック	32,200	644.00	20,736,800
日本リーテック	11,800	1,510.00	17,818,000
四電工	6,100	1,674.00	10,211,400
中電工	25,900	2,086.00	54,027,400
関電工	91,400	839.00	76,684,600
きんでん	125,600	1,733.00	217,664,800
東京エネシス	18,700	1,076.00	20,121,200
トーエネック	5,600	3,225.00	18,060,000
住友電設	13,900	2,000.00	27,800,000
日本電設工業	30,800	1,626.00	50,080,800
エクシオグループ	85,300	2,430.00	207,279,000
新日本空調	14,900	2,287.00	34,076,300
九電工	43,400	3,430.00	148,862,000
三機工業	36,500	1,408.00	51,392,000
日揮ホールディングス	173,200	944.00	163,500,800
中外炉工業	5,600	1,549.00	8,674,400
ヤマト	16,500	735.00	12,127,500
太平電業	12,500	2,803.00	35,037,500
高砂熱学工業	50,800	1,887.00	95,859,600
三晃金属工業	2,200	2,298.00	5,055,600
朝日工業社	3,800	3,120.00	11,856,000
明星工業	36,400	725.00	26,390,000
大気社	27,300	3,070.00	83,811,000
ダイダン	12,500	2,195.00	27,437,500
日比谷総合設備	18,100	1,995.00	36,109,500
フィル・カンパニー	3,200	2,152.00	6,886,400
テスホールディングス	10,200	2,269.00	23,143,800
インフロニア・ホールディングス	239,700	1,000.00	239,700,000
東洋エンジニアリング	23,600	684.00	16,142,400
レイズネクスト	27,100	1,163.00	31,517,300
ニッポン	52,700	1,639.00	86,375,300
日清製粉グループ本社	203,300	1,694.00	344,390,200
日東富士製粉	2,600	3,655.00	9,503,000
昭和産業	17,000	2,613.00	44,421,000
鳥越製粉	15,900	690.00	10,971,000
中部飼料	20,300	940.00	19,082,000
フィード・ワン	24,200	684.00	16,552,800
東洋精糖	3,000	1,080.00	3,240,000
日本甜菜製糖	9,400	1,632.00	15,340,800

DM三井製糖ホールディングス	16,400	1,905.00	31,242,000
塩水港精糖	21,400	209.00	4,472,600
日新製糖	8,500	1,684.00	14,314,000
森永製菓	42,200	3,770.00	159,094,000
中村屋	4,300	3,625.00	15,587,500
江崎グリコ	49,500	3,710.00	183,645,000
名糖産業	7,900	1,695.00	13,390,500
井村屋グループ	10,200	2,196.00	22,399,200
不二家	10,000	2,302.00	23,020,000
山崎製パン	134,900	1,569.00	211,658,100
第一屋製パン	3,500	539.00	1,886,500
モロゾフ	2,900	5,690.00	16,501,000
亀田製菓	10,200	4,365.00	44,523,000
寿スピリッツ	17,300	5,570.00	96,361,000
カルビー	82,000	2,719.00	222,958,000
森永乳業	33,300	5,430.00	180,819,000
六甲バター	13,100	1,630.00	21,353,000
ヤクルト本社	133,300	6,130.00	817,129,000
明治ホールディングス	119,000	7,040.00	837,760,000
雪印メグミルク	43,300	2,072.00	89,717,600
プリマハム	22,500	2,403.00	54,067,500
日本ハム	68,800	4,060.00	279,328,000
林兼産業	5,500	502.00	2,761,000
丸大食品	17,700	1,506.00	26,656,200
S Foods	16,200	3,350.00	54,270,000
柿安本店	6,200	2,737.00	16,969,400
伊藤ハム米久ホールディングス	115,900	649.00	75,219,100
サッポロホールディングス	61,400	2,240.00	137,536,000
アサヒグループホールディングス	423,300	4,500.00	1,904,850,000
キリンホールディングス	661,400	1,885.50	1,247,069,700
宝ホールディングス	122,300	1,197.00	146,393,100
オエノンホールディングス	51,100	360.00	18,396,000
養命酒製造	5,500	1,768.00	9,724,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	126,300	1,337.00	168,863,100
サントリー食品インターナショナル	120,400	4,230.00	509,292,000
ダイトーグループホールディングス	9,200	4,750.00	43,700,000
伊藤園	54,600	6,110.00	333,606,000
キーコーヒー	17,700	2,000.00	35,400,000
ユニカフェ	5,400	1,014.00	5,475,600
ジャパンフーズ	2,600	1,221.00	3,174,600
日清オイリオグループ	22,500	2,849.00	64,102,500
不二製油グループ本社	39,000	2,294.00	89,466,000

かどや製油	2,000	4,020.00	8,040,000
J-オイルミルズ	16,800	1,630.00	27,384,000
キッコーマン	129,500	9,170.00	1,187,515,000
味の素	397,400	3,457.00	1,373,811,800
ブルドックソース	7,600	2,094.00	15,914,400
キューピー	94,500	2,487.00	235,021,500
ハウス食品グループ本社	67,300	2,948.00	198,400,400
カゴメ	68,300	3,000.00	204,900,000
焼津水産化学工業	8,700	935.00	8,134,500
アリアケジャパン	16,400	6,430.00	105,452,000
ピエトロ	2,400	1,787.00	4,288,800
エバラ食品工業	3,900	2,665.00	10,393,500
やまみ	1,900	1,822.00	3,461,800
ニチレイ	85,700	2,705.00	231,818,500
東洋水産	86,400	4,860.00	419,904,000
イトアンドホールディングス	6,800	2,117.00	14,395,600
大冷	2,000	1,932.00	3,864,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,300	619.00	5,756,700
日清食品ホールディングス	70,600	8,770.00	619,162,000
永谷園ホールディングス	8,000	1,940.00	15,520,000
一正蒲鉾	7,000	805.00	5,635,000
フジッコ	19,500	1,872.00	36,504,000
ロック・フィールド	19,400	1,477.00	28,653,800
日本たばこ産業	964,800	2,378.00	2,294,294,400
ケンコーマヨネーズ	10,100	1,320.00	13,332,000
わらべや日洋ホールディングス	11,800	1,975.00	23,305,000
なとり	10,000	2,000.00	20,000,000
イフジ産業	3,100	948.00	2,938,800
ピクルスコーポレーション	8,600	1,840.00	15,824,000
ファーマフーズ	17,000	2,117.00	35,989,000
ユーグレナ	91,600	705.00	64,578,000
紀文食品	10,500	945.00	9,922,500
ミヨシ油脂	6,900	1,311.00	9,045,900
理研ビタミン	18,700	1,666.00	31,154,200
片倉工業	19,800	2,360.00	46,728,000
ゲンゼ	11,900	3,980.00	47,362,000
東洋紡	69,800	1,228.00	85,714,400
ユニチカ	49,900	286.00	14,271,400
富士紡ホールディングス	8,000	3,900.00	31,200,000
倉敷紡績	15,300	1,956.00	29,926,800
シキボウ	9,200	896.00	8,243,200
日本毛織	53,500	912.00	48,792,000

トーア紡コーポレーション	6,500	426.00	2,769,000
帝国繊維	20,100	2,031.00	40,823,100
帝人	165,600	1,374.00	227,534,400
東レ	1,272,100	666.80	848,236,280
住江織物	3,800	1,471.00	5,589,800
日本フェルト	11,100	441.00	4,895,100
イチカワ	2,600	1,363.00	3,543,800
日東製網	1,900	1,400.00	2,660,000
アツギ	13,800	563.00	7,769,400
ダイニック	6,600	693.00	4,573,800
セーレン	36,200	2,335.00	84,527,000
ソトー	6,600	809.00	5,339,400
東海染工	2,200	1,131.00	2,488,200
小松マテーレ	29,000	1,224.00	35,496,000
ワコールホールディングス	43,900	2,124.00	93,243,600
ホギメディカル	23,700	3,225.00	76,432,500
T S Iホールディングス	59,200	325.00	19,240,000
マツオカコーポレーション	5,800	1,188.00	6,890,400
ワールド	23,100	1,111.00	25,664,100
三陽商会	8,400	886.00	7,442,400
ナイガイ	6,600	306.00	2,019,600
オンワードホールディングス	106,100	282.00	29,920,200
ルックホールディングス	5,700	1,233.00	7,028,100
ゴールドウイン	31,700	6,370.00	201,929,000
デサント	34,300	3,925.00	134,627,500
キング	8,800	549.00	4,831,200
ヤマトインターナショナル	16,000	290.00	4,640,000
特種東海製紙	10,800	4,010.00	43,308,000
王子ホールディングス	734,000	550.00	403,700,000
日本製紙	84,100	1,081.00	90,912,100
三菱製紙	24,900	311.00	7,743,900
北越コーポレーション	115,100	693.00	79,764,300
中越パルプ工業	6,700	945.00	6,331,500
巴川製紙所	5,300	793.00	4,202,900
大王製紙	84,700	1,835.00	155,424,500
阿波製紙	4,500	333.00	1,498,500
レンゴー	166,000	850.00	141,100,000
トーモク	10,800	1,708.00	18,446,400
ザ・バック	13,300	2,714.00	36,096,200
北の達人コーポレーション	62,800	336.00	21,100,800
クラレ	256,800	990.00	254,232,000
旭化成	1,163,900	1,063.50	1,237,807,650

共和レザー	10,900	630.00	6,867,000	
昭和電工	152,300	2,397.00	365,063,100	
住友化学	1,290,100	517.00	666,981,700	
住友精化	7,800	3,020.00	23,556,000	
日産化学	95,500	6,470.00	617,885,000	
ラサ工業	6,200	1,601.00	9,926,200	
クレハ	13,900	8,020.00	111,478,000	
多木化学	6,800	5,510.00	37,468,000	
テイカ	12,900	1,238.00	15,970,200	
石原産業	29,200	1,104.00	32,236,800	
片倉コープアグリ	4,200	1,151.00	4,834,200	
日本曹達	22,500	3,205.00	72,112,500	
東ソー	253,300	1,666.00	421,997,800	
トクヤマ	56,200	1,778.00	99,923,600	
セントラル硝子	28,700	2,024.00	58,088,800	
東亜合成	100,000	1,163.00	116,300,000	
大阪ソーダ	16,400	2,845.00	46,658,000	
関東電化工業	38,400	1,013.00	38,899,200	
デンカ	64,100	3,570.00	228,837,000	
信越化学工業	301,500	19,225.00	5,796,337,500	
日本カーバイド工業	6,200	1,267.00	7,855,400	
堺化学工業	12,300	2,214.00	27,232,200	
第一稀元素化学工業	16,300	1,216.00	19,820,800	
エア・ウォーター	166,300	1,770.00	294,351,000	
日本酸素ホールディングス	168,800	2,523.00	425,882,400	
日本化学工業	5,500	2,562.00	14,091,000	
東邦アセチレン	2,900	1,217.00	3,529,300	
日本パーカライジング	88,600	1,085.00	96,131,000	
高压ガス工業	27,800	756.00	21,016,800	
チタン工業	2,000	1,622.00	3,244,000	
四国化成工業	22,900	1,346.00	30,823,400	
戸田工業	3,700	3,715.00	13,745,500	
ステラ ケミファ	8,800	2,462.00	21,665,600	
保土谷化学工業	5,600	5,390.00	30,184,000	
日本触媒	29,500	5,250.00	154,875,000	
大日精化工業	14,500	2,206.00	31,987,000	
カネカ	45,400	3,645.00	165,483,000	
三菱瓦斯化学	163,300	1,874.00	306,024,200	
三井化学	159,500	3,045.00	485,677,500	
J S R	163,600	4,255.00	696,118,000	
東京応化工業	30,100	6,770.00	203,777,000	
大阪有機化学工業	15,000	3,320.00	49,800,000	

三菱ケミカルホールディングス	1,173,800	828.10	972,023,780	
KHネオケム	28,900	2,979.00	86,093,100	
ダイセル	252,900	776.00	196,250,400	
住友ベークライト	27,600	5,470.00	150,972,000	
積水化学工業	367,400	1,891.00	694,753,400	
日本ゼオン	158,400	1,240.00	196,416,000	
アイカ工業	48,900	3,435.00	167,971,500	
宇部興産	82,800	1,943.00	160,880,400	
積水樹脂	26,500	2,023.00	53,609,500	
タキロンシーアイ	38,000	533.00	20,254,000	
旭有機材	9,900	1,614.00	15,978,600	
ニチバン	10,400	1,795.00	18,668,000	
リケンテクノス	42,800	491.00	21,014,800	
大倉工業	9,000	2,141.00	19,269,000	
積水化成成品工業	23,500	474.00	11,139,000	
群栄化学工業	4,000	3,440.00	13,760,000	
タイガースポリマー	9,200	448.00	4,121,600	
ミライアル	5,600	1,753.00	9,816,800	
ダイキアクシス	6,800	830.00	5,644,000	
ダイキョーニシカワ	37,000	546.00	20,202,000	
竹本容器	6,300	850.00	5,355,000	
森六ホールディングス	9,400	1,781.00	16,741,400	
恵和	4,800	5,110.00	24,528,000	
日本化薬	138,300	1,178.00	162,917,400	
カーリットホールディングス	17,400	653.00	11,362,200	
日本精化	14,100	2,154.00	30,371,400	
扶桑化学工業	15,800	4,575.00	72,285,000	
トリケミカル研究所	18,100	3,495.00	63,259,500	
ADEKA	80,900	2,463.00	199,256,700	
日油	59,900	5,610.00	336,039,000	
新日本理化	29,100	246.00	7,158,600	
ハリマ化成グループ	13,100	792.00	10,375,200	
花王	396,600	6,062.00	2,404,189,200	
第一工業製薬	6,500	2,987.00	19,415,500	
石原ケミカル	8,900	1,300.00	11,570,000	
日華化学	5,900	819.00	4,832,100	
ニイタカ	3,600	2,122.00	7,639,200	
三洋化成工業	10,500	5,110.00	53,655,000	
有機合成薬品工業	12,200	264.00	3,220,800	
大日本塗料	21,500	820.00	17,630,000	
日本ペイントホールディングス	659,700	1,207.00	796,257,900	
関西ペイント	182,100	2,538.00	462,169,800	

神東塗料	13,800	175.00	2,415,000	
中国塗料	41,400	903.00	37,384,200	
日本特殊塗料	13,100	821.00	10,755,100	
藤倉化成	21,900	472.00	10,336,800	
太陽ホールディングス	25,900	3,215.00	83,268,500	
D I C	74,200	2,875.00	213,325,000	
サカタインクス	34,800	990.00	34,452,000	
東洋インキＳＣホールディングス	37,100	1,935.00	71,788,500	
T & K T O K A	14,200	790.00	11,218,000	
富士フィルムホールディングス	315,100	8,405.00	2,648,415,500	
資生堂	334,000	6,508.00	2,173,672,000	
ライオン	216,400	1,605.00	347,322,000	
高砂香料工業	12,300	2,764.00	33,997,200	
マンダム	37,600	1,363.00	51,248,800	
ミルボン	22,100	5,720.00	126,412,000	
ファンケル	72,600	3,475.00	252,285,000	
コーセー	33,700	13,270.00	447,199,000	
コタ	11,400	1,564.00	17,829,600	
シーボン	2,300	1,690.00	3,887,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	76,500	1,994.00	152,541,000	
ノエビアホールディングス	15,200	5,370.00	81,624,000	
アジュバンホールディングス	4,000	1,115.00	4,460,000	
新日本製薬	4,900	1,133.00	5,551,700	
エステー	11,500	1,511.00	17,376,500	
アグロ カネショウ	6,000	1,265.00	7,590,000	
コニシ	29,500	1,662.00	49,029,000	
長谷川香料	30,900	2,708.00	83,677,200	
星光P M C	10,100	687.00	6,938,700	
小林製薬	50,200	9,170.00	460,334,000	
荒川化学工業	14,900	1,162.00	17,313,800	
メック	13,400	3,825.00	51,255,000	
日本高純度化学	4,900	2,501.00	12,254,900	
タカラバイオ	46,900	2,633.00	123,487,700	
J C U	20,200	4,940.00	99,788,000	
新田ゼラチン	11,300	595.00	6,723,500	
O A T アグリオ	3,700	1,854.00	6,859,800	
デクセリアルズ	46,600	3,775.00	175,915,000	
アース製薬	14,700	6,210.00	91,287,000	
北興化学工業	16,700	860.00	14,362,000	
大成ラミック	5,500	2,790.00	15,345,000	
クミアイ化学工業	66,700	771.00	51,425,700	
日本農薬	31,900	470.00	14,993,000	

アキレス	11,500	1,235.00	14,202,500
有沢製作所	26,200	937.00	24,549,400
日東電工	108,400	8,530.00	924,652,000
レック	23,400	818.00	19,141,200
三光合成	18,800	364.00	6,843,200
きもと	27,400	213.00	5,836,200
藤森工業	16,100	3,810.00	61,341,000
前澤化成工業	11,400	1,285.00	14,649,000
未来工業	6,400	1,583.00	10,131,200
ウェーブロックホールディングス	6,800	731.00	4,970,800
J S P	10,500	1,583.00	16,621,500
エフピコ	33,000	3,865.00	127,545,000
天馬	14,700	2,561.00	37,646,700
信越ポリマー	32,200	1,084.00	34,904,800
東リ	44,600	220.00	9,812,000
ニフコ	59,800	3,380.00	202,124,000
バルカー	14,600	2,479.00	36,193,400
ユニ・チャーム	345,600	4,870.00	1,683,072,000
ショーエイコーポレーション	4,800	635.00	3,048,000
協和キリン	210,400	3,160.00	664,864,000
武田薬品工業	1,409,200	3,126.00	4,405,159,200
アステラス製薬	1,554,500	1,837.50	2,856,393,750
大日本住友製薬	110,700	1,335.00	147,784,500
塩野義製薬	225,500	7,712.00	1,739,056,000
わかもと製薬	21,300	290.00	6,177,000
日本新薬	46,900	7,960.00	373,324,000
中外製薬	560,800	3,617.00	2,028,413,600
科研製薬	28,100	4,225.00	118,722,500
エーザイ	214,600	6,876.00	1,475,589,600
ロート製薬	92,000	3,400.00	312,800,000
小野薬品工業	411,700	2,821.00	1,161,405,700
久光製薬	47,400	3,940.00	186,756,000
持田製薬	22,600	3,385.00	76,501,000
参天製薬	334,300	1,391.00	465,011,300
扶桑薬品工業	6,300	2,529.00	15,932,700
日本ケミファ	2,100	2,001.00	4,202,100
ツムラ	55,500	3,260.00	180,930,000
日医工	55,600	688.00	38,252,800
キッセイ薬品工業	31,700	2,200.00	69,740,000
生化学工業	31,600	925.00	29,230,000
栄研化学	31,500	1,905.00	60,007,500
日水製薬	6,600	1,073.00	7,081,800



鳥居薬品	9,600	2,867.00	27,523,200
JCRファーマ	50,500	2,198.00	110,999,000
東和薬品	25,800	2,680.00	69,144,000
富士製薬工業	11,000	981.00	10,791,000
ゼリア新薬工業	32,500	1,948.00	63,310,000
第一三共	1,408,900	2,771.00	3,904,061,900
キョーリン製薬ホールディングス	36,000	1,774.00	63,864,000
大幸薬品	27,000	705.00	19,035,000
ダイト	11,500	2,927.00	33,660,500
大塚ホールディングス	372,600	4,204.00	1,566,410,400
大正製薬ホールディングス	42,700	5,340.00	228,018,000
ペプチドリーム	94,100	2,727.00	256,610,700
あすか製薬ホールディングス	20,400	931.00	18,992,400
サワイグループホールディングス	39,300	4,440.00	174,492,000
日本コークス工業	151,500	122.00	18,483,000
ニチレキ	22,900	1,393.00	31,899,700
ユシロ化学工業	9,300	1,067.00	9,923,100
ビーピー・カストロール	6,400	1,385.00	8,864,000
富士石油	47,900	244.00	11,687,600
MORESCO	5,900	1,118.00	6,596,200
出光興産	199,000	2,881.00	573,319,000
ENEOSホールディングス	2,697,100	424.40	1,144,649,240
コスモエネルギーホールディングス	51,900	2,240.00	116,256,000
横浜ゴム	103,800	1,762.00	182,895,600
TOYO TIRE	94,400	1,729.00	163,217,600
ブリヂストン	516,400	4,748.00	2,451,867,200
住友ゴム工業	161,100	1,137.00	183,170,700
藤倉コンポジット	14,400	789.00	11,361,600
オカモト	10,600	4,025.00	42,665,000
フコク	7,800	942.00	7,347,600
ニッタ	18,500	2,843.00	52,595,500
住友理工	34,700	585.00	20,299,500
三ツ星ベルト	21,800	2,079.00	45,322,200
バンドー化学	28,900	866.00	25,027,400
日東紡績	26,700	2,829.00	75,534,300
AGC	164,600	5,400.00	888,840,000
日本板硝子	86,000	489.00	42,054,000
石塚硝子	3,100	1,972.00	6,113,200
日本山村硝子	6,900	776.00	5,354,400
日本電気硝子	72,000	2,933.00	211,176,000
オハラ	7,100	1,229.00	8,725,900
住友大阪セメント	33,200	3,535.00	117,362,000

太平洋セメント	101,900	2,261.00	230,395,900
日本ヒューム	18,100	678.00	12,271,800
日本コンクリート工業	35,700	262.00	9,353,400
三谷セキサン	8,400	7,560.00	63,504,000
アジアパイルホールディングス	27,800	436.00	12,120,800
東海カーボン	150,300	1,187.00	178,406,100
日本カーボン	9,200	4,220.00	38,824,000
東洋炭素	11,700	3,250.00	38,025,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,900	4,715.00	46,678,500
TOTO	128,100	5,170.00	662,277,000
日本碍子	194,300	1,878.00	364,895,400
日本特殊陶業	136,400	1,947.00	265,570,800
MARUWA	6,200	14,860.00	92,132,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,620.00	15,204,000
黒崎播磨	3,100	4,010.00	12,431,000
ヨータイ	11,500	1,220.00	14,030,000
イソライト工業	8,000	845.00	6,760,000
東京窯業	23,100	306.00	7,068,600
ニッカトー	8,200	677.00	5,551,400
フジインコーポレーテッド	14,400	7,270.00	104,688,000
クニミネ工業	5,700	1,012.00	5,768,400
エーアンドエーマテリアル	3,100	894.00	2,771,400
ニチアス	41,600	2,655.00	110,448,000
ニチハ	25,000	2,912.00	72,800,000
日本製鉄	793,500	1,848.50	1,466,784,750
神戸製鋼所	331,000	560.00	185,360,000
中山製鋼所	28,300	420.00	11,886,000
合同製鐵	9,600	1,360.00	13,056,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	478,900	1,449.00	693,926,100
東京製鐵	60,500	1,345.00	81,372,500
共英製鋼	20,000	1,324.00	26,480,000
大和工業	33,900	3,580.00	121,362,000
東京鐵鋼	7,900	1,311.00	10,356,900
大阪製鐵	9,500	1,155.00	10,972,500
淀川製鋼所	23,300	2,448.00	57,038,400
丸一鋼管	62,800	2,538.00	159,386,400
モリ工業	5,300	2,639.00	13,986,700
大同特殊鋼	29,000	4,035.00	117,015,000
日本高周波鋼業	6,700	332.00	2,224,400
日本冶金工業	13,000	2,160.00	28,080,000
山陽特殊製鋼	18,200	1,955.00	35,581,000
愛知製鋼	10,000	2,470.00	24,700,000

日立金属	191,000	2,115.00	403,965,000
日本金属	4,500	964.00	4,338,000
大太平洋金属	10,900	2,033.00	22,159,700
新日本電工	114,700	288.00	33,033,600
栗本鐵工所	8,100	1,498.00	12,133,800
虹技	2,500	968.00	2,420,000
三菱製鋼	11,400	990.00	11,286,000
日亜鋼業	23,300	268.00	6,244,400
日本精線	2,900	4,780.00	13,862,000
エンビプロ・ホールディングス	7,600	1,710.00	12,996,000
シンニッタン	21,700	219.00	4,752,300
新家工業	4,400	1,603.00	7,053,200
大紀アルミニウム工業所	26,800	1,398.00	37,466,400
日本軽金属ホールディングス	44,900	1,656.00	74,354,400
三井金属鉱業	47,900	3,010.00	144,179,000
東邦亜鉛	9,900	2,143.00	21,215,700
三菱マテリアル	117,200	1,944.00	227,836,800
住友金属鉱山	226,600	4,304.00	975,286,400
D O W Aホールディングス	48,300	4,515.00	218,074,500
古河機械金属	29,400	1,225.00	36,015,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,600	760.00	15,656,000
東邦チタニウム	31,900	884.00	28,199,600
U A C J	26,900	2,436.00	65,528,400
C Kサンエツ	3,700	3,990.00	14,763,000
古河電気工業	55,100	2,212.00	121,881,200
住友電気工業	663,000	1,461.00	968,643,000
フジクラ	197,800	539.00	106,614,200
昭和電線ホールディングス	15,500	1,679.00	26,024,500
東京特殊電線	2,700	2,928.00	7,905,600
タツタ電線	31,500	458.00	14,427,000
カナレ電気	2,700	1,735.00	4,684,500
平河ヒューテック	9,900	1,182.00	11,701,800
リョービ	21,900	1,064.00	23,301,600
アーレスティ	19,200	357.00	6,854,400
アサヒホールディングス	71,000	1,987.00	141,077,000
稲葉製作所	10,000	1,323.00	13,230,000
宮地エンジニアリンググループ	5,400	3,185.00	17,199,000
トーカロ	45,700	1,425.00	65,122,500
アルファC o	6,800	1,101.00	7,486,800
S U M C O	272,900	2,225.00	607,202,500
川田テクノロジーズ	3,600	4,005.00	14,418,000
R S Technologies	5,800	5,910.00	34,278,000

ジェイテックコーポレーション	2,000	1,761.00	3,522,000	
信和	11,000	790.00	8,690,000	
東洋製罐グループホールディングス	112,900	1,402.00	158,285,800	
ホッカンホールディングス	9,700	1,426.00	13,832,200	
コロナ	9,800	898.00	8,800,400	
横河ブリッジホールディングス	30,400	2,160.00	65,664,000	
駒井ハルテック	3,300	2,208.00	7,286,400	
高田機工	1,600	2,728.00	4,364,800	
三和ホールディングス	167,200	1,179.00	197,128,800	
文化シャッター	56,300	1,031.00	58,045,300	
三協立山	22,800	709.00	16,165,200	
アルインコ	12,900	945.00	12,190,500	
東洋シャッター	3,900	587.00	2,289,300	
L I X I L	279,000	2,972.00	829,188,000	
日本フィルコン	12,300	519.00	6,383,700	
ノーリツ	33,900	1,688.00	57,223,200	
長府製作所	18,000	2,033.00	36,594,000	
リンナイ	33,400	10,340.00	345,356,000	
ダイニチ工業	8,500	755.00	6,417,500	
日東精工	22,300	592.00	13,201,600	
三洋工業	2,200	1,818.00	3,999,600	
岡部	35,900	725.00	26,027,500	
ジーテクト	22,000	1,376.00	30,272,000	
東プレ	33,100	1,096.00	36,277,600	
高周波熱錬	31,700	567.00	17,973,900	
東京製綱	10,900	867.00	9,450,300	
サンコール	15,200	452.00	6,870,400	
モリテック スチール	13,800	361.00	4,981,800	
パイオラックス	26,200	1,682.00	44,068,400	
エイチワン	17,400	647.00	11,257,800	
日本発條	163,000	979.00	159,577,000	
中央発條	8,500	828.00	7,038,000	
アドバネクス	2,400	1,261.00	3,026,400	
立川ブラインド工業	7,800	1,122.00	8,751,600	
三益半導体工業	13,800	2,382.00	32,871,600	
日本ドライケミカル	4,500	1,967.00	8,851,500	
日本製鋼所	53,900	3,520.00	189,728,000	
三浦工業	76,800	3,935.00	302,208,000	
タクマ	60,300	1,412.00	85,143,600	
ツガミ	42,400	1,582.00	67,076,800	
オークマ	20,700	4,890.00	101,223,000	
芝浦機械	20,100	3,580.00	71,958,000	

アマダ	280,100	1,078.00	301,947,800
アイダエンジニアリング	46,700	952.00	44,458,400
滝澤鉄工所	5,200	1,142.00	5,938,400
F U J I	81,700	2,572.00	210,132,400
牧野フライス製作所	19,500	3,830.00	74,685,000
オーエスジー	82,200	1,708.00	140,397,600
ダイジェット工業	2,300	972.00	2,235,600
旭ダイヤモンド工業	47,000	609.00	28,623,000
D M G 森精機	105,300	1,860.00	195,858,000
ソディック	39,400	771.00	30,377,400
ディスコ	26,100	32,900.00	858,690,000
日東工器	9,800	1,751.00	17,159,800
日進工具	14,000	1,548.00	21,672,000
パンチ工業	15,000	504.00	7,560,000
富士ダイス	9,100	644.00	5,860,400
豊和工業	9,500	786.00	7,467,000
O K K	6,800	800.00	5,440,000
東洋機械金属	11,700	488.00	5,709,600
津田駒工業	3,400	661.00	2,247,400
エンシュウ	4,400	631.00	2,776,400
島精機製作所	26,100	1,967.00	51,338,700
オプトラン	22,300	2,337.00	52,115,100
N C ホールディングス	5,100	1,450.00	7,395,000
イワキポンプ	11,400	1,012.00	11,536,800
フリュー	15,800	1,223.00	19,323,400
ヤマシンフィルタ	36,000	479.00	17,244,000
日阪製作所	22,000	804.00	17,688,000
やまびこ	34,500	1,243.00	42,883,500
野村マイクロ・サイエンス	4,700	4,955.00	23,288,500
平田機工	8,400	5,860.00	49,224,000
ペガサスミシン製造	18,200	491.00	8,936,200
マルマエ	7,300	2,743.00	20,023,900
タツモ	8,300	1,480.00	12,284,000
ナプテスコ	101,200	3,155.00	319,286,000
三井海洋開発	18,900	1,358.00	25,666,200
レオン自動機	19,000	1,327.00	25,213,000
S M C	52,500	75,120.00	3,943,800,000
ホソカワミクロン	12,500	3,070.00	38,375,000
ユニオンツール	6,600	3,705.00	24,453,000
オイレス工業	24,900	1,743.00	43,400,700
日精エー・エス・ビー機械	6,000	2,949.00	17,694,000
サトーホールディングス	23,400	2,098.00	49,093,200

技研製作所	15,700	4,175.00	65,547,500
日本エアージェット	8,200	1,228.00	10,069,600
カワタ	5,700	887.00	5,055,900
日精樹脂工業	12,700	1,001.00	12,712,700
オカダアイヨン	5,700	1,482.00	8,447,400
ワイエイシーホールディングス	7,100	857.00	6,084,700
小松製作所	812,600	2,597.00	2,110,322,200
住友重機械工業	102,700	2,587.00	265,684,900
日立建機	71,900	3,175.00	228,282,500
日工	25,000	607.00	15,175,000
巴工業	7,100	2,250.00	15,975,000
井関農機	16,800	1,357.00	22,797,600
TOWA	15,400	3,080.00	47,432,000
丸山製作所	3,800	1,566.00	5,950,800
北川鉄工所	8,300	1,457.00	12,093,100
ローツェ	8,800	11,370.00	100,056,000
タカキタ	6,400	620.00	3,968,000
クボタ	874,700	2,480.00	2,169,256,000
荏原実業	8,300	2,487.00	20,642,100
三菱化工機	5,900	2,129.00	12,561,100
月島機械	33,300	1,084.00	36,097,200
帝国電機製作所	12,600	1,470.00	18,522,000
新東工業	39,900	686.00	27,371,400
澁谷工業	15,800	2,900.00	45,820,000
アイチ コーポレーション	26,500	793.00	21,014,500
小森コーポレーション	45,800	706.00	32,334,800
鶴見製作所	14,000	1,593.00	22,302,000
住友精密工業	2,700	2,038.00	5,502,600
日本ギア工業	6,700	265.00	1,775,500
酒井重工業	3,300	2,705.00	8,926,500
荏原製作所	74,500	6,090.00	453,705,000
石井鐵工所	2,600	2,982.00	7,753,200
西島製作所	16,500	898.00	14,817,000
北越工業	16,900	974.00	16,460,600
ダイキン工業	228,400	25,035.00	5,717,994,000
オルガノ	5,200	7,570.00	39,364,000
トーヨーカネツ	6,900	2,471.00	17,049,900
栗田工業	97,100	5,140.00	499,094,000
椿本チエイン	23,500	2,947.00	69,254,500
大同工業	8,200	934.00	7,658,800
木村化工機	15,200	828.00	12,585,600
アネスト岩田	28,000	880.00	24,640,000

ダイフク	98,700	9,540.00	941,598,000
サムコ	4,500	2,627.00	11,821,500
加藤製作所	8,900	783.00	6,968,700
油研工業	3,200	1,703.00	5,449,600
タダノ	94,000	1,026.00	96,444,000
フジテック	66,500	2,350.00	156,275,000
C K D	53,000	2,206.00	116,918,000
キトー	15,300	1,826.00	27,937,800
平和	50,100	1,861.00	93,236,100
理想科学工業	15,100	2,066.00	31,196,600
S A N K Y O	38,800	3,010.00	116,788,000
日本金銭機械	18,300	659.00	12,059,700
マースグループホールディングス	11,400	1,618.00	18,445,200
フクシマガリレイ	12,300	4,510.00	55,473,000
オーイズミ	6,500	379.00	2,463,500
ダイコク電機	8,300	1,195.00	9,918,500
竹内製作所	27,300	2,608.00	71,198,400
アマノ	47,000	2,512.00	118,064,000
J U K I	24,900	867.00	21,588,300
ジャノメ	15,400	650.00	10,010,000
マックス	23,900	1,807.00	43,187,300
グローリー	46,100	2,162.00	99,668,200
新晃工業	16,700	1,892.00	31,596,400
大和冷機工業	26,000	1,188.00	30,888,000
セガサミーホールディングス	177,900	1,815.00	322,888,500
日本ピストンリング	6,600	1,231.00	8,124,600
リケン	7,700	2,475.00	19,057,500
T P R	24,200	1,341.00	32,452,200
ツバキ・ナカシマ	39,400	1,407.00	55,435,800
ホシザキ	52,400	8,480.00	444,352,000
大豊工業	14,800	767.00	11,351,600
日本精工	337,700	725.00	244,832,500
N T N	385,300	223.00	85,921,900
ジェイテクト	172,100	986.00	169,690,600
不二越	15,300	3,930.00	60,129,000
日本トムソン	49,300	620.00	30,566,000
T H K	104,300	2,577.00	268,781,100
ユースン精機	14,000	728.00	10,192,000
前澤給装工業	13,500	1,015.00	13,702,500
イーグル工業	22,300	1,051.00	23,437,300
前澤工業	10,900	582.00	6,343,800
日本ピラー工業	18,200	3,170.00	57,694,000

キッツ	60,500	684.00	41,382,000
マキタ	218,200	4,894.00	1,067,870,800
三井E & Sホールディングス	64,800	365.00	23,652,000
日立造船	152,000	741.00	112,632,000
三菱重工業	281,800	2,587.00	729,016,600
I H I	112,100	2,171.00	243,369,100
スター精密	27,700	1,568.00	43,433,600
日清紡ホールディングス	109,600	865.00	94,804,000
イビデン	94,200	6,530.00	615,126,000
コニカミノルタ	393,500	496.00	195,176,000
ブラザー工業	219,300	2,089.00	458,117,700
ミネベアミツミ	309,300	3,085.00	954,190,500
日立製作所	862,300	6,165.00	5,316,079,500
東芝	313,300	4,545.00	1,423,948,500
三菱電機	1,792,800	1,451.00	2,601,352,800
富士電機	108,000	5,900.00	637,200,000
東洋電機製造	7,000	1,014.00	7,098,000
安川電機	193,000	5,560.00	1,073,080,000
シンフォニアテクノロジー	21,600	1,243.00	26,848,800
明電舎	30,400	2,558.00	77,763,200
オリジン	4,500	1,235.00	5,557,500
山洋電気	8,100	5,610.00	45,441,000
デンヨー	15,300	1,731.00	26,484,300
P H Cホールディングス	20,900	1,943.00	40,608,700
東芝テック	19,200	4,495.00	86,304,000
芝浦メカトロニクス	3,300	8,310.00	27,423,000
マブチモーター	42,200	3,720.00	156,984,000
日本電産	464,700	13,275.00	6,168,892,500
トレックス・セミコンダクター	9,300	3,115.00	28,969,500
東光高岳	10,800	1,343.00	14,504,400
ダイヘン	19,600	4,440.00	87,024,000
ヤーマン	30,200	926.00	27,965,200
J V Cケンウッド	152,100	165.00	25,096,500
ミマキエンジニアリング	17,300	857.00	14,826,100
I - P E X	8,900	1,895.00	16,865,500
日新電機	42,000	1,479.00	62,118,000
大崎電気工業	32,900	446.00	14,673,400
オムロン	149,200	11,440.00	1,706,848,000
日東工業	23,900	1,568.00	37,475,200
I D E C	22,200	2,561.00	56,854,200
正興電機製作所	6,600	1,135.00	7,491,000
不二電機工業	4,300	1,159.00	4,983,700



ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,200	2,376.00	143,035,200
サクサホールディングス	4,200	1,329.00	5,581,800
メルコホールディングス	5,200	3,980.00	20,696,000
テクノメディカ	4,700	1,657.00	7,787,900
日本電気	227,800	5,150.00	1,173,170,000
富士通	161,300	19,130.00	3,085,669,000
沖電気工業	72,800	882.00	64,209,600
岩崎通信機	7,400	836.00	6,186,400
電気興業	9,400	2,419.00	22,738,600
サンケン電気	16,800	5,890.00	98,952,000
ナカヨ	3,300	1,188.00	3,920,400
アイホン	10,100	2,073.00	20,937,300
ルネサスエレクトロニクス	972,100	1,354.00	1,316,223,400
セイコーエプソン	222,400	1,974.00	439,017,600
ワコム	140,000	910.00	127,400,000
アルバック	33,000	6,920.00	228,360,000
アクセル	9,000	1,007.00	9,063,000
E I Z O	13,900	3,980.00	55,322,000
日本信号	45,600	900.00	41,040,000
京三製作所	38,500	449.00	17,286,500
能美防災	24,100	2,183.00	52,610,300
ホーチキ	13,900	1,300.00	18,070,000
星和電機	10,400	496.00	5,158,400
エレコム	41,700	1,451.00	60,506,700
パナソニック	1,912,200	1,222.00	2,336,708,400
シャープ	204,400	1,228.00	251,003,200
アンリツ	115,500	1,740.00	200,970,000
富士通ゼネラル	48,700	2,678.00	130,418,600
ソニーグループ	1,123,100	13,440.00	15,094,464,000
T D K	259,900	4,415.00	1,147,458,500
帝国通信工業	8,800	1,282.00	11,281,600
タムラ製作所	69,100	624.00	43,118,400
アルプスアルパイン	159,500	1,078.00	171,941,000
池上通信機	5,300	682.00	3,614,600
日本電波工業	16,700	1,523.00	25,434,100
鈴木	9,300	843.00	7,839,900
メイコー	14,800	4,170.00	61,716,000
日本トリム	3,700	3,230.00	11,951,000
ローランド ディー . ジー .	10,900	2,909.00	31,708,100
フォスター電機	18,100	721.00	13,050,100
S M K	4,200	2,183.00	9,168,600
ヨコオ	13,600	2,744.00	37,318,400

ホシデン	43,900	1,156.00	50,748,400
ヒロセ電機	27,600	19,070.00	526,332,000
日本航空電子工業	41,100	1,920.00	78,912,000
TOA	19,300	782.00	15,092,600
マクセル	36,300	1,414.00	51,328,200
古野電気	22,200	1,162.00	25,796,400
ユニデンホールディングス	3,900	3,425.00	13,357,500
スミダコーポレーション	17,700	1,170.00	20,709,000
アイコム	6,700	2,358.00	15,798,600
リオン	7,300	2,268.00	16,556,400
本多通信工業	16,600	420.00	6,972,000
横河電機	179,400	2,033.00	364,720,200
新電元工業	6,900	3,430.00	23,667,000
アズビル	105,100	4,935.00	518,668,500
東亜ディーケーケー	10,200	860.00	8,772,000
日本光電工業	74,300	3,210.00	238,503,000
チノー	5,700	1,574.00	8,971,800
共和電業	17,200	390.00	6,708,000
日本電子材料	8,700	2,470.00	21,489,000
堀場製作所	33,100	6,570.00	217,467,000
アドバンテスト	133,300	10,200.00	1,359,660,000
小野測器	9,800	486.00	4,762,800
エスベック	15,000	2,104.00	31,560,000
キーエンス	162,500	71,580.00	11,631,750,000
日置電機	8,700	8,620.00	74,994,000
シスメックス	151,700	14,775.00	2,241,367,500
日本マイクロニクス	31,700	1,719.00	54,492,300
メガチップス	16,800	4,860.00	81,648,000
OBARA GROUP	8,400	3,360.00	28,224,000
澤藤電機	2,800	1,650.00	4,620,000
原田工業	9,600	983.00	9,436,800
コーセル	23,000	833.00	19,159,000
イリソ電子工業	15,200	4,280.00	65,056,000
オブテックスグループ	30,000	1,560.00	46,800,000
千代田インテグレ	8,000	2,012.00	16,096,000
アイ・オー・データ機器	8,100	751.00	6,083,100
レーザーテック	78,800	30,230.00	2,382,124,000
スタンレー電気	125,800	2,852.00	358,781,600
岩崎電気	7,000	2,297.00	16,079,000
ウシオ電機	92,300	1,892.00	174,631,600
岡谷電機産業	16,400	318.00	5,215,200
ハリオス テクノ ホールディング	19,400	268.00	5,199,200

エノモト	5,600	1,633.00	9,144,800
日本セラミック	17,000	2,737.00	46,529,000
遠藤照明	9,300	1,019.00	9,476,700
古河電池	13,500	1,358.00	18,333,000
双信電機	9,600	657.00	6,307,200
山一電機	13,400	2,173.00	29,118,200
図研	11,900	3,560.00	42,364,000
日本電子	37,400	8,600.00	321,640,000
カシオ計算機	129,800	1,459.00	189,378,200
ファナック	157,300	23,535.00	3,702,055,500
日本シイエムケイ	37,200	638.00	23,733,600
エンプラス	4,900	2,518.00	12,338,200
大真空	24,800	1,393.00	34,546,400
ローム	80,300	10,300.00	827,090,000
浜松ホトニクス	128,700	7,140.00	918,918,000
三井ハイテック	17,700	10,310.00	182,487,000
新光電気工業	52,800	5,150.00	271,920,000
京セラ	252,400	7,105.00	1,793,302,000
太陽誘電	87,100	6,300.00	548,730,000
村田製作所	526,700	9,102.00	4,794,023,400
双葉電子工業	32,200	681.00	21,928,200
北陸電気工業	7,700	1,340.00	10,318,000
ニチコン	57,100	1,211.00	69,148,100
日本ケミコン	17,000	1,694.00	28,798,000
K O A	27,600	1,529.00	42,200,400
市光工業	23,600	492.00	11,611,200
小糸製作所	98,600	5,940.00	585,684,000
ミツバ	33,000	429.00	14,157,000
S C R E E Nホールディングス	31,100	11,420.00	355,162,000
キャノン電子	17,100	1,580.00	27,018,000
キャノン	890,900	2,785.00	2,481,156,500
リコー	497,600	1,026.00	510,537,600
象印マホービン	49,000	1,577.00	77,273,000
M U T O Hホールディングス	3,000	1,660.00	4,980,000
東京エレクトロン	113,800	59,600.00	6,782,480,000
トヨタ紡織	73,100	2,144.00	156,726,400
芦森工業	3,400	903.00	3,070,200
ユニプレス	26,700	723.00	19,304,100
豊田自動織機	145,100	9,030.00	1,310,253,000
モリタホールディングス	28,700	1,293.00	37,109,100
三櫻工業	24,800	893.00	22,146,400
デンソー	394,700	9,031.00	3,564,535,700

東海理化電機製作所	47,200	1,500.00	70,800,000
川崎重工業	130,900	1,991.00	260,621,900
名村造船所	53,800	210.00	11,298,000
日本車輛製造	6,500	2,018.00	13,117,000
三菱ロジスネクスト	23,700	1,140.00	27,018,000
近畿車輛	2,700	990.00	2,673,000
日産自動車	2,114,400	548.10	1,158,902,640
いすゞ自動車	562,600	1,432.00	805,643,200
トヨタ自動車	9,081,400	2,051.00	18,625,951,400
日野自動車	223,900	923.00	206,659,700
三菱自動車工業	663,600	315.00	209,034,000
エフテック	12,500	495.00	6,187,500
レシップホールディングス	7,100	579.00	4,110,900
G M B	3,200	737.00	2,358,400
ファルテック	3,100	694.00	2,151,400
武蔵精密工業	40,000	1,704.00	68,160,000
日産車体	26,300	684.00	17,989,200
新明和工業	50,700	857.00	43,449,900
極東開発工業	33,300	1,518.00	50,549,400
トピー工業	14,700	1,068.00	15,699,600
ティラド	5,100	2,557.00	13,040,700
曙ブレーキ工業	98,400	178.00	17,515,200
タチエス	31,400	1,146.00	35,984,400
N O K	86,700	1,185.00	102,739,500
フタバ産業	44,900	405.00	18,184,500
K Y B	18,600	2,940.00	54,684,000
大同メタル工業	34,400	582.00	20,020,800
プレス工業	88,800	379.00	33,655,200
ミクニ	22,700	334.00	7,581,800
太平洋工業	37,500	1,120.00	42,000,000
河西工業	22,000	275.00	6,050,000
アイシン	131,200	4,275.00	560,880,000
マツダ	562,700	877.00	493,487,900
今仙電機製作所	12,100	575.00	6,957,500
本田技研工業	1,411,600	3,086.00	4,356,197,600
スズキ	410,100	4,319.00	1,771,221,900
S U B A R U	513,800	2,010.50	1,032,994,900
安永	8,600	932.00	8,015,200
ヤマハ発動機	233,900	2,700.00	631,530,000
T B K	20,000	400.00	8,000,000
エクセディ	27,000	1,658.00	44,766,000
豊田合成	57,900	2,341.00	135,543,900

愛三工業	28,100	752.00	21,131,200
盟和産業	2,600	975.00	2,535,000
日本プラスト	14,000	503.00	7,042,000
ヨロズ	16,700	1,088.00	18,169,600
エフ・シー・シー	29,300	1,439.00	42,162,700
シマノ	72,300	32,030.00	2,315,769,000
テイ・エス テック	75,700	1,333.00	100,908,100
ジャムコ	10,500	852.00	8,946,000
テルモ	507,300	4,721.00	2,394,963,300
クリエートメディック	5,400	991.00	5,351,400
日機装	53,800	823.00	44,277,400
日本エム・ディ・エム	10,300	1,804.00	18,581,200
島津製作所	230,700	4,815.00	1,110,820,500
JMS	15,200	593.00	9,013,600
長野計器	13,000	1,498.00	19,474,000
ブイ・テクノロジー	7,800	3,335.00	26,013,000
東京計器	11,400	970.00	11,058,000
愛知時計電機	2,600	4,570.00	11,882,000
インターアクション	9,000	2,341.00	21,069,000
オーバル	16,200	237.00	3,839,400
東京精密	30,300	4,720.00	143,016,000
マニー	71,400	1,545.00	110,313,000
ニコン	273,800	1,174.00	321,441,200
トプコン	84,300	1,602.00	135,048,600
オリンパス	940,200	2,449.00	2,302,549,800
理研計器	14,500	5,470.00	79,315,000
タムロン	13,900	2,740.00	38,086,000
HOYA	349,800	16,550.00	5,789,190,000
シード	8,400	533.00	4,477,200
ノーリツ鋼機	16,100	2,498.00	40,217,800
エー・アンド・デイ	16,400	1,120.00	18,368,000
朝日インテック	196,600	2,501.00	491,696,600
シチズン時計	210,000	485.00	101,850,000
リズム	5,600	1,173.00	6,568,800
大研医器	14,200	533.00	7,568,600
メニコン	59,400	3,470.00	206,118,000
シンシア	2,000	587.00	1,174,000
松風	7,500	1,981.00	14,857,500
セイコーホールディングス	25,400	2,212.00	56,184,800
ニプロ	133,600	1,079.00	144,154,400
中本パックス	5,000	1,625.00	8,125,000
スノーピーク	23,400	3,500.00	81,900,000

パラマウントベッドホールディングス	34,400	1,895.00	65,188,000
トランザクション	9,800	982.00	9,623,600
粧美堂	5,200	393.00	2,043,600
ニホンフラッシュ	15,300	1,013.00	15,498,900
前田工織	19,800	3,695.00	73,161,000
永大産業	23,400	279.00	6,528,600
アートネイチャー	15,300	700.00	10,710,000
バンダイナムコホールディングス	160,600	8,936.00	1,435,121,600
アイフィスジャパン	4,600	670.00	3,082,000
共立印刷	30,000	136.00	4,080,000
S H O E I	16,800	4,540.00	76,272,000
フランスベッドホールディングス	23,000	914.00	21,022,000
パイロットコーポレーション	30,300	4,150.00	125,745,000
萩原工業	11,600	1,237.00	14,349,200
トッパン・フォームズ	25,600	1,547.00	39,603,200
フジシールインターナショナル	43,500	2,043.00	88,870,500
タカラトミー	75,000	1,076.00	80,700,000
広済堂ホールディングス	11,100	757.00	8,402,700
エステールホールディングス	4,500	639.00	2,875,500
タカノ	6,100	663.00	4,044,300
プロネクサス	13,900	1,057.00	14,692,300
ホクシン	12,600	150.00	1,890,000
ウッドワン	5,500	981.00	5,395,500
大建工業	10,600	2,132.00	22,599,200
凸版印刷	272,500	2,001.00	545,272,500
大日本印刷	211,900	2,728.00	578,063,200
共同印刷	5,500	3,125.00	17,187,500
N I S S H A	36,800	1,612.00	59,321,600
光村印刷	1,600	1,438.00	2,300,800
T A K A R A & C O M P A N Y	8,800	1,755.00	15,444,000
アシックス	158,500	2,452.00	388,642,000
ツツミ	4,500	1,905.00	8,572,500
ローランド	12,500	3,870.00	48,375,000
小松ウオール工業	5,500	1,900.00	10,450,000
ヤマハ	106,600	5,650.00	602,290,000
河合楽器製作所	5,000	3,420.00	17,100,000
クリナップ	16,700	529.00	8,834,300
ピジョン	108,300	2,345.00	253,963,500
兼松サステック	1,200	1,791.00	2,149,200
キングジム	14,400	880.00	12,672,000
リンテック	38,400	2,610.00	100,224,000
イトーキ	33,000	357.00	11,781,000

任天堂	101,200	53,510.00	5,415,212,000
三菱鉛筆	29,500	1,208.00	35,636,000
タカラスタANDARD	37,000	1,410.00	52,170,000
コクヨ	86,000	1,698.00	146,028,000
ナカバヤシ	16,000	489.00	7,824,000
グローブライド	16,000	3,245.00	51,920,000
オカムラ	61,600	1,280.00	78,848,000
美津濃	17,800	2,173.00	38,679,400
東京電力ホールディングス	1,341,800	300.00	402,540,000
中部電力	548,500	1,204.00	660,394,000
関西電力	679,300	1,064.00	722,775,200
中国電力	280,200	944.00	264,508,800
北陸電力	163,900	593.00	97,192,700
東北電力	419,900	815.00	342,218,500
四国電力	161,400	806.00	130,088,400
九州電力	369,500	861.00	318,139,500
北海道電力	155,800	509.00	79,302,200
沖縄電力	38,000	1,461.00	55,518,000
電源開発	152,800	1,547.00	236,381,600
エフオン	10,800	586.00	6,328,800
イーレックス	26,400	2,196.00	57,974,400
レノバ	35,000	4,645.00	162,575,000
東京瓦斯	343,700	2,090.00	718,333,000
大阪瓦斯	324,700	1,918.00	622,774,600
東邦瓦斯	82,300	3,135.00	258,010,500
北海道瓦斯	8,900	1,504.00	13,385,600
広島ガス	34,200	361.00	12,346,200
西部ガスホールディングス	20,200	2,266.00	45,773,200
静岡ガス	46,700	985.00	45,999,500
メタウォーター	20,200	1,945.00	39,289,000
SBSホールディングス	13,300	3,210.00	42,693,000
東武鉄道	175,200	2,633.00	461,301,600
相鉄ホールディングス	57,400	2,062.00	118,358,800
東急	452,200	1,545.00	698,649,000
京浜急行電鉄	230,200	1,143.00	263,118,600
小田急電鉄	266,700	2,190.00	584,073,000
京王電鉄	93,000	5,080.00	472,440,000
京成電鉄	124,800	3,025.00	377,520,000
富士急行	21,400	4,130.00	88,382,000
新京成電鉄	4,100	2,015.00	8,261,500
東日本旅客鉄道	315,600	7,022.00	2,216,143,200
西日本旅客鉄道	217,300	4,848.00	1,053,470,400

東海旅客鉄道	149,100	15,545.00	2,317,759,500
西武ホールディングス	234,100	1,069.00	250,252,900
鴻池運輸	28,500	1,159.00	33,031,500
西日本鉄道	49,700	2,574.00	127,927,800
ハマキョウレックス	12,700	2,857.00	36,283,900
サカイ引越センター	8,200	4,260.00	34,932,000
近鉄グループホールディングス	169,800	3,245.00	551,001,000
阪急阪神ホールディングス	212,300	3,340.00	709,082,000
南海電気鉄道	75,700	2,116.00	160,181,200
京阪ホールディングス	75,600	2,557.00	193,309,200
神戸電鉄	4,000	3,140.00	12,560,000
名古屋鉄道	139,600	1,706.00	238,157,600
山陽電気鉄道	13,100	1,993.00	26,108,300
アルプス物流	11,800	1,058.00	12,484,400
日本通運	58,800	6,730.00	395,724,000
ヤマトホールディングス	237,900	2,654.00	631,386,600
山九	47,200	4,750.00	224,200,000
丸運	9,700	252.00	2,444,400
丸全昭和運輸	13,800	3,185.00	43,953,000
センコーグループホールディングス	85,100	932.00	79,313,200
トナミホールディングス	4,100	3,670.00	15,047,000
ニッコンホールディングス	57,000	2,090.00	119,130,000
日本石油輸送	1,800	2,618.00	4,712,400
福山通運	27,900	3,930.00	109,647,000
セイノーホールディングス	115,600	1,167.00	134,905,200
エスライン	5,100	900.00	4,590,000
神奈川中央交通	4,200	3,370.00	14,154,000
日立物流	32,800	5,240.00	171,872,000
丸和運輸機関	35,900	1,402.00	50,331,800
C & F ロジホールディングス	17,200	1,533.00	26,367,600
九州旅客鉄道	131,300	2,377.00	312,100,100
S Gホールディングス	320,800	2,616.00	839,212,800
日本郵船	142,300	8,350.00	1,188,205,000
商船三井	94,400	7,910.00	746,704,000
川崎汽船	52,300	6,800.00	355,640,000
N S ユナイテッド海運	10,200	3,345.00	34,119,000
飯野海運	84,300	519.00	43,751,700
共栄タンカー	6,400	830.00	5,312,000
乾汽船	11,600	2,163.00	25,090,800
日本航空	389,300	2,058.00	801,179,400
A N A ホールディングス	431,300	2,302.00	992,852,600
パスコ	3,200	1,300.00	4,160,000



トランコム	4,700	8,590.00	40,373,000
日新	13,500	1,599.00	21,586,500
三菱倉庫	53,900	2,827.00	152,375,300
三井倉庫ホールディングス	18,000	2,342.00	42,156,000
住友倉庫	60,000	1,922.00	115,320,000
澁澤倉庫	10,200	2,239.00	22,837,800
東陽倉庫	28,500	318.00	9,063,000
日本トランスシティ	37,400	643.00	24,048,200
ケイヒン	3,000	1,330.00	3,990,000
中央倉庫	10,300	955.00	9,836,500
川西倉庫	3,100	1,101.00	3,413,100
安田倉庫	13,900	961.00	13,357,900
ファイズホールディングス	3,600	525.00	1,890,000
東洋埠頭	5,200	1,429.00	7,430,800
宇徳	12,100	723.00	8,748,300
上組	93,400	2,168.00	202,491,200
サンリツ	4,700	841.00	3,952,700
キムラユニティー	4,500	1,305.00	5,872,500
キューソー流通システム	8,500	895.00	7,607,500
近鉄エクスプレス	32,100	3,025.00	97,102,500
東海運	9,700	303.00	2,939,100
エーアイティー	10,600	1,288.00	13,652,800
内外トランスライン	6,600	2,079.00	13,721,400
日本コンセプト	5,400	1,766.00	9,536,400
NEC ネットズエスアイ	58,300	1,720.00	100,276,000
クロスキャット	4,700	1,556.00	7,313,200
システナ	251,400	432.00	108,604,800
デジタルアーツ	9,500	8,650.00	82,175,000
日鉄ソリューションズ	25,500	3,480.00	88,740,000
キューブシステム	9,100	929.00	8,453,900
WOW WORLD	2,600	1,443.00	3,751,800
コア	7,600	1,546.00	11,749,600
ラクーンホールディングス	12,600	1,413.00	17,803,800
ソリトンシステムズ	8,900	1,221.00	10,866,900
ソフトクリエイイトホールディングス	7,700	4,235.00	32,609,500
T I S	167,800	3,435.00	576,393,000
J N S ホールディングス	8,100	462.00	3,742,200
グリー	108,100	740.00	79,994,000
G M O ペパボ	1,900	2,413.00	4,584,700
コーエーテクモホールディングス	56,200	4,670.00	262,454,000
三菱総合研究所	7,600	3,910.00	29,716,000
電算	2,000	2,331.00	4,662,000

A G S	9,200	866.00	7,967,200
ファインデックス	15,000	985.00	14,775,000
ブレインパッド	4,600	4,465.00	20,539,000
K L a b	32,200	485.00	15,617,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	25,700	942.00	24,209,400
ネクソン	396,800	2,226.00	883,276,800
アイスタイル	54,300	256.00	13,900,800
エムアップホールディングス	5,100	3,930.00	20,043,000
エイチーム	12,300	864.00	10,627,200
エニグモ	19,200	760.00	14,592,000
テクノスジャパン	14,000	480.00	6,720,000
コロプラ	58,100	651.00	37,823,100
ブロードリーフ	87,600	450.00	39,420,000
クロス・マーケティンググループ	6,900	954.00	6,582,600
デジタルハーツホールディングス	8,100	2,262.00	18,322,200
システム情報	13,400	806.00	10,800,400
メディアドゥ	6,200	4,100.00	25,420,000
じげん	50,400	285.00	14,364,000
ブイキューブ	18,000	1,024.00	18,432,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,200	599.00	2,515,800
サイバーリンクス	6,000	996.00	5,976,000
フィックスターズ	18,900	761.00	14,382,900
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,942.00	13,982,400
オブティム	12,400	1,271.00	15,760,400
セレス	6,500	2,384.00	15,496,000
S H I F T	8,900	23,070.00	205,323,000
ティーガイア	15,700	1,588.00	24,931,600
セック	2,600	2,316.00	6,021,600
テクマトリックス	29,800	1,911.00	56,947,800
プロシップ	5,900	1,484.00	8,755,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,800	2,627.00	125,570,600
G M O ペイメントゲートウェイ	34,100	13,510.00	460,691,000
ザッパラス	7,200	565.00	4,068,000
システムリサーチ	5,200	1,941.00	10,093,200
インターネットイニシアティブ	46,900	4,565.00	214,098,500
さくらインターネット	19,200	544.00	10,444,800
ヴィンクス	5,200	787.00	4,092,400
G M O グローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,080.00	16,320,000
S R A ホールディングス	8,600	2,785.00	23,951,000
システムインテグレータ	5,900	533.00	3,144,700
朝日ネット	16,400	587.00	9,626,800
e B A S E	21,300	608.00	12,950,400

アバント	19,000	1,155.00	21,945,000
アドソル日進	6,400	1,646.00	10,534,400
ODKソリューションズ	4,000	684.00	2,736,000
フリービット	10,600	1,031.00	10,928,600
コムチュア	19,800	3,240.00	64,152,000
サイバーコム	2,900	1,132.00	3,282,800
アステリア	12,900	750.00	9,675,000
アイル	9,900	1,376.00	13,622,400
マークラインズ	8,900	2,609.00	23,220,100
メディカル・データ・ビジョン	22,400	1,099.00	24,617,600
gumi	24,600	667.00	16,408,200
ショーケース	4,200	484.00	2,032,800
モバイルファクトリー	4,200	827.00	3,473,400
テラスカイ	6,500	1,799.00	11,693,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,900	1,258.00	9,938,200
PCIホールディングス	8,000	1,144.00	9,152,000
パイプドHD	3,300	2,491.00	8,220,300
アイビーシー	3,200	701.00	2,243,200
ネオジャパン	5,100	1,370.00	6,987,000
PR TIMES	3,800	2,937.00	11,160,600
ラクス	60,600	3,025.00	183,315,000
ランドコンピュータ	4,200	819.00	3,439,800
ダブルスタンダード	5,400	2,920.00	15,768,000
オープンドア	10,500	1,857.00	19,498,500
マイネット	6,300	536.00	3,376,800
アカツキ	7,900	2,545.00	20,105,500
ベネフィットジャパン	1,400	2,562.00	3,586,800
Ubicomホールディングス	4,700	2,511.00	11,801,700
カナミックネットワーク	19,200	474.00	9,100,800
ノムラシステムコーポレーション	9,900	255.00	2,524,500
チェンジ	32,500	1,736.00	56,420,000
シンクロ・フード	9,500	325.00	3,087,500
オークネット	9,500	1,523.00	14,468,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	758.00	2,880,400
セグエグループ	4,800	745.00	3,576,000
エイトレッド	2,600	2,266.00	5,891,600
マクロミル	36,200	997.00	36,091,400
ビーグリー	4,200	1,788.00	7,509,600
オロ	5,600	3,065.00	17,164,000
ユーザーローカル	5,400	1,566.00	8,456,400
テモナ	4,200	464.00	1,948,800
ニーズウェル	4,300	558.00	2,399,400

マネーフォワード	26,700	6,170.00	164,739,000
サインポスト	5,600	1,120.00	6,272,000
電算システムホールディングス	7,300	2,685.00	19,600,500
ソルクシーズ	15,300	443.00	6,777,900
フェイス	5,200	678.00	3,525,600
プロトコーポレーション	18,800	1,311.00	24,646,800
ハイマックス	4,800	1,060.00	5,088,000
野村総合研究所	340,000	4,835.00	1,643,900,000
サイバネットシステム	12,800	696.00	8,908,800
C Eホールディングス	9,700	474.00	4,597,800
日本システム技術	3,500	2,453.00	8,585,500
インテージホールディングス	22,100	1,643.00	36,310,300
東邦システムサイエンス	4,800	1,016.00	4,876,800
ソースネクスト	76,800	181.00	13,900,800
インフォコム	19,300	1,976.00	38,136,800
シンプレクス・ホールディングス	18,600	2,596.00	48,285,600
HEROZ	5,200	1,269.00	6,598,800
ラクスル	19,300	4,985.00	96,210,500
I P S	4,900	2,012.00	9,858,800
F I G	19,700	316.00	6,225,200
システムサポート	5,400	1,127.00	6,085,800
イーソル	11,000	602.00	6,622,000
アルテリア・ネットワークス	22,400	1,550.00	34,720,000
E d u L a b	1,700	1,087.00	1,847,900
東海ソフト	2,900	966.00	2,801,400
ウイングアーク1 s t	10,100	2,056.00	20,765,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	2,155.00	8,835,500
サーバーワークス	3,000	3,245.00	9,735,000
東名	1,800	1,150.00	2,070,000
ヴィッツ	1,800	1,219.00	2,194,200
トピラシステムズ	3,700	765.00	2,830,500
S a n s a n	62,600	2,336.00	146,233,600
L i n k - U	3,300	1,011.00	3,336,300
ギフティ	15,900	2,097.00	33,342,300
ベース	3,000	3,820.00	11,460,000
フォーカスシステムズ	12,000	937.00	11,244,000
クレスコ	12,900	1,949.00	25,142,100
フジ・メディア・ホールディングス	169,600	1,109.00	188,086,400
オービック	55,400	21,130.00	1,170,602,000
ジャストシステム	25,100	5,400.00	135,540,000
T D Cソフト	15,600	1,049.00	16,364,400
Zホールディングス	2,557,300	642.20	1,642,298,060

トレンドマイクロ	94,000	6,710.00	630,740,000
I Dホールディングス	11,300	846.00	9,559,800
日本オラクル	35,700	10,190.00	363,783,000
アルファシステムズ	4,700	3,850.00	18,095,000
フューチャー	18,600	3,365.00	62,589,000
C A C H o l d i n g s	10,400	1,464.00	15,225,600
S Bテクノロジー	7,700	2,439.00	18,780,300
トーセ	5,000	716.00	3,580,000
オービックビジネスコンサルタント	16,800	4,920.00	82,656,000
伊藤忠テクノソリューションズ	80,200	3,710.00	297,542,000
アイティフォー	21,500	778.00	16,727,000
東計電算	2,100	5,080.00	10,668,000
エクスネット	3,000	982.00	2,946,000
大塚商会	95,200	5,480.00	521,696,000
サイボウズ	23,600	1,824.00	43,046,400
電通国際情報サービス	25,500	3,730.00	95,115,000
A C C E S S	20,100	695.00	13,969,500
デジタルガレージ	29,100	4,715.00	137,206,500
E Mシステムズ	29,300	761.00	22,297,300
ウェザーニューズ	5,300	8,980.00	47,594,000
C I J	11,600	847.00	9,825,200
ビジネスエンジニアリング	2,100	3,640.00	7,644,000
日本エンタープライズ	19,000	170.00	3,230,000
WOWOW	8,500	1,828.00	15,538,000
スカラ	16,000	650.00	10,400,000
インテリジェント ウェイブ	10,600	519.00	5,501,400
I M A G I C A G R O U P	15,300	583.00	8,919,900
ネットワンシステムズ	67,100	3,205.00	215,055,500
システムソフト	39,100	112.00	4,379,200
アルゴグラフィックス	13,700	3,030.00	41,511,000
マーベラス	28,000	707.00	19,796,000
エイベックス	30,500	1,550.00	47,275,000
日本ユニシス	55,000	3,220.00	177,100,000
兼松エレクトロニクス	9,600	3,855.00	37,008,000
都築電気	9,100	1,707.00	15,533,700
T B S ホールディングス	107,100	1,662.00	178,000,200
日本テレビホールディングス	147,000	1,154.00	169,638,000
朝日放送グループホールディングス	17,700	691.00	12,230,700
テレビ朝日ホールディングス	42,400	1,432.00	60,716,800
スカパー J S A Tホールディングス	149,400	412.00	61,552,800
テレビ東京ホールディングス	12,700	1,992.00	25,298,400
日本BS放送	6,100	1,092.00	6,661,200

ビジョン	30,200	1,189.00	35,907,800
スマートバリュー	5,000	411.00	2,055,000
USEN-NEXT HOLDINGS	16,800	2,991.00	50,248,800
ワイヤレスゲート	7,800	319.00	2,488,200
コネクシオ	12,600	1,425.00	17,955,000
クロップス	3,400	958.00	3,257,200
日本電信電話	2,057,800	3,183.00	6,549,977,400
KDDI	1,282,600	3,363.00	4,313,383,800
ソフトバンク	2,664,800	1,450.50	3,865,292,400
光通信	20,700	17,600.00	364,320,000
エムティーアイ	17,400	582.00	10,126,800
GMOインターネット	62,400	2,663.00	166,171,200
ファイバーゲート	5,900	1,167.00	6,885,300
アйдママーケティングコミュニケーション	4,500	293.00	1,318,500
KADOKAWA	51,300	5,610.00	287,793,000
学研ホールディングス	25,000	978.00	24,450,000
ゼンリン	28,900	959.00	27,715,100
昭文社ホールディングス	7,500	477.00	3,577,500
インプレスホールディングス	14,600	213.00	3,109,800
アイネット	9,200	1,335.00	12,282,000
松竹	11,700	11,540.00	135,018,000
東宝	103,800	4,970.00	515,886,000
東映	5,800	17,550.00	101,790,000
エヌ・ティ・ティ・データ	468,500	2,338.00	1,095,353,000
ピー・シー・エー	10,400	1,597.00	16,608,800
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,894.00	11,553,400
DTS	33,800	2,497.00	84,398,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,900	6,090.00	498,771,000
シーイーシー	19,000	1,049.00	19,931,000
カブコン	165,900	2,699.00	447,764,100
アイ・エス・ビー	8,400	969.00	8,139,600
ジャステック	10,400	1,021.00	10,618,400
SCSK	121,900	2,228.00	271,593,200
日本システムウエア	6,700	2,171.00	14,545,700
アイネス	16,100	1,430.00	23,023,000
TKC	29,800	3,330.00	99,234,000
富士ソフト	18,800	5,410.00	101,708,000
NSD	56,600	2,084.00	117,954,400
コナミホールディングス	63,900	5,580.00	356,562,000
福井コンピュータホールディングス	8,100	3,295.00	26,689,500
JBCホールディングス	12,000	1,789.00	21,468,000
ミロク情報サービス	15,600	1,357.00	21,169,200

ソフトバンクグループ	1,055,000	5,344.00	5,637,920,000
ハウスイ	1,400	816.00	1,142,400
高千穂交易	6,800	1,436.00	9,764,800
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,511.00	4,381,900
伊藤忠食品	4,300	4,780.00	20,554,000
エレマテック	14,200	1,018.00	14,455,600
J A L U X	5,000	2,547.00	12,735,000
あらた	14,100	4,160.00	58,656,000
トーメンデバイス	2,700	6,360.00	17,172,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	6,350.00	33,020,000
フィールズ	15,500	508.00	7,874,000
双日	195,100	1,653.00	322,500,300
アルフレッサ ホールディングス	196,200	1,550.00	304,110,000
横浜冷凍	49,500	822.00	40,689,000
ラサ商事	9,400	968.00	9,099,200
アルコニックス	22,000	1,254.00	27,588,000
神戸物産	137,100	4,060.00	556,626,000
ハイパー	4,400	557.00	2,450,800
あい ホールディングス	25,200	1,883.00	47,451,600
ディーブイエックス	6,000	1,097.00	6,582,000
ダイワボウホールディングス	85,800	1,779.00	152,638,200
マクニカ・富士エレホールディングス	42,100	2,530.00	106,513,000
ラクト・ジャパン	6,100	2,347.00	14,316,700
グリムス	7,900	2,319.00	18,320,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,700	796.00	24,437,200
八洲電機	12,800	936.00	11,980,800
メディアスホールディングス	10,000	925.00	9,250,000
レスターホールディングス	16,700	1,893.00	31,613,100
ジューテックホールディングス	4,100	1,055.00	4,325,500
大光	6,800	686.00	4,664,800
O C H Iホールディングス	5,100	1,275.00	6,502,500
T O K A Iホールディングス	85,600	844.00	72,246,400
黒谷	4,800	600.00	2,880,000
C o m i n i x	3,100	722.00	2,238,200
三洋貿易	17,800	971.00	17,283,800
ビューティガレージ	2,900	2,964.00	8,595,600
ウイン・パートナーズ	12,800	967.00	12,377,600
ミタチ産業	4,900	927.00	4,542,300
シップヘルスケアホールディングス	56,600	2,606.00	147,499,600
明治電機工業	5,600	1,234.00	6,910,400
デリカフーズホールディングス	6,900	598.00	4,126,200
スターティアホールディングス	4,000	1,047.00	4,188,000

コメダホールディングス	38,500	1,996.00	76,846,000	
ピーバンドットコム	2,500	507.00	1,267,500	
アセンテック	6,100	949.00	5,788,900	
富士興産	4,400	998.00	4,391,200	
協栄産業	1,800	1,464.00	2,635,200	
フルサト・マルカホールディングス	17,000	2,155.00	36,635,000	
ヤマエグループホールディングス	11,900	1,016.00	12,090,400	
小野建	17,100	1,630.00	27,873,000	
南陽	3,600	1,880.00	6,768,000	
佐島電機	11,000	939.00	10,329,000	
エコートレーディング	3,800	623.00	2,367,400	
伯東	10,800	2,346.00	25,336,800	
コンドーテック	13,600	934.00	12,702,400	
中山福	9,400	352.00	3,308,800	
ナガイレーベン	23,400	2,224.00	52,041,600	
三菱食品	17,000	2,730.00	46,410,000	
松田産業	12,900	2,360.00	30,444,000	
第一興商	33,500	3,450.00	115,575,000	
メディパルホールディングス	190,600	2,119.00	403,881,400	
S P K	7,000	1,368.00	9,576,000	
萩原電気ホールディングス	6,500	2,005.00	13,032,500	
アズワン	12,700	14,370.00	182,499,000	
スズデン	6,100	1,735.00	10,583,500	
尾家産業	4,900	1,017.00	4,983,300	
シモジマ	10,800	1,136.00	12,268,800	
ドウシシャ	16,700	1,542.00	25,751,400	
小津産業	3,900	1,919.00	7,484,100	
高速	10,500	1,562.00	16,401,000	
たけびし	6,600	1,430.00	9,438,000	
リックス	4,000	1,491.00	5,964,000	
丸文	15,700	775.00	12,167,500	
ハピネット	14,700	1,459.00	21,447,300	
橋本総業ホールディングス	3,600	2,010.00	7,236,000	
日本ライフライン	52,300	1,043.00	54,548,900	
タカショー	13,500	724.00	9,774,000	
I D O M	53,600	681.00	36,501,600	
進和	10,400	2,037.00	21,184,800	
エスケイジャパン	4,300	420.00	1,806,000	
ダイトロン	7,500	2,049.00	15,367,500	
シークス	25,300	1,341.00	33,927,300	
田中商事	5,500	621.00	3,415,500	
オーハシテクニカ	9,900	1,340.00	13,266,000	



白銅	5,700	2,767.00	15,771,900
ダイコー通産	2,100	1,194.00	2,507,400
伊藤忠商事	1,235,100	3,417.00	4,220,336,700
丸紅	1,741,800	1,053.50	1,834,986,300
高島	2,700	2,169.00	5,856,300
長瀬産業	97,000	1,796.00	174,212,000
蝶理	9,900	1,713.00	16,958,700
豊田通商	177,400	5,050.00	895,870,000
三共生興	23,400	551.00	12,893,400
兼松	65,800	1,251.00	82,315,800
ツカモトコーポレーション	2,900	1,293.00	3,749,700
三井物産	1,371,300	2,599.00	3,564,008,700
日本紙パルプ商事	9,200	3,855.00	35,466,000
カメイ	21,000	996.00	20,916,000
東都水産	900	4,010.00	3,609,000
OUGホールディングス	2,600	2,653.00	6,897,800
スターゼン	13,100	1,924.00	25,204,400
山善	74,300	1,027.00	76,306,100
椿本興業	3,600	4,260.00	15,336,000
住友商事	1,114,500	1,628.50	1,814,963,250
内田洋行	7,500	5,150.00	38,625,000
三菱商事	1,323,200	3,594.00	4,755,580,800
第一実業	8,000	4,830.00	38,640,000
キャノンマーケティングジャパン	43,800	2,264.00	99,163,200
西華産業	9,300	1,615.00	15,019,500
佐藤商事	14,600	1,111.00	16,220,600
菱洋エレクトロ	10,500	2,300.00	24,150,000
東京産業	16,000	746.00	11,936,000
ユアサ商事	16,800	2,850.00	47,880,000
神鋼商事	4,000	3,250.00	13,000,000
トルク	9,500	198.00	1,881,000
阪和興業	35,400	3,045.00	107,793,000
正栄食品工業	11,400	3,810.00	43,434,000
カナデン	14,400	1,017.00	14,644,800
菱電商事	14,000	1,756.00	24,584,000
岩谷産業	42,400	5,730.00	242,952,000
ナイス	6,100	1,647.00	10,046,700
ニチモウ	2,600	2,315.00	6,019,000
極東貿易	5,100	2,414.00	12,311,400
アステナホールディングス	25,000	474.00	11,850,000
三愛石油	43,500	1,267.00	55,114,500
稲畑産業	38,900	1,611.00	62,667,900

G S Iクレオス	8,500	1,102.00	9,367,000
明和産業	16,300	845.00	13,773,500
クワザワホールディングス	7,000	585.00	4,095,000
ワキタ	37,700	1,031.00	38,868,700
東邦ホールディングス	56,700	1,747.00	99,054,900
サンゲツ	46,700	1,564.00	73,038,800
ミツウロコグループホールディングス	26,000	1,192.00	30,992,000
シナネンホールディングス	6,500	3,460.00	22,490,000
伊藤忠エネクス	39,100	967.00	37,809,700
サンリオ	54,500	2,387.00	130,091,500
サンワテクノス	10,700	1,560.00	16,692,000
リョーサン	19,500	2,083.00	40,618,500
新光商事	26,500	898.00	23,797,000
トーホー	8,000	1,258.00	10,064,000
三信電気	8,100	1,401.00	11,348,100
東陽テクニカ	17,500	1,075.00	18,812,500
モスフードサービス	23,200	3,040.00	70,528,000
加賀電子	16,000	2,999.00	47,984,000
ソーダニッカ	18,300	750.00	13,725,000
立花エレテック	14,100	1,562.00	22,024,200
フォーバル	7,800	1,027.00	8,010,600
P A L T A C	24,800	4,610.00	114,328,000
三谷産業	20,700	304.00	6,292,800
西本Wismettacホールディングス	4,000	3,100.00	12,400,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,933.00	3,092,800
コア商事ホールディングス	13,300	640.00	8,512,000
国際紙パルプ商事	37,100	287.00	10,647,700
ヤマタネ	8,200	1,588.00	13,021,600
丸紅建材リース	1,600	1,732.00	2,771,200
日鉄物産	12,600	4,750.00	59,850,000
泉州電業	5,000	5,550.00	27,750,000
トラスコ中山	36,800	2,670.00	98,256,000
オートバックスセブン	59,400	1,368.00	81,259,200
モリト	12,900	690.00	8,901,000
加藤産業	25,500	3,230.00	82,365,000
北恵	4,500	853.00	3,838,500
イノテック	10,700	1,387.00	14,840,900
イエローハット	30,600	1,588.00	48,592,800
J Kホールディングス	14,200	1,076.00	15,279,200
日伝	14,700	2,246.00	33,016,200
北沢産業	12,100	244.00	2,952,400
杉本商事	8,300	2,162.00	17,944,600

因幡電機産業	47,100	2,642.00	124,438,200
東テック	5,900	2,432.00	14,348,800
ミスミグループ本社	221,600	4,615.00	1,022,684,000
アルテック	12,000	292.00	3,504,000
タキヒヨー	5,300	1,650.00	8,745,000
蔵王産業	3,400	1,973.00	6,708,200
スズケン	69,000	3,290.00	227,010,000
ジェコス	12,200	778.00	9,491,600
グローセル	20,700	396.00	8,197,200
ローソン	39,100	5,800.00	226,780,000
サンエー	13,400	4,240.00	56,816,000
カワチ薬品	13,900	2,181.00	30,315,900
エービーシー・マート	27,600	4,915.00	135,654,000
ハードオフコーポレーション	8,300	703.00	5,834,900
アスクル	28,800	1,492.00	42,969,600
ゲオホールディングス	23,900	1,214.00	29,014,600
アダストリア	19,200	1,669.00	32,044,800
くら寿司	18,500	3,485.00	64,472,500
キャンドウ	8,600	2,320.00	19,952,000
アイケイ	6,000	400.00	2,400,000
パルグループホールディングス	15,700	1,595.00	25,041,500
エディオン	81,400	1,044.00	84,981,600
サーラコーポレーション	36,500	620.00	22,630,000
ワッツ	9,100	743.00	6,761,300
ハローズ	8,200	2,712.00	22,238,400
フジオフードグループ本社	14,900	1,390.00	20,711,000
あみやき亭	4,300	2,900.00	12,470,000
大黒天物産	5,700	5,460.00	31,122,000
ハニーズホールディングス	14,400	992.00	14,284,800
ファーマライズホールディングス	4,900	725.00	3,552,500
アルペン	13,700	2,115.00	28,975,500
ハブ	6,300	650.00	4,095,000
クオールホールディングス	21,900	1,348.00	29,521,200
ジーンズホールディングス	12,100	6,650.00	80,465,000
ビックカメラ	105,200	935.00	98,362,000
DCMホールディングス	109,300	1,074.00	117,388,200
Monotaro	223,400	2,037.00	455,065,800
東京一番フーズ	5,200	581.00	3,021,200
きちりホールディングス	4,700	445.00	2,091,500
アーランドサービスホールディングス	13,100	2,281.00	29,881,100
J.フロント リテイリング	211,300	949.00	200,523,700
ドトール・日レスホールディングス	30,700	1,553.00	47,677,100

マツキヨココカラ&カンパニー	108,700	4,380.00	476,106,000
ブロンコピリー	10,200	2,382.00	24,296,400
Z O Z O	121,500	3,425.00	416,137,500
トレジャー・ファクトリー	5,600	912.00	5,107,200
物語コーポレーション	9,500	6,410.00	60,895,000
三越伊勢丹ホールディングス	309,600	790.00	244,584,000
H a m e e	4,900	1,272.00	6,232,800
マーケットエンタープライズ	1,700	708.00	1,203,600
ウエルシアホールディングス	93,500	3,855.00	360,442,500
クリエイティブSDホールディングス	26,200	3,260.00	85,412,000
丸善C H Iホールディングス	20,600	355.00	7,313,000
ミサワ	4,200	675.00	2,835,000
ティーライフ	2,700	1,317.00	3,555,900
チムニー	5,400	1,190.00	6,426,000
シュッピン	15,100	1,008.00	15,220,800
オイシックス・ラ・大地	25,500	2,917.00	74,383,500
ネクステージ	35,800	2,251.00	80,585,800
ジョイフル本田	52,000	1,431.00	74,412,000
鳥貴族ホールディングス	6,700	1,684.00	11,282,800
ホットランド	13,500	1,308.00	17,658,000
すかいらーくホールディングス	228,200	1,507.00	343,897,400
S F Pホールディングス	8,600	1,327.00	11,412,200
綿半ホールディングス	13,600	1,243.00	16,904,800
ヨシックスホールディングス	3,600	1,875.00	6,750,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	51,700	1,047.00	54,129,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,500	1,109.00	10,535,500
B E E N O S	9,100	2,366.00	21,530,600
あさひ	14,900	1,337.00	19,921,300
日本調剤	11,000	1,296.00	14,256,000
コスモス薬品	17,800	17,540.00	312,212,000
トーエル	9,000	800.00	7,200,000
セブン&アイ・ホールディングス	690,800	4,883.00	3,373,176,400
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	94,000	687.00	64,578,000
ツルハホールディングス	38,600	11,960.00	461,656,000
サンマルクホールディングス	14,200	1,420.00	20,164,000
フェリシモ	4,200	1,362.00	5,720,400
トリドールホールディングス	44,000	2,386.00	104,984,000
T O K Y O B A S E	16,800	577.00	9,693,600
ウイルプラスホールディングス	3,200	897.00	2,870,400
J Mホールディングス	12,100	1,629.00	19,710,900
サツドラホールディングス	8,600	642.00	5,521,200

アレンザホールディングス	13,800	1,010.00	13,938,000
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,947.00	9,540,300
パロックジャパンリミテッド	12,700	825.00	10,477,500
クスリのアオキホールディングス	17,600	7,380.00	129,888,000
力の源ホールディングス	9,000	577.00	5,193,000
FOOD & LIFE COMPANIES	103,500	4,090.00	423,315,000
メディカルシステムネットワーク	17,700	562.00	9,947,400
はるやまホールディングス	9,100	472.00	4,295,200
ノジマ	28,700	2,311.00	66,325,700
カッパ・クリエイト	24,800	1,326.00	32,884,800
ライトオン	13,200	721.00	9,517,200
良品計画	203,400	1,750.00	355,950,000
三城ホールディングス	23,600	218.00	5,144,800
アドヴァングループ	18,400	953.00	17,535,200
アルビス	5,900	2,150.00	12,685,000
コナカ	20,800	318.00	6,614,400
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,650.00	3,960,000
G - 7ホールディングス	19,900	1,585.00	31,541,500
イオン北海道	31,200	1,310.00	40,872,000
コジマ	31,100	528.00	16,420,800
ヒマラヤ	6,600	945.00	6,237,000
コーナン商事	25,200	3,275.00	82,530,000
エコス	6,700	1,841.00	12,334,700
ワタミ	21,400	871.00	18,639,400
マルシェ	4,300	406.00	1,745,800
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	353,200	1,606.00	567,239,200
西松屋チェーン	39,000	1,335.00	52,065,000
ゼンショーホールディングス	86,400	2,647.00	228,700,800
幸楽苑ホールディングス	11,200	1,410.00	15,792,000
ハークスレイ	8,300	471.00	3,909,300
サイゼリヤ	26,300	2,958.00	77,795,400
V Tホールディングス	67,300	446.00	30,015,800
魚力	5,100	2,001.00	10,205,100
フジ・コーポレーション	9,700	1,125.00	10,912,500
ユナイテッドアローズ	18,700	1,795.00	33,566,500
ハイデイ日高	25,700	1,610.00	41,377,000
YU-WA Creation Holdings	12,300	206.00	2,533,800
コロワイド	72,600	1,572.00	114,127,200
ピーシーデポコーポレーション	21,800	291.00	6,343,800
壱番屋	12,500	4,505.00	56,312,500

P L A N T	5,100	696.00	3,549,600
スギホールディングス	35,300	6,830.00	241,099,000
薬王堂ホールディングス	9,000	2,170.00	19,530,000
スクロール	27,700	756.00	20,941,200
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,670.00	27,555,000
木曽路	23,500	2,160.00	50,760,000
S R S ホールディングス	24,600	768.00	18,892,800
リテールパートナーズ	21,700	1,326.00	28,774,200
ケーヨー	32,900	820.00	26,978,000
上新電機	20,500	2,095.00	42,947,500
日本瓦斯	86,100	1,516.00	130,527,600
ロイヤルホールディングス	30,300	1,858.00	56,297,400
いなげや	22,000	1,360.00	29,920,000
チヨダ	17,700	742.00	13,133,400
ライフコーポレーション	16,600	3,425.00	56,855,000
リンガーハット	21,800	2,177.00	47,458,600
M r M a x H D	22,800	561.00	12,790,800
A O K I ホールディングス	34,800	598.00	20,810,400
オークワ	27,900	964.00	26,895,600
コメリ	27,400	2,523.00	69,130,200
青山商事	37,000	642.00	23,754,000
しまむら	20,600	9,570.00	197,142,000
はせがわ	11,100	249.00	2,763,900
高島屋	128,900	1,021.00	131,606,900
松屋	35,900	800.00	28,720,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	83,900	796.00	66,784,400
近鉄百貨店	6,900	2,505.00	17,284,500
丸井グループ	149,500	2,105.00	314,697,500
アクシアル リテイリング	13,800	3,290.00	45,402,000
イオン	679,600	2,694.00	1,830,842,400
イズミ	32,000	3,230.00	103,360,000
平和堂	32,700	1,929.00	63,078,300
フジ	21,400	1,902.00	40,702,800
ヤオコー	20,100	6,940.00	139,494,000
ゼビオホールディングス	24,500	881.00	21,584,500
ケーズホールディングス	163,200	1,097.00	179,030,400
O l y m p i c グループ	9,700	618.00	5,994,600
日産東京販売ホールディングス	27,800	224.00	6,227,200
シルバーライフ	3,900	1,313.00	5,120,700
Genky DrugStores	7,800	5,220.00	40,716,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,400	911.00	4,008,400
ブックオフグループホールディングス	10,300	985.00	10,145,500

ギフト	2,900	2,666.00	7,731,400
アインホールディングス	25,700	5,710.00	146,747,000
元気寿司	5,100	2,443.00	12,459,300
ヤマダホールディングス	646,700	380.00	245,746,000
アークランドサカモト	27,900	1,605.00	44,779,500
ニトリホールディングス	70,100	18,255.00	1,279,675,500
グルメ杵屋	14,400	981.00	14,126,400
愛眼	12,900	178.00	2,296,200
ケーユーホールディングス	9,600	1,033.00	9,916,800
吉野家ホールディングス	61,800	2,297.00	141,954,600
松屋フーズホールディングス	8,600	3,530.00	30,358,000
サガミホールディングス	27,400	1,021.00	27,975,400
関西スーパーマーケット	13,600	1,034.00	14,062,400
王将フードサービス	11,700	6,000.00	70,200,000
プレナス	20,000	1,937.00	38,740,000
ミニストップ	13,200	1,394.00	18,400,800
アークス	33,900	2,135.00	72,376,500
パローホールディングス	39,300	2,138.00	84,023,400
ベルク	7,900	5,440.00	42,976,000
大庄	9,900	935.00	9,256,500
ファーストリテイリング	23,600	66,560.00	1,570,816,000
サンドラッグ	66,600	3,090.00	205,794,000
サックスパー ホールディングス	17,400	516.00	8,978,400
ヤマザワ	4,400	1,659.00	7,299,600
やまや	3,600	2,400.00	8,640,000
ベルーナ	38,500	704.00	27,104,000
島根銀行	5,800	545.00	3,161,000
じもとホールディングス	12,600	633.00	7,975,800
めぶきフィナンシャルグループ	918,800	230.00	211,324,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,200	1,466.00	32,545,200
九州フィナンシャルグループ	361,100	407.00	146,967,700
ゆうちょ銀行	417,400	1,007.00	420,321,800
富山第一銀行	42,100	282.00	11,872,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,010,000	415.00	419,150,000
西日本フィナンシャルホールディングス	115,500	720.00	83,160,000
三十三フィナンシャルグループ	16,400	1,452.00	23,812,800
第四北越フィナンシャルグループ	28,800	2,448.00	70,502,400
ひろぎんホールディングス	260,800	659.00	171,867,200
おきなわフィナンシャルグループ	15,900	2,181.00	34,677,900
十六フィナンシャルグループ	23,700	2,116.00	50,149,200
北國フィナンシャルホールディングス	16,400	2,436.00	39,950,400
新生銀行	115,300	1,831.00	211,114,300

あおぞら銀行	98,800	2,516.00	248,580,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,340,200	617.40	7,001,439,480
りそなホールディングス	2,023,900	436.50	883,432,350
三井住友トラスト・ホールディングス	334,200	3,803.00	1,270,962,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,224,000	3,812.00	4,665,888,000
千葉銀行	590,100	661.00	390,056,100
群馬銀行	339,700	341.00	115,837,700
武蔵野銀行	26,300	1,676.00	44,078,800
千葉興業銀行	41,600	251.00	10,441,600
筑波銀行	68,900	166.00	11,437,400
七十七銀行	55,500	1,270.00	70,485,000
青森銀行	13,700	1,715.00	23,495,500
秋田銀行	11,300	1,580.00	17,854,000
山形銀行	19,900	846.00	16,835,400
岩手銀行	11,600	1,782.00	20,671,200
東邦銀行	147,600	208.00	30,700,800
東北銀行	8,500	1,000.00	8,500,000
みちのく銀行	11,400	790.00	9,006,000
ふくおかフィナンシャルグループ	149,000	1,902.00	283,398,000
静岡銀行	430,600	826.00	355,675,600
スルガ銀行	155,100	494.00	76,619,400
八十二銀行	398,300	372.00	148,167,600
山梨中央銀行	19,200	833.00	15,993,600
大垣共立銀行	34,900	1,874.00	65,402,600
福井銀行	15,100	1,367.00	20,641,700
清水銀行	7,300	1,547.00	11,293,100
富山銀行	3,200	1,773.00	5,673,600
滋賀銀行	33,200	1,971.00	65,437,200
南都銀行	27,600	1,881.00	51,915,600
百五銀行	169,700	339.00	57,528,300
京都銀行	63,300	4,875.00	308,587,500
紀陽銀行	62,600	1,405.00	87,953,000
ほくほくフィナンシャルグループ	110,300	794.00	87,578,200
山陰合同銀行	104,900	624.00	65,457,600
中国銀行	141,300	884.00	124,909,200
鳥取銀行	5,600	1,130.00	6,328,000
伊予銀行	234,300	565.00	132,379,500
百十四銀行	18,800	1,441.00	27,090,800
四国銀行	26,900	742.00	19,959,800
阿波銀行	27,100	2,123.00	57,533,300
大分銀行	10,200	1,743.00	17,778,600
宮崎銀行	11,000	2,037.00	22,407,000



佐賀銀行	10,000	1,432.00	14,320,000
琉球銀行	38,400	752.00	28,876,800
セブン銀行	525,100	235.00	123,398,500
みずほフィナンシャルグループ	2,261,500	1,442.00	3,261,083,000
高知銀行	6,400	730.00	4,672,000
山口フィナンシャルグループ	206,000	633.00	130,398,000
長野銀行	5,800	1,185.00	6,873,000
名古屋銀行	13,200	2,670.00	35,244,000
北洋銀行	266,600	245.00	65,317,000
愛知銀行	6,400	3,705.00	23,712,000
中京銀行	6,400	1,492.00	9,548,800
大光銀行	6,100	1,276.00	7,783,600
愛媛銀行	24,700	784.00	19,364,800
トマト銀行	6,300	1,064.00	6,703,200
京葉銀行	75,400	442.00	33,326,800
栃木銀行	85,400	184.00	15,713,600
北日本銀行	5,500	1,523.00	8,376,500
東和銀行	31,000	516.00	15,996,000
福島銀行	20,300	221.00	4,486,300
大東銀行	8,500	739.00	6,281,500
トモニホールディングス	136,700	300.00	41,010,000
フィデアホールディングス	16,200	1,245.00	20,169,000
池田泉州ホールディングス	203,300	159.00	32,324,700
F P G	59,800	556.00	33,248,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,800	1,242.00	17,139,600
マーキュリアホールディングス	6,200	584.00	3,620,800
S B I ホールディングス	218,200	2,897.00	632,125,400
ジャフコ グループ	22,500	6,350.00	142,875,000
大和証券グループ本社	1,324,600	636.00	842,445,600
野村ホールディングス	2,700,200	488.30	1,318,507,660
岡三証券グループ	139,600	376.00	52,489,600
丸三証券	52,900	499.00	26,397,100
東洋証券	59,600	143.00	8,522,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	203,600	389.00	79,200,400
光世証券	4,100	493.00	2,021,300
水戸証券	47,900	266.00	12,741,400
いちよし証券	33,400	634.00	21,175,600
松井証券	86,800	777.00	67,443,600
マネックスグループ	144,400	689.00	99,491,600
極東証券	24,000	727.00	17,448,000
岩井コスモホールディングス	16,900	1,310.00	22,139,000
アイザワ証券グループ	29,300	1,036.00	30,354,800

マネーパートナーズグループ	19,600	215.00	4,214,000	
スパークス・グループ	82,300	302.00	24,854,600	
かんぽ生命保険	178,000	1,784.00	317,552,000	
S O M P Oホールディングス	311,700	4,937.00	1,538,862,900	
アニコム ホールディングス	54,300	761.00	41,322,300	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	396,500	3,500.00	1,387,750,000	
第一生命ホールディングス	870,400	2,337.00	2,034,124,800	
東京海上ホールディングス	582,400	6,242.00	3,635,340,800	
T & Dホールディングス	459,000	1,425.00	654,075,000	
アドバンスクリエイト	8,500	1,075.00	9,137,500	
全国保証	42,300	4,880.00	206,424,000	
あんしん保証	7,000	285.00	1,995,000	
イントラスト	8,200	690.00	5,658,000	
日本モーゲージサービス	10,300	1,065.00	10,969,500	
C a s a	6,700	890.00	5,963,000	
アルヒ	26,600	1,006.00	26,759,600	
プレミアグループ	9,000	3,490.00	31,410,000	
クレディセゾン	114,000	1,133.00	129,162,000	
芙蓉総合リース	18,600	7,770.00	144,522,000	
みずほリース	27,400	3,055.00	83,707,000	
東京センチュリー	34,300	5,360.00	183,848,000	
日本証券金融	70,100	828.00	58,042,800	
アイフル	298,100	339.00	101,055,900	
リコーリース	15,800	3,730.00	58,934,000	
イオンフィナンシャルサービス	96,600	1,214.00	117,272,400	
アコム	350,300	327.00	114,548,100	
ジャックス	19,700	2,840.00	55,948,000	
オリエントコーポレーション	482,300	119.00	57,393,700	
オリックス	1,073,700	2,239.50	2,404,551,150	
三菱H C キャピタル	654,100	552.00	361,063,200	
九州リースサービス	9,500	571.00	5,424,500	
日本取引所グループ	448,000	2,415.00	1,081,920,000	
イー・ギャランティ	26,200	2,342.00	61,360,400	
アサックス	9,900	701.00	6,939,900	
N E C キャピタルソリューション	7,400	1,966.00	14,548,400	
いちご	201,800	278.00	56,100,400	
日本駐車場開発	208,400	135.00	28,134,000	
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,288.00	14,296,800	
S R E ホールディングス	4,600	7,390.00	33,994,000	
A Dワークスグループ	35,600	154.00	5,482,400	
ヒューリック	423,600	1,083.00	458,758,800	
三栄建築設計	8,400	1,650.00	13,860,000	

野村不動産ホールディングス	92,000	2,488.00	228,896,000
三重交通グループホールディングス	40,400	468.00	18,907,200
サムティ	29,100	2,153.00	62,652,300
ディア・ライフ	26,800	510.00	13,668,000
日本商業開発	12,500	1,784.00	22,300,000
プレサンスコーポレーション	24,000	1,916.00	45,984,000
ハウスコム	5,000	1,255.00	6,275,000
日本管理センター	10,600	994.00	10,536,400
サンセイランディック	8,200	810.00	6,642,000
フージャースホールディングス	23,300	637.00	14,842,100
オープンハウス	56,400	5,870.00	331,068,000
東急不動産ホールディングス	523,300	596.00	311,886,800
飯田グループホールディングス	148,100	2,478.00	366,991,800
イーランド	4,400	1,452.00	6,388,800
ムゲンエステート	15,900	480.00	7,632,000
ハウズドゥ	8,700	892.00	7,760,400
シーアールイー	6,200	1,630.00	10,106,000
ケイアイスター不動産	8,100	8,040.00	65,124,000
グッドコムアセット	9,500	1,022.00	9,709,000
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,862.00	12,592,800
テンポイノベーション	7,600	850.00	6,460,000
フェイスネットワーク	3,600	1,241.00	4,467,600
パーク24	95,800	1,456.00	139,484,800
パラカ	6,100	1,528.00	9,320,800
三井不動産	806,700	2,211.50	1,784,017,050
三菱地所	1,162,700	1,563.00	1,817,300,100
平和不動産	30,700	3,630.00	111,441,000
東京建物	175,500	1,611.00	282,730,500
ダイビル	45,700	2,218.00	101,362,600
京阪神ビルディング	29,700	1,494.00	44,371,800
住友不動産	371,400	3,283.00	1,219,306,200
テーオーシー	35,400	639.00	22,620,600
東京楽天地	3,500	3,995.00	13,982,500
スターツコーポレーション	24,600	2,393.00	58,867,800
フジ住宅	23,900	657.00	15,702,300
空港施設	22,100	538.00	11,889,800
明和地所	12,400	564.00	6,993,600
ゴールドクレスト	15,300	1,558.00	23,837,400
エスリード	8,300	1,630.00	13,529,000
日神グループホールディングス	33,300	477.00	15,884,100
日本エスコン	32,900	785.00	25,826,500
タカラレーベン	74,100	277.00	20,525,700

AVANTIA	12,000	851.00	10,212,000
イオンモール	89,600	1,591.00	142,553,600
毎日コムネット	9,200	726.00	6,679,200
ファースト住建	8,600	1,221.00	10,500,600
カチタス	44,100	4,080.00	179,928,000
トーセイ	26,300	977.00	25,695,100
穴吹興産	5,000	1,866.00	9,330,000
サンフロンティア不動産	26,400	945.00	24,948,000
FJネクストホールディングス	19,600	992.00	19,443,200
インテリックス	4,000	615.00	2,460,000
ランドビジネス	7,500	259.00	1,942,500
サンネクスタグループ	8,000	1,062.00	8,496,000
グランディハウス	17,100	470.00	8,037,000
日本空港ビルデング	67,700	4,600.00	311,420,000
明豊ファシリティワークス	8,200	778.00	6,379,600
日本工営	10,100	3,115.00	31,461,500
LIFULL	53,600	230.00	12,328,000
ミクシィ	39,400	1,995.00	78,603,000
ジェイエイシーリクルートメント	14,000	2,151.00	30,114,000
日本M&Aセンターホールディングス	281,100	3,025.00	850,327,500
メンバーズ	5,300	2,293.00	12,152,900
中広	3,600	388.00	1,396,800
UTグループ	24,800	4,035.00	100,068,000
アイティメディア	8,300	1,774.00	14,724,200
E・Jホールディングス	9,200	1,168.00	10,745,600
夢真ビーネックスグループ	45,800	1,590.00	72,822,000
コシダカホールディングス	46,300	578.00	26,761,400
アルトナー	4,500	822.00	3,699,000
パソナグループ	18,700	3,185.00	59,559,500
CDS	4,400	1,614.00	7,101,600
リンクアンドモチベーション	37,800	531.00	20,071,800
エス・エム・エス	58,300	4,215.00	245,734,500
サニーサイドアップグループ	6,400	720.00	4,608,000
パーソルホールディングス	171,400	3,200.00	548,480,000
リニカル	10,000	749.00	7,490,000
クックパッド	55,200	240.00	13,248,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,900	591.00	5,259,900
学情	7,200	1,061.00	7,639,200
スタジオアリス	7,800	2,034.00	15,865,200
シミックホールディングス	9,700	1,484.00	14,394,800
エプコ	4,000	773.00	3,092,000
NJS	3,900	1,873.00	7,304,700

総合警備保障	68,200	4,595.00	313,379,000
カカクコム	125,800	3,075.00	386,835,000
アイロムグループ	6,200	1,581.00	9,802,200
セントケア・ホールディング	11,600	731.00	8,479,600
サイネックス	3,400	597.00	2,029,800
ルネサンス	12,200	1,080.00	13,176,000
ディップ	30,200	3,705.00	111,891,000
デジタルホールディングス	12,200	1,354.00	16,518,800
新日本科学	21,100	1,475.00	31,122,500
キャリアデザインセンター	4,700	954.00	4,483,800
ベネフィット・ワン	62,400	4,765.00	297,336,000
エムスリー	302,300	5,573.00	1,684,717,900
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	287.00	3,128,300
アウトソーシング	98,300	1,602.00	157,476,600
ウェルネット	18,000	447.00	8,046,000
ワールドホールディングス	7,000	2,499.00	17,493,000
ディー・エヌ・エー	65,400	1,699.00	111,114,600
博報堂D Yホールディングス	238,700	1,848.00	441,117,600
ぐるなび	28,800	423.00	12,182,400
タカミヤ	21,500	445.00	9,567,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,600	937.00	10,869,200
ファンコミュニケーションズ	43,600	415.00	18,094,000
ライク	4,700	1,646.00	7,736,200
ビジネス・ブレークスルー	7,100	421.00	2,989,100
エスプール	48,600	1,163.00	56,521,800
WDBホールディングス	7,900	3,005.00	23,739,500
手間いらず	2,200	4,975.00	10,945,000
ティア	10,700	433.00	4,633,100
C D G	2,100	1,375.00	2,887,500
アドウェイズ	25,900	852.00	22,066,800
バリューコマース	13,500	4,215.00	56,902,500
インフォマート	188,000	914.00	171,832,000
J Pホールディングス	45,300	238.00	10,781,400
エコナックホールディングス	34,500	89.00	3,070,500
レッグス	3,800	1,356.00	5,152,800
プレステージ・インターナショナル	64,700	663.00	42,896,100
アミューズ	9,500	2,001.00	19,009,500
ドリームインキュベータ	5,000	1,321.00	6,605,000
クイック	11,900	1,438.00	17,112,200
T A C	10,700	221.00	2,364,700
電通グループ	176,700	3,950.00	697,965,000
イオンファンタジー	6,800	1,751.00	11,906,800

シーティーエス	19,700	756.00	14,893,200
ネクシィーズグループ	6,400	687.00	4,396,800
H.U.グループホールディングス	44,900	2,792.00	125,360,800
アルプス技研	15,300	1,875.00	28,687,500
ダイオーズ	3,700	1,021.00	3,777,700
日本空調サービス	18,300	782.00	14,310,600
オリエンタルランド	202,500	19,260.00	3,900,150,000
ダスキン	39,900	2,760.00	110,124,000
明光ネットワークジャパン	20,700	551.00	11,405,700
ファルコホールディングス	8,300	1,997.00	16,575,100
ラウンドワン	48,000	1,256.00	60,288,000
リゾートトラスト	78,700	1,807.00	142,210,900
ビー・エム・エル	22,100	3,455.00	76,355,500
りらいあコミュニケーションズ	26,400	953.00	25,159,200
リソー教育	79,100	379.00	29,978,900
早稲田アカデミー	9,800	1,038.00	10,172,400
ユー・エス・エス	192,000	1,763.00	338,496,000
東京個別指導学院	15,600	613.00	9,562,800
サイバーエージェント	422,400	1,852.00	782,284,800
楽天グループ	880,100	1,111.00	977,791,100
クリーク・アンド・リバー社	9,100	1,966.00	17,890,600
モーニングスター	30,500	615.00	18,757,500
テー・オー・ダブリュー	31,000	305.00	9,455,000
山田コンサルティンググループ	9,100	1,136.00	10,337,600
セントラルスポーツ	6,500	2,359.00	15,333,500
フルキャストホールディングス	14,700	2,417.00	35,529,900
エン・ジャパン	27,800	3,280.00	91,184,000
リソルホールディングス	1,900	4,135.00	7,856,500
テクノプロ・ホールディングス	102,700	3,320.00	340,964,000
アトラグループ	3,800	283.00	1,075,400
インターワークス	5,700	399.00	2,274,300
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	6,480.00	51,840,000
Keeper 技研	11,200	2,237.00	25,054,400
ファーストロジック	3,700	780.00	2,886,000
三機サービス	3,600	1,003.00	3,610,800
Gunosy	11,300	757.00	8,554,100
デザインワン・ジャパン	5,900	186.00	1,097,400
イー・ガーディアン	7,000	3,275.00	22,925,000
リブセンス	11,200	182.00	2,038,400
ジャパンマテリアル	52,900	1,783.00	94,320,700
ベクトル	24,300	1,109.00	26,948,700
ウチヤマホールディングス	9,500	296.00	2,812,000

チャーム・ケア・コーポレーション	13,000	1,382.00	17,966,000
キャリアリンク	6,500	1,249.00	8,118,500
I B J	14,400	885.00	12,744,000
アサンテ	7,700	1,714.00	13,197,800
バリューHR	7,000	2,601.00	18,207,000
M & A キャピタルパートナーズ	14,200	5,380.00	76,396,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,577.00	10,723,600
E R I ホールディングス	5,000	1,299.00	6,495,000
アビスト	2,800	2,810.00	7,868,000
シグマクシス・ホールディングス	10,400	2,522.00	26,228,800
ウィルグループ	12,800	1,254.00	16,051,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,700	167.00	4,124,900
メドピア	13,300	3,060.00	40,698,000
レアジョブ	3,600	874.00	3,146,400
リクルートホールディングス	1,321,700	6,480.00	8,564,616,000
エラン	23,900	1,108.00	26,481,200
土木管理総合試験所	8,900	332.00	2,954,800
ネットマーケティング	9,100	401.00	3,649,100
日本郵政	2,237,500	882.60	1,974,817,500
ベルシステム24ホールディングス	24,900	1,206.00	30,029,400
鎌倉新書	19,900	620.00	12,338,000
S M N	4,200	606.00	2,545,200
グローバルキッズCOMPANY	3,500	731.00	2,558,500
エアトリ	11,200	3,265.00	36,568,000
アトラエ	12,100	2,438.00	29,499,800
ストライク	6,500	5,160.00	33,540,000
ソラスト	42,300	1,158.00	48,983,400
セラク	5,600	1,576.00	8,825,600
インソース	16,700	2,724.00	45,490,800
ベイカレント・コンサルティング	12,100	44,000.00	532,400,000
Orchestra Holdings	3,400	3,395.00	11,543,000
アイモバイル	5,100	1,209.00	6,165,900
キャリアインデックス	6,200	900.00	5,580,000
MS - Japan	7,300	936.00	6,832,800
船場	3,800	774.00	2,941,200
グレイステクノロジー	22,900	357.00	8,175,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	54,500	1,902.00	103,659,000
フルテック	2,600	1,472.00	3,827,200
GameWith	5,800	444.00	2,575,200
ソウルドアウト	4,400	1,201.00	5,284,400
MS & Consulting	3,000	707.00	2,121,000
ウェルビー	11,500	1,271.00	14,616,500

エル・ティー・エス	2,300	2,567.00	5,904,100
ミダックホールディングス	7,500	3,740.00	28,050,000
日総工産	13,700	838.00	11,480,600
キュービーネットホールディングス	8,100	1,627.00	13,178,700
R P Aホールディングス	25,000	344.00	8,600,000
スプリックス	5,100	1,748.00	8,914,800
マネジメントソリューションズ	8,500	2,901.00	24,658,500
プロレド・パートナーズ	4,000	982.00	3,928,000
テノ・ホールディングス	2,600	552.00	1,435,200
フロンティア・マネジメント	4,900	687.00	3,366,300
ピアラ	3,300	605.00	1,996,500
コプロ・ホールディングス	3,600	1,238.00	4,456,800
ギークス	3,100	1,700.00	5,270,000
カーブスホールディングス	47,400	763.00	36,166,200
フォーラムエンジニアリング	12,300	806.00	9,913,800
ダイレクトマーケティングミックス	9,300	3,245.00	30,178,500
ポピンズホールディングス	4,100	2,800.00	11,480,000
L I T A L I C O	13,900	3,865.00	53,723,500
アドバンテッジリスクマネジメント	9,100	732.00	6,661,200
リログループ	93,800	2,054.00	192,665,200
東祥	13,000	1,589.00	20,657,000
T R Eホールディングス	23,600	1,687.00	39,813,200
人・夢・技術グループ	7,000	1,759.00	12,313,000
エイチ・アイ・エス	38,200	1,821.00	69,562,200
ラックランド	5,000	3,030.00	15,150,000
共立メンテナンス	30,600	3,850.00	117,810,000
イチネンホールディングス	17,800	1,306.00	23,246,800
建設技術研究所	10,400	2,278.00	23,691,200
スペース	12,600	963.00	12,133,800
燦ホールディングス	7,700	1,506.00	11,596,200
スバル興業	1,100	8,520.00	9,372,000
東京テアトル	6,700	1,225.00	8,207,500
タナベ経営	7,000	687.00	4,809,000
ナガワ	5,500	11,330.00	62,315,000
東京都競馬	12,900	4,130.00	53,277,000
カナモト	30,300	2,302.00	69,750,600
西尾レントオール	15,900	2,658.00	42,262,200
トランス・コスモス	21,800	3,090.00	67,362,000
乃村工藝社	73,700	939.00	69,204,300
藤田観光	7,500	2,321.00	17,407,500
K N T - C Tホールディングス	10,600	1,348.00	14,288,800
日本管財	18,500	2,709.00	50,116,500



トーカイ	15,200	1,967.00	29,898,400	
セコム	168,900	7,932.00	1,339,714,800	
セントラル警備保障	8,400	2,282.00	19,168,800	
丹青社	35,400	781.00	27,647,400	
メイテック	20,700	6,530.00	135,171,000	
応用地質	19,500	1,991.00	38,824,500	
船井総研ホールディングス	35,200	2,504.00	88,140,800	
進学会ホールディングス	6,800	268.00	1,822,400	
オオバ	12,400	764.00	9,473,600	
いであ	4,800	1,884.00	9,043,200	
学究社	5,700	1,487.00	8,475,900	
ベネッセホールディングス	57,200	2,227.00	127,384,400	
イオンディライト	21,200	3,305.00	70,066,000	
ナック	8,500	951.00	8,083,500	
ダイセキ	31,700	4,865.00	154,220,500	
ステップ	6,400	1,818.00	11,635,200	
合 計	195,103,700		476,982,165,290	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## マネープールマザーファンド

## 貸借対照表

	2021年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	355,244,717,742
流動資産合計	355,244,717,742
資産合計	355,244,717,742
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,355,321
未払利息	529,947

	2021年12月20日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,885,268
負債合計	1,885,268
純資産の部	
元本等	
元本	354,713,644,471
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	529,188,003
元本等合計	355,242,832,474
純資産合計	355,242,832,474
負債純資産合計	355,244,717,742

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	354,713,644,471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 1.0015円 (1万口当たり純資産額) (10,015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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

	2021年12月20日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	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つた場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月22日
期首元本額	431,429,543,849円
期中追加設定元本額	120,434,561,446円
期中一部解約元本額	197,150,460,824円
期末元本額	354,713,644,471円

区分	2021年12月20日現在
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)	105,486円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	1,993円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円

区分	2021年12月20日現在
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,952円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー / SMARS（SMA専用）	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり（毎月決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし（毎月決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド（SMA専用）	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド（適格機関投資家専用）	20,561,472,318円
225ベアファンド6（建玉比率非調整型 / リセット型）（適格機関投資家専用）	1,498,061,767円
225ベアファンド7（建玉比率非調整型 / リセット型）（適格機関投資家専用）	95,439,490,969円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド（適格機関投資家専用）	3,602,226,083円
米国国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	2,597,251,209円
日本債券ベアファンド4（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	759,656,238円
ドイツ中期国債ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	953,537,021円
TOPIXベアファンド2（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	25,010,563,070円
TOPIXベアファンドR（建玉比率非調整型 / リセット型）（適格機関投資家専用）	17,035,091,570円
225ベアファンド8（建玉比率非調整型 / リセット型）（適格機関投資家専用）	21,827,692,985円

区分	2021年12月20日現在
225ベアファンド9(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	2,455,891,566円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド(適格機関投資家専用)	7,874,339,062円
225ベアファンド10(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	1,582,854,193円
TOPIXベアファンドR2(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	27,964,409,252円
TOPIXベアファンドF(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	88,331,803,512円
TOPIXベアファンドF2(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	37,113,642,601円
TOPIXベアファンドF3(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,461円
北米株配当戦略投信2018-11(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	9,986円
私募マネープールファンドAL(適格機関投資家専用)	80,626,667円

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## 【純資産額計算書】

（2022年 1月31日現在）

資産総額	141,582,776,761円
負債総額	227,796,355円
純資産総額（ - ）	141,354,980,406円
発行済口数	95,119,583,514口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4861円
（1万口当たり純資産額）	（14,861円）

（参考）

## J P X日経インデックス400 マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	35,638,842,136円
負債総額	147,507,072円
純資産総額（ - ）	35,491,335,064円
発行済口数	20,292,217,476口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7490円
（1万口当たり純資産額）	（17,490円）

## 中小型株式 マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	29,101,212,271円
負債総額	3,219円
純資産総額（ - ）	29,101,209,052円
発行済口数	6,201,729,769口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6924円
（1万口当たり純資産額）	（46,924円）



## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	474,015,235,461円
負債総額	448,167,802円
純資産総額（ - ）	473,567,067,659円
発行済口数	256,054,418,913口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8495円
（1万口当たり純資産額）	（18,495円）

## マネープールマザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	373,357,311,163円
負債総額	49,534,778円
純資産総額（ - ）	373,307,776,385円
発行済口数	372,769,568,264口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0014円
（1万口当たり純資産額）	（10,014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（2022年 1月31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 3月18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。

2022年1月31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	533	14,928,919
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	247,727
単位型公社債投資信託	55	301,731
合計	658	15,478,377

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
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	当事業年度
	（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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



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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 投資有価証券 その他有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020年3月31日）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

##### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

##### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。



## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

## 3. 確定拠出制度

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

### 資産の部

#### 流動資産

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

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

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

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

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

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

## 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	株主資本				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	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44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取る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)通常の見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

通常の見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3月18日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社



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

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
業務執行社員

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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

2022年2月18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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2020年12月22日から2021年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2021年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

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

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

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。