

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出書類】 | 訂正有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2022年4月11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】 | S M T E T Fカーボン・エフィシエント日本株 |
| 【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】 | (1)当初申込額 25億1,000万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、2021年 6月 4日に提出した有価証券届出書（2021年6月22日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前> 及び <訂正後> に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新・訂正後> に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。

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

<ファンドの特色>

「特色」の「<S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数とは>」を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

<S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数とは>

本ファンドの対象株価指数であるS&P/JPXカーボン・エフィシエント指数とは、東証株価指数(TOPIX)の構成銘柄をユニバースとする株価指数です。炭素効率性(売上高当たり炭素排出量)の水準に着目し、TOPIXとの産業グループごとのウェイト合計を一致させながら、炭素効率性の高い(売上高当たり炭素排出量が少ない)銘柄のウェイトを引き上げる一方で、炭素効率性の低い(売上高当たり炭素排出量が多い)銘柄のウェイトを引き下げる等のルールを採用することで構成銘柄のウェイトを決定します。これにより市場全体の環境に対する取り組み、情報開示を促し、株式市場の活性化を目指すものです。S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数は2009年3月20日の時価総額を100としてS&P Dow Jones Indices LLC、株式会社日本取引所グループ及び株式会社JPX総研が算出・公表しています*。

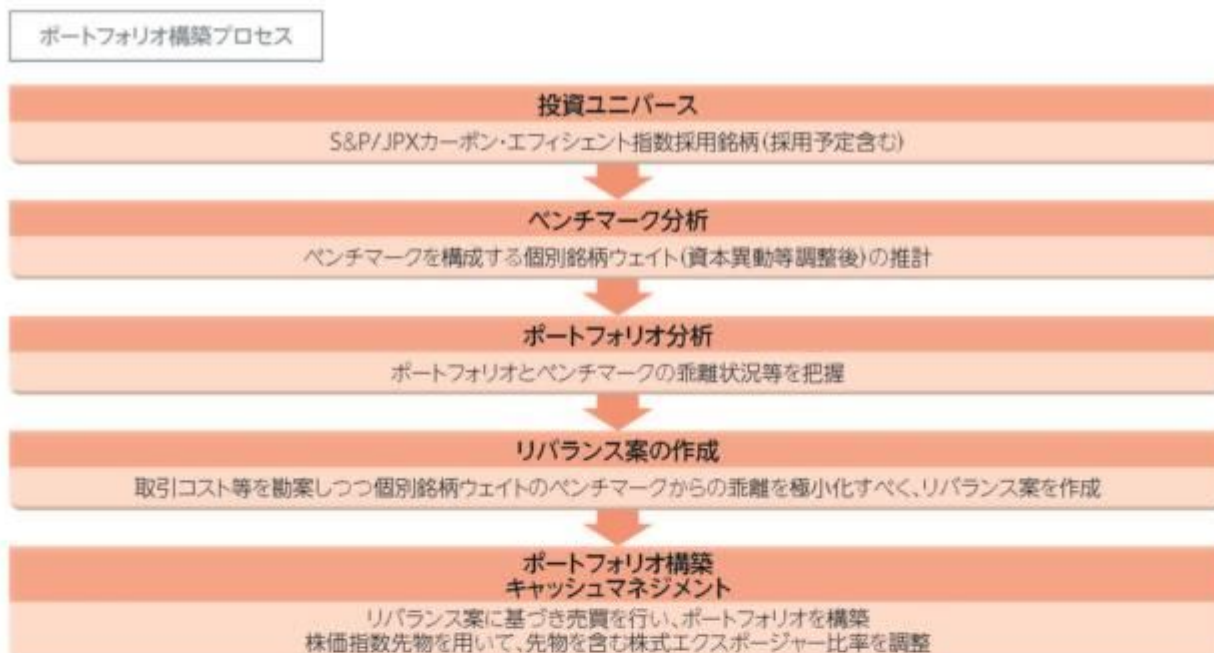
*指数の著作権等については後掲「[S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数]の著作権等について」をご参照ください。

「特色」を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

2. 上場投資信託(ETF)であり、通常の投資信託とは仕組みが異なります。

- 受益権は、東京証券取引所に上場しており、株式と同様に売買可能です。
 - ・売買単位は、1口単位です。
 - ・取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行います。
 - ・追加設定に係る受益権の取得申込者は、ユニット(対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象株価指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ)単位で、株式による取得申込みを行うことができます。
 - ・委託会社は、取得申込受付日に適用されるユニットの銘柄及び株数を決定し、販売会社に提示します。
 - ・原則として、金銭による取得申込みはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
 - ・一定口数以上の受益権を保有する受益者は、当該受益権を当該受益権に相当する投資信託財産に属する株式と交換することができます。
 - ・解約申込みにより、受益権を換金することはできません。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

[S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数]の著作権等について

[S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数]はS&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)、株式会社日本取引所グループ(以下「JPX」)および株式会社JPX総研(以下、「JPX総研」)の商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(以下「当社」)に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。JPX[®]はJPXの登録商標であり、これを利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社に付与されています。TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、JPX総研の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利はJPX総研が有します。当社の商品は、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはもしくはそれぞれの関連会社、JPXまたはJPX総研によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

分配方針

- 年2回、毎決算時に分配方針に基づき分配を行います。
※第1期決算日は2022年1月11日です。
- 経費等控除後の配当等収益の全額を分配することを原則とします。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。
- 売買益(評価益を含みます。)が生じても、分配は行いません。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

「S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数(以下「当指数」)」は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(以下「SPDJ」)ならびに株式会社JPX総研および株式会社日本取引所グループ(以下「JPX総研」)の商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(以下「当社」)に付与されています。Standard & Poor's^(R)およびS&P^(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones^(R)は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標です。また、JPXは株式会社日本取引所グループ、TOPIXは株式会社JPX総研の商標です。これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与され

ています。指数に直接投資することはできません。

当社の商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）、およびJ P X総研によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones IndicesまたはJ P X総研のいずれも、当社の商品の所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当社の商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡する当指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。当指数に関して、S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研と当社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研の特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。当指数は当社または当社の商品に関係なく、S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研によって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研は、当指数の決定、構成または計算において当社または当社の商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研のいずれも、当社の商品の価格および数量、または当社の商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当社の商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indices およびJ P X総研は、ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。当指数に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研は、当指数またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。

S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研は、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones IndicesおよびJ P X総研は、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくは当指数を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、当社、当社の商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones IndicesまたはJ P X総研は、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

（２）ファンドの沿革

< 訂正前 >

（前略）

2021年6月23日

受益権を東京証券取引所に上場（予定）

< 訂正後 >

(前略)

2021年6月23日

受益権を東京証券取引所に上場

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(2021年 3月31日現在)

(後略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(2022年 2月28日現在)

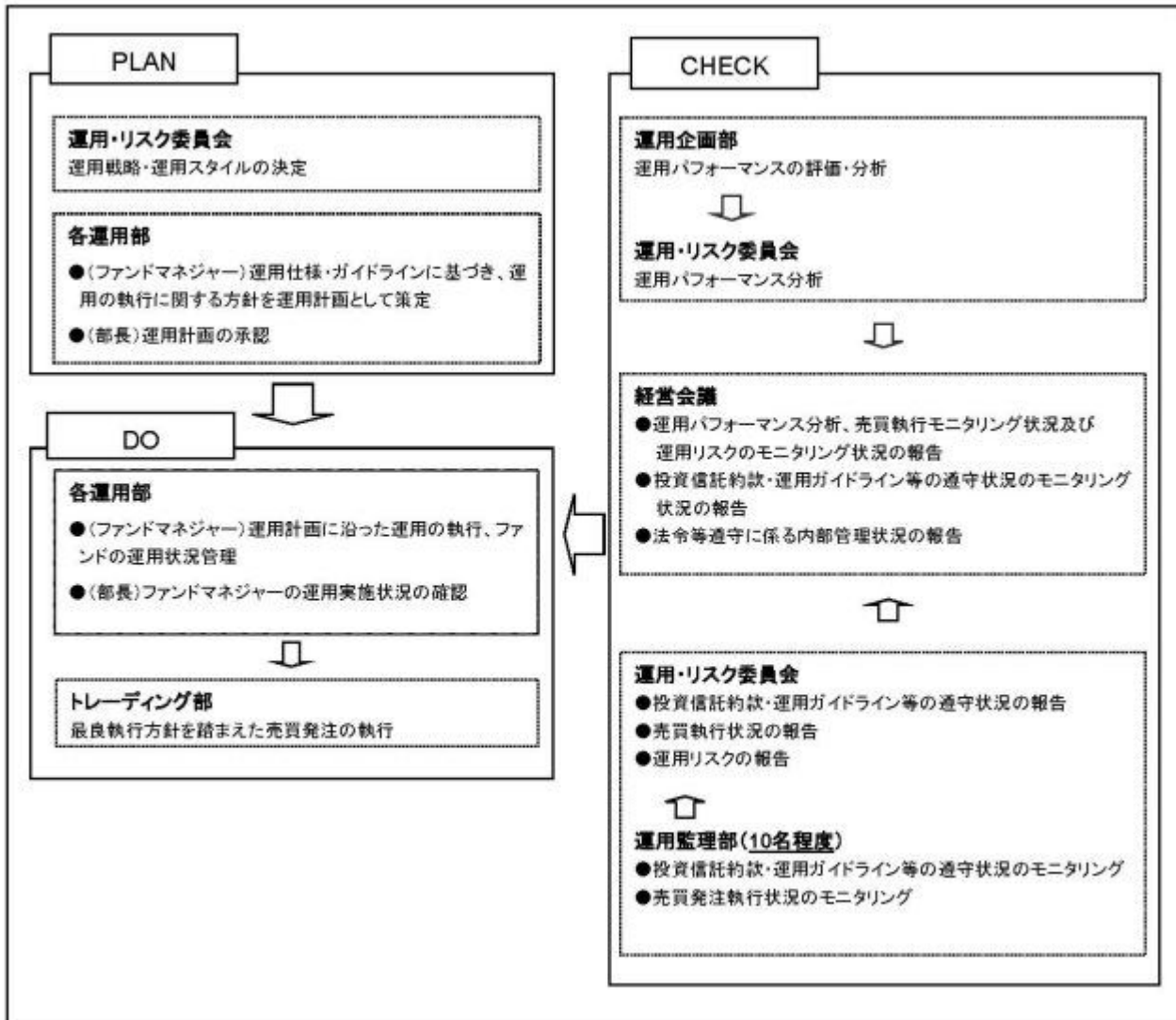
(後略)

2 投資方針

(3) 運用体制

<訂正前>

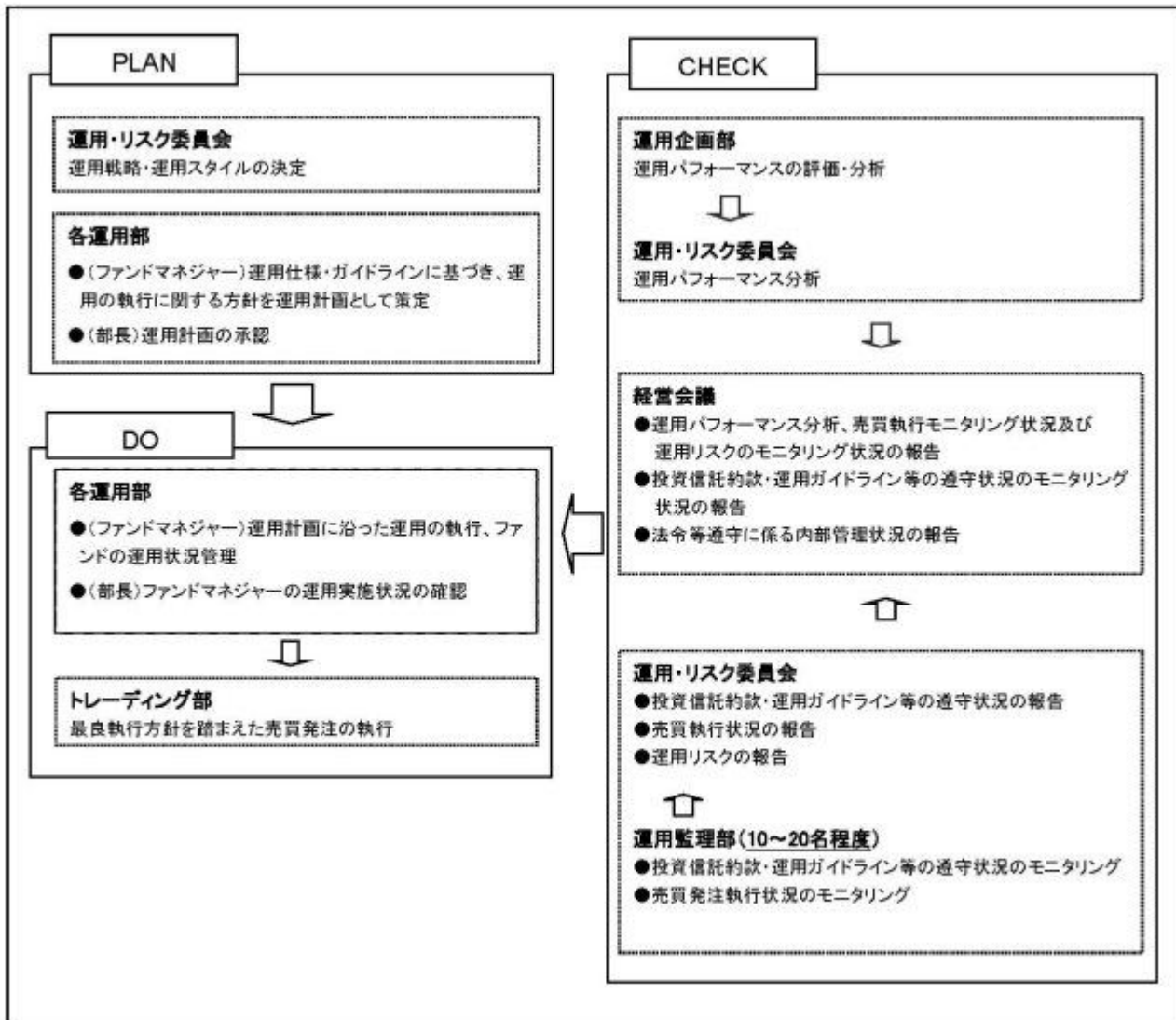
(前略)



(後略)

<訂正後>

(前略)



(後略)

3 投資リスク

(2) リスクの管理体制

< 訂正前 >

委託会社におけるリスク管理体制

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

< 訂正後 >

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〕を以下の内容に更新・訂正します。

< 更新・訂正後 >

【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ますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

*当ファンドの年間騰落率は、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*2017年3月～2022年2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ますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの年間騰落率は、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

各資産クラスの指数について

| | |
|--|---|
| 日本株 TOPIX (東証株価指数, 配当込み) | TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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。同指数の相対性及び同指数に係る権利又は利益は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という。)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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は利益に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。 |
| 先進国株 MSCIコフサイ・インデックス (配当込み、円ベース) | MSCIコフサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) | MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 日本国債 NOMURA-BPI国債 | NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動き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算出されています。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。 |
| 先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発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、またデータの誤差、遅延または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債 JPMi Global Bond Index (配当込み、円ベース) | 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP, 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。JP, Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP, 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**(3) 信託報酬等**

<訂正前>

(前略)

信託報酬の総額は、下記のa.及びb.により計算された額の合計額とします。

a.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0.1265%（税抜0.115%）

（ 1 ）以内の率を乗じて得た額

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

なお、2021年6月4日現在、以下の通りです。

(中略)

b. 当ファンドの投資信託約款に定める株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）以内を乗じて得た額

なお、2021年6月4日現在、以下の通りです。

(後略)

<訂正後>

(前略)

信託報酬の総額は、下記のa.及びb.により計算された額の合計額とします。

a.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0.1265%（税抜0.115%）

（ 1 ）以内の率を乗じて得た額

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

なお、2022年4月11日現在、以下の通りです。

(中略)

b. 当ファンドの投資信託約款に定める株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）以内を乗じて得た額

なお、2022年4月11日現在、以下の通りです。

(後略)

(4) その他の手数料等

<訂正前>

(前略)

2：2021年6月4日現在、当ファンドの純資産総額に年率0.015%以内の率を乗じた額です。

3：2021年6月4日現在、新規上場料は新規上場時の純資産総額に対して、追加上場料は追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時及び新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額、年間上場料は毎年末のファンドの純資産総額に最大0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額です。

4：2021年6月4日現在、当該株式の個別銘柄時価総額の0.15%に相当する金額です。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

2：2022年4月11日現在、当ファンドの純資産総額に年率0.015%以内の率を乗じた額です。

3：2022年4月11日現在、追加上場料は追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時及び新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額、年間上場料は毎年末のファンドの純資産総額に最大0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額です。

4：2022年4月11日現在、当該株式の個別銘柄時価総額の0.15%に相当する金額です。

(後略)

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

上記は、2021年 3月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

上記は、2022年 2月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

(後略)

5 運用状況

< 更新・訂正後 >

以下は、2022年2月28日現在の状況について記載してあります。

S M T E T Fカーボン・エフィシエント日本株

(1) 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 | 1,040,990,480 | 99.70 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,080,617 | 0.30 |
| 合計(純資産総額) | | 1,044,071,097 | 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。

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 | 1,891,000 | 0.18 |

(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、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 | 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 | 26,000 | 2,322.00 | 60,372,000 | 2,138.50 | 55,601,000 | 5.33 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 3,500 | 14,405.00 | 50,417,500 | 11,810.00 | 41,335,000 | 3.96 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 500 | 62,500.00 | 31,250,000 | 53,780.00 | 26,890,000 | 2.58 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 26,900 | 701.40 | 18,867,660 | 712.80 | 19,174,320 | 1.84 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 300 | 62,750.00 | 18,825,000 | 55,770.00 | 16,731,000 | 1.60 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 3,100 | 6,408.00 | 19,864,800 | 4,819.00 | 14,938,900 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 2,900 | 5,360.00 | 15,544,000 | 5,125.00 | 14,862,500 | 1.42 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 3,900 | 3,593.00 | 14,012,700 | 3,756.00 | 14,648,400 | 1.40 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 3,800 | 3,275.00 | 12,445,000 | 3,501.00 | 13,303,800 | 1.27 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 4,000 | 3,307.00 | 13,228,000 | 3,293.00 | 13,172,000 | 1.26 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 700 | 19,385.00 | 13,569,500 | 17,670.00 | 12,369,000 | 1.18 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 3,400 | 3,482.00 | 11,838,800 | 3,525.00 | 11,985,000 | 1.15 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 800 | 15,770.00 | 12,616,000 | 14,855.00 | 11,884,000 | 1.14 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 200 | 53,830.00 | 10,766,000 | 58,020.00 | 11,604,000 | 1.11 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 2,800 | 4,255.00 | 11,914,000 | 4,121.00 | 11,538,800 | 1.11 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 4,100 | 2,756.00 | 11,299,600 | 2,793.50 | 11,453,350 | 1.10 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 500 | 25,755.00 | 12,877,500 | 21,205.00 | 10,602,500 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 500 | 18,500.00 | 9,250,000 | 21,130.00 | 10,565,000 | 1.01 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 1,800 | 6,784.00 | 12,211,200 | 5,650.00 | 10,170,000 | 0.97 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 1,000 | 12,345.00 | 12,345,000 | 9,883.00 | 9,883,000 | 0.95 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 2,400 | 3,528.00 | 8,467,200 | 3,743.00 | 8,983,200 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 1,600 | 5,019.00 | 8,030,400 | 5,591.00 | 8,945,600 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 3,100 | 2,805.00 | 8,695,500 | 2,865.50 | 8,883,050 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 1,100 | 9,028.00 | 9,930,800 | 7,787.00 | 8,565,700 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 1,300 | 7,010.00 | 9,113,000 | 6,574.00 | 8,546,200 | 0.82 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|---------|-------|-------|-----------|------------|-----------|-----------|------|
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 400 | 24,180.00 | 9,672,000 | 21,155.00 | 8,462,000 | 0.81 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 2,100 | 3,772.00 | 7,921,200 | 3,871.00 | 8,129,100 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 4,200 | 1,879.00 | 7,891,800 | 1,918.50 | 8,057,700 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | デンソー | 輸送用機器 | 1,000 | 10,060.00 | 10,060,000 | 8,047.00 | 8,047,000 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | 資生堂 | 化学 | 1,100 | 6,000.00 | 6,600,000 | 6,566.00 | 7,222,600 | 0.69 |

(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 | 0.21 |
| | | 建設業 | 2.78 |
| | | 食料品 | 3.50 |
| | | 繊維製品 | 0.45 |
| | | パルプ・紙 | 0.19 |
| | | 化学 | 7.02 |
| | | 医薬品 | 5.50 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.45 |
| | | ゴム製品 | 0.23 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.54 |
| | | 鉄鋼 | 0.59 |
| | | 非鉄金属 | 0.77 |
| | | 金属製品 | 0.28 |
| | | 機械 | 5.06 |
| | | 電気機器 | 18.76 |
| | | 輸送用機器 | 9.23 |
| | | 精密機器 | 2.73 |
| | | その他製品 | 2.23 |
| | | 電気・ガス業 | 1.20 |
| | | 陸運業 | 3.22 |
| | | 海運業 | 0.30 |
| | | 空運業 | 0.33 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.14 |
| | | 情報・通信業 | 8.31 |
| | | 卸売業 | 4.83 |
| 小売業 | 4.08 | | |
| 銀行業 | 5.43 | | |
| 証券、商品先物取引業 | 0.86 | | |
| 保険業 | 2.47 | | |
| その他金融業 | 1.06 | | |

| | | |
|----|-------|-------|
| | 不動産業 | 1.81 |
| | サービス業 | 5.12 |
| | 小計 | 99.70 |
| 合計 | | 99.70 |

(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又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 | ミニTOPIX先物 | 買建 | 1円 | | 1,983,500 | 1,891,000 | 0.18 |

(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、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。

(3) 運用実績

純資産の推移

| | | 純資産総額 (円) | | 1口当たりの純資産額 (円) | | 東京証券取引所 取引価格 (円) |
|----------|---------------|---------------|---------------|----------------|--------|---------------------|
| | | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) | |
| 第1期計算期間末 | (2022年 1月11日) | 1,102,639,028 | 1,113,876,536 | 26,297 | 26,565 | 26,360 |
| | 2021年 6月末日 | 1,076,407,707 | | 25,671 | | 25,940 |
| | 7月末日 | 1,051,901,128 | | 25,086 | | 25,260 |
| | 8月末日 | 1,083,016,625 | | 25,829 | | 25,830 |
| | 9月末日 | 1,131,829,200 | | 26,993 | | 27,100 |
| | 10月末日 | 1,118,076,419 | | 26,665 | | 26,500 |
| | 11月末日 | 1,079,165,357 | | 25,737 | | 25,810 |
| | 12月末日 | 1,116,890,208 | | 26,636 | | 26,720 |
| | 2022年 1月末日 | 1,051,618,913 | | 25,080 | | 25,180 |
| | 2月末日 | 1,044,071,097 | | 24,900 | | 24,790 |

(注)計算期間末が東京証券取引所の休業日にあたる場合、東京証券取引所取引価格は直前営業日の終値を表示しています。終値がない場合には、その直近値を表示しています。

分配の推移

| | 期 間 | 1口当たりの分配金 (円) |
|---------|---------------------------|---------------|
| 第1期計算期間 | 2021年 6月22日 ~ 2022年 1月11日 | 268 |

収益率の推移

| | 期 間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第1期計算期間 | 2021年 6月22日～2022年 1月11日 | 5.9 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 設定及び解約の実績


| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|---------|-------------------------|---------|---------|-----------|
| 第1期計算期間 | 2021年 6月22日～2022年 1月11日 | 41,931 | | 41,931 |

(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：2021年6月22日
作成基準日：2022年2月28日

基準価額・純資産の推移



基準価額 24,900円

純資産総額 10.44億円

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|---------------|------|
| 2022年1月 | 268円 |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| 設定来 分配金合計額 | 268円 |

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

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

主要な資産の状況

| 銘柄名 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 投資比率 |
|-------------------|------|----|--------|------|
| トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 5.3% |
| ソニーグループ | 日本 | 株式 | 電気機器 | 4.0% |
| キーエンス | 日本 | 株式 | 電気機器 | 2.6% |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本 | 株式 | 銀行業 | 1.8% |
| 東京エレクトロン | 日本 | 株式 | 電気機器 | 1.6% |
| リフルートホールディングス | 日本 | 株式 | サービス業 | 1.4% |
| ソフトバンクグループ | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 1.4% |
| KDDI | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 1.4% |
| 武田薬品工業 | 日本 | 株式 | 医薬品 | 1.3% |
| 日本電信電話 | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 1.3% |

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※2021年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※2013年～2020年は、ファンドのベンチマークである「S&P/JPXカーボン・エフィシエント指数」の年間収益率です。
※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

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

第3【ファンドの経理状況】

<更新・訂正後>

(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1期計算期間(2021年6月22日から2022年1月11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

SMT ETFカーボン・エフィシエント日本株

(1) 貸借対照表

| (単位：円) | |
|------------------------|---------------|
| 第1期 (2022年 1月11日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 13,088,440 |
| 株式 | 1,099,703,150 |
| 未収入金 | 10,944 |
| 未収配当金 | 1,488,417 |
| 差入委託証拠金 | 546,000 |
| 流動資産合計 | 1,114,836,951 |
| 資産合計 | 1,114,836,951 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 12,588 |
| 前受金 | 45,000 |
| 未払収益分配金 | 11,237,508 |
| 未払受託者報酬 | 189,206 |
| 未払委託者報酬 | 587,817 |
| 未払利息 | 7 |
| その他未払費用 | 125,797 |
| 流動負債合計 | 12,197,923 |
| 負債合計 | 12,197,923 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 1,051,964,928 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 50,674,100 |
| (分配準備積立金) | 18,878 |
| 元本等合計 | 1,102,639,028 |
| 純資産合計 | 1,102,639,028 |
| 負債純資産合計 | 1,114,836,951 |

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| | 第1期 自 2021年 6月22日 至 2022年 1月11日 |
|-------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | |
| 受取配当金 | 12,268,283 |
| 受取利息 | 24 |
| 有価証券売買等損益 | 50,935,705 |
| 派生商品取引等損益 | 285,676 |
| その他収益 | 3,261 |
| 営業収益合計 | 62,921,597 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 1,152 |
| 受託者報酬 | 189,206 |
| 委託者報酬 | 587,817 |
| その他費用 | 237,007 |
| 営業費用合計 | 1,015,182 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 61,906,415 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 61,906,415 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 61,906,415 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | - |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,193 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,193 |
| 分配金 | 11,237,508 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 50,674,100 |

(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 | 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。 |
| 4. 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1月12日から7月11日まで、及び7月12日から翌年1月11日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2021年 6月22日から2022年 1月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

| | 第1期 (2022年 1月11日現在) | |
|----------------------------|------------------------|---------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 41,931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 | 26,297円 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 第1期 自 2021年 6月22日 至 2022年 1月11日 | | |
|---------------------------------------|-------|-------------|
| 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | |
| 当期配当等収益額 | A | 12,270,416円 |
| 分配準備積立金 | B | - 円 |
| 配当等収益合計額 | C=A+B | 12,270,416円 |
| 経費 | D | 1,014,030円 |
| 収益分配可能額 | E=C-D | 11,256,386円 |
| 収益分配金金額 | F | 11,237,508円 |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | I | 18,878円 |
| 口数 | H | 41,931口 |
| 1口当たり分配金額 | L | 268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1期 自 2021年 6月22日 至 2022年 1月11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 | <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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従っ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（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。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | <p style="text-align: center;">第1期 (2022年 1月11日現在)</p> |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | <p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第1期 |
|----------------|--------------------------------|
| | 自 2021年 6月22日 至 2022年 1月11日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首元本額 | 1,051,964,928円 |
| 期中追加設定元本額 | - 円 |
| 期中一部交換元本額 | - 円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第1期 |
|----|---------------------|
| | (2022年 1月11日現在) |
| | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 50,674,407 |
| 合計 | 50,674,407 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

第1期（2022年 1月11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 | 1,996,000 | - | 1,983,500 | 12,500 |
| 合計 | | 1,996,000 | - | 1,983,500 | 12,500 |

(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。

(4) 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 | 800 | 547.00 | 437,600 | |
| 住石ホールディングス | 100 | 146.00 | 14,600 | |
| I N P E X | 1,600 | 1,019.00 | 1,630,400 | |
| 石油資源開発 | 100 | 2,641.00 | 264,100 | |
| ショーボンドホールディングス | 100 | 4,990.00 | 499,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 300 | 1,893.00 | 567,900 | |
| Robot Home | 100 | 229.00 | 22,900 | |
| 安藤・間 | 400 | 878.00 | 351,200 | |
| 東急建設 | 200 | 688.00 | 137,600 | |
| コムシスホールディングス | 200 | 2,617.00 | 523,400 | |
| ピーアールホールディングス | 100 | 352.00 | 35,200 | |
| オリエンタル白石 | 200 | 235.00 | 47,000 | |
| 大成建設 | 500 | 3,480.00 | 1,740,000 | |
| 大林組 | 1,600 | 902.00 | 1,443,200 | |
| 清水建設 | 1,400 | 729.00 | 1,020,600 | |
| 長谷工コーポレーション | 400 | 1,439.00 | 575,600 | |
| 鹿島建設 | 1,300 | 1,352.00 | 1,757,600 | |
| 西松建設 | 100 | 3,700.00 | 370,000 | |
| 三井住友建設 | 300 | 434.00 | 130,200 | |
| 奥村組 | 100 | 3,265.00 | 326,500 | |
| 東鉄工業 | 100 | 2,477.00 | 247,700 | |
| 戸田建設 | 600 | 724.00 | 434,400 | |
| 熊谷組 | 100 | 2,909.00 | 290,900 | |
| 矢作建設工業 | 100 | 745.00 | 74,500 | |
| 日本ハウスホールディングス | 100 | 469.00 | 46,900 | |
| 大東建託 | 200 | 13,060.00 | 2,612,000 | |
| 新日本建設 | 100 | 792.00 | 79,200 | |
| 日本国土開発 | 100 | 551.00 | 55,100 | |
| 東洋建設 | 200 | 569.00 | 113,800 | |
| 五洋建設 | 600 | 643.00 | 385,800 | |

| | | | |
|--------------------------|-------|----------|-----------|
| 世紀東急工業 | 100 | 804.00 | 80,400 |
| 住友林業 | 100 | 2,185.00 | 218,500 |
| 巴コーポレーション | 100 | 506.00 | 50,600 |
| 大和ハウス工業 | 1,600 | 3,345.00 | 5,352,000 |
| ライト工業 | 100 | 1,898.00 | 189,800 |
| 積水ハウス | 2,000 | 2,459.50 | 4,919,000 |
| ユアテック | 100 | 664.00 | 66,400 |
| 中電工 | 100 | 2,106.00 | 210,600 |
| 関電工 | 300 | 873.00 | 261,900 |
| きんでん | 300 | 1,718.00 | 515,400 |
| 日本電設工業 | 100 | 1,567.00 | 156,700 |
| エクシオグループ | 300 | 2,420.00 | 726,000 |
| 九電工 | 100 | 3,460.00 | 346,000 |
| 三機工業 | 100 | 1,427.00 | 142,700 |
| 日揮ホールディングス | 400 | 1,041.00 | 416,400 |
| 高砂熱学工業 | 100 | 1,908.00 | 190,800 |
| 明星工業 | 100 | 740.00 | 74,000 |
| 大気社 | 100 | 3,070.00 | 307,000 |
| インフロニア・ホールディングス | 500 | 1,077.00 | 538,500 |
| レイズネクスト | 100 | 1,172.00 | 117,200 |
| 日清製粉グループ本社 | 100 | 1,617.00 | 161,700 |
| 森永製菓 | 100 | 3,745.00 | 374,500 |
| 山崎製パン | 400 | 1,548.00 | 619,200 |
| 寿スピリッツ | 100 | 4,920.00 | 492,000 |
| カルビー | 100 | 2,728.00 | 272,800 |
| 明治ホールディングス | 100 | 7,110.00 | 711,000 |
| サッポロホールディングス | 300 | 2,239.00 | 671,700 |
| アサヒグループホールディングス | 1,400 | 4,587.00 | 6,421,800 |
| キリンホールディングス | 2,400 | 1,865.50 | 4,477,200 |
| 宝ホールディングス | 400 | 1,208.00 | 483,200 |
| オエノンホールディングス | 100 | 337.00 | 33,700 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 700 | 1,348.00 | 943,600 |
| サントリー食品インターナショナル | 600 | 4,265.00 | 2,559,000 |
| キッコーマン | 600 | 9,090.00 | 5,454,000 |
| 味の素 | 400 | 3,517.00 | 1,406,800 |
| キューピー | 200 | 2,491.00 | 498,200 |
| ハウス食品グループ本社 | 100 | 2,915.00 | 291,500 |
| カゴメ | 200 | 3,025.00 | 605,000 |
| ニチレイ | 100 | 2,641.00 | 264,100 |
| 東洋水産 | 300 | 4,865.00 | 1,459,500 |
| 日清食品ホールディングス | 200 | 8,270.00 | 1,654,000 |
| 日本たばこ産業 | 3,000 | 2,365.50 | 7,096,500 |
| 片倉工業 | 100 | 2,299.00 | 229,900 |

| | | | |
|----------------|-------|-----------|------------|
| 東洋紡 | 100 | 1,345.00 | 134,500 |
| ダイトウボウ | 100 | 102.00 | 10,200 |
| 帝人 | 500 | 1,457.00 | 728,500 |
| 東レ | 3,000 | 718.70 | 2,156,100 |
| ワコールホールディングス | 100 | 2,103.00 | 210,300 |
| ホギメディカル | 100 | 3,140.00 | 314,000 |
| T S Iホールディングス | 100 | 329.00 | 32,900 |
| ワールド | 100 | 1,161.00 | 116,100 |
| オンワードホールディングス | 200 | 297.00 | 59,400 |
| キムラタン | 200 | 19.00 | 3,800 |
| ゴールドウイン | 100 | 6,360.00 | 636,000 |
| デサント | 100 | 4,015.00 | 401,500 |
| 王子ホールディングス | 1,500 | 563.00 | 844,500 |
| 日本製紙 | 200 | 1,164.00 | 232,800 |
| 北越コーポレーション | 300 | 714.00 | 214,200 |
| 大王製紙 | 200 | 1,858.00 | 371,600 |
| レンゴー | 400 | 891.00 | 356,400 |
| 北の達人コーポレーション | 100 | 305.00 | 30,500 |
| クラレ | 500 | 1,039.00 | 519,500 |
| 旭化成 | 3,400 | 1,123.00 | 3,818,200 |
| 昭和電工 | 300 | 2,582.00 | 774,600 |
| 住友化学 | 3,200 | 570.00 | 1,824,000 |
| 日産化学 | 300 | 6,500.00 | 1,950,000 |
| 日本曹達 | 100 | 3,305.00 | 330,500 |
| 東ソー | 500 | 1,780.00 | 890,000 |
| トクヤマ | 100 | 1,828.00 | 182,800 |
| セントラル硝子 | 100 | 2,127.00 | 212,700 |
| 東亜合成 | 200 | 1,177.00 | 235,400 |
| 大阪ソーダ | 100 | 3,005.00 | 300,500 |
| 関東電化工業 | 100 | 1,117.00 | 111,700 |
| デンカ | 100 | 3,915.00 | 391,500 |
| 信越化学工業 | 700 | 19,385.00 | 13,569,500 |
| エア・ウォーター | 400 | 1,795.00 | 718,000 |
| 日本酸素ホールディングス | 300 | 2,508.00 | 752,400 |
| 日本パーカラライジング | 300 | 1,097.00 | 329,100 |
| 日本触媒 | 100 | 5,370.00 | 537,000 |
| カネカ | 100 | 3,850.00 | 385,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 500 | 2,020.00 | 1,010,000 |
| 三井化学 | 300 | 3,290.00 | 987,000 |
| J S R | 500 | 4,130.00 | 2,065,000 |
| 東京応化工業 | 100 | 6,430.00 | 643,000 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 2,300 | 877.50 | 2,018,250 |
| K Hネオケム | 100 | 3,125.00 | 312,500 |

| | | | |
|--------------------|-------|-----------|-----------|
| ダイセル | 600 | 833.00 | 499,800 |
| 住友ベークライト | 100 | 5,850.00 | 585,000 |
| 積水化学工業 | 200 | 1,957.00 | 391,400 |
| 日本ゼオン | 400 | 1,390.00 | 556,000 |
| アイカ工業 | 100 | 3,325.00 | 332,500 |
| 積水樹脂 | 100 | 2,090.00 | 209,000 |
| タキロンシーアイ | 100 | 552.00 | 55,200 |
| リケンテクノス | 100 | 498.00 | 49,800 |
| 積水化成成品工業 | 100 | 478.00 | 47,800 |
| 日本化薬 | 300 | 1,154.00 | 346,200 |
| カーリットホールディングス | 100 | 710.00 | 71,000 |
| A D E K A | 200 | 2,474.00 | 494,800 |
| 日油 | 100 | 5,460.00 | 546,000 |
| 花王 | 1,100 | 5,872.00 | 6,459,200 |
| 大日本塗料 | 100 | 817.00 | 81,700 |
| 日本ペイントホールディングス | 2,600 | 1,100.00 | 2,860,000 |
| 関西ペイント | 600 | 2,466.00 | 1,479,600 |
| 中国塗料 | 100 | 948.00 | 94,800 |
| 藤倉化成 | 100 | 486.00 | 48,600 |
| D I C | 200 | 2,982.00 | 596,400 |
| サカタインクス | 100 | 994.00 | 99,400 |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 100 | 1,914.00 | 191,400 |
| 富士フイルムホールディングス | 800 | 8,494.00 | 6,795,200 |
| 資生堂 | 1,100 | 6,000.00 | 6,600,000 |
| ライオン | 700 | 1,534.00 | 1,073,800 |
| マンダム | 100 | 1,381.00 | 138,100 |
| ミルボン | 100 | 5,520.00 | 552,000 |
| ファンケル | 200 | 3,075.00 | 615,000 |
| コーセー | 100 | 11,520.00 | 1,152,000 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 300 | 1,794.00 | 538,200 |
| コニシ | 100 | 1,685.00 | 168,500 |
| 長谷川香料 | 100 | 2,604.00 | 260,400 |
| 小林製薬 | 200 | 8,690.00 | 1,738,000 |
| J C U | 100 | 5,210.00 | 521,000 |
| デクセリアルズ | 100 | 3,695.00 | 369,500 |
| クミアイ化学工業 | 200 | 781.00 | 156,200 |
| 日本農薬 | 100 | 502.00 | 50,200 |
| 日東電工 | 400 | 9,040.00 | 3,616,000 |
| きもと | 100 | 225.00 | 22,500 |
| エフピコ | 100 | 3,885.00 | 388,500 |
| 信越ポリマー | 100 | 1,086.00 | 108,600 |
| ニフコ | 100 | 3,770.00 | 377,000 |
| バルカー | 100 | 2,690.00 | 269,000 |

| | | | |
|-------------------|-------|----------|------------|
| ユニ・チャーム | 100 | 4,807.00 | 480,700 |
| 協和キリン | 500 | 3,090.00 | 1,545,000 |
| 武田薬品工業 | 3,800 | 3,275.00 | 12,445,000 |
| アステラス製薬 | 4,200 | 1,879.00 | 7,891,800 |
| 大日本住友製薬 | 300 | 1,355.00 | 406,500 |
| 塩野義製薬 | 600 | 7,577.00 | 4,546,200 |
| 中外製薬 | 1,600 | 3,769.00 | 6,030,400 |
| 科研製薬 | 100 | 4,205.00 | 420,500 |
| エーザイ | 500 | 6,548.00 | 3,274,000 |
| ロート製薬 | 200 | 3,330.00 | 666,000 |
| 小野薬品工業 | 1,200 | 2,797.00 | 3,356,400 |
| 久光製薬 | 100 | 4,060.00 | 406,000 |
| 持田製薬 | 100 | 3,465.00 | 346,500 |
| 参天製薬 | 1,000 | 1,427.00 | 1,427,000 |
| 日医工 | 100 | 731.00 | 73,100 |
| キッセイ薬品工業 | 100 | 2,246.00 | 224,600 |
| 生化学工業 | 100 | 968.00 | 96,800 |
| 栄研化学 | 100 | 1,878.00 | 187,800 |
| JCRファーマ | 100 | 2,145.00 | 214,500 |
| 東和薬品 | 100 | 2,925.00 | 292,500 |
| ゼリア新薬工業 | 100 | 1,937.00 | 193,700 |
| 第一三共 | 4,100 | 2,756.00 | 11,299,600 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 100 | 1,808.00 | 180,800 |
| 大幸薬品 | 100 | 736.00 | 73,600 |
| 大塚ホールディングス | 100 | 4,235.00 | 423,500 |
| 大正製薬ホールディングス | 100 | 5,500.00 | 550,000 |
| あすか製薬ホールディングス | 100 | 1,001.00 | 100,100 |
| 日本コークス工業 | 400 | 136.00 | 54,400 |
| 出光興産 | 400 | 3,110.00 | 1,244,000 |
| E N E O Sホールディングス | 6,900 | 449.80 | 3,103,620 |
| コスモエネルギーホールディングス | 100 | 2,314.00 | 231,400 |
| 横浜ゴム | 100 | 1,869.00 | 186,900 |
| TOYO TIRE | 100 | 1,819.00 | 181,900 |
| ブリヂストン | 400 | 5,092.00 | 2,036,800 |
| 住友ゴム工業 | 100 | 1,184.00 | 118,400 |
| バンドー化学 | 100 | 894.00 | 89,400 |
| 日東紡績 | 100 | 2,913.00 | 291,300 |
| A G C | 200 | 5,300.00 | 1,060,000 |
| 日本板硝子 | 100 | 537.00 | 53,700 |
| 日本電気硝子 | 100 | 2,862.00 | 286,200 |
| 太平洋セメント | 100 | 2,351.00 | 235,100 |
| 東海カーボン | 600 | 1,251.00 | 750,600 |
| TOTO | 400 | 5,150.00 | 2,060,000 |

| | | | |
|--------------------|-------|----------|-----------|
| 日本碍子 | 400 | 2,013.00 | 805,200 |
| 日本特殊陶業 | 100 | 2,038.00 | 203,800 |
| ニチアス | 100 | 2,762.00 | 276,200 |
| 日本製鉄 | 1,200 | 2,048.50 | 2,458,200 |
| 神戸製鋼所 | 500 | 608.00 | 304,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 700 | 1,631.00 | 1,141,700 |
| 東京製鐵 | 100 | 1,435.00 | 143,500 |
| 大和工業 | 100 | 3,790.00 | 379,000 |
| 淀川製鋼所 | 100 | 2,542.00 | 254,200 |
| 丸一鋼管 | 100 | 2,615.00 | 261,500 |
| 大同特殊鋼 | 100 | 4,335.00 | 433,500 |
| 日立金属 | 300 | 2,130.00 | 639,000 |
| 新日本電工 | 100 | 303.00 | 30,300 |
| 日本軽金属ホールディングス | 100 | 1,817.00 | 181,700 |
| 三井金属鉱業 | 100 | 3,190.00 | 319,000 |
| 三菱マテリアル | 200 | 2,052.00 | 410,400 |
| 住友金属鉱山 | 500 | 4,716.00 | 2,358,000 |
| D O W Aホールディングス | 100 | 4,915.00 | 491,500 |
| エス・サイエンス | 200 | 24.00 | 4,800 |
| 東邦チタニウム | 100 | 956.00 | 95,600 |
| U A C J | 100 | 2,809.00 | 280,900 |
| 古河電気工業 | 100 | 2,387.00 | 238,700 |
| 住友電気工業 | 1,500 | 1,630.50 | 2,445,750 |
| フジクラ | 500 | 583.00 | 291,500 |
| タツタ電線 | 100 | 486.00 | 48,600 |
| アサヒホールディングス | 200 | 2,074.00 | 414,800 |
| トーカロ | 100 | 1,392.00 | 139,200 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 200 | 1,399.00 | 279,800 |
| 横河ブリッジホールディングス | 100 | 2,191.00 | 219,100 |
| 三和ホールディングス | 300 | 1,247.00 | 374,100 |
| 文化シャッター | 100 | 1,063.00 | 106,300 |
| L I X I L | 500 | 2,932.00 | 1,466,000 |
| ノーリツ | 100 | 1,687.00 | 168,700 |
| 岡部 | 100 | 745.00 | 74,500 |
| 東プレ | 100 | 1,287.00 | 128,700 |
| 高周波熱錬 | 100 | 635.00 | 63,500 |
| 日本発條 | 100 | 979.00 | 97,900 |
| 日本製鋼所 | 100 | 4,150.00 | 415,000 |
| 三浦工業 | 200 | 3,590.00 | 718,000 |
| タクマ | 100 | 1,416.00 | 141,600 |
| ツガミ | 100 | 1,656.00 | 165,600 |
| オークマ | 100 | 5,150.00 | 515,000 |
| アマダ | 600 | 1,172.00 | 703,200 |

| | | | |
|---------------|-------|-----------|------------|
| アイダエンジニアリング | 100 | 1,048.00 | 104,800 |
| F U J I | 200 | 2,691.00 | 538,200 |
| オーエスジー | 200 | 1,809.00 | 361,800 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 100 | 638.00 | 63,800 |
| D M G 森精機 | 300 | 1,956.00 | 586,800 |
| ソディック | 100 | 806.00 | 80,600 |
| ディスコ | 100 | 34,700.00 | 3,470,000 |
| 島精機製作所 | 100 | 1,970.00 | 197,000 |
| オプトラン | 100 | 2,332.00 | 233,200 |
| フリュー | 100 | 1,261.00 | 126,100 |
| ヤマシンフィルタ | 100 | 481.00 | 48,100 |
| やまびこ | 100 | 1,207.00 | 120,700 |
| ナブテスコ | 300 | 3,650.00 | 1,095,000 |
| S M C | 100 | 72,510.00 | 7,251,000 |
| オイレス工業 | 100 | 1,668.00 | 166,800 |
| 小松製作所 | 2,000 | 2,940.00 | 5,880,000 |
| 住友重機械工業 | 200 | 2,993.00 | 598,600 |
| 日立建機 | 200 | 3,445.00 | 689,000 |
| 日工 | 100 | 614.00 | 61,400 |
| クボタ | 2,100 | 2,614.50 | 5,490,450 |
| 月島機械 | 100 | 1,076.00 | 107,600 |
| 新東工業 | 100 | 711.00 | 71,100 |
| アイチ コーポレーション | 100 | 826.00 | 82,600 |
| 小森コーポレーション | 100 | 705.00 | 70,500 |
| 荏原製作所 | 200 | 6,220.00 | 1,244,000 |
| ダイキン工業 | 500 | 25,755.00 | 12,877,500 |
| 栗田工業 | 200 | 5,200.00 | 1,040,000 |
| アネスト岩田 | 100 | 871.00 | 87,100 |
| ダイフク | 200 | 9,190.00 | 1,838,000 |
| タダノ | 100 | 1,135.00 | 113,500 |
| フジテック | 100 | 2,446.00 | 244,600 |
| C K D | 100 | 2,230.00 | 223,000 |
| 平和 | 100 | 1,926.00 | 192,600 |
| S A N K Y O | 100 | 3,020.00 | 302,000 |
| 竹内製作所 | 100 | 2,863.00 | 286,300 |
| アマノ | 100 | 2,554.00 | 255,400 |
| J U K I | 100 | 830.00 | 83,000 |
| マックス | 100 | 1,863.00 | 186,300 |
| グローリー | 100 | 2,228.00 | 222,800 |
| 大和冷機工業 | 100 | 1,250.00 | 125,000 |
| セガサミーホールディングス | 400 | 1,824.00 | 729,600 |
| ツバキ・ナカシマ | 100 | 1,504.00 | 150,400 |
| ホシザキ | 100 | 8,610.00 | 861,000 |

| | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|
| 日本精工 | 700 | 806.00 | 564,200 |
| NTN | 700 | 252.00 | 176,400 |
| ジェイテクト | 200 | 1,069.00 | 213,800 |
| 日本トムソン | 100 | 650.00 | 65,000 |
| THK | 200 | 2,946.00 | 589,200 |
| イーグル工業 | 100 | 1,119.00 | 111,900 |
| キッツ | 100 | 710.00 | 71,000 |
| マキタ | 600 | 4,790.00 | 2,874,000 |
| 三井E&Sホールディングス | 200 | 399.00 | 79,800 |
| 日立造船 | 300 | 790.00 | 237,000 |
| 三菱重工業 | 700 | 3,076.00 | 2,153,200 |
| IHI | 300 | 2,452.00 | 735,600 |
| サノヤスホールディングス | 100 | 128.00 | 12,800 |
| スター精密 | 100 | 1,546.00 | 154,600 |
| 日清紡ホールディングス | 200 | 926.00 | 185,200 |
| イビデン | 200 | 6,450.00 | 1,290,000 |
| コニカミノルタ | 900 | 532.00 | 478,800 |
| ブラザー工業 | 600 | 2,213.00 | 1,327,800 |
| ミネベアミツミ | 600 | 3,100.00 | 1,860,000 |
| 日立製作所 | 1,800 | 6,784.00 | 12,211,200 |
| 三菱電機 | 4,800 | 1,513.00 | 7,262,400 |
| 富士電機 | 200 | 6,200.00 | 1,240,000 |
| 安川電機 | 700 | 5,440.00 | 3,808,000 |
| シンフォニアテクノロジー | 100 | 1,273.00 | 127,300 |
| 明電舎 | 100 | 2,713.00 | 271,300 |
| 東芝テック | 100 | 4,495.00 | 449,500 |
| マブチモーター | 100 | 3,830.00 | 383,000 |
| 日本電産 | 1,000 | 12,345.00 | 12,345,000 |
| ダブル・スコープ | 100 | 924.00 | 92,400 |
| ヤーマン | 100 | 928.00 | 92,800 |
| JVCケンウッド | 400 | 182.00 | 72,800 |
| 日新電機 | 100 | 1,612.00 | 161,200 |
| 大崎電気工業 | 100 | 468.00 | 46,800 |
| オムロン | 500 | 10,620.00 | 5,310,000 |
| 日東工業 | 100 | 1,576.00 | 157,600 |
| IDEC | 100 | 2,626.00 | 262,600 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 100 | 2,555.00 | 255,500 |
| 日本電気 | 500 | 5,230.00 | 2,615,000 |
| 富士通 | 300 | 18,400.00 | 5,520,000 |
| 沖電気工業 | 200 | 913.00 | 182,600 |
| ルネサスエレクトロニクス | 200 | 1,386.00 | 277,200 |
| セイコーエプソン | 600 | 2,047.00 | 1,228,200 |
| ワコム | 300 | 885.00 | 265,500 |

| | | | |
|------------|-------|-----------|------------|
| アルバック | 100 | 6,510.00 | 651,000 |
| ジャパンディスプレイ | 1,400 | 37.00 | 51,800 |
| 日本信号 | 100 | 898.00 | 89,800 |
| 京三製作所 | 100 | 446.00 | 44,600 |
| 能美防災 | 100 | 2,122.00 | 212,200 |
| エレコム | 100 | 1,497.00 | 149,700 |
| パナソニック | 1,100 | 1,299.50 | 1,429,450 |
| シャープ | 600 | 1,312.00 | 787,200 |
| アンリツ | 300 | 1,787.00 | 536,100 |
| ソニーグループ | 3,500 | 14,405.00 | 50,417,500 |
| T D K | 600 | 4,405.00 | 2,643,000 |
| タムラ製作所 | 200 | 656.00 | 131,200 |
| アルプスアルパイン | 400 | 1,160.00 | 464,000 |
| フォスター電機 | 100 | 736.00 | 73,600 |
| ホシデン | 100 | 1,159.00 | 115,900 |
| ヒロセ電機 | 100 | 17,810.00 | 1,781,000 |
| 日本航空電子工業 | 100 | 1,951.00 | 195,100 |
| マクセル | 100 | 1,447.00 | 144,700 |
| 古野電気 | 100 | 1,162.00 | 116,200 |
| 横河電機 | 500 | 2,014.00 | 1,007,000 |
| アズビル | 400 | 4,895.00 | 1,958,000 |
| 日本光電工業 | 200 | 3,145.00 | 629,000 |
| 堀場製作所 | 100 | 6,530.00 | 653,000 |
| アドバンテスト | 400 | 10,470.00 | 4,188,000 |
| キーエンス | 500 | 62,500.00 | 31,250,000 |
| シスメックス | 400 | 12,620.00 | 5,048,000 |
| 日本マイクロニクス | 100 | 1,702.00 | 170,200 |
| オプテックスグループ | 100 | 1,561.00 | 156,100 |
| レーザーテック | 200 | 30,730.00 | 6,146,000 |
| スタンレー電気 | 100 | 2,918.00 | 291,800 |
| ウシオ電機 | 200 | 1,817.00 | 363,400 |
| 日本電子 | 100 | 7,490.00 | 749,000 |
| カシオ計算機 | 400 | 1,457.00 | 582,800 |
| ファナック | 400 | 24,180.00 | 9,672,000 |
| 日本シイエムケイ | 100 | 609.00 | 60,900 |
| 浜松ホトニクス | 300 | 6,580.00 | 1,974,000 |
| 京セラ | 600 | 7,191.00 | 4,314,600 |
| 太陽誘電 | 200 | 6,380.00 | 1,276,000 |
| 村田製作所 | 1,100 | 9,028.00 | 9,930,800 |
| 双葉電子工業 | 100 | 690.00 | 69,000 |
| ニチコン | 100 | 1,246.00 | 124,600 |
| K O A | 100 | 1,543.00 | 154,300 |
| 市光工業 | 100 | 551.00 | 55,100 |

| | | | |
|---------------------|--------|-----------|------------|
| 小糸製作所 | 100 | 6,380.00 | 638,000 |
| S C R E E Nホールディングス | 100 | 12,050.00 | 1,205,000 |
| キヤノン | 2,300 | 2,817.50 | 6,480,250 |
| リコー | 1,100 | 1,070.00 | 1,177,000 |
| 東京エレクトロン | 300 | 62,750.00 | 18,825,000 |
| トヨタ紡織 | 100 | 2,401.00 | 240,100 |
| 豊田自動織機 | 200 | 9,400.00 | 1,880,000 |
| モリタホールディングス | 100 | 1,321.00 | 132,100 |
| デンソー | 1,000 | 10,060.00 | 10,060,000 |
| 東海理化電機製作所 | 100 | 1,608.00 | 160,800 |
| 川崎重工業 | 300 | 2,241.00 | 672,300 |
| 名村造船所 | 100 | 214.00 | 21,400 |
| 日産自動車 | 5,500 | 622.30 | 3,422,650 |
| いすゞ自動車 | 1,600 | 1,465.00 | 2,344,000 |
| トヨタ自動車 | 26,000 | 2,322.00 | 60,372,000 |
| 日野自動車 | 600 | 1,012.00 | 607,200 |
| 三菱自動車工業 | 2,000 | 334.00 | 668,000 |
| 日産車体 | 100 | 710.00 | 71,000 |
| 新明和工業 | 100 | 887.00 | 88,700 |
| 極東開発工業 | 100 | 1,513.00 | 151,300 |
| 曙ブレーキ工業 | 100 | 191.00 | 19,100 |
| N O K | 200 | 1,280.00 | 256,000 |
| フタバ産業 | 100 | 467.00 | 46,700 |
| K Y B | 100 | 3,320.00 | 332,000 |
| プレス工業 | 100 | 411.00 | 41,100 |
| ミクニ | 100 | 395.00 | 39,500 |
| アイシン | 100 | 4,730.00 | 473,000 |
| マツダ | 1,600 | 994.00 | 1,590,400 |
| 本田技研工業 | 3,400 | 3,482.00 | 11,838,800 |
| スズキ | 900 | 4,695.00 | 4,225,500 |
| S U B A R U | 1,500 | 2,196.00 | 3,294,000 |
| ヤマハ発動機 | 300 | 2,907.00 | 872,100 |
| 豊田合成 | 100 | 2,664.00 | 266,400 |
| 愛三工業 | 100 | 861.00 | 86,100 |
| テイ・エス テック | 200 | 1,481.00 | 296,200 |
| テルモ | 1,300 | 4,520.00 | 5,876,000 |
| 日機装 | 100 | 810.00 | 81,000 |
| 島津製作所 | 700 | 4,290.00 | 3,003,000 |
| 東京精密 | 100 | 4,940.00 | 494,000 |
| マニー | 200 | 1,597.00 | 319,400 |
| ニコン | 700 | 1,284.00 | 898,800 |
| トプコン | 200 | 1,546.00 | 309,200 |
| オリンパス | 2,100 | 2,495.50 | 5,240,550 |

| | | | | |
|-------------------|-------|-----------|------------|--|
| HOYA | 800 | 15,770.00 | 12,616,000 | |
| 朝日インテック | 400 | 2,276.00 | 910,400 | |
| シチズン時計 | 500 | 496.00 | 248,000 | |
| メニコン | 200 | 3,050.00 | 610,000 | |
| ニプロ | 200 | 1,076.00 | 215,200 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 100 | 1,936.00 | 193,600 | |
| バンダイナムコホールディングス | 500 | 8,590.00 | 4,295,000 | |
| フランスベッドホールディングス | 100 | 905.00 | 90,500 | |
| パイロットコーポレーション | 100 | 4,180.00 | 418,000 | |
| フジシールインターナショナル | 100 | 2,225.00 | 222,500 | |
| タカラトミー | 200 | 1,125.00 | 225,000 | |
| 凸版印刷 | 400 | 2,158.00 | 863,200 | |
| 大日本印刷 | 400 | 2,874.00 | 1,149,600 | |
| NISSHA | 100 | 1,593.00 | 159,300 | |
| アシックス | 400 | 2,417.00 | 966,800 | |
| ヤマハ | 300 | 5,530.00 | 1,659,000 | |
| ピジョン | 300 | 2,353.00 | 705,900 | |
| リンテック | 100 | 2,694.00 | 269,400 | |
| イトーキ | 100 | 352.00 | 35,200 | |
| 任天堂 | 200 | 53,830.00 | 10,766,000 | |
| タカラスタANDARD | 100 | 1,420.00 | 142,000 | |
| コクヨ | 200 | 1,708.00 | 341,600 | |
| オカムラ | 100 | 1,242.00 | 124,200 | |
| 東京電力ホールディングス | 2,900 | 298.00 | 864,200 | |
| 中部電力 | 1,000 | 1,219.00 | 1,219,000 | |
| 関西電力 | 1,200 | 1,116.00 | 1,339,200 | |
| 中国電力 | 500 | 945.00 | 472,500 | |
| 北陸電力 | 200 | 591.00 | 118,200 | |
| 東北電力 | 700 | 815.00 | 570,500 | |
| 四国電力 | 300 | 813.00 | 243,900 | |
| 九州電力 | 700 | 858.00 | 600,600 | |
| 北海道電力 | 300 | 516.00 | 154,800 | |
| 電源開発 | 100 | 1,501.00 | 150,100 | |
| レノバ | 100 | 1,706.00 | 170,600 | |
| 東京瓦斯 | 1,300 | 2,166.00 | 2,815,800 | |
| 大阪瓦斯 | 1,000 | 1,970.00 | 1,970,000 | |
| 東邦瓦斯 | 300 | 3,045.00 | 913,500 | |
| 西部ガスホールディングス | 100 | 2,103.00 | 210,300 | |
| 静岡ガス | 200 | 992.00 | 198,400 | |
| SBSホールディングス | 100 | 3,495.00 | 349,500 | |
| 東武鉄道 | 300 | 2,653.00 | 795,900 | |
| 相鉄ホールディングス | 100 | 2,087.00 | 208,700 | |
| 東急 | 1,500 | 1,543.00 | 2,314,500 | |

| | | | |
|------------------------|-----|-----------|-----------|
| 京浜急行電鉄 | 400 | 1,154.00 | 461,600 |
| 小田急電鉄 | 700 | 2,124.00 | 1,486,800 |
| 京王電鉄 | 400 | 5,110.00 | 2,044,000 |
| 京成電鉄 | 400 | 3,005.00 | 1,202,000 |
| 富士急行 | 100 | 4,010.00 | 401,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 700 | 6,744.00 | 4,720,800 |
| 西日本旅客鉄道 | 400 | 4,762.00 | 1,904,800 |
| 東海旅客鉄道 | 300 | 14,815.00 | 4,444,500 |
| 西武ホールディングス | 400 | 1,067.00 | 426,800 |
| 鴻池運輸 | 100 | 1,197.00 | 119,700 |
| 西日本鉄道 | 100 | 2,537.00 | 253,700 |
| 近鉄グループホールディングス | 500 | 3,240.00 | 1,620,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 500 | 3,240.00 | 1,620,000 |
| 南海電気鉄道 | 200 | 2,217.00 | 443,400 |
| 京阪ホールディングス | 200 | 2,672.00 | 534,400 |
| 名古屋鉄道 | 300 | 1,830.00 | 549,000 |
| ヤマトホールディングス | 700 | 2,590.00 | 1,813,000 |
| 山九 | 100 | 4,725.00 | 472,500 |
| センコーグループホールディングス | 400 | 932.00 | 372,800 |
| ニッコンホールディングス | 100 | 2,182.00 | 218,200 |
| セイノーホールディングス | 200 | 1,150.00 | 230,000 |
| 日立物流 | 100 | 5,310.00 | 531,000 |
| 丸和運輸機関 | 100 | 1,445.00 | 144,500 |
| 九州旅客鉄道 | 300 | 2,350.00 | 705,000 |
| S Gホールディングス | 600 | 2,538.00 | 1,522,800 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 200 | 7,070.00 | 1,414,000 |
| 日本郵船 | 200 | 9,290.00 | 1,858,000 |
| 商船三井 | 100 | 9,090.00 | 909,000 |
| 飯野海運 | 100 | 546.00 | 54,600 |
| 日本航空 | 600 | 2,194.00 | 1,316,400 |
| ANAホールディングス | 800 | 2,395.50 | 1,916,400 |
| 三菱倉庫 | 200 | 2,821.00 | 564,200 |
| 三井倉庫ホールディングス | 100 | 2,439.00 | 243,900 |
| 住友倉庫 | 100 | 1,911.00 | 191,100 |
| 上組 | 200 | 2,207.00 | 441,400 |
| NEC ネットエスアイ | 100 | 1,742.00 | 174,200 |
| システナ | 400 | 385.00 | 154,000 |
| 日鉄ソリューションズ | 100 | 3,445.00 | 344,500 |
| T I S | 400 | 3,105.00 | 1,242,000 |
| グリー | 300 | 852.00 | 255,600 |
| コーエーテクモホールディングス | 100 | 4,310.00 | 431,000 |
| K L a b | 100 | 463.00 | 46,300 |

| | | | |
|-------------------------|-------|-----------|-----------|
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 100 | 953.00 | 95,300 |
| ネクソン | 1,400 | 2,152.00 | 3,012,800 |
| アイスタイル | 100 | 243.00 | 24,300 |
| コロブラ | 200 | 645.00 | 129,000 |
| ブロードリーフ | 300 | 390.00 | 117,000 |
| じげん | 100 | 300.00 | 30,000 |
| テクマトリックス | 100 | 1,593.00 | 159,300 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 200 | 2,450.00 | 490,000 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 100 | 12,180.00 | 1,218,000 |
| インターネットイニシアティブ | 100 | 4,245.00 | 424,500 |
| eBASE | 100 | 565.00 | 56,500 |
| アバント | 100 | 1,109.00 | 110,900 |
| メディカル・データ・ビジョン | 100 | 1,167.00 | 116,700 |
| gumi | 100 | 619.00 | 61,900 |
| チェンジ | 100 | 1,578.00 | 157,800 |
| マクロミル | 100 | 1,054.00 | 105,400 |
| 野村総合研究所 | 800 | 4,290.00 | 3,432,000 |
| ソースネクスト | 200 | 164.00 | 32,800 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 700 | 1,143.00 | 800,100 |
| オービック | 100 | 19,110.00 | 1,911,000 |
| ジャストシステム | 100 | 4,995.00 | 499,500 |
| Zホールディングス | 5,900 | 615.00 | 3,628,500 |
| トレンドマイクロ | 300 | 5,840.00 | 1,752,000 |
| 日本オラクル | 100 | 8,390.00 | 839,000 |
| フューチャー | 200 | 1,584.00 | 316,800 |
| オービックビジネスコンサルタント | 100 | 4,605.00 | 460,500 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 200 | 3,455.00 | 691,000 |
| アイティフォー | 100 | 800.00 | 80,000 |
| 大塚商会 | 200 | 5,220.00 | 1,044,000 |
| サイボウズ | 100 | 1,578.00 | 157,800 |
| 電通国際情報サービス | 100 | 3,440.00 | 344,000 |
| デジタルガレージ | 100 | 4,600.00 | 460,000 |
| EMシステムズ | 100 | 694.00 | 69,400 |
| ネットワンシステムズ | 200 | 2,876.00 | 575,200 |
| システムソフト | 100 | 117.00 | 11,700 |
| マーベラス | 100 | 723.00 | 72,300 |
| エイベックス | 100 | 1,358.00 | 135,800 |
| 日本ユニシス | 200 | 3,080.00 | 616,000 |
| TBSホールディングス | 400 | 1,627.00 | 650,800 |
| 日本テレビホールディングス | 300 | 1,207.00 | 362,100 |
| テレビ朝日ホールディングス | 200 | 1,456.00 | 291,200 |
| スカパーJSATホールディングス | 400 | 430.00 | 172,000 |
| 日本通信 | 300 | 191.00 | 57,300 |

| | | | |
|----------------------|-------|-----------|------------|
| 日本電信電話 | 4,000 | 3,307.00 | 13,228,000 |
| K D D I | 3,900 | 3,593.00 | 14,012,700 |
| ソフトバンク | 3,600 | 1,450.00 | 5,220,000 |
| 光通信 | 100 | 17,630.00 | 1,763,000 |
| G M Oインターネット | 200 | 2,593.00 | 518,600 |
| K A D O K A W A | 200 | 2,723.00 | 544,600 |
| 学研ホールディングス | 100 | 1,051.00 | 105,100 |
| ゼンリン | 100 | 1,014.00 | 101,400 |
| 東宝 | 200 | 4,740.00 | 948,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 1,100 | 2,327.00 | 2,559,700 |
| D T S | 100 | 2,452.00 | 245,200 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 200 | 5,800.00 | 1,160,000 |
| カプコン | 400 | 2,537.00 | 1,014,800 |
| S C S K | 300 | 2,162.00 | 648,600 |
| T K C | 100 | 3,185.00 | 318,500 |
| 富士ソフト | 100 | 5,160.00 | 516,000 |
| N S D | 100 | 1,967.00 | 196,700 |
| コナミホールディングス | 100 | 5,520.00 | 552,000 |
| ソフトバンクグループ | 2,900 | 5,360.00 | 15,544,000 |
| 双日 | 400 | 1,773.00 | 709,200 |
| アルフレッサ ホールディングス | 500 | 1,599.00 | 799,500 |
| 神戸物産 | 100 | 3,930.00 | 393,000 |
| あい ホールディングス | 100 | 1,949.00 | 194,900 |
| ダイワボウホールディングス | 200 | 1,768.00 | 353,600 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 100 | 2,633.00 | 263,300 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 100 | 807.00 | 80,700 |
| T O K A Iホールディングス | 200 | 873.00 | 174,600 |
| 三洋貿易 | 100 | 1,000.00 | 100,000 |
| シップヘルスケアホールディングス | 200 | 2,622.00 | 524,400 |
| コメダホールディングス | 100 | 2,040.00 | 204,000 |
| ナガイレーベン | 100 | 2,209.00 | 220,900 |
| メディバルホールディングス | 400 | 2,114.00 | 845,600 |
| 日本ライフライン | 100 | 1,113.00 | 111,300 |
| I D O M | 100 | 753.00 | 75,300 |
| 伊藤忠商事 | 2,400 | 3,528.00 | 8,467,200 |
| 丸紅 | 2,900 | 1,126.50 | 3,266,850 |
| 長瀬産業 | 200 | 1,884.00 | 376,800 |
| 豊田通商 | 400 | 5,320.00 | 2,128,000 |
| 兼松 | 200 | 1,277.00 | 255,400 |
| 三井物産 | 3,100 | 2,805.00 | 8,695,500 |
| カメイ | 100 | 1,048.00 | 104,800 |
| 山善 | 200 | 1,032.00 | 206,400 |
| 住友商事 | 3,100 | 1,709.00 | 5,297,900 |

| | | | |
|-------------------|-------|----------|-----------|
| 三菱商事 | 2,100 | 3,772.00 | 7,921,200 |
| キャノンマーケティングジャパン | 100 | 2,270.00 | 227,000 |
| ユアサ商事 | 100 | 2,922.00 | 292,200 |
| 阪和興業 | 100 | 3,205.00 | 320,500 |
| 岩谷産業 | 100 | 5,830.00 | 583,000 |
| 三愛石油 | 100 | 1,338.00 | 133,800 |
| 稲畑産業 | 100 | 1,676.00 | 167,600 |
| ワキタ | 100 | 1,054.00 | 105,400 |
| 東邦ホールディングス | 100 | 1,730.00 | 173,000 |
| サンゲツ | 100 | 1,620.00 | 162,000 |
| ミツウロコグループホールディングス | 100 | 1,167.00 | 116,700 |
| 伊藤忠エネクス | 100 | 1,006.00 | 100,600 |
| サンリオ | 100 | 2,387.00 | 238,700 |
| リョーサン | 100 | 2,301.00 | 230,100 |
| 新光商事 | 100 | 893.00 | 89,300 |
| 東陽テクニカ | 100 | 1,100.00 | 110,000 |
| PALTAC | 100 | 4,550.00 | 455,000 |
| トラスコ中山 | 100 | 2,603.00 | 260,300 |
| オートバックスセブン | 100 | 1,412.00 | 141,200 |
| 加藤産業 | 100 | 3,350.00 | 335,000 |
| イエローハット | 100 | 1,640.00 | 164,000 |
| 因幡電機産業 | 100 | 2,740.00 | 274,000 |
| ミスミグループ本社 | 500 | 4,185.00 | 2,092,500 |
| スズケン | 200 | 3,365.00 | 673,000 |
| ローソン | 100 | 5,020.00 | 502,000 |
| エービーシー・マート | 100 | 4,920.00 | 492,000 |
| アスクル | 100 | 1,540.00 | 154,000 |
| アダストリア | 100 | 1,624.00 | 162,400 |
| エディオン | 100 | 1,038.00 | 103,800 |
| サーラコーポレーション | 100 | 618.00 | 61,800 |
| クオールホールディングス | 100 | 1,377.00 | 137,700 |
| ビックカメラ | 300 | 954.00 | 286,200 |
| DCMホールディングス | 300 | 1,090.00 | 327,000 |
| MonotaRO | 700 | 2,082.00 | 1,457,400 |
| J.フロント リテイリング | 500 | 1,054.00 | 527,000 |
| ドトール・日レスホールディングス | 100 | 1,587.00 | 158,700 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 200 | 4,085.00 | 817,000 |
| ZOZO | 200 | 3,340.00 | 668,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 800 | 856.00 | 684,800 |
| ウエルシアホールディングス | 200 | 3,315.00 | 663,000 |
| クリエイトSDホールディングス | 100 | 3,140.00 | 314,000 |
| ネクステージ | 100 | 2,870.00 | 287,000 |
| ジョイフル本田 | 100 | 1,513.00 | 151,300 |

| | | | |
|-----------------------------|-------|-----------|-----------|
| すかいらーくホールディングス | 300 | 1,494.00 | 448,200 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 100 | 1,035.00 | 103,500 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 1,600 | 5,019.00 | 8,030,400 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 200 | 717.00 | 143,400 |
| ツルハホールディングス | 100 | 10,680.00 | 1,068,000 |
| トリドールホールディングス | 100 | 2,374.00 | 237,400 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 200 | 4,095.00 | 819,000 |
| ノジマ | 100 | 2,368.00 | 236,800 |
| 良品計画 | 500 | 1,646.00 | 823,000 |
| コジマ | 100 | 513.00 | 51,300 |
| パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス | 800 | 1,550.00 | 1,240,000 |
| 西松屋チェーン | 100 | 1,364.00 | 136,400 |
| ゼンショーホールディングス | 200 | 2,722.00 | 544,400 |
| V Tホールディングス | 100 | 469.00 | 46,900 |
| コロワイド | 100 | 1,651.00 | 165,100 |
| ピーシーデポコーポレーション | 100 | 300.00 | 30,000 |
| スギホールディングス | 100 | 6,950.00 | 695,000 |
| スクロール | 100 | 865.00 | 86,500 |
| 千趣会 | 100 | 383.00 | 38,300 |
| ケーヨー | 100 | 848.00 | 84,800 |
| 日本瓦斯 | 200 | 1,595.00 | 319,000 |
| ロイヤルホールディングス | 100 | 1,843.00 | 184,300 |
| MrMaxHD | 100 | 616.00 | 61,600 |
| AOKIホールディングス | 100 | 613.00 | 61,300 |
| オークワ | 100 | 933.00 | 93,300 |
| コメリ | 100 | 2,573.00 | 257,300 |
| 青山商事 | 100 | 687.00 | 68,700 |
| 高島屋 | 300 | 1,088.00 | 326,400 |
| 松屋 | 100 | 824.00 | 82,400 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 200 | 811.00 | 162,200 |
| 丸井グループ | 300 | 2,222.00 | 666,600 |
| イオン | 1,800 | 2,640.00 | 4,752,000 |
| イズミ | 100 | 3,220.00 | 322,000 |
| フジ | 100 | 1,916.00 | 191,600 |
| ケーズホールディングス | 300 | 1,094.00 | 328,200 |
| アインホールディングス | 100 | 5,790.00 | 579,000 |
| ヤマダホールディングス | 1,500 | 398.00 | 597,000 |
| ニトリホールディングス | 100 | 17,285.00 | 1,728,500 |
| 吉野家ホールディングス | 100 | 2,249.00 | 224,900 |
| アークス | 100 | 2,132.00 | 213,200 |
| パローホールディングス | 100 | 2,144.00 | 214,400 |

| | | | | |
|---------------------|--------|-----------|------------|--|
| ファーストリテイリング | 100 | 59,260.00 | 5,926,000 | |
| サンドラッグ | 200 | 3,015.00 | 603,000 | |
| ベルーナ | 100 | 719.00 | 71,900 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 2,100 | 259.00 | 543,900 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 100 | 1,647.00 | 164,700 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 900 | 450.00 | 405,000 | |
| ゆうちょ銀行 | 1,200 | 1,123.00 | 1,347,600 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 2,400 | 476.00 | 1,142,400 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 300 | 810.00 | 243,000 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 100 | 2,670.00 | 267,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 500 | 736.00 | 368,000 | |
| 新生銀行 | 300 | 2,118.00 | 635,400 | |
| あおぞら銀行 | 300 | 2,708.00 | 812,400 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 26,900 | 701.40 | 18,867,660 | |
| りそなホールディングス | 3,600 | 498.00 | 1,792,800 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 800 | 4,268.00 | 3,414,400 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 2,800 | 4,255.00 | 11,914,000 | |
| 千葉銀行 | 1,400 | 743.00 | 1,040,200 | |
| 群馬銀行 | 800 | 381.00 | 304,800 | |
| 武蔵野銀行 | 100 | 1,879.00 | 187,900 | |
| 千葉興業銀行 | 100 | 289.00 | 28,900 | |
| 筑波銀行 | 200 | 196.00 | 39,200 | |
| 七十七銀行 | 100 | 1,439.00 | 143,900 | |
| 東邦銀行 | 400 | 217.00 | 86,800 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 300 | 2,250.00 | 675,000 | |
| 静岡銀行 | 1,000 | 880.00 | 880,000 | |
| スルガ銀行 | 400 | 521.00 | 208,400 | |
| 八十二銀行 | 900 | 421.00 | 378,900 | |
| 山梨中央銀行 | 100 | 962.00 | 96,200 | |
| 大垣共立銀行 | 100 | 2,012.00 | 201,200 | |
| 滋賀銀行 | 100 | 2,255.00 | 225,500 | |
| 南都銀行 | 100 | 2,036.00 | 203,600 | |
| 百五銀行 | 400 | 360.00 | 144,000 | |
| 京都銀行 | 100 | 5,620.00 | 562,000 | |
| 紀陽銀行 | 200 | 1,473.00 | 294,600 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 300 | 968.00 | 290,400 | |
| 山陰合同銀行 | 200 | 676.00 | 135,200 | |
| 中国銀行 | 400 | 957.00 | 382,800 | |
| 伊予銀行 | 600 | 610.00 | 366,000 | |
| 四国銀行 | 100 | 810.00 | 81,000 | |
| 阿波銀行 | 100 | 2,330.00 | 233,000 | |
| 琉球銀行 | 100 | 806.00 | 80,600 | |
| セブン銀行 | 1,600 | 252.00 | 403,200 | |

| | | | |
|-------------------------------|-------|----------|-----------|
| みずほフィナンシャルグループ | 4,300 | 1,587.50 | 6,826,250 |
| 山口フィナンシャルグループ | 500 | 726.00 | 363,000 |
| 北洋銀行 | 600 | 269.00 | 161,400 |
| 愛媛銀行 | 100 | 905.00 | 90,500 |
| 京葉銀行 | 200 | 501.00 | 100,200 |
| 栃木銀行 | 200 | 235.00 | 47,000 |
| 東和銀行 | 100 | 568.00 | 56,800 |
| トモニホールディングス | 200 | 339.00 | 67,800 |
| 池田泉州ホールディングス | 500 | 185.00 | 92,500 |
| F P G | 100 | 704.00 | 70,400 |
| S B Iホールディングス | 600 | 3,145.00 | 1,887,000 |
| ジャフコ グループ | 100 | 6,340.00 | 634,000 |
| 大和証券グループ本社 | 3,600 | 697.60 | 2,511,360 |
| 野村ホールディングス | 5,900 | 532.40 | 3,141,160 |
| 岡三証券グループ | 300 | 400.00 | 120,000 |
| 丸三証券 | 100 | 540.00 | 54,000 |
| 東洋証券 | 100 | 155.00 | 15,500 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 400 | 416.00 | 166,400 |
| 水戸証券 | 100 | 280.00 | 28,000 |
| いちよし証券 | 100 | 681.00 | 68,100 |
| 松井証券 | 200 | 815.00 | 163,000 |
| マネックスグループ | 400 | 654.00 | 261,600 |
| 極東証券 | 100 | 779.00 | 77,900 |
| アイザワ証券グループ | 100 | 1,060.00 | 106,000 |
| スパークス・グループ | 200 | 275.00 | 55,000 |
| かんぽ生命保険 | 500 | 2,085.00 | 1,042,500 |
| S O M P Oホールディングス | 800 | 5,353.00 | 4,282,400 |
| アニコム ホールディングス | 100 | 788.00 | 78,800 |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 1,200 | 3,898.00 | 4,677,600 |
| 第一生命ホールディングス | 2,200 | 2,671.50 | 5,877,300 |
| 東京海上ホールディングス | 1,300 | 7,010.00 | 9,113,000 |
| T & Dホールディングス | 1,300 | 1,699.00 | 2,208,700 |
| 全国保証 | 100 | 5,240.00 | 524,000 |
| クレディセゾン | 200 | 1,288.00 | 257,600 |
| みずほリース | 100 | 3,215.00 | 321,500 |
| 東京センチュリー | 100 | 5,820.00 | 582,000 |
| 日本証券金融 | 200 | 940.00 | 188,000 |
| アイフル | 600 | 375.00 | 225,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 200 | 1,332.00 | 266,400 |
| アコム | 800 | 345.00 | 276,000 |
| オリエントコーポレーション | 1,000 | 133.00 | 133,000 |
| オリックス | 2,200 | 2,465.50 | 5,424,100 |
| 三菱H C キャピタル | 1,400 | 606.00 | 848,400 |

| | | | |
|-------------------|-------|----------|-----------|
| 日本取引所グループ | 1,100 | 2,502.00 | 2,752,200 |
| イー・ギャランティ | 100 | 2,078.00 | 207,800 |
| いちご | 500 | 283.00 | 141,500 |
| 日本駐車場開発 | 300 | 137.00 | 41,100 |
| A Dワークスグループ | 100 | 144.00 | 14,400 |
| ヒューリック | 900 | 1,079.00 | 971,100 |
| 野村不動産ホールディングス | 300 | 2,661.00 | 798,300 |
| 三重交通グループホールディングス | 100 | 477.00 | 47,700 |
| サムティ | 100 | 2,111.00 | 211,100 |
| ディア・ライフ | 100 | 526.00 | 52,600 |
| プレサンスコーポレーション | 100 | 2,093.00 | 209,300 |
| フージャースホールディングス | 100 | 681.00 | 68,100 |
| オープンハウスグループ | 100 | 5,930.00 | 593,000 |
| 東急不動産ホールディングス | 1,100 | 649.00 | 713,900 |
| 飯田グループホールディングス | 300 | 2,735.00 | 820,500 |
| パーク24 | 200 | 1,551.00 | 310,200 |
| 三井不動産 | 2,300 | 2,318.50 | 5,332,550 |
| 三菱地所 | 1,000 | 1,625.50 | 1,625,500 |
| 平和不動産 | 100 | 3,900.00 | 390,000 |
| 東京建物 | 600 | 1,694.00 | 1,016,400 |
| 京阪神ビルディング | 100 | 1,512.00 | 151,200 |
| 住友不動産 | 900 | 3,397.00 | 3,057,300 |
| テーオーシー | 100 | 677.00 | 67,700 |
| レオパレス21 | 400 | 175.00 | 70,000 |
| スターツコーポレーション | 100 | 2,469.00 | 246,900 |
| 日神グループホールディングス | 100 | 498.00 | 49,800 |
| 日本エスコン | 100 | 777.00 | 77,700 |
| タカラレーベン | 200 | 295.00 | 59,000 |
| イオンモール | 100 | 1,633.00 | 163,300 |
| ランド | 2,200 | 11.00 | 24,200 |
| カチタス | 100 | 3,935.00 | 393,500 |
| トーセイ | 100 | 1,013.00 | 101,300 |
| 日本空港ビルディング | 100 | 4,760.00 | 476,000 |
| L I F U L L | 200 | 238.00 | 47,600 |
| ミクシィ | 100 | 2,048.00 | 204,800 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 600 | 2,512.00 | 1,507,200 |
| コシダカホールディングス | 100 | 624.00 | 62,400 |
| リンクアンドモチベーション | 100 | 498.00 | 49,800 |
| エス・エム・エス | 200 | 3,720.00 | 744,000 |
| パーソルホールディングス | 400 | 3,030.00 | 1,212,000 |
| クックパッド | 100 | 269.00 | 26,900 |
| 総合警備保障 | 200 | 4,325.00 | 865,000 |
| カカクコム | 300 | 2,784.00 | 835,200 |

| | | | |
|------------------------|-------|-----------|------------|
| ディップ | 100 | 3,695.00 | 369,500 |
| ベネフィット・ワン | 100 | 3,910.00 | 391,000 |
| エムスリー | 800 | 5,103.00 | 4,082,400 |
| アウトソーシング | 200 | 1,505.00 | 301,000 |
| ウェルネット | 100 | 447.00 | 44,700 |
| ディー・エヌ・エー | 200 | 1,742.00 | 348,400 |
| 博報堂D Yホールディングス | 500 | 1,918.00 | 959,000 |
| ぐるなび | 100 | 395.00 | 39,500 |
| タカミヤ | 100 | 427.00 | 42,700 |
| ファンコミュニケーションズ | 100 | 386.00 | 38,600 |
| エスプール | 100 | 1,031.00 | 103,100 |
| インフォーマート | 400 | 841.00 | 336,400 |
| J Pホールディングス | 100 | 240.00 | 24,000 |
| エコナックホールディングス | 100 | 90.00 | 9,000 |
| プレステージ・インターナショナル | 100 | 679.00 | 67,900 |
| 電通グループ | 400 | 3,995.00 | 1,598,000 |
| H . U . グループホールディングス | 100 | 2,952.00 | 295,200 |
| サニックス | 100 | 234.00 | 23,400 |
| オリエンタルランド | 500 | 18,500.00 | 9,250,000 |
| ダスキン | 100 | 2,750.00 | 275,000 |
| 明光ネットワークジャパン | 100 | 567.00 | 56,700 |
| ラウンドワン | 100 | 1,273.00 | 127,300 |
| リゾートトラスト | 200 | 1,885.00 | 377,000 |
| ピー・エム・エル | 100 | 3,665.00 | 366,500 |
| リソー教育 | 300 | 373.00 | 111,900 |
| ユー・エス・エス | 400 | 1,916.00 | 766,400 |
| サイバーエージェント | 1,000 | 1,818.00 | 1,818,000 |
| 楽天グループ | 2,300 | 1,148.00 | 2,640,400 |
| テー・オー・ダブリュー | 100 | 296.00 | 29,600 |
| エン・ジャパン | 100 | 3,010.00 | 301,000 |
| テクノプロ・ホールディングス | 300 | 3,395.00 | 1,018,500 |
| ジャパンマテリアル | 100 | 1,838.00 | 183,800 |
| ベクトル | 100 | 1,045.00 | 104,500 |
| リクルートホールディングス | 3,100 | 6,408.00 | 19,864,800 |
| エラン | 100 | 1,039.00 | 103,900 |
| 日本郵政 | 2,500 | 991.90 | 2,479,750 |
| ベルシステム24ホールディングス | 100 | 1,203.00 | 120,300 |
| ソラスト | 100 | 1,164.00 | 116,400 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 100 | 1,935.00 | 193,500 |
| カーブスホールディングス | 100 | 749.00 | 74,900 |
| リログループ | 100 | 1,991.00 | 199,100 |
| エイチ・アイ・エス | 100 | 1,873.00 | 187,300 |
| カナモト | 100 | 2,428.00 | 242,800 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|---------------|--|
| アゴーラ ホスピタリティー グループ | 100 | 22.00 | 2,200 | |
| 乃村工藝社 | 100 | 922.00 | 92,200 | |
| セコム | 400 | 7,940.00 | 3,176,000 | |
| 丹青社 | 100 | 763.00 | 76,300 | |
| 船井総研ホールディングス | 100 | 2,383.00 | 238,300 | |
| ベネッセホールディングス | 200 | 2,195.00 | 439,000 | |
| 合 計 | 427,000 | | 1,099,703,150 | |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2 ファンドの現況

SMT ETFカーボン・エフィシエント日本株

純資産額計算書

(2022年 2月28日現在)

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,044,382,663円 |
| 負債総額 | 311,566円 |
| 純資産総額(-) | 1,044,071,097円 |
| 発行済口数 | 41,931口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 24,900.0000円 |

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

<訂正前>

(1)資本金の額（2021年 3月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2021年6月 4日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（2022年 2月28日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2022年 4月11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

<訂正前>

（前略）

2021年3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 | 520 | 14,190,499 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単体型株式投資信託 | 78 | 292,510 |
| 単体型公社債投資信託 | 44 | 284,118 |
| 合計 | 642 | 14,767,128 |

<訂正後>

（前略）

2022年2月28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 | 536 | 14,909,551 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |

| | | |
|------------|-----|------------|
| 単位型株式投資信託 | 71 | 247,430 |
| 単位型公社債投資信託 | 55 | 270,791 |
| 合計 | 662 | 15,427,772 |

3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

(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内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

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

(1) 貸借対照表

（単位：百万円）

| | 前事業年度 (2020年3月31日) | 当事業年度 (2021年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 24,869 | 21,589 |
| 金銭の信託 | 5,823 | 10,857 |
| 前払費用 | 348 | 397 |
| 未収委託者報酬 | 7,284 | 8,471 |
| 未収運用受託報酬 | 5,842 | 6,151 |
| 未収収益 | 190 | 177 |
| その他 | 4,624 | 3,428 |
| 流動資産合計 | 48,983 | 51,072 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 256 | 1 301 |
| 器具備品 | 1 576 | 1 692 |
| その他 | 1 0 | 1 0 |
| 有形固定資産合計 | 832 | 993 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 3,030 | 4,104 |

| | | |
|------------|--------|--------|
| その他 | 40 | 41 |
| 無形固定資産合計 | 3,070 | 4,145 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 8,469 | 9,950 |
| 関係会社株式 | 5,636 | 5,636 |
| 繰延税金資産 | 700 | 311 |
| その他 | 35 | 39 |
| 投資その他の資産合計 | 14,842 | 15,937 |
| 固定資産合計 | 18,745 | 21,077 |
| 資産合計 | 67,729 | 72,149 |

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (2020年3月31日) | 当事業年度 (2021年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 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 |
| 固定負債 | | |
| 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 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 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 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額 | 587 | 791 |
| 金 | | |
| 繰延ヘッジ損益 | 284 | 65 |
| 評価・換算差額等合計 | 302 | 726 |
| 純資産合計 | 56,464 | 60,824 |
| 負債・純資産合計 | 67,729 | 72,149 |

(2) 損益計算書

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) |
|----------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 34,967 | 37,224 |
| 運用受託報酬 | 11,091 | 10,982 |
| その他営業収益 | 500 | 403 |
| 営業収益合計 | 46,559 | 48,611 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 15,998 | 17,936 |
| 広告宣伝費 | 331 | 203 |
| 公告費 | 0 | - |
| 調査費 | 5,018 | 5,064 |
| 調査費 | 788 | 898 |
| 委託調査費 | 4,217 | 4,154 |
| 図書費 | 11 | 11 |
| 営業雑経費 | 3,434 | 4,492 |
| 通信費 | 52 | 56 |
| 印刷費 | 470 | 449 |
| 協会費 | 53 | 58 |
| 諸会費 | 16 | 18 |
| 情報機器関連費 | 2,726 | 3,815 |
| その他営業雑経費 | 114 | 93 |
| 営業費用合計 | 24,783 | 27,696 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 5,756 | 5,976 |
| 役員報酬 | 244 | 214 |
| 給料・手当 | 4,962 | 4,861 |

| | | |
|---------|--------|--------|
| 賞与 | 549 | 901 |
| 退職給付費用 | 118 | 170 |
| 福利費 | 535 | 608 |
| 交際費 | 14 | 1 |
| 旅費交通費 | 190 | 13 |
| 租税公課 | 344 | 315 |
| 不動産賃借料 | 269 | 276 |
| 寄付金 | 7 | 3 |
| 減価償却費 | 334 | 748 |
| 業務委託費 | 864 | 966 |
| 諸経費 | 750 | 848 |
| 一般管理費合計 | 9,185 | 9,929 |
| 営業利益 | 12,589 | 10,984 |

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 15 | 2 |
| 収益分配金 | 119 | 101 |
| 金銭の信託運用益 | - | 3,038 |
| 投資有価証券売却益 | 483 | 1 |
| 投資有価証券償還益 | 316 | 54 |
| 為替差益 | 273 | - |
| デリバティブ利益 | 666 | - |
| その他 | 30 | 45 |
| 営業外収益合計 | 1,906 | 3,243 |
| 営業外費用 | | |
| 金銭の信託運用損 | 1,076 | - |
| 投資有価証券売却損 | 4 | 0 |
| 投資有価証券償還損 | 19 | 0 |
| 為替差損 | - | 158 |
| デリバティブ費用 | - | 3,782 |
| その他 | 19 | 5 |
| 営業外費用合計 | 1,118 | 3,946 |
| 経常利益 | 13,377 | 10,281 |
| 特別損失 | | |
| システム統合費用 | 149 | 110 |
| 特別損失合計 | 149 | 110 |
| 税引前当期純利益 | 13,227 | 10,170 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 4,263 | 3,242 |
| 法人税等調整額 | 193 | 65 |
| 法人税等合計 | 4,070 | 3,177 |
| 当期純利益 | 9,157 | 6,993 |

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

| | 株主資本 | | | | |
|-------------------------|-------|----------|-------------|-------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| | | | | | |
| 当期首残高 | 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 | | | | |
|-------------------------|-------|----------|-------------|-------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| | | | | | |
| 当期首残高 | 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 |
|-------------------------|-----------------|---------|------------|--------|
| | 其他有価証券 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 |
| 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 其他有価証券 | 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 其他有価証券

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的主要原因別の内訳

| | 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]

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いません。

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) |
|-------|--|--|
| 当期純利益 | 9,157百万円 | 6,993百万円 |

| | | |
|--------------|----------|----------|
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 9,157百万円 | 6,993百万円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 | 3,000株 |

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

| | | |
|------------|---|--------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | | 18,523 |
| 金銭の信託 | | 15,986 |
| 未収委託者報酬 | | 9,080 |
| 未収運用受託報酬 | | 6,066 |
| その他 | | 5,520 |
| 流動資産合計 | | 55,177 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 1,024 |
| 無形固定資産 | | 5,276 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 6,629 |
| 関係会社株式 | | 5,636 |
| 繰延税金資産 | | 208 |
| その他 | | 37 |
| 投資その他の資産合計 | | 12,511 |
| 固定資産合計 | | 18,813 |
| 資産合計 | | 73,990 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | | 8,383 |
| 未払法人税等 | | 474 |
| 賞与引当金 | | 302 |
| その他 | 2 | 1,946 |
| 流動負債合計 | | 11,106 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 781 |
| 資産除去債務 | | 153 |
| その他 | | 10 |
| 固定負債合計 | | 945 |
| 負債合計 | | 12,051 |

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部

株主資本

| | |
|--------------|--------|
| 資本金 | 2,000 |
| 資本剰余金 | |
| その他資本剰余金 | 17,239 |
| 資本剰余金合計 | 17,239 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 500 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | 2,100 |
| 繰越利益剰余金 | 39,182 |
| 利益剰余金合計 | 41,782 |
| 株主資本合計 | 61,022 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 995 |
| 繰延ヘッジ損益 | 78 |
| 評価・換算差額等合計 | 916 |
| 純資産合計 | 61,938 |
| 負債・純資産合計 | 73,990 |

中間損益計算書

(単位：百万円)

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

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

| | | | |
|--|------|----------|---------|
| | 株主資本 | | |
| | 資本金 | 資本剰余金 | |
| | | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |

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

| | 株主資本 | | | | |
|---------------------------|-------|----------|-------------|-------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| | | | | | |
| 当期首残高 | 500 | 2,100 | 38,258 | 40,858 | 60,098 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 2,797 | 2,797 | 2,797 |
| 中間純利益 | | | 3,721 | 3,721 | 3,721 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | 923 | 923 | 923 |
| 当中間期末残高 | 500 | 2,100 | 39,182 | 41,782 | 61,022 |

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

重要な会計方針

| 第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日) | |
|---|----------------------|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法 | |
| 有価証券 | |
| 子会社株式 | 移動平均法による原価法によっております。 |
| 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。）

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。

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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

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

确实であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

（会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

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

2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

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

（追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| 第36期中間会計期間末 (2021年9月30日) | |
|--|--------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 591百万円 |
| 2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 | |

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市

場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

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

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

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

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

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

（1）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

| 区 分 | 中間貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2） | | | |
|------------------|------------------------|-------|------|-------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託(*3) | 1,051 | 1,296 | - | 2,347 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | 242 | (103) | - | 138 |
| ヘッジ会計が適用されているもの | - | (79) | - | (79) |
| デリバティブ取引計 | 242 | (183) | - | 58 |

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

（2）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

デリバティブ取引

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

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

（単位：百万円）

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 |
|--------|------------|
| 投資有価証券 | 0 |

| | |
|-------|-------|
| 子会社株式 | 5,636 |
|-------|-------|

（有価証券関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

| | 貸借対照表計上額 |
|-------|----------|
| 子会社株式 | 5,636 |

2. その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

| | | | | |
|----|--------|---|-----|-----|
| 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）

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いません。 | |

（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。

5 その他

< 訂正前 >

（前略）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2021年 6月 4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。

<訂正後>

（前略）

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年 4月11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

<訂正前>

(1)受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

（中略）

(2)販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在） | 事業の内容 |
|----|-----------------------------|-------|
| | | |

（後略）

<訂正後>

(1)受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

（中略）

(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 |
|----|-----------------------------|-------|
| | | |

（後略）

3 資本関係

<訂正前>

（前略）

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

（後略）

<訂正後>

（前略）

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

（後略）

独立監査人の監査報告書

2022年2月14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SMT ETFカーボン・エフィシエント日本株の2021年6月22日から2022年1月11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、SMT ETFカーボン・エフィシエント日本株の2022年1月11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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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。

[次へ](#)

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
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 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、「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。