

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月27日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株式インデックス・オープン（SMA専用）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

日本株式インデックス・オープン（SMA専用）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2023年 3月28日から2023年 9月26日までとします。

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

**（ 8 ） 【 申込取扱場所 】**

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 10 ） 【 払込取扱場所 】**

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

**（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 12 ） 【 その他 】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

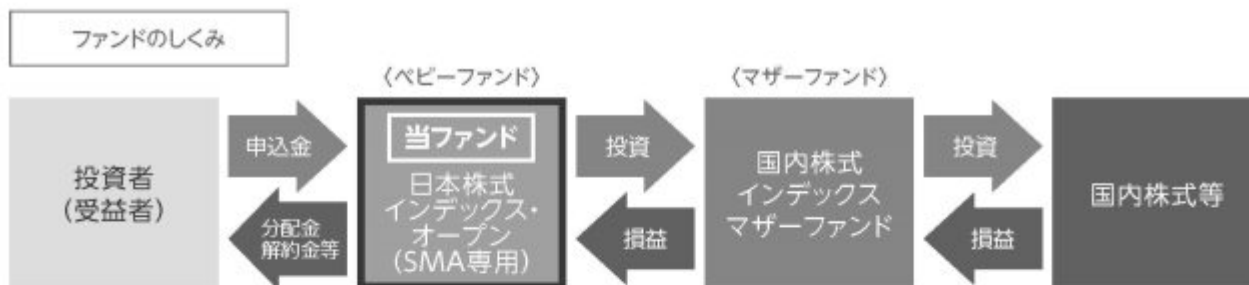
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

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



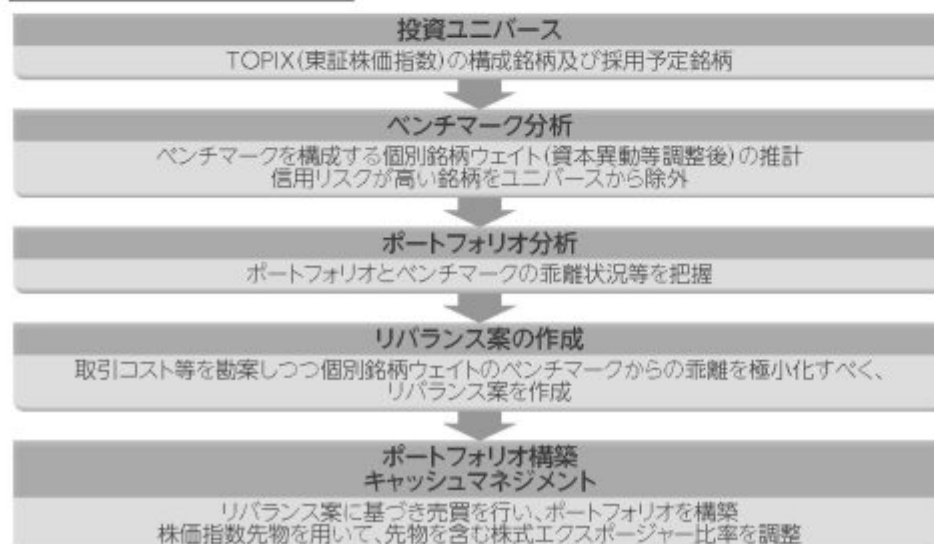
## ? ファミリーファンド方式とは

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

### ＜マザーファンドの概要＞

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

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

### ? TOPIX(東証株価指数)とは

インデックスの概要 (2023年1月末現在)		TOPIXの構成銘柄時価総額上位10銘柄		
構成国	1ヵ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,165銘柄	1	トヨタ自動車	139,236
時価総額	約380兆円	2	ソニーグループ	109,525
※上記時価総額は浮動株ベース		3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	79,655
		4	キーエンス	79,295
		5	日本電信電話	66,875
		6	三井住友フィナンシャルグループ	54,388
		7	武田薬品工業	48,537
		8	ソフトバンクグループ	47,636
		9	任天堂	47,483
		10	第一三共	47,476
		※上記時価総額は浮動株ベース		

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

※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機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。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(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標章又は商標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謬、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。

「TOPIX(東証株価指数)」の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(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標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

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

本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、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責任を有しません。

**分配方針**

- 原則として、毎年6月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

**主な投資制限**

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

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

**(2) 【ファンドの沿革】**

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

**(3) 【ファンドの仕組み】**

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2023年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### （イ）基本方針

本ファンドは、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### （ロ）運用方法

#### 投資対象

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

#### 投資態度

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

## （２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

- 1.株券または新株引受権証書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

## （参考）マザーファンドの概要

### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### （1）投資対象

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

##### （2）投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

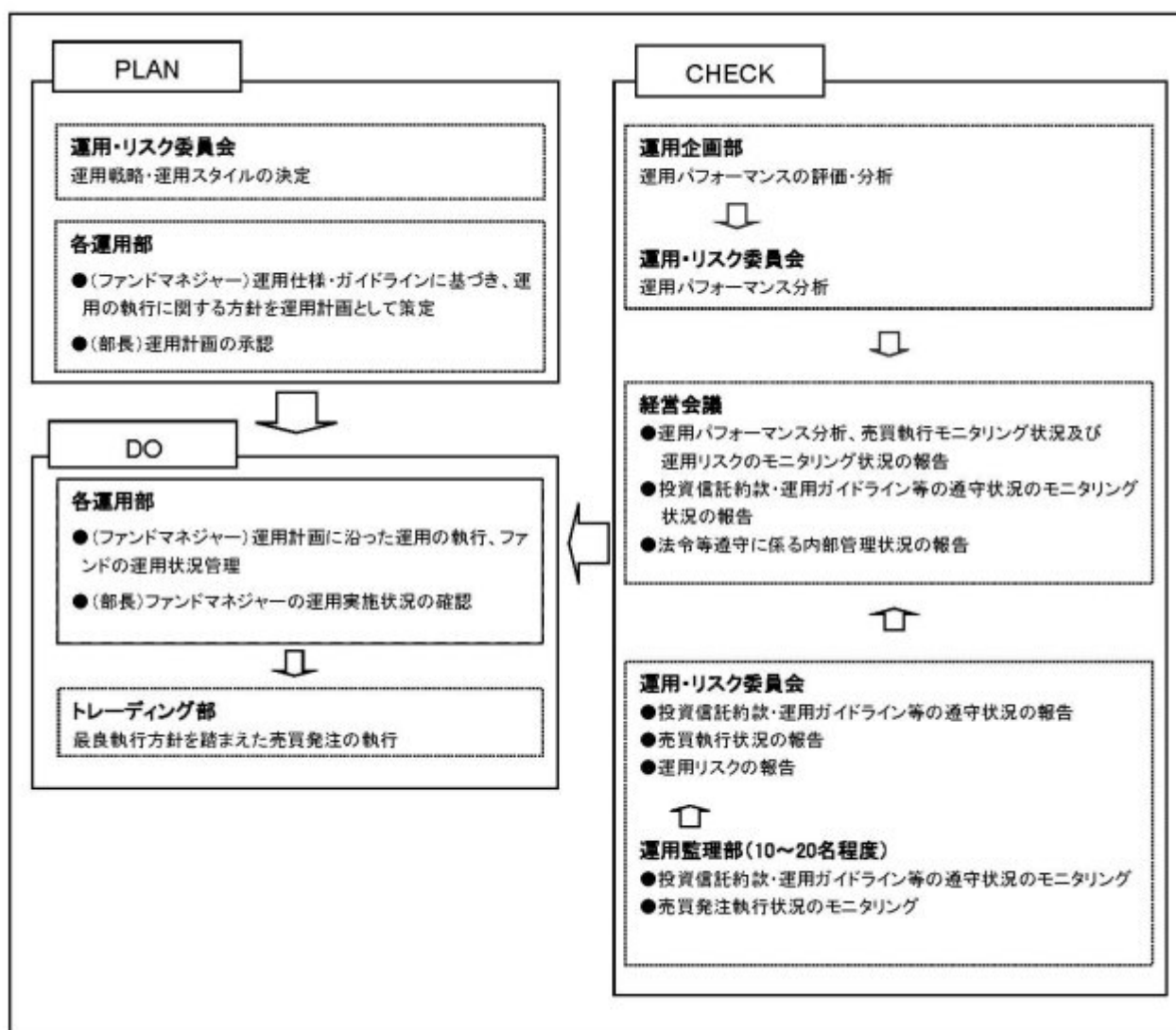


したがいが当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### （３）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### <約款に定める投資制限>

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

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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

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

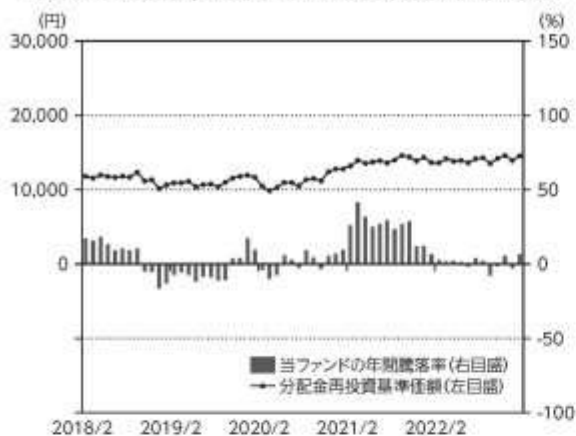
## (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

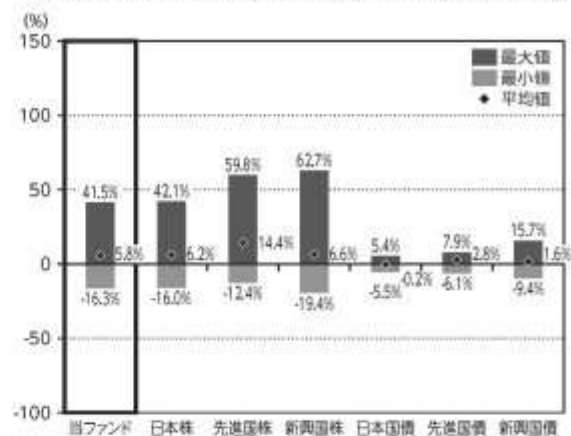
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2018年2月～2023年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

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が算出・公表する指数で、日本の株式市場を広く把握するとともに、投資対象としての代表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。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は債権は、株式会社JPX又は株式会社JPXの親会社（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債権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謬、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コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、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、本ファンドの募集、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延に基づいて発生する責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPELガンババネン・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・リーダー・インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## ( 3 ) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.407%（税抜 0.37%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.132% ( 税抜 0.12% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.198% ( 税抜 0.18% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% ( 税抜 0.07% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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

##### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### 個別元本について

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

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

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

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

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

##### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本



払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2023年1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。

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

## 5【運用状況】

以下は、2023年1月31日現在の状況について記載してあります。

### 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,611,208,389	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,310,941	0.05
合計（純資産総額）		2,612,519,330	100.00

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,319,458,509	1.8634	2,458,678,986	1.9790	2,611,208,389	99.95

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ．種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95

合計	99.95
----	-------

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第7期計算期間末 (2013年 6月25日)	324,037,180	324,037,180	6,721	6,721
第8期計算期間末 (2014年 6月25日)	421,829,003	421,829,003	7,970	7,970
第9期計算期間末 (2015年 6月25日)	462,803,071	462,803,071	10,698	10,698
第10期計算期間末 (2016年 6月27日)	399,546,072	399,546,072	7,968	7,968
第11期計算期間末 (2017年 6月26日)	473,027,168	473,027,168	10,666	10,666
第12期計算期間末 (2018年 6月25日)	600,485,748	600,485,748	11,635	11,635
第13期計算期間末 (2019年 6月25日)	1,610,423,900	1,610,423,900	10,595	10,595
第14期計算期間末 (2020年 6月25日)	1,570,256,552	1,570,256,552	10,957	10,957
第15期計算期間末 (2021年 6月25日)	2,908,068,863	2,908,068,863	14,010	14,010
第16期計算期間末 (2022年 6月27日)	3,222,783,216	3,222,783,216	13,733	13,733
2022年 1月末日	2,971,713,868		13,652	
2月末日	2,973,717,417		13,588	
3月末日	3,423,466,237		14,166	
4月末日	3,353,784,320		13,823	
5月末日	3,391,167,161		13,923	
6月末日	3,200,996,695		13,631	
7月末日	3,324,215,924		14,135	
8月末日	3,168,352,710		14,299	
9月末日	2,916,569,490		13,511	
10月末日	2,913,356,181		14,195	
11月末日	2,798,540,431		14,607	
12月末日	2,558,035,579		13,936	
2023年 1月末日	2,612,519,330		14,547	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	0
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	0
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	0
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	0
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	0
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	0
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	0
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	0
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	0
第16期計算期間	2021年 6月26日～2022年 6月27日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	47.1
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	18.6
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	34.2
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	25.5
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	33.9
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	9.1
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	8.9
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	3.4
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	27.9
第16期計算期間	2021年 6月26日～2022年 6月27日	2.0
第17期中間計算期間	2022年 6月28日～2022年12月27日	2.3

(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7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	833,004,843	8,948,125,655	482,095,593
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	240,217,610	193,049,580	529,263,623
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	267,031,202	363,702,679	432,592,146
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	168,629,406	99,774,600	501,446,952
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	105,855,663	163,810,500	443,492,115
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	205,570,147	132,941,629	516,120,633
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	1,166,396,443	162,578,396	1,519,938,680

第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	390,544,895	477,351,199	1,433,132,376
第15期計算期間	2020年 6月26日～2021年 6月25日	1,441,950,295	799,305,694	2,075,776,977
第16期計算期間	2021年 6月26日～2022年 6月27日	720,012,856	449,034,868	2,346,754,965
第17期中間計算期間	2022年 6月28日～2022年12月27日	56,097,071	567,240,001	1,835,612,035

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	510,530,134,550	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,726,258,442	0.53
合計(純資産総額)		513,256,392,992	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,607,660,000	0.51

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,869,300	2,115.60	20,879,491,080	1,896.50	18,717,127,450	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,271,400	11,930.44	15,168,361,416	11,580.00	14,722,812,000	2.87
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,239,500	738.97	8,305,653,315	952.70	10,707,871,650	2.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,800	51,535.93	9,266,160,214	59,280.00	10,658,544,000	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,309,900	3,982.16	9,198,391,384	3,892.00	8,990,130,800	1.75

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,293,600	3,999.49	5,173,740,264	5,652.00	7,311,427,200	1.42
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,595,300	3,751.86	5,985,342,258	4,090.00	6,524,777,000	1.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,300	5,370.07	5,597,223,961	6,144.00	6,403,891,200	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	1,134,800	5,831.45	6,617,529,460	5,625.00	6,383,250,000	1.24
日本	株式	第一三共	医薬品	1,570,400	3,554.69	5,582,285,176	4,064.00	6,382,105,600	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	883,000	6,772.07	5,979,737,810	6,782.00	5,988,506,000	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	303,800	18,160.11	5,517,041,418	19,075.00	5,794,985,000	1.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,800	58,695.81	7,442,628,708	45,170.00	5,727,556,000	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,000	4,675.91	6,396,644,880	4,144.00	5,668,992,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,393,000	4,529.61	6,309,746,730	4,059.00	5,654,187,000	1.10
日本	株式	HOYA	精密機器	383,900	13,936.75	5,350,318,325	14,200.00	5,451,380,000	1.06
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,500	3,194.81	4,445,578,115	3,820.00	5,315,530,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,560,100	1,539.08	3,940,198,708	2,027.50	5,190,602,750	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,000	4,482.93	5,330,203,770	4,336.00	5,155,504,000	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,171,800	3,729.45	4,370,169,510	4,183.00	4,901,639,400	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,700	20,707.13	4,487,235,071	22,470.00	4,869,249,000	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,782,500	2,476.97	4,415,199,025	2,714.00	4,837,705,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,000	3,188.82	4,658,866,020	3,207.00	4,685,427,000	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,896,000	1,492.10	4,321,121,600	1,486.50	4,304,904,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,600	19,676.23	3,848,670,588	21,580.00	4,221,048,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	176,400	21,318.02	3,760,498,728	22,905.00	4,040,442,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,100	8,205.04	4,472,567,304	7,394.00	4,030,469,400	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,400	5,413.00	3,547,680,200	6,127.00	4,015,635,800	0.78
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,087.57	3,892,557,873	65,350.00	3,849,115,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	180,900	19,366.05	3,503,318,445	18,510.00	3,348,459,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.30
		建設業	1.95
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.18
		医薬品	5.34
		石油・石炭製品	0.48

ゴム製品	0.71
ガラス・土石製品	0.71
鉄鋼	0.84
非鉄金属	0.75
金属製品	0.57
機械	5.21
電気機器	17.29
輸送用機器	7.37
精密機器	2.60
その他製品	2.30
電気・ガス業	1.23
陸運業	2.95
海運業	0.60
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.87
卸売業	5.90
小売業	4.52
銀行業	6.54
証券、商品先物取引業	0.76
保険業	2.40
その他金融業	1.13
不動産業	1.89
サービス業	5.30
小計	99.47
合計	99.47

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	132円		2,540,940,250	2,607,660,000	0.51

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

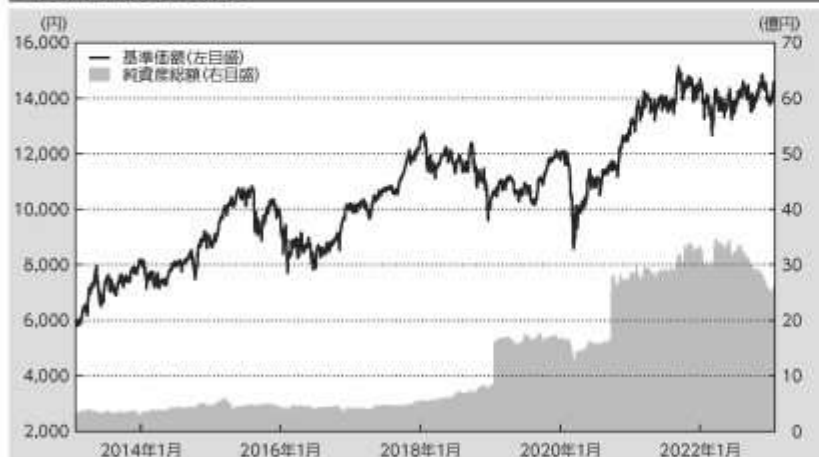
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2007年2月16日  
作成基準日：2023年1月31日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	14,547円
純資産総額	26.13億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.6%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.9%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	2.1%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.1%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.4%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.2%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.2%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**

※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限るものとし、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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



を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口単位とします。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の請求の受付を取り消すことができません。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2007年2月16日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

## <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2021年6月26日から2022年6月27日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 （2021年 6月25日現在）	第16期 （2022年 6月27日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	7,321,902	8,398,951
親投資信託受益証券	2,906,626,431	3,221,189,390
未収入金	31,151	-
流動資産合計	2,913,979,484	3,229,588,341
<b>資産合計</b>	2,913,979,484	3,229,588,341
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払受託者報酬	1,092,378	1,254,317
未払委託者報酬	4,681,570	5,375,577
未払利息	11	13
その他未払費用	136,662	175,218
流動負債合計	5,910,621	6,805,125
<b>負債合計</b>	5,910,621	6,805,125
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,075,776,977	2,346,754,965
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	832,291,886	876,028,251
（分配準備積立金）	564,146,869	526,240,014
元本等合計	2,908,068,863	3,222,783,216
<b>純資産合計</b>	2,908,068,863	3,222,783,216
<b>負債純資産合計</b>	2,913,979,484	3,229,588,341



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2020年 6月26日 至 2021年 6月25日	自	2021年 6月26日 至 2022年 6月27日
営業収益				
受取利息		17		22
有価証券売買等損益		645,842,884		41,573,015
営業収益合計		645,842,901		41,572,993
営業費用				
支払利息		1,594		2,313
受託者報酬		1,914,944		2,454,751
委託者報酬		8,206,785		10,520,246
その他費用		136,662		175,218
営業費用合計		10,259,985		13,152,528
営業利益又は営業損失（ ）		635,582,916		54,725,521
経常利益又は経常損失（ ）		635,582,916		54,725,521
当期純利益又は当期純損失（ ）		635,582,916		54,725,521
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		120,215,220		2,217,845
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		137,124,176		832,291,886
剰余金増加額又は欠損金減少額		279,052,623		281,300,940
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		279,052,623		281,300,940
剰余金減少額又は欠損金増加額		99,252,609		180,621,209
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		99,252,609		180,621,209
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		832,291,886		876,028,251

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2021年 6月26日から2022年 6月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2021年 6月25日現在)	第16期 (2022年 6月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,075,776,977口	2,346,754,965口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4010円 (14,010円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3733円 (13,733円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2020年 6月26日 至 2021年 6月25日			第16期 自 2021年 6月26日 至 2022年 6月27日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	57,466,566円	費用控除後の配当等収益額	A	63,561,236円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	426,658,343円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	1,287,504,447円	収益調整金額	C	1,630,766,104円
分配準備積立金額	D	80,021,960円	分配準備積立金額	D	462,678,778円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,851,651,316円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,157,006,118円
当ファンドの期末残存口数	F	2,075,776,977口	当ファンドの期末残存口数	F	2,346,754,965口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,920円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,191円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第16期 自 2021年 6月26日 至 2022年 6月27日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第16期 (2022年 6月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第15期	第16期
	自 2020年 6月26日 至 2021年 6月25日	自 2021年 6月26日 至 2022年 6月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,433,132,376円	2,075,776,977円
期中追加設定元本額	1,441,950,295円	720,012,856円
期中一部解約元本額	799,305,694円	449,034,868円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期 (2021年 6月25日現在)	第16期 (2022年 6月27日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	543,159,790	39,553,765
合計	543,159,790	39,553,765

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,728,476,814	3,221,189,390	
合計		1,728,476,814	3,221,189,390	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年 6月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,733,191,599
株式	484,271,312,390
派生商品評価勘定	19,487,350
未収配当金	2,024,264,819
前払金	131,157,000
差入委託証拠金	290,690,000
流動資産合計	491,470,103,158
資産合計	491,470,103,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,678,450
未払金	970,872,980
未払解約金	788,789,626
未払利息	7,726
流動負債合計	1,910,348,782
負債合計	1,910,348,782
純資産の部	
元本等	
元本	262,695,780,133
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	226,863,974,243
元本等合計	489,559,754,376
純資産合計	489,559,754,376
負債純資産合計	491,470,103,158

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 6月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年 6月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	262,695,780,133口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8636円 (1万口当たり純資産額) (18,636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

	2022年 6月27日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 6月27日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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

2022年 6月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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	2022年 6月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月26日
期首元本額	249,570,740,519円
期中追加設定元本額	36,969,404,823円
期中一部解約元本額	23,844,365,209円
期末元本額	262,695,780,133円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	401,075,067円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,001,372,094円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,488,601円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,962,061,571円
世界経済インデックスファンド	3,910,818,156円
日本株式インデックス・オープン	3,300,318,120円
D C マイセレクション 2 5	6,212,168,379円
D C マイセレクション 5 0	18,955,462,091円
D C マイセレクション 7 5	18,882,147,276円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,208,873,298円
D C マイセレクション S 2 5	3,153,104,642円
D C マイセレクション S 5 0	9,222,696,065円
D C マイセレクション S 7 5	7,063,122,817円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,399,936,918円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	195,918,245円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	704,666,315円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	515,705,434円
D C 世界経済インデックスファンド	3,611,039,799円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,728,476,814円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,430,425円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	18,158,121円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	21,158,127円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	181,339,528円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,336,253円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	29,506,079円



区分	2022年 6月27日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	111,155,929円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,062,212円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	69,590,905円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	897,830,876円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	434,611,473円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,804,406,605円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,673,141円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	18,504,420円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	478,613,064円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	274,170,318円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	348,608,051円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	35,108,426円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	586,574,305円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,179,258円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,035,970,286円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	481,085,177円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	419,084,237円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,699,700,438円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,844,477円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,239,193円
SMT インデックスバランス・オープン	58,198,880円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,429,830,657円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	558,843,487円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,488,774円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	178,981,447円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	32,271,588円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,839,104円
グローバル経済コア	218,635,322円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	27,986,760円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	111,801,107円
DCターゲット・イヤーフンド2055	23,926,568円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	696,080,004円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	204,394,944円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	14,607,615円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	12,249,508円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	5,025,590円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	5,862,728円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,771,281,184円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	919,312,864円

区分	2022年 6月27日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	307,590,042円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	51,800,409円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	144,428,377円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,636,672,686円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,425,077円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	177,263,959円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6月27日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,031,624,721	
合計	9,031,624,721	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 6月27日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,468,937,000	-	5,337,780,000	131,157,000
合計		5,468,937,000	-	5,337,780,000	131,157,000

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,800	3,410.00	30,008,000	

日本水産	252,700	560.00	141,512,000
マルハニチロ	37,300	2,557.00	95,376,100
雪国まいたけ	19,400	896.00	17,382,400
カネコ種苗	7,500	1,618.00	12,135,000
サカタのタネ	29,700	4,465.00	132,610,500
ホクト	20,900	1,932.00	40,378,800
ホクリヨウ	3,600	628.00	2,260,800
住石ホールディングス	46,400	180.00	8,352,000
日鉄鉱業	5,400	5,280.00	28,512,000
三井松島ホールディングス	11,100	3,040.00	33,744,000
I N P E X	953,400	1,496.00	1,426,286,400
石油資源開発	31,200	3,160.00	98,592,000
K & O エナジーグループ	10,900	1,514.00	16,502,600
ショーボンドホールディングス	33,300	6,010.00	200,133,000
ミライト・ホールディングス	85,400	1,619.00	138,262,600
タマホーム	16,100	2,435.00	39,203,500
サンヨーホームズ	3,100	739.00	2,290,900
日本アクア	10,500	595.00	6,247,500
ファーストコーポレーション	6,500	739.00	4,803,500
ベステラ	5,400	1,145.00	6,183,000
Robot Home	44,200	180.00	7,956,000
キャンディル	4,100	528.00	2,164,800
ダイセキ環境ソリューション	5,100	919.00	4,686,900
第一カッター興業	6,100	1,305.00	7,960,500
安藤・間	124,500	829.00	103,210,500
東急建設	73,400	625.00	45,875,000
コムシスホールディングス	85,500	2,567.00	219,478,500
ビーアールホールディングス	34,300	321.00	11,010,300
高松コンストラクショングループ	16,200	2,056.00	33,307,200
東建コーポレーション	7,400	7,410.00	54,834,000
ソネック	2,700	1,100.00	2,970,000
ヤマウラ	11,900	952.00	11,328,800
オリエンタル白石	89,200	238.00	21,229,600
大成建設	166,500	4,130.00	687,645,000
大林組	583,600	962.00	561,423,200
清水建設	542,100	731.00	396,275,100
飛島建設	16,400	1,016.00	16,662,400
長谷工コーポレーション	170,300	1,577.00	268,563,100
松井建設	21,600	665.00	14,364,000
銭高組	2,400	3,345.00	8,028,000
鹿島建設	427,600	1,494.00	638,834,400
不動テトラ	13,000	1,575.00	20,475,000

大末建設	6,400	1,540.00	9,856,000
鉄建建設	12,700	1,796.00	22,809,200
西松建設	37,100	3,980.00	147,658,000
三井住友建設	138,100	458.00	63,249,800
大豊建設	8,900	4,450.00	39,605,000
佐田建設	13,200	451.00	5,953,200
ナカノフドー建設	14,600	302.00	4,409,200
奥村組	32,100	2,989.00	95,946,900
東鉄工業	25,600	2,355.00	60,288,000
イチケン	4,400	1,832.00	8,060,800
富士ピー・エス	7,900	465.00	3,673,500
浅沼組	6,900	5,310.00	36,639,000
戸田建設	241,400	709.00	171,152,600
熊谷組	30,300	2,721.00	82,446,300
北野建設	3,700	2,125.00	7,862,500
植木組	5,100	1,396.00	7,119,600
矢作建設工業	25,300	769.00	19,455,700
ピーエス三菱	20,200	606.00	12,241,200
日本ハウスホールディングス	41,400	393.00	16,270,200
大東建託	62,700	11,450.00	717,915,000
新日本建設	26,100	706.00	18,426,600
東亜道路工業	3,200	5,610.00	17,952,000
日本道路	5,300	6,200.00	32,860,000
東亜建設工業	14,100	2,465.00	34,756,500
日本国土開発	51,700	513.00	26,522,100
若築建設	9,700	2,136.00	20,719,200
東洋建設	68,700	853.00	58,601,100
五洋建設	231,300	682.00	157,746,600
世紀東急工業	29,400	806.00	23,696,400
福田組	6,500	4,605.00	29,932,500
住友林業	141,800	1,994.00	282,749,200
日本基礎技術	15,600	587.00	9,157,200
巴コーポレーション	23,900	436.00	10,420,400
大和ハウス工業	512,000	3,122.00	1,598,464,000
ライト工業	34,800	1,828.00	63,614,400
積水ハウス	609,200	2,341.00	1,426,137,200
日特建設	12,700	795.00	10,096,500
北陸電気工事	11,500	753.00	8,659,500
ユアテック	35,000	705.00	24,675,000
日本リーテック	12,000	985.00	11,820,000
四電工	6,200	1,711.00	10,608,200
中電工	25,900	2,106.00	54,545,400

関電工	99,600	824.00	82,070,400
きんでん	128,600	1,529.00	196,629,400
東京エネシス	18,800	953.00	17,916,400
トーエネック	6,200	3,395.00	21,049,000
住友電設	15,100	2,538.00	38,323,800
日本電設工業	28,600	1,644.00	47,018,400
エクシオグループ	87,400	2,127.00	185,899,800
新日本空調	14,200	1,802.00	25,588,400
九電工	41,600	2,719.00	113,110,400
三機工業	39,800	1,490.00	59,302,000
日揮ホールディングス	178,300	1,762.00	314,164,600
中外炉工業	5,800	1,659.00	9,622,200
ヤマト	15,800	790.00	12,482,000
太平電業	11,900	2,870.00	34,153,000
高砂熱学工業	49,700	1,588.00	78,923,600
三晃金属工業	2,400	2,634.00	6,321,600
朝日工業社	7,700	1,666.00	12,828,200
明星工業	33,100	700.00	23,170,000
大気社	27,000	3,180.00	85,860,000
ダイダン	12,200	2,070.00	25,254,000
日比谷総合設備	17,700	1,901.00	33,647,700
フィル・カンパニー	3,300	1,220.00	4,026,000
テスホールディングス	17,000	1,213.00	20,621,000
インフロニア・ホールディングス	237,700	933.00	221,774,100
東洋エンジニアリング	25,700	642.00	16,499,400
レイズネクスト	27,400	1,131.00	30,989,400
ニッポン	51,000	1,609.00	82,059,000
日清製粉グループ本社	197,000	1,576.00	310,472,000
日東富士製粉	2,800	4,570.00	12,796,000
昭和産業	16,500	2,512.00	41,448,000
鳥越製粉	15,300	650.00	9,945,000
中部飼料	20,900	1,046.00	21,861,400
フィード・ワン	24,100	678.00	16,339,800
東洋精糖	3,300	952.00	3,141,600
日本甜菜製糖	10,200	1,662.00	16,952,400
D M三井製糖ホールディングス	16,500	1,893.00	31,234,500
塩水港精糖	23,400	209.00	4,890,600
日新製糖	9,300	1,749.00	16,265,700
森永製菓	41,600	4,175.00	173,680,000
中村屋	4,200	3,140.00	13,188,000
江崎グリコ	48,500	3,780.00	183,330,000
名糖産業	7,600	1,645.00	12,502,000

井村屋グループ	10,100	2,310.00	23,331,000
不道家	10,900	2,347.00	25,582,300
山崎製パン	129,200	1,658.00	214,213,600
第一屋製パン	3,800	499.00	1,896,200
モロゾフ	5,900	3,635.00	21,446,500
亀田製菓	10,500	4,680.00	49,140,000
寿スピリッツ	17,600	7,250.00	127,600,000
カルビー	89,400	2,685.00	240,039,000
森永乳業	34,300	4,745.00	162,753,500
六甲バター	13,400	1,405.00	18,827,000
ヤクルト本社	131,400	7,680.00	1,009,152,000
明治ホールディングス	114,000	6,590.00	751,260,000
雪印メグミルク	44,400	1,801.00	79,964,400
プリマハム	24,500	2,196.00	53,802,000
日本ハム	70,800	4,180.00	295,944,000
林兼産業	5,900	489.00	2,885,100
丸大食品	18,200	1,541.00	28,046,200
S Foods	17,600	3,145.00	55,352,000
柿安本店	6,800	2,368.00	16,102,400
伊藤ハム米久ホールディングス	126,300	682.00	86,136,600
サッポロホールディングス	60,500	2,962.00	179,201,000
アサヒグループホールディングス	420,400	4,493.00	1,888,857,200
キリンホールディングス	720,800	2,172.00	1,565,577,600
宝ホールディングス	117,100	1,011.00	118,388,100
オエノンホールディングス	53,000	302.00	16,006,000
養命酒製造	5,500	1,757.00	9,663,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,300	1,570.00	203,001,000
サントリー食品インターナショナル	131,200	5,140.00	674,368,000
ダイドーグループホールディングス	10,100	4,980.00	50,298,000
伊藤園	59,500	5,590.00	332,605,000
キーコーヒー	18,400	2,092.00	38,492,800
ユニカフェ	5,900	918.00	5,416,200
ジャパンフーズ	2,800	1,160.00	3,248,000
日清オイリオグループ	23,200	3,085.00	71,572,000
不二製油グループ本社	42,500	2,119.00	90,057,500
かどや製油	1,900	3,530.00	6,707,000
J - オイルミルズ	18,300	1,566.00	28,657,800
キッコーマン	125,500	7,080.00	888,540,000
味の素	401,800	3,270.00	1,313,886,000
ブルドックソース	7,400	1,900.00	14,060,000
キューピー	91,600	2,218.00	203,168,800
ハウス食品グループ本社	65,200	2,862.00	186,602,400

カゴメ	74,400	3,300.00	245,520,000
焼津水産化学工業	8,400	926.00	7,778,400
アリアケジャパン	17,900	5,570.00	99,703,000
ピエトロ	2,600	1,817.00	4,724,200
エバラ食品工業	4,300	2,993.00	12,869,900
やまみ	1,700	1,780.00	3,026,000
ニチレイ	78,600	2,289.00	179,915,400
東洋水産	89,700	5,200.00	466,440,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,342.00	17,330,800
大冷	2,200	1,880.00	4,136,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,100	510.00	5,151,000
日清食品ホールディングス	67,400	9,060.00	610,644,000
永谷園ホールディングス	8,700	1,995.00	17,356,500
一正蒲鉾	7,900	820.00	6,478,000
フジッコ	18,200	1,967.00	35,799,400
ロック・フィールド	20,000	1,441.00	28,820,000
日本たばこ産業	1,051,400	2,416.00	2,540,182,400
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,453.00	14,965,900
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,789.00	21,646,900
なとり	10,900	2,018.00	21,996,200
イフジ産業	3,400	956.00	3,250,400
ピクルスコーポレーション	9,400	1,317.00	12,379,800
ファーマフーズ	24,700	1,419.00	35,049,300
ユーグレナ	100,700	912.00	91,838,400
紀文食品	15,200	968.00	14,713,600
ミヨシ油脂	7,100	1,038.00	7,369,800
理研ビタミン	17,900	1,620.00	28,998,000
片倉工業	18,800	1,981.00	37,242,800
ゲンゼ	11,600	3,705.00	42,978,000
東洋紡	76,100	1,023.00	77,850,300
ユニチカ	54,700	235.00	12,854,500
富士紡ホールディングス	8,200	3,280.00	26,896,000
倉敷紡績	14,900	1,950.00	29,055,000
シキボウ	10,000	900.00	9,000,000
日本毛織	51,200	964.00	49,356,800
トーア紡コーポレーション	7,100	380.00	2,698,000
帝国繊維	20,800	1,629.00	33,883,200
帝人	172,500	1,415.00	244,087,500
東レ	1,254,400	741.80	930,513,920
住江織物	3,400	1,703.00	5,790,200
日本フェルト	12,000	418.00	5,016,000
イチカワ	2,700	1,428.00	3,855,600

日東製網	2,100	1,351.00	2,837,100
アツギ	14,400	497.00	7,156,800
ダイニック	6,500	648.00	4,212,000
セーレン	36,800	1,982.00	72,937,600
ソトー	7,200	826.00	5,947,200
東海染工	2,400	1,136.00	2,726,400
小松マテーレ	29,800	1,154.00	34,389,200
ワコールホールディングス	42,500	2,148.00	91,290,000
ホギメディカル	24,500	2,947.00	72,201,500
T S Iホールディングス	60,700	340.00	20,638,000
マツオカコーポレーション	5,900	933.00	5,504,700
ワールド	25,200	1,297.00	32,684,400
三陽商会	8,700	885.00	7,699,500
ナイガイ	7,200	291.00	2,095,200
オンワードホールディングス	109,400	251.00	27,459,400
ルックホールディングス	6,200	1,586.00	9,833,200
ゴールドウイン	32,700	7,610.00	248,847,000
デサント	34,300	3,110.00	106,673,000
キング	9,400	530.00	4,982,000
ヤマトインターナショナル	15,900	279.00	4,436,100
特種東海製紙	10,500	3,185.00	33,442,500
王子ホールディングス	758,900	588.00	446,233,200
日本製紙	82,300	958.00	78,843,400
三菱製紙	25,300	299.00	7,564,700
北越コーポレーション	117,900	696.00	82,058,400
中越パルプ工業	7,300	919.00	6,708,700
巴川製紙所	5,700	621.00	3,539,700
大王製紙	85,400	1,410.00	120,414,000
阿波製紙	4,500	309.00	1,390,500
レンゴー	159,000	727.00	115,593,000
トーモク	10,200	1,510.00	15,402,000
ザ・パック	12,900	2,238.00	28,870,200
北の達人コーポレーション	68,500	205.00	14,042,500
クラレ	265,500	1,129.00	299,749,500
旭化成	1,212,000	1,055.50	1,279,266,000
共和レザー	10,900	585.00	6,376,500
昭和電工	167,500	2,447.00	409,872,500
住友化学	1,339,000	535.00	716,365,000
住友精化	7,900	2,880.00	22,752,000
日産化学	92,500	6,340.00	586,450,000
ラサ工業	6,700	1,933.00	12,951,100
クレハ	14,300	10,150.00	145,145,000



多木化学	6,700	4,425.00	29,647,500
テイカ	12,000	1,208.00	14,496,000
石原産業	33,500	1,031.00	34,538,500
片倉コープアグリ	4,300	1,294.00	5,564,200
日本曹達	22,100	4,210.00	93,041,000
東ソー	249,800	1,713.00	427,907,400
トクヤマ	58,300	1,760.00	102,608,000
セントラル硝子	29,500	3,005.00	88,647,500
東亜合成	96,200	1,038.00	99,855,600
大阪ソーダ	15,700	3,170.00	49,769,000
関東電化工業	37,200	890.00	33,108,000
デンカ	66,300	3,270.00	216,801,000
信越化学工業	311,700	15,700.00	4,893,690,000
日本カーバイド工業	6,800	1,385.00	9,418,000
堺化学工業	12,700	1,882.00	23,901,400
第一稀元素化学工業	16,800	1,231.00	20,680,800
エア・ウォーター	162,600	1,699.00	276,257,400
日本酸素ホールディングス	166,400	2,251.00	374,566,400
日本化学工業	5,600	1,996.00	11,177,600
東邦アセチレン	4,000	1,135.00	4,540,000
日本パーカライジング	85,800	925.00	79,365,000
高压ガス工業	28,100	664.00	18,658,400
チタン工業	2,200	1,630.00	3,586,000
四国化成工業	22,900	1,252.00	28,670,800
戸田工業	4,100	2,370.00	9,717,000
ステラ ケミファ	9,600	2,430.00	23,328,000
保土谷化学工業	5,400	3,430.00	18,522,000
日本触媒	28,900	5,290.00	152,881,000
大日精化工業	14,300	1,748.00	24,996,400
カネカ	44,000	3,380.00	148,720,000
三菱瓦斯化学	159,800	2,015.00	321,997,000
三井化学	157,300	2,947.00	463,563,100
J S R	178,300	3,620.00	645,446,000
東京応化工業	29,300	6,890.00	201,877,000
大阪有機化学工業	14,500	2,290.00	33,205,000
三菱ケミカルホールディングス	1,218,300	751.90	916,039,770
K Hネオケム	30,000	2,532.00	75,960,000
ダイセル	263,400	848.00	223,363,200
住友ベークライト	28,100	4,310.00	121,111,000
積水化学工業	381,400	1,884.00	718,557,600
日本ゼオン	153,400	1,376.00	211,078,400
アイカ工業	47,800	2,821.00	134,843,800

U B E	90,200	2,037.00	183,737,400
積水樹脂	27,200	1,696.00	46,131,200
タキロンシーアイ	41,400	541.00	22,397,400
旭有機材	10,800	2,019.00	21,805,200
ニチバン	10,500	1,625.00	17,062,500
リケンテクノス	41,500	431.00	17,886,500
大倉工業	8,800	1,725.00	15,180,000
積水化成成品工業	23,800	419.00	9,972,200
群栄化学工業	4,000	2,630.00	10,520,000
タイガースポリマー	9,500	462.00	4,389,000
ミライアル	6,100	1,808.00	11,028,800
ダイキアクシス	7,500	732.00	5,490,000
ダイキョーニシカワ	40,300	517.00	20,835,100
竹本容器	6,800	812.00	5,521,600
森六ホールディングス	9,600	1,827.00	17,539,200
恵和	5,200	3,830.00	19,916,000
日本化薬	137,900	1,110.00	153,069,000
カーリットホールディングス	17,000	710.00	12,070,000
日本精化	13,300	1,928.00	25,642,400
扶桑化学工業	15,800	3,650.00	57,670,000
トリケミカル研究所	19,700	2,241.00	44,147,700
A D E K A	79,700	2,340.00	186,498,000
日油	58,600	5,060.00	296,516,000
新日本理化	28,700	258.00	7,404,600
ハリマ化成グループ	13,200	762.00	10,058,400
花王	413,000	5,583.00	2,305,779,000
第一工業製薬	6,700	2,207.00	14,786,900
石原ケミカル	9,200	1,284.00	11,812,800
日華化学	6,400	874.00	5,593,600
ニイタカ	3,700	2,144.00	7,932,800
三洋化成工業	11,400	4,775.00	54,435,000
有機合成薬品工業	13,300	272.00	3,617,600
大日本塗料	22,200	710.00	15,762,000
日本ペイントホールディングス	719,000	1,060.00	762,140,000
関西ペイント	176,400	1,798.00	317,167,200
神東塗料	15,000	155.00	2,325,000
中国塗料	42,600	885.00	37,701,000
日本特殊塗料	12,400	1,004.00	12,449,600
藤倉化成	23,800	473.00	11,257,400
太陽ホールディングス	28,200	2,957.00	83,387,400
D I C	73,100	2,465.00	180,191,500
サカティンクス	38,000	894.00	33,972,000

東洋インキＳＣホールディングス	38,000	1,956.00	74,328,000
T & K T O K A	15,400	805.00	12,397,000
富士フィルムホールディングス	343,400	7,299.00	2,506,476,600
資生堂	364,000	5,401.00	1,965,964,000
ライオン	207,100	1,505.00	311,685,500
高砂香料工業	11,800	2,417.00	28,520,600
マンダム	39,000	1,492.00	58,188,000
ミルボン	24,100	4,860.00	117,126,000
ファンケル	79,100	2,442.00	193,162,200
コーセー	36,800	12,170.00	447,856,000
コタ	13,600	1,477.00	20,087,200
シーボン	2,500	1,687.00	4,217,500
ポーラ・オルビスホールディングス	83,400	1,657.00	138,193,800
ノエビアホールディングス	15,200	5,680.00	86,336,000
アジュバンホールディングス	4,400	991.00	4,360,400
新日本製薬	8,000	1,481.00	11,848,000
エステー	12,600	1,491.00	18,786,600
アグロ カネショウ	6,500	1,254.00	8,151,000
コニシ	30,500	1,543.00	47,061,500
長谷川香料	33,700	2,640.00	88,968,000
星光P M C	11,000	560.00	6,160,000
小林製薬	54,700	8,430.00	461,121,000
荒川化学工業	14,600	983.00	14,351,800
メック	13,800	2,340.00	32,292,000
日本高純度化学	4,900	2,313.00	11,333,700
タカラバイオ	51,100	1,948.00	99,542,800
J C U	20,600	3,435.00	70,761,000
新田ゼラチン	11,500	624.00	7,176,000
O A T アグリオ	8,100	1,536.00	12,441,600
デクセリアルズ	50,900	3,765.00	191,638,500
アース製薬	16,100	5,280.00	85,008,000
北興化学工業	17,000	925.00	15,725,000
大成ラミック	5,400	2,645.00	14,283,000
クミアイ化学工業	72,700	1,064.00	77,352,800
日本農薬	34,800	649.00	22,585,200
アキレス	12,500	1,370.00	17,125,000
有沢製作所	27,200	1,023.00	27,825,600
日東電工	118,100	9,100.00	1,074,710,000
レック	23,900	657.00	15,702,300
三光合成	22,300	341.00	7,604,300
きもと	29,900	223.00	6,667,700
藤森工業	16,000	3,515.00	56,240,000

前澤化成工業	11,800	1,297.00	15,304,600
未来工業	7,000	1,510.00	10,570,000
ウェブロックホールディングス	7,400	628.00	4,647,200
J S P	11,400	1,397.00	15,925,800
エフピコ	35,900	2,820.00	101,238,000
天馬	15,400	2,358.00	36,313,200
信越ポリマー	35,100	1,190.00	41,769,000
東リ	45,900	206.00	9,455,400
ニフコ	65,200	3,215.00	209,618,000
バルカー	15,900	2,644.00	42,039,600
ユニ・チャーム	376,600	4,647.00	1,750,060,200
ショーエイコーポレーション	5,200	590.00	3,068,000
協和キリン	207,500	3,080.00	639,100,000
武田薬品工業	1,535,700	3,776.00	5,798,803,200
アステラス製薬	1,670,400	2,163.00	3,613,075,200
住友ファーマ	120,700	1,077.00	129,993,900
塩野義製薬	233,100	6,758.00	1,575,289,800
わかもと製薬	20,400	263.00	5,365,200
日本新薬	45,500	8,000.00	364,000,000
中外製薬	611,100	3,576.00	2,185,293,600
科研製薬	28,800	3,755.00	108,144,000
エーザイ	221,900	5,620.00	1,247,078,000
ロート製薬	95,500	3,845.00	367,197,500
小野薬品工業	397,600	3,315.00	1,318,044,000
久光製薬	44,800	3,470.00	155,456,000
持田製薬	22,700	3,230.00	73,321,000
参天製薬	348,400	1,048.00	365,123,200
扶桑薬品工業	6,500	2,148.00	13,962,000
日本ケミファ	2,200	1,909.00	4,199,800
ツムラ	57,400	2,974.00	170,707,600
日医工	57,200	351.00	20,077,200
キッセイ薬品工業	30,400	2,566.00	78,006,400
生化学工業	34,500	828.00	28,566,000
栄研化学	30,800	1,757.00	54,115,600
日水製薬	7,200	1,711.00	12,319,200
鳥居薬品	10,500	3,245.00	34,072,500
J C R ファーマ	55,100	2,326.00	128,162,600
東和薬品	28,100	2,379.00	66,849,900
富士製薬工業	11,000	954.00	10,494,000
ゼリア新薬工業	31,200	2,102.00	65,582,400
第一三共	1,456,700	3,323.00	4,840,614,100
キョーリン製薬ホールディングス	36,600	1,740.00	63,684,000

大幸薬品	29,500	586.00	17,287,000
ダイト	12,300	2,780.00	34,194,000
大塚ホールディングス	383,500	4,797.00	1,839,649,500
大正製薬ホールディングス	39,600	5,330.00	211,068,000
ペプチドリーム	102,500	1,411.00	144,627,500
あすか製薬ホールディングス	19,800	1,018.00	20,156,400
サワイグループホールディングス	39,300	4,125.00	162,112,500
日本コークス工業	165,100	117.00	19,316,700
ニチレキ	22,400	1,290.00	28,896,000
ユシロ化学工業	9,600	931.00	8,937,600
ビーピー・カストロール	7,000	1,152.00	8,064,000
富士石油	45,900	320.00	14,688,000
MORESCO	6,500	1,240.00	8,060,000
出光興産	204,800	3,210.00	657,408,000
Eneosホールディングス	2,939,200	508.20	1,493,701,440
コスモエネルギーホールディングス	70,300	3,705.00	260,461,500
横浜ゴム	99,400	1,860.00	184,884,000
TOYO TIRE	96,600	1,742.00	168,277,200
ブリヂストン	534,000	5,163.00	2,757,042,000
住友ゴム工業	164,900	1,186.00	195,571,400
藤倉コンポジット	15,600	897.00	13,993,200
オカモト	10,000	3,835.00	38,350,000
フコク	8,500	974.00	8,279,000
ニッタ	19,000	2,793.00	53,067,000
住友理工	37,900	592.00	22,436,800
三ツ星ベルト	23,700	2,793.00	66,194,100
バンドー化学	31,500	924.00	29,106,000
日東紡績	25,900	2,471.00	63,998,900
AGC	170,200	4,990.00	849,298,000
日本板硝子	90,200	397.00	35,809,400
石塚硝子	3,200	1,660.00	5,312,000
日本山村硝子	7,100	756.00	5,367,600
日本電気硝子	74,500	2,729.00	203,310,500
オハラ	7,800	1,193.00	9,305,400
住友大阪セメント	33,200	3,385.00	112,382,000
太平洋セメント	111,100	2,025.00	224,977,500
日本ヒューム	17,400	664.00	11,553,600
日本コンクリート工業	36,600	270.00	9,882,000
三谷セキサン	8,400	4,315.00	36,246,000
アジアパイルホールディングス	28,700	466.00	13,374,200
東海カーボン	154,800	1,078.00	166,874,400
日本カーボン	10,100	4,190.00	42,319,000

東洋炭素	11,900	2,878.00	34,248,200
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,080.00	41,616,000
TOTO	125,300	4,580.00	573,874,000
日本碍子	198,900	1,853.00	368,561,700
日本特殊陶業	140,400	2,498.00	350,719,200
MARUWA	6,800	15,560.00	105,808,000
品川リフラクトリーズ	4,600	3,575.00	16,445,000
黒崎播磨	3,300	4,280.00	14,124,000
ヨータイ	12,500	1,403.00	17,537,500
東京窯業	21,600	270.00	5,832,000
ニッカトー	8,600	471.00	4,050,600
フジインコーポレーテッド	15,700	5,810.00	91,217,000
クニミネ工業	6,300	921.00	5,802,300
エーアンドエーマテリアル	3,300	882.00	2,910,600
ニチアス	42,600	2,307.00	98,278,200
ニチハ	25,700	2,650.00	68,105,000
日本製鉄	826,300	1,907.00	1,575,754,100
神戸製鋼所	344,700	616.00	212,335,200
中山製鋼所	28,200	428.00	12,069,600
合同製鐵	9,800	1,357.00	13,298,600
JFEホールディングス	472,200	1,433.00	676,662,600
東京製鐵	59,600	1,536.00	91,545,600
共英製鋼	20,000	1,359.00	27,180,000
大和工業	32,900	4,525.00	148,872,500
東京鐵鋼	8,200	1,219.00	9,995,800
大阪製鐵	10,300	1,448.00	14,914,400
淀川製鋼所	22,600	2,252.00	50,895,200
丸一鋼管	57,800	2,880.00	166,464,000
モリ工業	5,100	2,469.00	12,591,900
大同特殊鋼	28,100	3,555.00	99,895,500
日本高周波鋼業	7,300	334.00	2,438,200
日本冶金工業	13,500	2,135.00	28,822,500
山陽特殊製鋼	17,700	1,967.00	34,815,900
愛知製鋼	10,900	2,090.00	22,781,000
日立金属	208,200	2,065.00	429,933,000
日本金属	4,900	1,074.00	5,262,600
大平洋金属	11,900	2,374.00	28,250,600
新日本電工	113,100	357.00	40,376,700
栗本鐵工所	8,300	1,641.00	13,620,300
虹技	2,600	1,018.00	2,646,800
三菱製鋼	12,500	948.00	11,850,000
日亜鋼業	23,300	261.00	6,081,300

日本精線	3,100	4,215.00	13,066,500
エンビプロ・ホールディングス	12,900	843.00	10,874,700
シンニッタン	23,700	222.00	5,261,400
新家工業	4,300	1,484.00	6,381,200
大紀アルミニウム工業所	25,700	1,228.00	31,559,600
日本軽金属ホールディングス	49,000	1,519.00	74,431,000
三井金属鉱業	52,200	3,235.00	168,867,000
東邦亜鉛	10,200	2,193.00	22,368,600
三菱マテリアル	117,000	1,945.00	227,565,000
住友金属鉱山	223,500	4,326.00	966,861,000
DOWAホールディングス	47,700	4,510.00	215,127,000
古河機械金属	30,300	1,211.00	36,693,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	22,400	2,390.00	53,536,000
東邦チタニウム	34,600	2,199.00	76,085,400
UACJ	27,400	2,163.00	59,266,200
CKサンエツ	3,800	3,960.00	15,048,000
古河電気工業	57,200	2,238.00	128,013,600
住友電気工業	690,400	1,518.00	1,048,027,200
フジクラ	215,500	788.00	169,814,000
昭和電線ホールディングス	16,900	1,724.00	29,135,600
東京特殊電線	2,700	2,300.00	6,210,000
タツタ電線	34,300	467.00	16,018,100
カナレ電気	2,900	1,622.00	4,703,800
平河ヒューテック	10,800	1,091.00	11,782,800
リョービ	21,200	1,057.00	22,408,400
アーレスティ	20,800	387.00	8,049,600
アサヒホールディングス	77,400	2,133.00	165,094,200
稲葉製作所	10,100	1,361.00	13,746,100
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,330.00	18,648,000
トーカロ	49,800	1,258.00	62,648,400
アルファC o	7,000	996.00	6,972,000
SUMCO	311,500	1,891.00	589,046,500
川田テクノロジーズ	3,700	3,530.00	13,061,000
RS Technologies	6,300	5,980.00	37,674,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	2,098.00	5,245,000
信和	12,000	783.00	9,396,000
東洋製罐グループホールディングス	106,700	1,410.00	150,447,000
ホッカンホールディングス	9,500	1,239.00	11,770,500
コロナ	9,800	834.00	8,173,200
横河ブリッジホールディングス	29,500	1,938.00	57,171,000
駒井ハルテック	3,200	1,676.00	5,363,200
高田機工	1,700	2,468.00	4,195,600

三和ホールディングス	182,200	1,304.00	237,588,800
文化シャッター	58,400	992.00	57,932,800
三協立山	23,600	553.00	13,050,800
アルインコ	13,200	858.00	11,325,600
東洋シャッター	4,300	604.00	2,597,200
L I X I L	304,100	2,567.00	780,624,700
日本フィルコン	12,600	498.00	6,274,800
ノーリツ	32,900	1,458.00	47,968,200
長府製作所	19,600	1,767.00	34,633,200
リンナイ	34,400	9,320.00	320,608,000
ダイニチ工業	9,200	644.00	5,924,800
日東精工	22,600	492.00	11,119,200
三洋工業	2,300	1,628.00	3,744,400
岡部	31,900	617.00	19,682,300
ジーテクト	22,200	1,289.00	28,615,800
東プレ	31,700	1,011.00	32,048,700
高周波熱錬	30,600	654.00	20,012,400
東京製網	11,800	936.00	11,044,800
サンコール	16,500	618.00	10,197,000
モリテック スチール	15,100	287.00	4,333,700
パイオラックス	26,200	1,989.00	52,111,800
エイチワン	17,800	605.00	10,769,000
日本発條	167,800	917.00	153,872,600
中央発條	9,300	708.00	6,584,400
アドバネクス	2,500	1,220.00	3,050,000
立川ブラインド工業	7,900	1,083.00	8,555,700
三益半導体工業	15,100	2,167.00	32,721,700
日本ドライケミカル	4,600	1,509.00	6,941,400
日本製鋼所	52,700	2,981.00	157,098,700
三浦工業	78,700	2,808.00	220,989,600
タクマ	59,000	1,323.00	78,057,000
ツガミ	40,700	1,137.00	46,275,900
オークマ	19,900	5,210.00	103,679,000
芝浦機械	21,900	2,700.00	59,130,000
アマダ	305,300	1,016.00	310,184,800
アイダエンジニアリング	45,300	923.00	41,811,900
滝澤鉄工所	5,700	1,148.00	6,543,600
F U J I	81,200	2,044.00	165,972,800
牧野フライス製作所	20,200	4,275.00	86,355,000
オーエスジー	86,400	1,648.00	142,387,200
ダイジェット工業	2,400	929.00	2,229,600
旭ダイヤモンド工業	48,900	635.00	31,051,500



D M G 森精機	109,700	1,824.00	200,092,800
ソディック	42,200	808.00	34,097,600
ディスコ	28,500	32,950.00	939,075,000
日東工器	9,800	1,490.00	14,602,000
日進工具	15,300	1,230.00	18,819,000
パンチ工業	16,500	463.00	7,639,500
富士ダイス	9,900	650.00	6,435,000
豊和工業	10,200	895.00	9,129,000
O K K	7,200	1,125.00	8,100,000
東洋機械金属	12,800	567.00	7,257,600
津田駒工業	3,400	547.00	1,859,800
エンシュウ	4,600	932.00	4,287,200
島精機製作所	28,400	2,069.00	58,759,600
オプトラン	24,300	1,880.00	45,684,000
N C ホールディングス	5,000	1,970.00	9,850,000
イワキポンプ	12,400	937.00	11,618,800
フリュー	17,300	1,097.00	18,978,100
ヤマシンフィルタ	33,600	314.00	10,550,400
日阪製作所	21,300	837.00	17,828,100
やまびこ	34,000	1,173.00	39,882,000
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,685.00	23,584,000
平田機工	8,700	4,330.00	37,671,000
ペガサスミシン製造	19,800	596.00	11,800,800
マルマエ	8,000	1,960.00	15,680,000
タツモ	10,000	1,273.00	12,730,000
ナプテスコ	105,400	3,420.00	360,468,000
三井海洋開発	20,600	1,119.00	23,051,400
レオン自動機	20,800	1,204.00	25,043,200
S M C	57,200	62,570.00	3,579,004,000
ホソカワミクロン	12,900	2,624.00	33,849,600
ユニオンツール	7,200	3,360.00	24,192,000
オイレス工業	25,700	1,543.00	39,655,100
日精エー・エス・ビー機械	7,200	3,575.00	25,740,000
サトーホールディングス	25,500	1,907.00	48,628,500
技研製作所	17,100	3,095.00	52,924,500
日本エアーテック	9,000	1,019.00	9,171,000
カワタ	5,900	1,020.00	6,018,000
日精樹脂工業	12,900	888.00	11,455,200
オカダアイヨン	6,200	1,465.00	9,083,000
ワイエイシイホールディングス	7,700	1,653.00	12,728,100
小松製作所	885,600	2,973.00	2,632,888,800
住友重機械工業	107,000	3,045.00	325,815,000

日立建機	78,400	2,963.00	232,299,200
日工	25,600	617.00	15,795,200
巴工業	7,300	2,326.00	16,979,800
井関農機	16,500	1,180.00	19,470,000
TOWA	16,800	1,803.00	30,290,400
丸山製作所	3,600	1,536.00	5,529,600
北川鉄工所	8,200	1,444.00	11,840,800
ローツェ	9,600	9,190.00	88,224,000
タカキタ	6,500	505.00	3,282,500
クボタ	946,600	2,090.00	1,978,394,000
荏原実業	9,100	2,242.00	20,402,200
三菱化工機	6,100	2,015.00	12,291,500
月島機械	32,600	879.00	28,655,400
帝国電機製作所	12,900	1,578.00	20,356,200
新東工業	39,100	683.00	26,705,300
澁谷工業	16,100	2,299.00	37,013,900
アイチ コーポレーション	28,200	852.00	24,026,400
小森コーポレーション	47,500	860.00	40,850,000
鶴見製作所	14,300	1,857.00	26,555,100
住友精密工業	2,900	2,763.00	8,012,700
日本ギア工業	7,300	272.00	1,985,600
酒井重工業	3,400	2,869.00	9,754,600
荏原製作所	78,200	5,320.00	416,024,000
石井鐵工所	2,600	2,894.00	7,524,400
西島製作所	16,700	1,279.00	21,359,300
北越工業	17,200	895.00	15,394,000
ダイキン工業	225,200	21,850.00	4,920,620,000
オルガノ	5,700	8,600.00	49,020,000
トーヨーカネツ	7,100	2,644.00	18,772,400
栗田工業	101,100	4,915.00	496,906,500
椿本チエイン	25,600	3,090.00	79,104,000
大同工業	8,500	836.00	7,106,000
木村化工機	15,900	703.00	11,177,700
アネスト岩田	30,500	892.00	27,206,000
ダイフク	97,300	7,840.00	762,832,000
サムコ	5,200	2,696.00	14,019,200
加藤製作所	9,600	809.00	7,766,400
油研工業	3,300	1,760.00	5,808,000
タダノ	97,200	893.00	86,799,600
フジテック	63,400	2,895.00	183,543,000
C K D	52,300	1,819.00	95,133,700
キトー	15,800	2,589.00	40,906,200

平和	54,500	2,010.00	109,545,000
理想科学工業	15,800	2,270.00	35,866,000
SANKYO	42,200	4,125.00	174,075,000
日本金銭機械	20,000	659.00	13,180,000
マースグループホールディングス	12,500	1,642.00	20,525,000
フクシマガリレイ	12,500	3,300.00	41,250,000
オーイズミ	7,100	417.00	2,960,700
ダイコク電機	9,100	1,246.00	11,338,600
竹内製作所	29,800	2,306.00	68,718,800
アマノ	51,200	2,347.00	120,166,400
JUKI	27,200	713.00	19,393,600
ジャノメ	16,700	716.00	11,957,200
マックス	24,100	1,641.00	39,548,100
グローリー	47,700	2,063.00	98,405,100
新晃工業	18,200	1,631.00	29,684,200
大和冷機工業	28,300	1,100.00	31,130,000
セガサミーホールディングス	193,800	2,125.00	411,825,000
日本ピストンリング	7,200	1,289.00	9,280,800
リケン	7,600	2,378.00	18,072,800
TPR	23,500	1,236.00	29,046,000
ツバキ・ナカシマ	43,000	972.00	41,796,000
ホシザキ	57,100	8,200.00	468,220,000
大豊工業	16,100	694.00	11,173,400
日本精工	345,700	755.00	261,003,500
NTN	376,900	265.00	99,878,500
ジェイテクト	173,700	1,046.00	181,690,200
不二越	14,600	3,555.00	51,903,000
日本トムソン	47,800	524.00	25,047,200
THK	110,300	2,639.00	291,081,700
ユーシン精機	15,300	693.00	10,602,900
前澤給装工業	13,400	908.00	12,167,200
イーグル工業	22,300	989.00	22,054,700
前澤工業	12,300	622.00	7,650,600
日本ピラー工業	17,800	2,808.00	49,982,400
キッツ	58,700	661.00	38,800,700
マキタ	226,500	3,454.00	782,331,000
三井E&Sホールディングス	70,800	346.00	24,496,800
日立造船	158,700	845.00	134,101,500
三菱重工業	293,400	4,769.00	1,399,224,600
IHI	122,100	3,700.00	451,770,000
スター精密	27,300	1,686.00	46,027,800
日清紡ホールディングス	112,800	1,078.00	121,598,400

イビデン	97,300	4,005.00	389,686,500
コニカミノルタ	410,300	460.00	188,738,000
ブラザー工業	228,700	2,403.00	549,566,100
ミネベアミツミ	320,300	2,408.00	771,282,400
日立製作所	939,700	6,597.00	6,199,200,900
東芝	341,500	5,707.00	1,948,940,500
三菱電機	1,867,000	1,474.50	2,752,891,500
富士電機	111,700	5,740.00	641,158,000
東洋電機製造	6,700	908.00	6,083,600
安川電機	199,500	4,510.00	899,745,000
シンフォニアテクノロジー	21,100	1,378.00	29,075,800
明電舎	29,500	1,987.00	58,616,500
オリジン	4,600	1,227.00	5,644,200
山洋電気	7,900	5,330.00	42,107,000
デンヨー	14,800	1,581.00	23,398,800
PHCホールディングス	31,500	1,281.00	40,351,500
東芝テック	21,000	4,340.00	91,140,000
芝浦メカトロニクス	3,600	9,960.00	35,856,000
マブチモーター	45,200	3,605.00	162,946,000
日本電産	458,400	8,640.00	3,960,576,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,300	460.00	5,198,000
トレックス・セミコンダクター	9,600	2,659.00	25,526,400
東光高岳	11,900	1,705.00	20,289,500
ダイヘン	19,200	4,145.00	79,584,000
ヤーマン	33,000	1,667.00	55,011,000
JVCケンウッド	168,800	178.00	30,046,400
ミマキエンジニアリング	20,800	527.00	10,961,600
I-PEX	10,400	1,317.00	13,696,800
日新電機	45,800	1,565.00	71,677,000
大崎電気工業	33,900	501.00	16,983,900
オムロン	162,600	7,105.00	1,155,273,000
日東工業	24,500	2,328.00	57,036,000
I D E C	24,200	2,826.00	68,389,200
正興電機製作所	7,200	1,080.00	7,776,000
不二電機工業	5,200	1,122.00	5,834,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	61,100	2,168.00	132,464,800
サクサホールディングス	4,500	1,330.00	5,985,000
メルコホールディングス	5,600	3,430.00	19,208,000
テクノメディカ	5,500	1,544.00	8,492,000
日本電気	237,200	5,250.00	1,245,300,000
富士通	175,800	17,125.00	3,010,575,000
沖電気工業	75,800	752.00	57,001,600

岩崎通信機	7,900	801.00	6,327,900
電気興業	9,700	2,398.00	23,260,600
サンケン電気	17,300	4,820.00	83,386,000
ナカヨ	3,300	1,076.00	3,550,800
アイホン	9,600	1,723.00	16,540,800
ルネサスエレクトロニクス	1,063,200	1,325.00	1,408,740,000
セイコーエプソン	226,300	2,012.00	455,315,600
ワコム	153,700	854.00	131,259,800
アルバック	38,900	4,930.00	191,777,000
アクセル	9,900	798.00	7,900,200
E I Z O	14,200	3,790.00	53,818,000
日本信号	44,200	932.00	41,194,400
京三製作所	39,400	431.00	16,981,400
能美防災	24,400	1,751.00	42,724,400
ホーチキ	14,200	1,253.00	17,792,600
星和電機	11,700	505.00	5,908,500
エレコム	45,900	1,546.00	70,961,400
パナソニック ホールディングス	2,083,900	1,117.00	2,327,716,300
シャープ	198,000	1,062.00	210,276,000
アンリツ	125,800	1,501.00	188,825,800
富士通ゼネラル	53,000	2,632.00	139,496,000
ソニーグループ	1,224,000	11,505.00	14,082,120,000
T D K	283,400	4,360.00	1,235,624,000
帝国通信工業	9,900	1,388.00	13,741,200
タムラ製作所	72,000	576.00	41,472,000
アルプスアルパイン	165,200	1,441.00	238,053,200
池上通信機	5,700	611.00	3,482,700
日本電波工業	21,100	1,143.00	24,117,300
鈴木	11,700	807.00	9,441,900
メイコー	21,700	3,365.00	73,020,500
日本トリム	4,400	2,511.00	11,048,400
ローランド ディー . ジー .	12,000	3,310.00	39,720,000
フォスター電機	18,700	734.00	13,725,800
S M K	4,500	2,081.00	9,364,500
ヨコオ	14,300	2,177.00	31,131,100
ホシデン	45,900	1,242.00	57,007,800
ヒロセ電機	28,600	17,670.00	505,362,000
日本航空電子工業	41,100	2,089.00	85,857,900
T O A	20,900	757.00	15,821,300
マクセル	38,000	1,342.00	50,996,000
古野電気	25,000	1,016.00	25,400,000
ユニデンホールディングス	4,300	4,090.00	17,587,000

スミダコーポレーション	20,600	771.00	15,882,600
アイコム	6,600	2,470.00	16,302,000
リオン	7,700	2,451.00	18,872,700
本多通信工業	18,500	522.00	9,657,000
横河電機	184,700	2,212.00	408,556,400
新電元工業	7,100	3,505.00	24,885,500
アズビル	114,500	3,565.00	408,192,500
東亜ディーケーケー	11,600	877.00	10,173,200
日本光電工業	77,800	2,844.00	221,263,200
チノー	6,200	1,627.00	10,087,400
共和電業	18,700	318.00	5,946,600
日本電子材料	9,400	1,768.00	16,619,200
堀場製作所	34,400	6,110.00	210,184,000
アドバンテスト	145,300	7,670.00	1,114,451,000
小野測器	11,500	441.00	5,071,500
エスペック	15,900	1,760.00	27,984,000
キーエンス	177,000	47,360.00	8,382,720,000
日置電機	9,600	6,630.00	63,648,000
シスメックス	148,600	8,188.00	1,216,736,800
日本マイクロニクス	32,100	1,308.00	41,986,800
メガチップス	17,900	3,195.00	57,190,500
O B A R A G R O U P	8,600	2,975.00	25,585,000
澤藤電機	3,600	1,472.00	5,299,200
原田工業	11,100	907.00	10,067,700
コーセル	23,700	857.00	20,310,900
イリソ電子工業	16,900	3,195.00	53,995,500
オブテックスグループ	32,900	2,074.00	68,234,600
千代田インテグレ	8,500	1,963.00	16,685,500
レーザーテック	82,100	16,805.00	1,379,690,500
スタンレー電気	130,200	2,276.00	296,335,200
岩崎電気	7,100	2,602.00	18,474,200
ウシオ電機	96,000	1,691.00	162,336,000
岡谷電機産業	20,800	261.00	5,428,800
ヘリオス テクノ ホールディング	22,500	302.00	6,795,000
エノモト	6,600	1,510.00	9,966,000
日本セラミック	19,000	2,029.00	38,551,000
遠藤照明	11,200	771.00	8,635,200
古河電池	15,400	1,219.00	18,772,600
双信電機	12,600	534.00	6,728,400
山一電機	14,200	1,769.00	25,119,800
図研	13,300	2,971.00	39,514,300
日本電子	38,900	5,570.00	216,673,000

カシオ計算機	125,900	1,260.00	158,634,000
ファナック	171,500	22,180.00	3,803,870,000
日本シイエムケイ	39,700	449.00	17,825,300
エンプラス	5,400	3,210.00	17,334,000
大真空	26,700	959.00	25,605,300
ローム	83,500	10,190.00	850,865,000
浜松ホトニクス	133,800	5,540.00	741,252,000
三井ハイテック	17,800	9,150.00	162,870,000
新光電気工業	57,900	3,790.00	219,441,000
京セラ	275,100	7,378.00	2,029,687,800
太陽誘電	89,900	4,965.00	446,353,500
村田製作所	546,900	7,939.00	4,341,839,100
双葉電子工業	36,100	658.00	23,753,800
北陸電気工業	8,900	1,090.00	9,701,000
ニチコン	56,600	1,294.00	73,240,400
日本ケミコン	19,500	1,739.00	33,910,500
K O A	28,900	1,656.00	47,858,400
市光工業	27,900	368.00	10,267,200
小糸製作所	101,200	4,340.00	439,208,000
ミツバ	32,300	403.00	13,016,900
S C R E E Nホールディングス	31,800	9,930.00	315,774,000
キャノン電子	19,000	1,558.00	29,602,000
キャノン	970,900	3,199.00	3,105,909,100
リコー	490,700	1,067.00	523,576,900
象印マホービン	51,100	1,419.00	72,510,900
M U T O Hホールディングス	3,300	2,112.00	6,969,600
東京エレクトロン	124,000	47,770.00	5,923,480,000
トヨタ紡織	72,100	2,025.00	146,002,500
芦森工業	3,700	1,045.00	3,866,500
ユニプレス	31,100	842.00	26,186,200
豊田自動織機	145,000	8,320.00	1,206,400,000
モリタホールディングス	31,300	1,322.00	41,378,600
三櫻工業	27,000	668.00	18,036,000
デンソー	398,300	7,350.00	2,927,505,000
東海理化電機製作所	51,400	1,472.00	75,660,800
川崎重工業	135,800	2,588.00	351,450,400
名村造船所	53,100	428.00	22,726,800
日本車輛製造	6,500	2,046.00	13,299,000
三菱ロジスネクスト	25,900	854.00	22,118,600
近畿車輛	2,900	1,121.00	3,250,900
日産自動車	2,304,300	549.00	1,265,060,700
いすゞ自動車	581,700	1,565.00	910,360,500

トヨタ自動車	9,237,600	2,121.50	19,597,568,400
日野自動車	244,000	713.00	173,972,000
三菱自動車工業	723,200	447.00	323,270,400
エフテック	12,900	546.00	7,043,400
レシップホールディングス	7,700	535.00	4,119,500
G M B	3,500	734.00	2,569,000
ファルテック	3,400	611.00	2,077,400
武蔵精密工業	43,600	1,427.00	62,217,200
日産車体	28,600	584.00	16,702,400
新明和工業	52,400	1,060.00	55,544,000
極東開発工業	32,800	1,434.00	47,035,200
トピー工業	15,100	1,350.00	20,385,000
ティラド	5,000	2,778.00	13,890,000
曙ブレーキ工業	107,200	156.00	16,723,200
タチエス	32,800	1,085.00	35,588,000
N O K	80,500	1,127.00	90,723,500
フタバ産業	45,300	389.00	17,621,700
K Y B	18,200	3,060.00	55,692,000
大同メタル工業	37,500	525.00	19,687,500
プレス工業	89,800	408.00	36,638,400
ミクニ	23,400	364.00	8,517,600
太平洋工業	38,400	1,073.00	41,203,200
河西工業	24,000	262.00	6,288,000
アイシン	143,000	4,255.00	608,465,000
マツダ	587,700	1,115.00	655,285,500
今仙電機製作所	12,800	584.00	7,475,200
本田技研工業	1,465,200	3,304.00	4,841,020,800
スズキ	407,200	4,222.00	1,719,198,400
S U B A R U	528,800	2,445.50	1,293,180,400
安永	8,400	743.00	6,241,200
ヤマハ発動機	254,900	2,636.00	671,916,400
T B K	20,200	341.00	6,888,200
エクセディ	29,500	1,722.00	50,799,000
豊田合成	57,900	2,171.00	125,700,900
愛三工業	30,600	713.00	21,817,800
盟和産業	2,800	1,027.00	2,875,600
日本プラスト	14,500	468.00	6,786,000
ヨロズ	16,200	910.00	14,742,000
エフ・シー・シー	31,900	1,361.00	43,415,900
シマノ	74,400	23,380.00	1,739,472,000
テイ・エス テック	82,500	1,407.00	116,077,500
ジャムコ	11,400	1,146.00	13,064,400



テルモ	552,900	4,126.00	2,281,265,400
クリエートメディック	5,900	991.00	5,846,900
日機装	52,600	816.00	42,921,600
日本エム・ディ・エム	11,300	1,562.00	17,650,600
島津製作所	239,500	4,395.00	1,052,602,500
JMS	15,600	562.00	8,767,200
長野計器	13,400	1,115.00	14,941,000
ブイ・テクノロジー	8,600	2,854.00	24,544,400
東京計器	12,500	1,291.00	16,137,500
愛知時計電機	7,500	1,386.00	10,395,000
インターアクション	9,800	1,880.00	18,424,000
オーバル	17,600	297.00	5,227,200
東京精密	31,300	4,585.00	143,510,500
マニー	73,500	1,355.00	99,592,500
ニコン	283,100	1,627.00	460,603,700
トプコン	91,900	1,797.00	165,144,300
オリンパス	972,100	2,700.00	2,624,670,000
理研計器	13,900	3,670.00	51,013,000
タムロン	14,200	2,646.00	37,573,200
HOYA	377,200	12,070.00	4,552,804,000
シード	9,200	507.00	4,664,400
ノーリツ鋼機	17,600	2,371.00	41,729,600
A & Dホロンホールディングス	22,000	899.00	19,778,000
朝日インテック	214,200	2,047.00	438,467,400
シチズン時計	203,500	547.00	111,314,500
リズム	6,100	1,702.00	10,382,200
大研医器	15,500	488.00	7,564,000
メニコン	61,800	3,200.00	197,760,000
シンシア	2,200	444.00	976,800
松風	7,100	1,696.00	12,041,600
セイコーホールディングス	27,600	2,815.00	77,694,000
ニプロ	138,700	1,072.00	148,686,400
中本パックス	5,500	1,623.00	8,926,500
スノーピーク	25,400	2,690.00	68,326,000
パラマウントベッドホールディングス	37,500	2,189.00	82,087,500
トランザクション	11,900	1,120.00	13,328,000
粧美堂	5,200	413.00	2,147,600
ニホンフラッシュ	15,700	997.00	15,652,900
前田工織	18,900	2,780.00	52,542,000
永大産業	22,700	264.00	5,992,800
アートネイチャー	16,700	723.00	12,074,100
バンダイナムコホールディングス	166,100	9,602.00	1,594,892,200

アイフィスジャパン	5,000	648.00	3,240,000
共立印刷	28,700	152.00	4,362,400
S H O E I	17,500	5,280.00	92,400,000
フランスベッドホールディングス	25,100	892.00	22,389,200
パイロットコーポレーション	29,600	4,790.00	141,784,000
萩原工業	12,000	1,084.00	13,008,000
フジシールインターナショナル	42,600	1,478.00	62,962,800
タカラトミー	80,700	1,328.00	107,169,600
広済堂ホールディングス	12,100	1,145.00	13,854,500
エステールホールディングス	4,300	634.00	2,726,200
タカノ	6,700	789.00	5,286,300
プロネクサス	15,100	1,064.00	16,066,400
ホクシン	13,800	148.00	2,042,400
ウッドワン	6,000	1,148.00	6,888,000
大建工業	10,400	1,828.00	19,011,200
凸版印刷	268,700	2,283.00	613,442,100
大日本印刷	218,100	2,927.00	638,378,700
共同印刷	5,200	2,462.00	12,802,400
N I S S H A	36,000	1,476.00	53,136,000
光村印刷	1,600	1,239.00	1,982,400
T A K A R A & C O M P A N Y	11,400	1,834.00	20,907,600
アシックス	157,400	2,450.00	385,630,000
ツツミ	4,900	1,920.00	9,408,000
ローランド	13,600	4,195.00	57,052,000
小松ウオール工業	6,000	1,873.00	11,238,000
ヤマハ	113,600	5,520.00	627,072,000
河合楽器製作所	5,100	2,678.00	13,657,800
クリナップ	18,200	565.00	10,283,000
ビジョン	118,100	1,843.00	217,658,300
兼松サステック	1,300	1,676.00	2,178,800
キングジム	15,300	888.00	13,586,400
リンテック	38,800	2,412.00	93,585,600
イトーキ	36,000	375.00	13,500,000
任天堂	110,300	58,380.00	6,439,314,000
三菱鉛筆	28,300	1,421.00	40,214,300
タカラスタンダード	34,400	1,255.00	43,172,000
コクヨ	88,500	1,714.00	151,689,000
ナカバヤシ	16,300	499.00	8,133,700
グローブライド	15,500	2,185.00	33,867,500
オカムラ	59,000	1,166.00	68,794,000
美津濃	17,200	2,330.00	40,076,000
東京電力ホールディングス	1,462,200	513.00	750,108,600

中部電力	567,100	1,352.00	766,719,200
関西電力	702,300	1,335.00	937,570,500
中国電力	289,700	865.00	250,590,500
北陸電力	170,100	527.00	89,642,700
東北電力	437,300	717.00	313,544,100
四国電力	166,900	768.00	128,179,200
九州電力	383,500	859.00	329,426,500
北海道電力	169,800	475.00	80,655,000
沖縄電力	41,400	1,295.00	53,613,000
電源開発	151,800	2,060.00	312,708,000
エフオン	11,800	561.00	6,619,800
イーレックス	26,400	2,159.00	56,997,600
レノバ	38,300	2,479.00	94,945,700
東京瓦斯	356,700	2,679.00	955,599,300
大阪瓦斯	337,000	2,518.00	848,566,000
東邦瓦斯	80,900	3,155.00	255,239,500
北海道瓦斯	9,700	1,604.00	15,558,800
広島ガス	35,200	323.00	11,369,600
西部ガスホールディングス	19,700	1,810.00	35,657,000
静岡ガス	47,800	860.00	41,108,000
メタウォーター	20,300	1,988.00	40,356,400
SBSホールディングス	14,500	2,764.00	40,078,000
東武鉄道	182,400	3,005.00	548,112,000
相鉄ホールディングス	59,500	2,296.00	136,612,000
東急	467,500	1,557.00	727,897,500
京浜急行電鉄	228,600	1,438.00	328,726,800
小田急電鉄	260,800	1,769.00	461,355,200
京王電鉄	91,000	4,575.00	416,325,000
京成電鉄	122,000	3,575.00	436,150,000
富士急行	21,100	4,170.00	87,987,000
新京成電鉄	4,500	2,927.00	13,171,500
東日本旅客鉄道	313,300	6,787.00	2,126,367,100
西日本旅客鉄道	217,100	4,948.00	1,074,210,800
東海旅客鉄道	145,800	15,540.00	2,265,732,000
西武ホールディングス	242,000	1,373.00	332,266,000
鴻池運輸	28,800	1,275.00	36,720,000
西日本鉄道	49,300	2,812.00	138,631,600
ハマキョウレックス	13,100	2,813.00	36,850,300
サカイ引越センター	9,000	4,410.00	39,690,000
近鉄グループホールディングス	177,300	4,105.00	727,816,500
阪急阪神ホールディングス	221,100	3,625.00	801,487,500
南海電気鉄道	79,100	2,612.00	206,609,200

京阪ホールディングス	75,500	3,220.00	243,110,000
神戸電鉄	4,400	3,245.00	14,278,000
名古屋鉄道	186,900	2,067.00	386,322,300
山陽電気鉄道	13,500	2,166.00	29,241,000
アルプス物流	12,900	1,126.00	14,525,400
ヤマトホールディングス	259,300	2,209.00	572,793,700
山九	46,200	3,870.00	178,794,000
丸運	9,400	239.00	2,246,600
丸全昭和運輸	13,300	2,892.00	38,463,600
センコーグループホールディングス	88,900	897.00	79,743,300
トナミホールディングス	3,800	3,485.00	13,243,000
ニッコンホールディングス	59,300	2,140.00	126,902,000
日本石油輸送	2,000	2,491.00	4,982,000
福山通運	25,900	3,125.00	80,937,500
セイノーホールディングス	109,200	1,106.00	120,775,200
エスライン	5,200	837.00	4,352,400
神奈川中央交通	4,600	3,435.00	15,801,000
日立物流	35,700	8,650.00	308,805,000
丸和運輸機関	33,900	1,389.00	47,087,100
C & F ロジホールディングス	16,600	1,059.00	17,579,400
九州旅客鉄道	130,400	2,730.00	355,992,000
S Gホールディングス	323,700	2,247.00	727,353,900
NIPPON EXPRESSホールディングス	58,000	7,630.00	442,540,000
日本郵船	155,200	9,630.00	1,494,576,000
商船三井	294,200	3,185.00	937,027,000
川崎汽船	57,000	8,640.00	492,480,000
NSユニテッド海運	10,600	3,745.00	39,697,000
飯野海運	84,500	704.00	59,488,000
共栄タンカー	8,400	998.00	8,383,200
乾汽船	11,600	1,777.00	20,613,200
日本航空	406,600	2,386.00	970,147,600
ANAホールディングス	450,500	2,500.00	1,126,250,000
パスコ	3,500	1,328.00	4,648,000
ランコム	5,200	6,540.00	34,008,000
日新	13,900	1,586.00	22,045,400
三菱倉庫	51,600	3,240.00	167,184,000
三井倉庫ホールディングス	18,600	2,913.00	54,181,800
住友倉庫	57,600	2,023.00	116,524,800
澁澤倉庫	9,800	2,131.00	20,883,800
東陽倉庫	27,800	297.00	8,256,600
日本トランスシティ	35,300	493.00	17,402,900
ケイヒン	3,200	1,319.00	4,220,800

中央倉庫	10,100	982.00	9,918,200
川西倉庫	3,400	1,076.00	3,658,400
安田倉庫	13,400	947.00	12,689,800
ファイズホールディングス	3,900	745.00	2,905,500
東洋埠頭	5,300	1,326.00	7,027,800
上組	95,400	2,584.00	246,513,600
サンリツ	4,900	722.00	3,537,800
キムラユニティー	4,800	1,517.00	7,281,600
キューソー流通システム	9,200	1,120.00	10,304,000
近鉄エクスプレス	34,900	4,170.00	145,533,000
東海運	10,500	293.00	3,076,500
エーアイティー	11,600	1,459.00	16,924,400
内外トランスライン	7,100	1,920.00	13,632,000
日本コンセプト	5,900	1,424.00	8,401,600
NEC ネットズエスアイ	63,500	1,844.00	117,094,000
クロスキャット	10,200	959.00	9,781,800
システナ	274,000	414.00	113,436,000
デジタルアーツ	10,300	5,950.00	61,285,000
日鉄ソリューションズ	31,500	3,650.00	114,975,000
キューブシステム	9,900	904.00	8,949,600
WOW WORLD	2,900	1,061.00	3,076,900
コア	8,200	1,490.00	12,218,000
手間いらず	2,800	5,150.00	14,420,000
ラクーンホールディングス	16,400	1,694.00	27,781,600
ソリトンシステムズ	9,800	1,211.00	11,867,800
ソフトクリエイティブホールディングス	8,400	3,840.00	32,256,000
T I S	172,700	3,460.00	597,542,000
J N S ホールディングス	8,800	413.00	3,634,400
グリー	87,500	842.00	73,675,000
G M O ペパボ	2,100	2,016.00	4,233,600
コーエーテクモホールディングス	61,200	4,370.00	267,444,000
三菱総合研究所	9,000	4,035.00	36,315,000
電算	2,200	2,150.00	4,730,000
A G S	8,600	748.00	6,432,800
ファインデックス	16,500	648.00	10,692,000
ブレインパッド	16,500	1,022.00	16,863,000
K L a b	33,600	466.00	15,657,600
ポルトゥウィンホールディングス	28,000	932.00	26,096,000
ネクソン	435,700	2,863.00	1,247,409,100
アイスタイル	50,400	233.00	11,743,200
エムアップホールディングス	22,300	1,228.00	27,384,400
エイチーム	12,700	776.00	9,855,200

エニグモ	21,100	499.00	10,528,900
テクノスジャパン	15,300	491.00	7,512,300
コロプラ	63,400	635.00	40,259,000
ブロードリーフ	95,500	440.00	42,020,000
クロス・マーケティンググループ	7,500	793.00	5,947,500
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,721.00	15,144,800
システム情報	14,600	954.00	13,928,400
メディアドゥ	6,900	1,738.00	11,992,200
じげん	54,900	319.00	17,513,100
ブイキューブ	19,700	1,014.00	19,975,800
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	507.00	2,332,200
サイバーリンクス	6,600	1,265.00	8,349,000
フィックスターズ	19,300	947.00	18,277,100
CARTA HOLDINGS	7,900	1,911.00	15,096,900
オブティム	13,700	763.00	10,453,100
セレス	7,400	1,170.00	8,658,000
SHIFT	11,200	18,360.00	205,632,000
ティーガイア	17,100	1,622.00	27,736,200
セック	2,900	2,540.00	7,366,000
テクマトリックス	32,500	1,692.00	54,990,000
プロシップ	6,500	1,517.00	9,860,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	49,900	2,399.00	119,710,100
GMOペイメントゲートウェイ	37,200	9,490.00	353,028,000
ザッパラス	7,500	374.00	2,805,000
システムリサーチ	5,700	2,050.00	11,685,000
インターネットイニシアティブ	51,100	4,895.00	250,134,500
さくらインターネット	20,900	551.00	11,515,900
ヴィンクス	5,600	1,220.00	6,832,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	5,060.00	21,758,000
SRAホールディングス	9,300	2,768.00	25,742,400
システムインテグレータ	6,500	492.00	3,198,000
朝日ネット	17,800	572.00	10,181,600
eBASE	23,300	534.00	12,442,200
アバント	20,700	1,350.00	27,945,000
アドソル日進	7,000	1,490.00	10,430,000
ODKソリューションズ	4,300	606.00	2,605,800
フリービット	10,200	810.00	8,262,000
コムチュア	21,600	2,641.00	57,045,600
サイバーコム	3,100	1,310.00	4,061,000
アステリア	14,000	1,052.00	14,728,000
アイル	9,800	1,602.00	15,699,600
マークライنز	9,700	2,081.00	20,185,700

メディカル・データ・ビジョン	24,500	1,045.00	25,602,500
g u m i	26,900	647.00	17,404,300
ショーケース	4,600	451.00	2,074,600
モバイルファクトリー	4,500	1,173.00	5,278,500
テラスカイ	7,100	1,479.00	10,500,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,600	1,373.00	11,807,800
P C Iホールディングス	8,100	931.00	7,541,100
パイプドHD	3,600	2,784.00	10,022,400
アイビーシー	3,300	467.00	1,541,100
ネオジャパン	5,600	1,114.00	6,238,400
P R T I M E S	4,200	2,064.00	8,668,800
ラクス	88,100	1,576.00	138,845,600
ランドコンピュータ	4,600	948.00	4,360,800
ダブルスタンダード	5,900	1,919.00	11,322,100
オープンドア	11,500	1,780.00	20,470,000
マイネット	6,900	499.00	3,443,100
アカツキ	8,600	2,773.00	23,847,800
ベネフィットジャパン	1,600	1,912.00	3,059,200
U b i c o mホールディングス	5,100	2,300.00	11,730,000
カナミックネットワーク	22,800	530.00	12,084,000
ノムラシステムコーポレーション	10,700	237.00	2,535,900
チェンジ	38,500	1,958.00	75,383,000
シンクロ・フード	10,400	385.00	4,004,000
オークネット	10,300	2,064.00	21,259,200
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	688.00	2,683,200
セグエグループ	5,300	562.00	2,978,600
エイトレッド	2,800	1,970.00	5,516,000
マクロミル	38,700	940.00	36,378,000
ビーグリー	4,700	1,351.00	6,349,700
オロ	6,000	1,702.00	10,212,000
ユーザーローカル	6,000	1,601.00	9,606,000
テモナ	4,300	368.00	1,582,400
ニーズウェル	5,500	652.00	3,586,000
マネーフォワード	39,100	3,445.00	134,699,500
サインポスト	6,200	878.00	5,443,600
電算システムホールディングス	7,900	2,259.00	17,846,100
ソルクシーズ	16,800	387.00	6,501,600
フェイス	5,400	609.00	3,288,600
プロトコーポレーション	20,600	1,025.00	21,115,000
ハイマックス	5,200	1,347.00	7,004,400
野村総合研究所	345,800	3,615.00	1,250,067,000
サイバネットシステム	13,900	773.00	10,744,700

C Eホールディングス	10,000	431.00	4,310,000
日本システム技術	3,600	2,351.00	8,463,600
インテージホールディングス	22,200	1,348.00	29,925,600
東邦システムサイエンス	5,300	878.00	4,653,400
ソースネクスト	83,600	233.00	19,478,800
インフォコム	21,100	2,085.00	43,993,500
シンプレクス・ホールディングス	30,400	1,783.00	54,203,200
HEROZ	5,700	879.00	5,010,300
ラクスル	22,400	1,848.00	41,395,200
I P S	5,400	2,240.00	12,096,000
F I G	21,500	307.00	6,600,500
システムサポート	7,100	1,183.00	8,399,300
イーソル	12,100	607.00	7,344,700
アルテリア・ネットワークス	20,400	1,232.00	25,132,800
東海ソフト	3,200	934.00	2,988,800
ウイングアーク1 s t	14,700	1,544.00	22,696,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,500	1,528.00	6,876,000
サーバーワークス	3,400	2,310.00	7,854,000
東名	1,700	1,129.00	1,919,300
ヴィッツ	2,000	1,154.00	2,308,000
トピラシステムズ	4,100	919.00	3,767,900
S a n s a n	63,400	961.00	60,927,400
L i n k - U	3,700	714.00	2,641,800
ギフトィ	16,500	1,247.00	20,575,500
ベース	3,300	5,450.00	17,985,000
J M D C	24,000	6,030.00	144,720,000
フォーカスシステムズ	12,400	907.00	11,246,800
クレスコ	14,100	1,860.00	26,226,000
フジ・メディア・ホールディングス	175,400	1,126.00	197,500,400
オービック	60,400	19,530.00	1,179,612,000
ジャストシステム	27,300	3,985.00	108,790,500
T D C ソフト	15,900	1,062.00	16,885,800
Zホールディングス	2,765,200	416.80	1,152,535,360
トレンドマイクロ	96,800	6,680.00	646,624,000
I Dホールディングス	12,300	831.00	10,221,300
日本オラクル	31,100	7,820.00	243,202,000
アルファシステムズ	5,200	4,220.00	21,944,000
フューチャー	40,600	1,445.00	58,667,000
C A C H o l d i n g s	10,500	1,435.00	15,067,500
S Bテクノロジー	8,400	2,253.00	18,925,200
トーセ	5,100	764.00	3,896,400
オービックビジネスコンサルタント	18,300	4,670.00	85,461,000



伊藤忠テクノソリューションズ	87,400	3,300.00	288,420,000
アイティフォー	23,500	766.00	18,001,000
東計電算	2,300	5,470.00	12,581,000
エクスネット	3,200	994.00	3,180,800
大塚商会	103,800	4,130.00	428,694,000
サイボウズ	25,800	946.00	24,406,800
電通国際情報サービス	25,100	4,025.00	101,027,500
A C C E S S	21,900	725.00	15,877,500
デジタルガレージ	31,800	3,855.00	122,589,000
E Mシステムズ	31,800	1,008.00	32,054,400
ウェザーニューズ	6,000	6,160.00	36,960,000
C I J	15,100	771.00	11,642,100
ビジネスエンジニアリング	4,500	2,164.00	9,738,000
日本エンタープライズ	20,800	160.00	3,328,000
WOWOW	8,400	1,534.00	12,885,600
スカラ	16,400	747.00	12,250,800
インテリジェント ウェイブ	9,900	786.00	7,781,400
I M A G I C A G R O U P	14,800	736.00	10,892,800
ネットワンシステムズ	70,800	2,942.00	208,293,600
システムソフト	53,500	104.00	5,564,000
アルゴグラフィックス	15,000	3,135.00	47,025,000
マーベラス	30,500	684.00	20,862,000
エイベックス	33,200	1,312.00	43,558,400
B I P R O G Y	59,900	2,789.00	167,061,100
兼松エレクトロニクス	10,500	4,000.00	42,000,000
都築電気	9,100	1,261.00	11,475,100
T B S ホールディングス	100,800	1,676.00	168,940,800
日本テレビホールディングス	160,200	1,220.00	195,444,000
朝日放送グループホールディングス	16,800	646.00	10,852,800
テレビ朝日ホールディングス	46,200	1,477.00	68,237,400
スカパーJ S A Tホールディングス	162,800	517.00	84,167,600
テレビ東京ホールディングス	12,500	1,973.00	24,662,500
日本BS放送	6,700	1,061.00	7,108,700
ビジョン	31,700	1,261.00	39,973,700
スマートバリュー	4,800	491.00	2,356,800
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,900	1,961.00	31,179,900
ワイヤレスゲート	8,500	311.00	2,643,500
コネクシオ	13,700	1,307.00	17,905,900
クロップス	3,700	978.00	3,618,600
日本電信電話	2,101,200	3,888.00	8,169,465,600
K D D I	1,397,800	4,338.00	6,063,656,400
ソフトバンク	2,904,000	1,518.50	4,409,724,000

光通信	22,100	14,360.00	317,356,000
エムティーアイ	16,600	476.00	7,901,600
GMOインターネット	67,200	2,352.00	158,054,400
ファイバーゲート	9,000	922.00	8,298,000
アйдママーケティングコミュニケーション	4,800	304.00	1,459,200
KADOKAWA	103,800	2,965.00	307,767,000
学研ホールディングス	27,300	918.00	25,061,400
ゼンリン	31,500	931.00	29,326,500
昭文社ホールディングス	8,300	375.00	3,112,500
インプレスホールディングス	15,900	219.00	3,482,100
アイネット	9,400	1,241.00	11,665,400
松竹	11,600	12,100.00	140,360,000
東宝	113,200	4,790.00	542,228,000
東映	5,700	17,830.00	101,631,000
エヌ・ティ・ティ・データ	510,600	1,921.00	980,862,600
ピー・シー・エー	11,400	1,171.00	13,349,400
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,369.00	8,350,900
DTS	35,800	3,070.00	109,906,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,200	5,960.00	531,632,000
シーイーシー	20,700	1,124.00	23,266,800
カブコン	180,800	3,290.00	594,832,000
アイ・エス・ピー	9,200	1,010.00	9,292,000
ジャステック	11,300	1,154.00	13,040,200
SCSK	132,800	2,271.00	301,588,800
日本システムウエア	7,300	2,307.00	16,841,100
アイネス	16,200	1,615.00	26,163,000
TKC	30,300	3,260.00	98,778,000
富士ソフト	19,100	7,660.00	146,306,000
NSD	60,100	2,363.00	142,016,300
コナミホールディングス	69,700	7,700.00	536,690,000
福井コンピュータホールディングス	8,900	3,385.00	30,126,500
JBCホールディングス	13,100	1,579.00	20,684,900
ミロク情報サービス	17,100	1,146.00	19,596,600
ソフトバンクグループ	1,149,700	5,418.00	6,229,074,600
高千穂交易	7,000	1,910.00	13,370,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,200	1,787.00	5,718,400
伊藤忠食品	4,100	4,830.00	19,803,000
エレマテック	15,400	1,252.00	19,280,800
あらた	14,600	3,885.00	56,721,000
トーメンデバイス	2,900	5,610.00	16,269,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,230.00	29,811,000
フィールズ	16,800	912.00	15,321,600

双日	202,500	1,906.00	385,965,000
アルフレッサ ホールディングス	204,400	1,788.00	365,467,200
横浜冷凍	49,200	867.00	42,656,400
ラサ商事	9,000	966.00	8,694,000
アルコニックス	24,300	1,310.00	31,833,000
神戸物産	138,300	3,355.00	463,996,500
ハイパー	4,900	454.00	2,224,600
あい ホールディングス	27,500	1,574.00	43,285,000
ディーブイエックス	6,600	1,034.00	6,824,400
ダイワボウホールディングス	85,700	1,725.00	147,832,500
マクニカ・富士エレホールディングス	45,900	2,655.00	121,864,500
ラクト・ジャパン	6,600	2,093.00	13,813,800
グリムス	8,600	1,528.00	13,140,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,600	705.00	22,278,000
八洲電機	13,900	979.00	13,608,100
メディアスホールディングス	11,000	967.00	10,637,000
レスターホールディングス	18,200	1,921.00	34,962,200
ジューテックホールディングス	4,000	1,032.00	4,128,000
大光	8,200	719.00	5,895,800
OCHIホールディングス	4,800	1,225.00	5,880,000
TOKAIホールディングス	93,300	867.00	80,891,100
黒谷	5,300	587.00	3,111,100
Cominix	3,400	728.00	2,475,200
三洋貿易	18,200	966.00	17,581,200
ビューティガレージ	3,100	2,478.00	7,681,800
ウイン・パートナーズ	13,900	1,011.00	14,052,900
ミタチ産業	4,900	909.00	4,454,100
シップヘルスケアホールディングス	57,600	2,414.00	139,046,400
明治電機工業	6,000	1,083.00	6,498,000
デリカフーズホールディングス	7,500	520.00	3,900,000
スターティアホールディングス	4,400	808.00	3,555,200
コメダホールディングス	42,000	2,286.00	96,012,000
ピーバンドットコム	2,800	538.00	1,506,400
アセンテック	6,600	660.00	4,356,000
富士興産	4,800	1,071.00	5,140,800
協栄産業	2,000	1,356.00	2,712,000
フルサト・マルカホールディングス	17,500	2,543.00	44,502,500
ヤマエグループホールディングス	11,500	1,269.00	14,593,500
小野建	17,700	1,400.00	24,780,000
南陽	3,700	1,780.00	6,586,000
佐島電機	12,000	1,079.00	12,948,000
エコートレーディング	4,100	567.00	2,324,700

伯東	11,700	2,576.00	30,139,200
コンドーテック	14,400	1,026.00	14,774,400
中山福	10,200	326.00	3,325,200
ナガイレーベン	24,000	1,922.00	46,128,000
三菱食品	18,500	3,630.00	67,155,000
松田産業	14,000	2,039.00	28,546,000
第一興商	36,500	3,820.00	139,430,000
メディカルホールディングス	187,900	1,928.00	362,271,200
S P K	7,600	1,361.00	10,343,600
萩原電気ホールディングス	6,800	1,962.00	13,341,600
アズワン	27,600	5,790.00	159,804,000
スズデン	6,200	1,921.00	11,910,200
尾家産業	4,700	847.00	3,980,900
シモジマ	11,800	959.00	11,316,200
ドウシシャ	18,200	1,534.00	27,918,800
小津産業	4,200	1,875.00	7,875,000
高速	10,600	1,520.00	16,112,000
たけびし	6,800	1,479.00	10,057,200
リックス	4,100	1,882.00	7,716,200
丸文	15,900	722.00	11,479,800
ハピネット	15,100	1,578.00	23,827,800
橋本総業ホールディングス	3,600	1,949.00	7,016,400
日本ライフライン	57,000	930.00	53,010,000
タカショー	14,900	735.00	10,951,500
I D O M	58,400	755.00	44,092,000
進和	11,400	2,140.00	24,396,000
エスケイジャパン	4,700	466.00	2,190,200
ダイトロン	7,700	1,899.00	14,622,300
シークス	25,500	994.00	25,347,000
田中商事	6,000	593.00	3,558,000
オーハシテクニカ	9,800	1,308.00	12,818,400
白銅	6,200	2,354.00	14,594,800
ダイコー通産	2,300	1,122.00	2,580,600
伊藤忠商事	1,217,900	3,661.00	4,458,731,900
丸紅	1,757,700	1,231.50	2,164,607,550
高島	2,700	2,511.00	6,779,700
長瀬産業	92,900	1,834.00	170,378,600
蝶理	10,800	1,928.00	20,822,400
豊田通商	179,000	4,545.00	813,555,000
三共生興	24,700	556.00	13,733,200
兼松	68,300	1,335.00	91,180,500
ツカモトコーポレーション	3,200	1,131.00	3,619,200

三井物産	1,428,000	2,980.00	4,255,440,000
日本紙パルプ商事	9,400	3,830.00	36,002,000
カメイ	21,300	1,057.00	22,514,100
東都水産	1,000	4,640.00	4,640,000
OUGホールディングス	2,800	2,757.00	7,719,600
スターゼン	13,400	2,010.00	26,934,000
山善	73,300	984.00	72,127,200
椿本興業	3,400	3,680.00	12,512,000
住友商事	1,164,000	1,827.00	2,126,628,000
内田洋行	7,800	5,050.00	39,390,000
三菱商事	1,321,900	4,023.00	5,318,003,700
第一実業	7,900	3,310.00	26,149,000
キャノンマーケティングジャパン	47,700	2,871.00	136,946,700
西華産業	8,700	1,668.00	14,511,600
佐藤商事	14,100	1,118.00	15,763,800
菱洋エレクトロ	11,400	2,238.00	25,513,200
東京産業	16,300	704.00	11,475,200
ユアサ商事	16,400	3,340.00	54,776,000
神鋼商事	4,300	3,775.00	16,232,500
トルク	10,400	205.00	2,132,000
阪和興業	35,100	2,709.00	95,085,900
正栄食品工業	12,500	3,645.00	45,562,500
カナデン	15,700	1,003.00	15,747,100
菱電商事	15,300	1,576.00	24,112,800
岩谷産業	43,800	5,090.00	222,942,000
ナイス	6,100	1,672.00	10,199,200
ニチモウ	2,500	2,385.00	5,962,500
極東貿易	5,500	2,690.00	14,795,000
アステナホールディングス	25,600	440.00	11,264,000
三愛オブリ	44,500	978.00	43,521,000
稲畑産業	38,500	2,231.00	85,893,500
G S I クレオス	9,200	1,345.00	12,374,000
明和産業	17,800	715.00	12,727,000
クワザワホールディングス	7,200	453.00	3,261,600
ワキタ	36,900	1,185.00	43,726,500
東邦ホールディングス	55,400	2,071.00	114,733,400
サンゲツ	47,900	1,547.00	74,101,300
ミツウロコグループホールディングス	24,000	889.00	21,336,000
シナネンホールディングス	6,600	3,425.00	22,605,000
伊藤忠エネクス	42,600	1,047.00	44,602,200
サンリオ	55,800	2,621.00	146,251,800
サンワテクノス	10,400	1,313.00	13,655,200

リョーサン	20,200	2,236.00	45,167,200
新光商事	26,600	896.00	23,833,600
トーホー	7,800	1,323.00	10,319,400
三信電気	8,200	1,549.00	12,701,800
東陽テクニカ	19,000	1,109.00	21,071,000
モスフードサービス	25,300	3,080.00	77,924,000
加賀電子	16,300	3,075.00	50,122,500
ソーダニッカ	17,000	590.00	10,030,000
立花エレテック	13,300	1,525.00	20,282,500
フォーバル	7,300	860.00	6,278,000
PALTA C	27,000	4,145.00	111,915,000
三谷産業	30,100	315.00	9,481,500
西本Wismettacホールディングス	4,400	3,725.00	16,390,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,849.00	3,143,300
コア商事ホールディングス	12,100	741.00	8,966,100
国際紙パルプ商事	37,100	457.00	16,954,700
ヤマタネ	8,500	1,605.00	13,642,500
丸紅建材リース	1,700	1,902.00	3,233,400
日鉄物産	12,400	5,070.00	62,868,000
泉州電業	4,900	4,900.00	24,010,000
トラスコ中山	40,100	1,709.00	68,530,900
オートバックスセブン	61,400	1,394.00	85,591,600
モリト	14,100	760.00	10,716,000
加藤産業	23,200	3,100.00	71,920,000
北恵	4,900	880.00	4,312,000
イノテック	11,700	1,300.00	15,210,000
イエローハット	31,300	1,687.00	52,803,100
J Kホールディングス	14,200	952.00	13,518,400
日伝	14,000	1,910.00	26,740,000
北沢産業	11,300	214.00	2,418,200
杉本商事	9,000	2,095.00	18,855,000
因幡電機産業	49,100	2,630.00	129,133,000
東テク	6,000	2,991.00	17,946,000
ミスミグループ本社	241,600	2,946.00	711,753,600
アルテック	12,300	239.00	2,939,700
タキヒヨー	5,400	1,004.00	5,421,600
蔵王産業	3,700	1,868.00	6,911,600
スズケン	71,100	3,785.00	269,113,500
ジェコス	13,300	820.00	10,906,000
グローセル	21,500	404.00	8,686,000
ローソン	42,600	4,505.00	191,913,000
サンエー	13,700	4,070.00	55,759,000

カワチ薬品	15,100	2,128.00	32,132,800
エービーシー・マート	30,100	5,730.00	172,473,000
ハードオフコーポレーション	8,900	913.00	8,125,700
アスクル	43,800	1,489.00	65,218,200
ゲオホールディングス	24,300	1,216.00	29,548,800
アダストリア	20,900	2,108.00	44,057,200
くら寿司	20,200	3,145.00	63,529,000
キャンドウ	7,300	2,154.00	15,724,200
アイケイ	6,800	505.00	3,434,000
パルグループホールディングス	17,100	1,763.00	30,147,300
エディオン	88,600	1,221.00	108,180,600
サーラコーポレーション	39,600	666.00	26,373,600
ワッツ	9,800	724.00	7,095,200
ハローズ	8,900	3,015.00	26,833,500
フジオフードグループ本社	15,000	1,400.00	21,000,000
あみやき亭	4,700	2,908.00	13,667,600
大黒天物産	6,200	3,930.00	24,366,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,150.00	18,515,000
ファーマライズホールディングス	4,800	707.00	3,393,600
アルペン	14,500	2,080.00	30,160,000
ハブ	6,900	582.00	4,015,800
クオールホールディングス	23,900	1,368.00	32,695,200
ジinzホールディングス	11,200	4,230.00	47,376,000
ビックカメラ	114,500	1,140.00	130,530,000
D C Mホールディングス	114,600	1,031.00	118,152,600
Monotaro	243,500	2,006.00	488,461,000
東京一番フーズ	5,200	600.00	3,120,000
きちりホールディングス	5,100	397.00	2,024,700
アーランドサービスホールディングス	14,200	2,127.00	30,203,400
J.フロント リテイリング	219,200	1,116.00	244,627,200
ドトール・日レスホールディングス	31,600	1,508.00	47,652,800
マツキヨココカラ&カンパニー	114,700	5,370.00	615,939,000
broncoビリー	10,500	2,495.00	26,197,500
Z O Z O	132,500	2,457.00	325,552,500
トレジャー・ファクトリー	6,000	1,162.00	6,972,000
物語コーポレーション	9,600	5,910.00	56,736,000
三越伊勢丹ホールディングス	305,200	1,063.00	324,427,600
Hamee	7,300	1,042.00	7,606,600
マーケットエンタープライズ	2,300	1,070.00	2,461,000
ウエルシアホールディングス	101,900	2,680.00	273,092,000
クリエイティブSDホールディングス	28,500	2,934.00	83,619,000
丸善CHIホールディングス	22,500	381.00	8,572,500

ミサワ	4,500	621.00	2,794,500
ティーライフ	2,900	1,432.00	4,152,800
チムニー	5,900	1,208.00	7,127,200
シュッピン	16,300	1,467.00	23,912,100
オイシックス・ラ・大地	27,900	1,579.00	44,054,100
ネクステージ	39,200	2,312.00	90,630,400
ジョイフル本田	58,100	1,572.00	91,333,200
鳥貴族ホールディングス	6,800	2,314.00	15,735,200
ホットランド	14,700	1,334.00	19,609,800
すかいらーくホールディングス	239,400	1,602.00	383,518,800
SFPホールディングス	9,400	1,578.00	14,833,200
綿半ホールディングス	13,900	1,371.00	19,056,900
ヨシックスホールディングス	3,900	2,607.00	10,167,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	56,300	1,065.00	59,959,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,300	1,380.00	14,214,000
BEENOS	9,900	2,336.00	23,126,400
あさひ	16,200	1,303.00	21,108,600
日本調剤	11,900	1,292.00	15,374,800
コスモス薬品	19,400	13,100.00	254,140,000
トーエル	9,100	928.00	8,444,800
セブン&アイ・ホールディングス	681,200	5,364.00	3,653,956,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,200	932.00	112,026,400
ツルハホールディングス	42,000	7,450.00	312,900,000
サンマルクホールディングス	15,400	1,565.00	24,101,000
フェリシモ	4,600	1,180.00	5,428,000
トリドールホールディングス	48,000	2,277.00	109,296,000
TOKYO BASE	18,800	339.00	6,373,200
ウイルプラスホールディングス	4,000	895.00	3,580,000
JMホールディングス	14,300	1,577.00	22,551,100
サツドラホールディングス	9,200	724.00	6,660,800
アレンザホールディングス	13,800	1,020.00	14,076,000
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,932.00	10,239,600
パロックジャパンリミテッド	13,800	810.00	11,178,000
クスリのアオキホールディングス	17,900	5,630.00	100,777,000
力の源ホールディングス	9,800	712.00	6,977,600
FOOD & LIFE COMPANIES	103,400	2,955.00	305,547,000
メディカルシステムネットワーク	18,200	436.00	7,935,200
はるやまホールディングス	9,800	449.00	4,400,200
ノジマ	31,200	2,817.00	87,890,400
カッパ・クリエイト	27,000	1,429.00	38,583,000



ライトオン	14,400	745.00	10,728,000
良品計画	221,700	1,376.00	305,059,200
パリミキホールディングス	25,200	263.00	6,627,600
アドヴァングループ	17,900	801.00	14,337,900
アルビス	6,000	2,209.00	13,254,000
コナカ	21,400	334.00	7,147,600
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,675.00	4,355,000
G - 7ホールディングス	21,600	1,451.00	31,341,600
イオン北海道	28,400	1,077.00	30,586,800
コジマ	33,700	617.00	20,792,900
ヒマラヤ	6,600	996.00	6,573,600
コーナン商事	27,500	3,640.00	100,100,000
エコス	6,800	2,150.00	14,620,000
ワタミ	23,300	914.00	21,296,200
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	384,900	2,089.00	804,056,100
西松屋チェーン	39,700	1,437.00	57,048,900
ゼンショーホールディングス	94,100	3,245.00	305,354,500
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,305.00	15,007,500
ハークスレイ	8,700	561.00	4,880,700
サイゼリヤ	28,700	2,657.00	76,255,900
V Tホールディングス	73,200	459.00	33,598,800
魚力	5,500	2,333.00	12,831,500
フジ・コーポレーション	10,500	1,194.00	12,537,000
ユナイテッドアローズ	20,300	2,017.00	40,945,100
ハイデイ日高	28,000	2,047.00	57,316,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	13,000	218.00	2,834,000
コロワイド	79,100	1,818.00	143,803,800
ピーシーデボコーポレーション	23,500	312.00	7,332,000
壱番屋	13,600	4,930.00	67,048,000
P L A N T	5,200	668.00	3,473,600
スギホールディングス	38,500	5,480.00	210,980,000
薬王堂ホールディングス	9,800	2,050.00	20,090,000
スクロール	30,000	910.00	27,300,000
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,777.00	30,031,300
木曽路	25,900	2,173.00	56,280,700
S R Sホールディングス	27,800	851.00	23,657,800
千趣会	35,700	392.00	13,994,400
リテールパートナーズ	27,700	1,147.00	31,771,900
ケーヨー	35,800	923.00	33,043,400
上新電機	20,000	1,908.00	38,160,000
日本瓦斯	93,700	1,917.00	179,622,900

ロイヤルホールディングス	31,700	2,200.00	69,740,000
いなげや	20,800	1,192.00	24,793,600
チヨダ	17,700	771.00	13,646,700
ライフコーポレーション	16,100	2,583.00	41,586,300
リンガーハット	22,700	2,305.00	52,323,500
MrMaxHD	24,600	609.00	14,981,400
AOKIホールディングス	37,800	698.00	26,384,400
オークワ	28,600	879.00	25,139,400
コメリ	29,800	2,653.00	79,059,400
青山商事	38,100	881.00	33,566,100
しまむら	22,400	10,940.00	245,056,000
はせがわ	11,600	259.00	3,004,400
高島屋	133,200	1,298.00	172,893,600
松屋	34,700	892.00	30,952,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,300	999.00	86,213,700
近鉄百貨店	6,300	2,405.00	15,151,500
丸井グループ	143,500	2,344.00	336,364,000
アクシアル リテイリング	13,600	3,030.00	41,208,000
イオン	670,100	2,309.50	1,547,595,950
イズミ	32,000	3,035.00	97,120,000
平和堂	29,900	1,943.00	58,095,700
フジ	45,800	2,135.00	97,783,000
ヤオコー	21,900	6,170.00	135,123,000
ゼビオホールディングス	26,600	934.00	24,844,400
ケースホールディングス	168,600	1,255.00	211,593,000
Olympicグループ	9,500	653.00	6,203,500
日産東京販売ホールディングス	29,800	257.00	7,658,600
シルバーライフ	4,200	1,543.00	6,480,600
Genky DrugStores	8,600	3,425.00	29,455,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,700	901.00	4,234,700
ブックオフグループホールディングス	11,200	986.00	11,043,200
ギフトホールディングス	3,200	2,169.00	6,940,800
アインホールディングス	24,400	7,120.00	173,728,000
元気寿司	5,500	2,517.00	13,843,500
ヤマダホールディングス	701,200	472.00	330,966,400
アークランドサカモト	30,400	1,519.00	46,177,600
ニトリホールディングス	76,400	12,730.00	972,572,000
グルメ杵屋	15,700	1,000.00	15,700,000
愛眼	14,100	179.00	2,523,900
ケーユーホールディングス	10,400	1,045.00	10,868,000
吉野家ホールディングス	67,300	2,478.00	166,769,400
松屋フーズホールディングス	9,300	3,810.00	35,433,000

サガミホールディングス	28,500	1,141.00	32,518,500
関西フードマーケット	17,100	1,190.00	20,349,000
王将フードサービス	12,800	6,850.00	87,680,000
プレナス	21,700	1,959.00	42,510,300
ミニストップ	14,400	1,444.00	20,793,600
アークス	35,200	1,974.00	69,484,800
パローホールディングス	40,600	1,826.00	74,135,600
ベルク	8,600	5,200.00	44,720,000
大庄	10,600	1,181.00	12,518,600
ファーストリテイリング	25,700	71,490.00	1,837,293,000
サンドラッグ	72,500	2,961.00	214,672,500
サクスパー ホールディングス	18,800	591.00	11,110,800
ヤマザワ	4,400	1,505.00	6,622,000
やまや	3,900	2,512.00	9,796,800
ペルーナ	41,800	729.00	30,472,200
島根銀行	6,100	519.00	3,165,900
じもとホールディングス	13,100	581.00	7,611,100
めぶきフィナンシャルグループ	836,900	262.00	219,267,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,900	2,151.00	49,257,900
九州フィナンシャルグループ	356,100	385.00	137,098,500
ゆうちょ銀行	454,900	1,042.00	474,005,800
富山第一銀行	43,900	403.00	17,691,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,002,900	461.00	462,336,900
西日本フィナンシャルホールディングス	107,300	746.00	80,045,800
三十三フィナンシャルグループ	16,300	1,383.00	22,542,900
第四北越フィナンシャルグループ	28,600	2,476.00	70,813,600
ひろぎんホールディングス	259,000	615.00	159,285,000
おきなわフィナンシャルグループ	16,700	2,167.00	36,188,900
十六フィナンシャルグループ	23,600	2,322.00	54,799,200
北國フィナンシャルホールディングス	17,000	4,635.00	78,795,000
プロクレアホールディングス	19,900	1,941.00	38,625,900
新生銀行	125,700	2,046.00	257,182,200
あおぞら銀行	107,600	2,708.00	291,380,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,548,700	735.80	8,497,533,460
りそなホールディングス	2,087,700	508.70	1,062,012,990
三井住友トラスト・ホールディングス	333,900	4,184.00	1,397,037,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,278,400	4,071.00	5,204,366,400
千葉銀行	577,200	726.00	419,047,200
群馬銀行	327,300	375.00	122,737,500
武蔵野銀行	26,000	1,772.00	46,072,000
千葉興業銀行	42,800	259.00	11,085,200
筑波銀行	75,100	190.00	14,269,000

七十七銀行	54,300	1,812.00	98,391,600
秋田銀行	11,800	1,646.00	19,422,800
山形銀行	18,700	910.00	17,017,000
岩手銀行	12,100	1,982.00	23,982,200
東邦銀行	145,500	201.00	29,245,500
東北銀行	8,800	979.00	8,615,200
ふくおかフィナンシャルグループ	146,900	2,375.00	348,887,500
静岡銀行	421,200	806.00	339,487,200
スルガ銀行	169,000	366.00	61,854,000
八十二銀行	392,800	475.00	186,580,000
山梨中央銀行	19,900	1,100.00	21,890,000
大垣共立銀行	34,700	1,714.00	59,475,800
福井銀行	15,700	1,343.00	21,085,100
清水銀行	7,200	1,474.00	10,612,800
富山銀行	3,100	1,869.00	5,793,900
滋賀銀行	33,000	2,711.00	89,463,000
南都銀行	27,400	1,972.00	54,032,800
百五銀行	169,600	329.00	55,798,400
京都銀行	62,900	5,660.00	356,014,000
紀陽銀行	59,900	1,343.00	80,445,700
ほくほくフィナンシャルグループ	112,000	831.00	93,072,000
山陰合同銀行	109,500	652.00	71,394,000
中国銀行	146,100	974.00	142,301,400
鳥取銀行	6,100	1,190.00	7,259,000
伊予銀行	229,200	646.00	148,063,200
百十四銀行	18,700	1,693.00	31,659,100
四国銀行	26,700	831.00	22,187,700
阿波銀行	26,900	2,017.00	54,257,300
大分銀行	10,600	1,874.00	19,864,400
宮崎銀行	11,000	2,088.00	22,968,000
佐賀銀行	10,400	1,451.00	15,090,400
琉球銀行	41,800	775.00	32,395,000
セブン銀行	572,300	255.00	145,936,500
みずほフィナンシャルグループ	2,361,900	1,528.50	3,610,164,150
高知銀行	6,400	731.00	4,678,400
山口フィナンシャルグループ	203,100	733.00	148,872,300
長野銀行	6,000	1,258.00	7,548,000
名古屋銀行	12,500	3,095.00	38,687,500
北洋銀行	258,200	216.00	55,771,200
愛知銀行	6,300	5,190.00	32,697,000
中京銀行	6,300	1,661.00	10,464,300
大光銀行	6,000	1,423.00	8,538,000

愛媛銀行	25,700	899.00	23,104,300
トマト銀行	6,200	1,009.00	6,255,800
京葉銀行	80,400	474.00	38,109,600
栃木銀行	88,700	259.00	22,973,300
北日本銀行	5,700	1,556.00	8,869,200
東和銀行	32,300	517.00	16,699,100
福島銀行	20,900	228.00	4,765,200
大東銀行	8,700	652.00	5,672,400
トモニホールディングス	142,400	307.00	43,716,800
フィデアホールディングス	17,600	1,289.00	22,686,400
池田泉州ホールディングス	210,200	197.00	41,409,400
F P G	65,100	909.00	59,175,900
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,100	1,307.00	19,735,700
マーキュリアホールディングス	9,900	622.00	6,157,800
S B Iホールディングス	238,000	2,693.00	640,934,000
ジャフコ グループ	73,800	1,647.00	121,548,600
大和証券グループ本社	1,374,900	613.10	842,951,190
野村ホールディングス	2,942,700	507.20	1,492,537,440
岡三証券グループ	143,900	344.00	49,501,600
丸三証券	57,800	492.00	28,437,600
東洋証券	61,400	190.00	11,666,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	200,900	374.00	75,136,600
光世証券	4,600	453.00	2,083,800
水戸証券	49,600	253.00	12,548,800
いちよし証券	34,700	663.00	23,006,100
松井証券	94,700	812.00	76,896,400
マネックスグループ	161,100	436.00	70,239,600
極東証券	23,600	698.00	16,472,800
岩井コスモホールディングス	18,400	1,270.00	23,368,000
アイザワ証券グループ	28,200	701.00	19,768,200
マネーパートナーズグループ	21,600	259.00	5,594,400
スパークス・グループ	90,000	272.00	24,480,000
かんぽ生命保険	194,000	2,160.00	419,040,000
S O M P Oホールディングス	288,300	5,890.00	1,698,087,000
アニコム ホールディングス	59,200	645.00	38,184,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	408,100	4,126.00	1,683,820,600
第一生命ホールディングス	917,500	2,519.50	2,311,641,250
東京海上ホールディングス	563,800	8,006.00	4,513,782,800
T & Dホールディングス	452,600	1,589.00	719,181,400
アドバンスクリエイト	9,200	950.00	8,740,000
全国保証	46,100	4,295.00	197,999,500
あんしん保証	9,400	268.00	2,519,200

イントラスト	9,000	577.00	5,193,000
日本モーゲージサービス	11,200	955.00	10,696,000
C a s a	7,300	865.00	6,314,500
アルヒ	28,900	991.00	28,639,900
プレミアグループ	9,900	3,910.00	38,709,000
ネットプロテクションズホールディングス	59,500	501.00	29,809,500
クレディセゾン	116,500	1,562.00	181,973,000
芙蓉総合リース	17,800	7,720.00	137,416,000
みずほリース	25,900	3,095.00	80,160,500
東京センチュリー	32,400	4,650.00	150,660,000
日本証券金融	76,200	875.00	66,675,000
アイフル	324,600	362.00	117,505,200
リコーリース	17,200	3,480.00	59,856,000
イオンフィナンシャルサービス	105,200	1,247.00	131,184,400
アコム	381,500	322.00	122,843,000
ジャックス	20,000	3,310.00	66,200,000
オリエントコーポレーション	524,900	129.00	67,712,100
オリックス	1,145,100	2,340.00	2,679,534,000
三菱HCキャピタル	653,300	633.00	413,538,900
九州リースサービス	9,500	580.00	5,510,000
日本取引所グループ	459,800	2,090.50	961,211,900
イー・ギャランティ	28,600	2,191.00	62,662,600
アサックス	10,800	610.00	6,588,000
NECキャピタルソリューション	8,100	2,005.00	16,240,500
いちご	220,100	304.00	66,910,400
日本駐車場開発	208,000	171.00	35,568,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,600	1,681.00	19,499,600
SREホールディングス	5,900	2,222.00	13,109,800
ADワークスグループ	36,200	154.00	5,574,800
ヒューリック	434,500	1,067.00	463,611,500
三栄建築設計	8,800	1,616.00	14,220,800
野村不動産ホールディングス	100,200	3,210.00	321,642,000
三重交通グループホールディングス	42,700	486.00	20,752,200
サムティ	30,000	2,034.00	61,020,000
ディア・ライフ	27,400	552.00	15,124,800
地主	13,000	2,033.00	26,429,000
プレサンスコーポレーション	23,500	1,505.00	35,367,500
ハウスコム	5,100	921.00	4,697,100
JPMC	11,000	1,033.00	11,363,000
サンセイランディック	7,700	893.00	6,876,100
フージャースホールディングス	24,600	791.00	19,458,600
オープンハウスグループ	61,600	5,530.00	340,648,000

東急不動産ホールディングス	540,800	708.00	382,886,400
飯田グループホールディングス	161,600	2,077.00	335,643,200
イーランド	4,100	1,472.00	6,035,200
ムゲンエステート	15,500	488.00	7,564,000
And Doホールディングス	9,500	876.00	8,322,000
シーアールイー	7,800	1,670.00	13,026,000
ケイアイスター不動産	9,000	4,640.00	41,760,000
グッドコムアセット	9,800	1,269.00	12,436,200
ジェイ・エス・ビー	4,400	3,275.00	14,410,000
ロードスターキャピタル	6,200	1,786.00	11,073,200
テンポイノベーション	7,500	843.00	6,322,500
フェイスネットワーク	3,800	1,348.00	5,122,400
パーク24	115,000	1,847.00	212,405,000
パラカ	6,400	1,786.00	11,430,400
三井不動産	796,100	2,891.00	2,301,525,100
三菱地所	1,154,500	1,955.00	2,257,047,500
平和不動産	31,800	3,895.00	123,861,000
東京建物	174,300	1,830.00	318,969,000
京阪神ビルディング	28,100	1,275.00	35,827,500
住友不動産	366,300	3,563.00	1,305,126,900
テーオーシー	33,700	653.00	22,006,100
東京楽天地	3,400	3,940.00	13,396,000
スターツコーポレーション	26,900	2,725.00	73,302,500
フジ住宅	25,100	644.00	16,164,400
空港施設	22,700	533.00	12,099,100
明和地所	12,100	622.00	7,526,200
ゴールドクレスト	16,200	1,697.00	27,491,400
エスリード	8,500	1,667.00	14,169,500
日神グループホールディングス	35,300	436.00	15,390,800
日本エスコン	35,900	749.00	26,889,100
タカラレーベン	80,700	341.00	27,518,700
A V A N T I A	11,500	844.00	9,706,000
イオンモール	97,600	1,618.00	157,916,800
毎日コムネット	9,200	658.00	6,053,600
ファースト住建	8,800	1,090.00	9,592,000
カチタス	48,300	2,945.00	142,243,500
トーセイ	28,100	1,213.00	34,085,300
穴吹興産	5,000	2,240.00	11,200,000
サンフロンティア不動産	28,200	1,107.00	31,217,400
F Jネクストホールディングス	20,600	1,067.00	21,980,200
インテリックス	4,300	590.00	2,537,000
ランドビジネス	7,000	234.00	1,638,000

サンネクスタグループ	7,700	1,087.00	8,369,900
グランディハウス	16,500	532.00	8,778,000
日本空港ビルデング	66,200	5,290.00	350,198,000
明豊ファシリティワークス	9,100	642.00	5,842,200
日本工営	12,000	3,300.00	39,600,000
L I F U L L	59,300	165.00	9,784,500
ミクシィ	42,900	2,241.00	96,138,900
ジェイエイシーリクルートメント	15,300	1,687.00	25,811,100
日本M&Aセンターホールディングス	306,500	1,423.00	436,149,500
メンバーズ	5,200	2,714.00	14,112,800
中広	3,900	390.00	1,521,000
UTグループ	27,100	2,148.00	58,210,800
アイティメディア	9,100	1,626.00	14,796,600
E・Jホールディングス	11,000	1,161.00	12,771,000
夢真ビーネックスグループ	61,100	1,497.00	91,466,700
コシダカホールディングス	50,400	753.00	37,951,200
アルトナー	5,000	866.00	4,330,000
パソナグループ	20,400	1,870.00	38,148,000
C D S	4,800	1,843.00	8,846,400
リンクアンドモチベーション	41,200	484.00	19,940,800
エス・エム・エス	63,600	2,721.00	173,055,600
サニーサイドアップグループ	7,100	599.00	4,252,900
パーソルホールディングス	186,800	2,425.00	452,990,000
リニカル	11,000	803.00	8,833,000
クックパッド	60,400	204.00	12,321,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,700	620.00	6,014,000
学情	8,000	890.00	7,120,000
スタジオアリス	8,500	2,356.00	20,026,000
シミックホールディングス	9,800	1,419.00	13,906,200
エプコ	4,400	749.00	3,295,600
N J S	4,300	1,968.00	8,462,400
総合警備保障	70,300	3,765.00	264,679,500
カカクコム	137,200	2,210.00	303,212,000
アイロムグループ	6,700	1,813.00	12,147,100
セントケア・ホールディング	12,600	842.00	10,609,200
サイネックス	3,800	591.00	2,245,800
ルネサンス	13,300	949.00	12,621,700
ディップ	32,900	3,750.00	123,375,000
デジタルホールディングス	13,300	1,285.00	17,090,500
新日本科学	22,900	2,041.00	46,738,900
キャリアデザインセンター	4,500	1,141.00	5,134,500
ベネフィット・ワン	68,100	1,880.00	128,028,000



エムスリー	329,600	4,004.00	1,319,718,400
ツカダ・グローバルホールディング	11,900	339.00	4,034,100
アウトソーシング	107,300	1,057.00	113,416,100
ウェルネット	18,000	488.00	8,784,000
ワールドホールディングス	7,600	2,153.00	16,362,800
ディー・エヌ・エー	71,300	1,832.00	130,621,600
博報堂D Yホールディングス	244,500	1,241.00	303,424,500
ぐるなび	29,300	389.00	11,397,700
タカミヤ	23,600	375.00	8,850,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	752.00	8,422,400
ファンコミュニケーションズ	44,500	393.00	17,488,500
ライク	6,400	2,220.00	14,208,000
ビジネス・ブレークスルー	7,700	428.00	3,295,600
エスプール	53,000	1,157.00	61,321,000
WDBホールディングス	8,700	2,257.00	19,635,900
ティア	11,700	437.00	5,112,900
C D G	2,300	1,287.00	2,960,100
アドウェイズ	28,500	679.00	19,351,500
バリューコマース	14,800	3,175.00	46,990,000
インフォマート	205,600	374.00	76,894,400
J Pホールディングス	49,500	248.00	12,276,000
エコナックホールディングス	36,600	100.00	3,660,000
C Lホールディングス	4,300	944.00	4,059,200
プレステージ・インターナショナル	70,600	631.00	44,548,600
アミューズ	10,300	1,936.00	19,940,800
ドリームインキュベータ	5,700	1,981.00	11,291,700
クイック	12,200	1,378.00	16,811,600
T A C	11,700	219.00	2,562,300
電通グループ	180,900	4,275.00	773,347,500
イオンファンタジー	7,300	2,602.00	18,994,600
シーティーエス	21,500	800.00	17,200,000
ネクシィーズグループ	6,700	569.00	3,812,300
H . U . グループホールディングス	48,900	2,850.00	139,365,000
アルプス技研	15,600	1,817.00	28,345,200
ダイオーズ	4,000	1,117.00	4,468,000
日本空調サービス	20,000	787.00	15,740,000
オリエンタルランド	205,900	18,445.00	3,797,825,500
ダスキン	41,400	2,827.00	117,037,800
明光ネットワークジャパン	22,500	610.00	13,725,000
ファルコホールディングス	8,600	2,088.00	17,956,800
ラウンドワン	52,300	1,522.00	79,600,600
リゾートトラスト	81,400	2,183.00	177,696,200

ビー・エム・エル	23,900	3,510.00	83,889,000
りらいあコミュニケーションズ	27,900	1,062.00	29,629,800
リソー教育	86,400	320.00	27,648,000
早稲田アカデミー	10,700	1,135.00	12,144,500
ユー・エス・エス	209,200	2,358.00	493,293,600
東京個別指導学院	17,100	620.00	10,602,000
サイバーエージェント	419,600	1,390.00	583,244,000
楽天グループ	897,900	642.00	576,451,800
クリーク・アンド・リバー社	10,000	1,987.00	19,870,000
モーニングスター	33,300	508.00	16,916,400
テー・オー・ダブリュー	36,800	317.00	11,665,600
山田コンサルティンググループ	10,000	1,106.00	11,060,000
セントラルスポーツ	7,100	2,445.00	17,359,500
フルキャストホールディングス	16,100	2,117.00	34,083,700
エン・ジャパン	32,400	1,705.00	55,242,000
リソルホールディングス	2,100	4,600.00	9,660,000
テクノプロ・ホールディングス	111,900	2,741.00	306,717,900
アトラグループ	4,100	195.00	799,500
インターワークス	6,300	376.00	2,368,800
アイ・アールジャパンホールディングス	8,800	2,008.00	17,670,400
Keeper 技研	12,100	3,475.00	42,047,500
ファーストロジック	3,600	806.00	2,901,600
三機サービス	3,600	1,041.00	3,747,600
Gunosy	10,700	757.00	8,099,900
デザインワン・ジャパン	7,300	179.00	1,306,700
イー・ガーディアン	6,900	2,855.00	19,699,500
リブセンス	12,500	162.00	2,025,000
ジャパンマテリアル	57,600	2,024.00	116,582,400
ベクトル	26,500	989.00	26,208,500
ウチヤマホールディングス	10,400	300.00	3,120,000
チャーム・ケア・コーポレーション	14,300	969.00	13,856,700
キャリアリンク	7,100	1,978.00	14,043,800
I B J	15,800	764.00	12,071,200
アサンテ	8,500	1,495.00	12,707,500
バリューHR	16,000	1,382.00	22,112,000
M&Aキャピタルパートナーズ	15,500	3,425.00	53,087,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,500	1,201.00	9,007,500
E R Iホールディングス	5,500	1,342.00	7,381,000
アビスト	3,000	2,800.00	8,400,000
シグマクシス・ホールディングス	22,800	1,046.00	23,848,800
ウィルグループ	14,200	1,107.00	15,719,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	23,500	165.00	3,877,500

メドピア	13,700	1,878.00	25,728,600
レアジョブ	4,200	561.00	2,356,200
リクルートホールディングス	1,371,900	4,112.00	5,641,252,800
エラン	26,100	1,044.00	27,248,400
土木管理総合試験所	9,700	334.00	3,239,800
ネットマーケティング	9,600	670.00	6,432,000
日本郵政	2,235,400	952.30	2,128,771,420
ベルシステム24ホールディングス	27,100	1,375.00	37,262,500
鎌倉新書	21,900	558.00	12,220,200
S MN	4,700	596.00	2,801,200
グローバルキッズCOMPANY	3,600	753.00	2,710,800
エアトリ	11,300	2,696.00	30,464,800
アトラエ	13,300	1,755.00	23,341,500
ストライク	7,900	3,335.00	26,346,500
ソラスト	46,400	680.00	31,552,000
セラク	6,300	1,123.00	7,074,900
インソース	20,000	2,354.00	47,080,000
ベikalent・コンサルティング	13,200	34,200.00	451,440,000
Orchestra Holdings	3,700	2,468.00	9,131,600
アイモバイル	8,200	1,473.00	12,078,600
キャリアインデックス	7,200	467.00	3,362,400
MS - Japan	8,000	913.00	7,304,000
船場	4,300	682.00	2,932,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,500	1,414.00	84,133,000
フルテック	2,900	1,361.00	3,946,900
GameWith	6,300	551.00	3,471,300
MS&Consulting	3,200	660.00	2,112,000
ウェルビー	12,700	693.00	8,801,100
エル・ティー・エス	2,500	3,650.00	9,125,000
ミダックホールディングス	8,600	2,812.00	24,183,200
日総工産	15,200	570.00	8,664,000
キュービーネットホールディングス	8,900	1,336.00	11,890,400
RPAホールディングス	27,300	326.00	8,899,800
スプリックス	6,400	962.00	6,156,800
マネジメントソリューションズ	9,400	2,130.00	20,022,000
プロレド・パートナーズ	4,900	491.00	2,405,900
テノ・ホールディングス	2,800	704.00	1,971,200
フロンティア・マネジメント	5,200	1,290.00	6,708,000
ピアラ	3,500	730.00	2,555,000
コプロ・ホールディングス	4,100	838.00	3,435,800
ギークス	3,600	962.00	3,463,200
カーブスホールディングス	51,800	648.00	33,566,400

フォーラムエンジニアリング	12,300	926.00	11,389,800
Fast Fitness Japan	3,700	1,436.00	5,313,200
ダイレクトマーケティングミックス	20,100	1,728.00	34,732,800
ポピンズ	4,500	1,915.00	8,617,500
LITALICO	15,300	2,125.00	32,512,500
アドバンテッジリスクマネジメント	10,200	462.00	4,712,400
リログループ	102,300	2,163.00	221,274,900
東祥	14,300	1,198.00	17,131,400
ビーウィズ	5,300	1,365.00	7,234,500
TREホールディングス	32,100	1,865.00	59,866,500
人・夢・技術グループ	7,600	2,330.00	17,708,000
エイチ・アイ・エス	39,800	2,073.00	82,505,400
ラックランド	5,700	3,005.00	17,128,500
共立メンテナンス	33,400	5,010.00	167,334,000
イチネンホールディングス	19,400	1,221.00	23,687,400
建設技術研究所	10,200	2,502.00	25,520,400
スペース	12,900	921.00	11,880,900
燦ホールディングス	8,300	1,802.00	14,956,600
スバル興業	1,200	8,740.00	10,488,000
東京テアトル	7,000	1,224.00	8,568,000
タナベ経営	7,700	654.00	5,035,800
ナガワ	5,500	7,840.00	43,120,000
東京都競馬	14,100	3,890.00	54,849,000
カナモト	31,500	1,931.00	60,826,500
西尾レントオール	16,200	2,708.00	43,869,600
トランス・コスモス	23,800	3,495.00	83,181,000
乃村工藝社	80,400	863.00	69,385,200
藤田観光	8,100	2,810.00	22,761,000
KNT-CTホールディングス	11,600	1,615.00	18,734,000
日本管財	20,100	2,558.00	51,415,800
トーカイ	15,500	1,629.00	25,249,500
セコム	184,000	8,312.00	1,529,408,000
セントラル警備保障	9,100	2,513.00	22,868,300
丹青社	36,700	803.00	29,470,100
メイテック	22,200	6,740.00	149,628,000
応用地質	19,100	1,692.00	32,317,200
船井総研ホールディングス	36,300	2,156.00	78,262,800
進学会ホールディングス	7,100	347.00	2,463,700
オオバ	12,500	777.00	9,712,500
いであ	4,900	1,707.00	8,364,300
学究社	6,200	1,572.00	9,746,400
ベネッセホールディングス	62,400	2,140.00	133,536,000

イオンディライト	21,600	2,897.00	62,575,200	
ナック	9,200	964.00	8,868,800	
ダイセキ	34,100	4,335.00	147,823,500	
ステップ	7,000	1,721.00	12,047,000	
合 計	203,485,100		484,271,312,390	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期中間計算期間(2022年6月28日から2022年12月27日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 （2022年 6月27日現在）	第17期中間計算期間 （2022年12月27日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	8,398,951	7,420,391
親投資信託受益証券	3,221,189,390	2,577,480,561
未収入金	-	112,143
流動資産合計	3,229,588,341	2,585,013,095
<b>資産合計</b>		
3,229,588,341		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払受託者報酬	1,254,317	1,166,366
未払委託者報酬	5,375,577	4,998,664
未払利息	13	14
その他未払費用	175,218	83,249
流動負債合計	6,805,125	6,248,293
<b>負債合計</b>		
6,805,125		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,346,754,965	1,835,612,035
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	876,028,251	743,152,767
（分配準備積立金）	526,240,014	401,136,054
元本等合計	3,222,783,216	2,578,764,802
<b>純資産合計</b>		
3,222,783,216		
<b>負債純資産合計</b>		
3,229,588,341		

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2021年 6月26日 至 2021年12月25日	第17期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	17	3
有価証券売買等損益	65,251,980	88,980,689
営業収益合計	65,251,997	88,980,692
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,512	1,606
受託者報酬	1,200,434	1,166,366
委託者報酬	5,144,669	4,998,664
その他費用	85,683	83,249
営業費用合計	6,432,298	6,249,885
営業利益又は営業損失（ ）	58,819,699	82,730,807
経常利益又は経常損失（ ）	58,819,699	82,730,807
中間純利益又は中間純損失（ ）	58,819,699	82,730,807
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	5,126,246	25,811,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	832,291,886	876,028,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	159,934,246	22,124,932
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	159,934,246	22,124,932
剰余金減少額又は欠損金増加額	65,683,001	211,920,171
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	65,683,001	211,920,171
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	980,236,584	743,152,767



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第17期中間計算期間は2022年 6月28日から2022年12月27日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第16期 (2022年 6月27日現在)	第17期中間計算期間 (2022年12月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,346,754,965口	1,835,612,035口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3733円 (13,733円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4049円 (14,049円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第17期中間計算期間 (2022年12月27日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第17期中間計算期間 (2022年12月27日現在)
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第16期 自 2021年 6月26日 至 2022年 6月27日	第17期中間計算期間 自 2022年 6月28日 至 2022年12月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,075,776,977円	2,346,754,965円
期中追加設定元本額	720,012,856円	56,097,071円
期中一部解約元本額	449,034,868円	567,240,001円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年12月27日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2022年12月27日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	2,716,052,224
株式	495,705,870,290
派生商品評価勘定	3,025,700
未収入金	14,150,000
未収配当金	42,973,690
前払金	30,168,400
差入委託証拠金	84,135,000
流動資産合計	498,596,375,304
資産合計	498,596,375,304
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,213,350
未払金	393,559,663
未払解約金	61,941,689
未払利息	5,215
流動負債合計	488,719,917
負債合計	488,719,917
純資産の部	
元本等	
元本	260,736,656,812
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	237,370,998,575
元本等合計	498,107,655,387
純資産合計	498,107,655,387
負債純資産合計	498,596,375,304

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2022年12月27日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年12月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,736,656,812口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9104円 (1万口当たり純資産額) (19,104円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年12月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月28日
期首元本額	262,695,780,133円
期中追加設定元本額	10,374,042,486円
期中一部解約元本額	12,333,165,807円
期末元本額	260,736,656,812円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	383,618,572円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,081,775,710円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,529,462円
SMT TOPIXインデックス・オープン	12,016,297,721円
世界経済インデックスファンド	4,453,660,965円
日本株式インデックス・オープン	3,229,346,314円
DCマイセレクション25	6,137,526,564円
DCマイセレクション50	18,979,662,301円
DCマイセレクション75	19,361,319,089円
DC日本株式インデックス・オープン	6,244,015,911円
DCマイセレクションS25	3,227,564,651円
DCマイセレクションS50	9,502,940,359円
DCマイセレクションS75	7,399,417,158円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,652,597,935円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	159,138,178円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	689,618,655円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	514,939,231円
DC世界経済インデックスファンド	3,838,178,107円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,349,183,711円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,917,118円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	170,559,046円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,730,894円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	97,779,341円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	22,360,893円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	61,800,559円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	783,105,343円

区分	2022年12月27日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	412,182,004円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,667,665,030円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	38,605,215円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,014,252円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	445,545,340円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	247,091,476円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	326,670,326円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	33,926,824円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	555,547,306円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,995,179,542円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,384,583,887円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,958,721円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	448,786,217円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,072,374円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,974,283円
SMT インデックスバランス・オープン	56,360,991円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	27,858,775,763円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン	54,692,644円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	207,415,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,490,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,189,371円
グローバル経済コア	221,444,035円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	30,520,430円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	480,678,671円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,556,400円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	239,237,780円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	21,287,433円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	18,630,287円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,482,895円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	9,923,628円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,450,804,524円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	767,941,558円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	344,749,491円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,926,668円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	367,521,214円

区分	2022年12月27日現在
SMTAM日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,665,229,202円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	19,708,459円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	214,311,254円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年12月27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	1,991,803,400	-	1,961,635,000	30,168,400
合計		1,991,803,400	-	1,961,635,000	30,168,400

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

## 【純資産額計算書】

（2023年 1月31日現在）

資産総額	2,613,613,331円
負債総額	1,094,001円
純資産総額（ - ）	2,612,519,330円
発行済口数	1,795,917,862口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4547円
（1万口当たり純資産額）	（14,547円）

（参考）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

資産総額	514,014,453,682円
負債総額	758,060,690円
純資産総額（ - ）	513,256,392,992円
発行済口数	259,357,316,097口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9790円
（1万口当たり純資産額）	（19,790円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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



ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2023年 1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 3月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	14,137,810
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	209,923
単位型公社債投資信託	52	181,913
合計	654	14,529,647

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

（単位：百万円）

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	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	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2021年4月1日 至 2022年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## （3）【株主資本等変動計算書】

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					



当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

（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

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。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

#### （2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、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事業年度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、退職給付に係る当事業年度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」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

### (2) 投資一任業務

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

### (3) 投資助言業務

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

### (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は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。

## 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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

## (会計方針の変更)

### 1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「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）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が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」等の適用

「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。）等を当事業年度の期首から適用し、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44-21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。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「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 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

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、退職給付に係る事業年度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、当事業年度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。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
そ の 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
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

## 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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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、自社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8．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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、「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。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950

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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	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)	-	196	-	196
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	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

（\*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）投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

（\*3）金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

（\*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）時価をもって貸借対照表計上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、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）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2021年3月31日）	当事業年度 （2022年3月31日）
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

（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（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

当事業年度(2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

(有価証券関係)

## 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)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えない もの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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）上記取引の評価損益は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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式				
	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	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
合計	6,915	-	80	80	

(注) 上記取引の評価損益は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	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

## (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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

## (3) 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	
退職給付引当金	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

### 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92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

#### 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。

(収益認識関係)

#### 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事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降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〕

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 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(*)	6,372百万円

(\*)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あります。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)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あります。

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

##### 固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022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	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
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	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992



## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## （1）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。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

## （2）デリバティブ

時価法によっております。

## （3）金銭の信託

時価法によっております。

## 2．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）に基づいて償却しております。

## 3．引当金の計上基準

## （1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち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

従業員の退職給付に備えるため、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間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。

## 4．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」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

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. ヘッジ会計の方法

(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。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日。以下、「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## （表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。	

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	777百万円
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37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	95百万円
無形固定資産	608百万円
2 営業外収益の主要項目	
デリバティブ利益	2,027百万円
投資有価証券売却益	317百万円
3 営業外費用の主要項目	
為替差損	1,011百万円
金銭の信託運用損	904百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

#### (リース取引関係)

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)

第37期中間会計期間末（2022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、「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 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

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順位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計上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)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(\*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計上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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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）市場価格のない株式等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
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計		8,141	-	0	0

（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	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（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				
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
	合計		6,898	-	22

## （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。

## （収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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4．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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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	4,950百万円

## 〔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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022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37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## 4【利害関係人との取引制限】

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

## (1)自己又はその役員との取引

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

## (2)運用財産相互間の取引

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

## (3)通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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



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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年3月27日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行  
設立年月日 : 2000年6月20日  
資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）  
事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2022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 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

**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2022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。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**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。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年9月6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」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2021年6月26日から2022年6月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2022年6月27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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、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드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR 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**

2022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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年3月7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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2022年6月28日から2022年12月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2022年12月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月28日から2022年12月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。