

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月20日提出
【計算期間】	第8期(自 2021年12月21日至 2022年12月20日)
【ファンド名】	国内株式SMTBセレクション(SMA専用)
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般	年1回	グロ ー バ ル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株		日本	ファンド・	なし		
債券	年4回	北米	オブ・ファ ンズ		その他 ()	ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型
一般	年6回	欧州				
公債	(隔 月)					
社債						
その他債券	年12回	アジア				その他
クレジット属 性 ()	(毎 月)	オセアニ ア				()
日々						
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投 資 信 託 証 券 (株 式 一 般))		アフリカ				
資産複合 ()		中近東 (中 東)				
資産配分 固定型		エマ ー ジ ン グ				
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。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

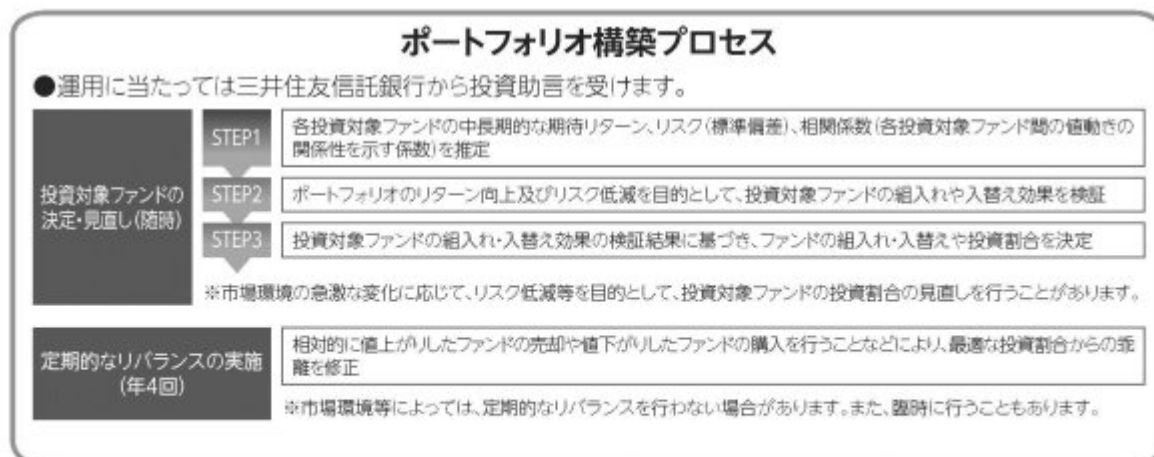
1. 主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド^{*}」)に投資します。

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

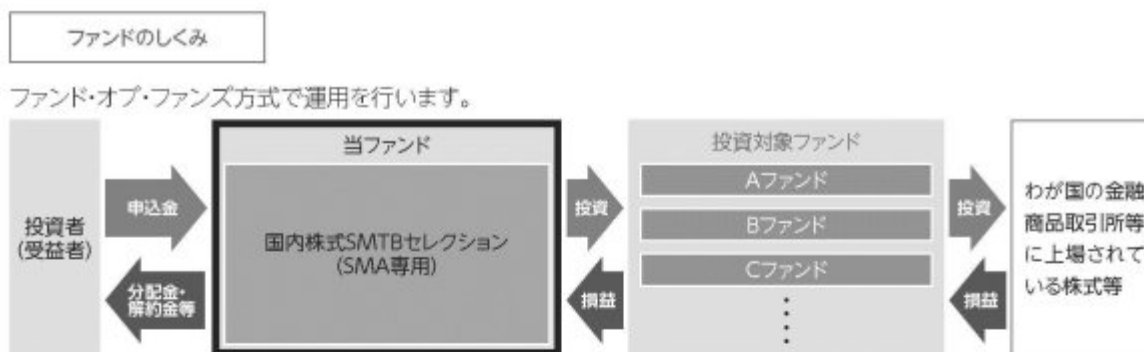
投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

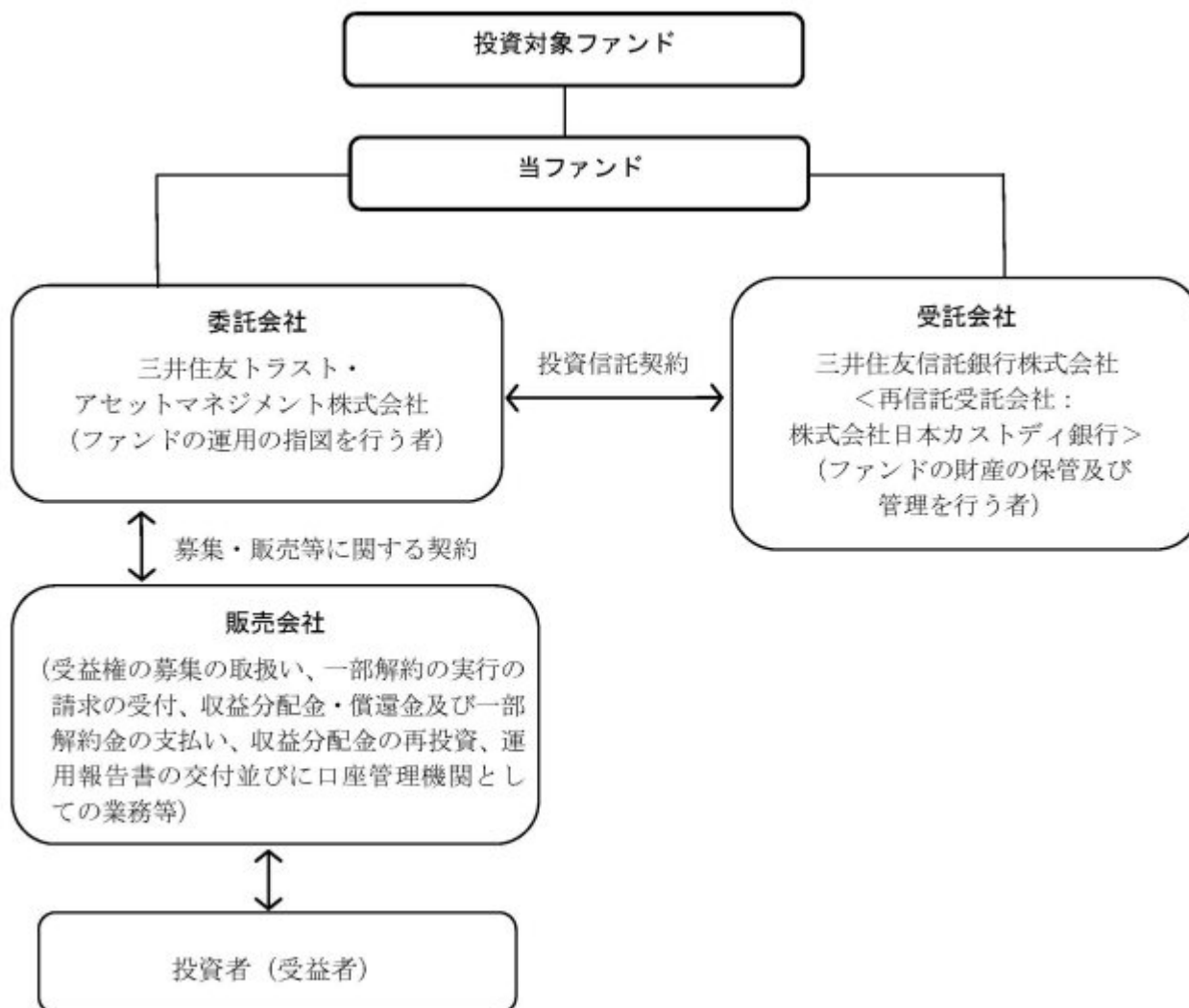
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（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】

基本方針

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

投資対象

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

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

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2023年 1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有します。J P X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、J P X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J P Xは責任を負いません。

2. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、わが国の取引所上場株式(これに準ずるものを含まず)のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞り込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>株式への投資比率は、原則として高位(80%以上)を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができるものとします。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：6月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年9月22日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

3. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式

投資態度	<p>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。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有しています。

J P X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。

J P X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。

J P X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、J P X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、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではありません。

J P X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。

J P X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、J P X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。

4. 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、親指数（MSCIジャパンIMI）構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使

用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

5. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

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

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

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有します。J P X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、J P X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J P Xは責任を負いません。

6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

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

7.FOFs用国内株式EVIバリューフンド（適格機関投資家専用）

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

「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社J P X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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）に帰属します。J P Xは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

8. マネープールマザーファンド

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．外貨建資産への投資

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

ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

が小さかった場合も同様です。

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

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

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

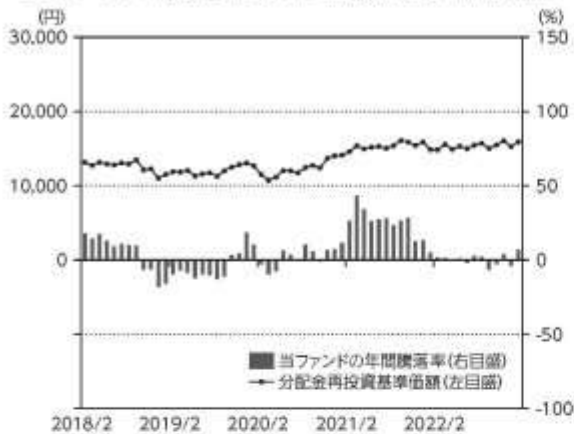
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

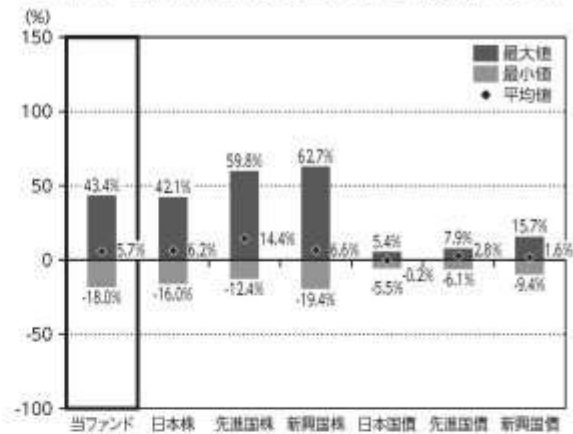
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*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総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機動性を有するマーケット・ベンチマークで、原則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標準又は商標は、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準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。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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債固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村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により提供されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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、印刷又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMiカンガリメントポインテックスエマージング マーケットグローバルデバースファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

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

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

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

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

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

上記は、2023年1月31日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更

される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2023年1月31日現在の状況について記載してあります。

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	88,171,782,191	54.60
親投資信託受益証券	日本	71,658,913,002	44.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,642,006,521	1.02
合計(純資産総額)		161,472,701,714	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	28,175,884,896	1.9056	53,693,097,184	1.9790	55,760,076,209	34.53
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューフンド(適格機関投資家専用)	25,550,485,459	1.2268	31,345,562,388	1.2476	31,876,785,658	19.74
日本	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式EVIバリューフンド(適格機関投資家専用)	21,858,637,618	1.0764	23,529,449,182	1.1066	24,188,768,388	14.98
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	7,383,128,465	2.1528	15,894,769,806	2.1808	16,101,126,556	9.97
日本	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9,522,311,750	1.6347	15,566,926,102	1.6808	16,005,101,589	9.91
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	1,645,470,781	4.7520	7,819,381,414	4.8568	7,991,722,489	4.95
日本	親投資信託受益証券	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	7,445,484,315	1.0290	7,661,549,760	1.0620	7,907,104,342	4.90
日本	親投資信託受益証券	マネーパールマザーファンド	9,953	1.0011	9,963	1.0010	9,962	0.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	54.60
親投資信託受益証券	44.38
合計	98.98

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末 (2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末 (2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末 (2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282
第5期計算期間末 (2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
第6期計算期間末 (2020年12月21日)	142,930,348,485	142,930,348,485	13,862	13,862
第7期計算期間末 (2021年12月20日)	144,548,292,355	144,548,292,355	15,531	15,531
第8期計算期間末 (2022年12月20日)	154,756,463,658	154,756,463,658	15,497	15,497
2022年 1月末日	141,354,980,406		14,861	
2月末日	131,019,844,640		14,840	
3月末日	138,966,552,712		15,579	
4月末日	136,141,264,295		14,904	
5月末日	142,730,951,581		15,306	
6月末日	142,270,561,200		14,991	
7月末日	150,833,790,261		15,455	
8月末日	155,500,550,353		15,705	
9月末日	151,283,857,124		15,027	
10月末日	151,537,777,201		15,466	
11月末日	158,731,559,126		16,040	
12月末日	152,954,267,443		15,255	
2023年 1月末日	161,472,701,714		15,909	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	0
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	0
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	0
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	0
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	10.5
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	1.1
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	19.7
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	15.6
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	15.9
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	6.0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	12.0
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	0.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	81,752,097,825	11,939,046,387	69,813,051,438
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	32,549,745,987	26,264,044,984	76,098,752,441
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	25,222,310,539	24,029,412,202	77,291,650,778
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	39,648,856,359	16,087,379,469	100,853,127,668
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	35,149,470,870	24,542,896,159	111,459,702,379
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	23,651,763,751	31,999,573,730	103,111,892,400
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	27,063,834,005	37,106,762,396	93,068,964,009
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	27,355,134,067	20,561,245,789	99,862,852,287

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

（参考）

中小型株式 マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	21,309,484,000	95.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		938,938,613	4.22
合計(純資産総額)		22,248,422,613	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	カブコン	情報・通信業	148,800	3,560.05	529,735,440	4,200.00	624,960,000	2.81
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス業	231,000	1,985.00	458,535,000	2,423.00	559,713,000	2.52
日本	株式	ローツェ	機械	56,000	7,561.16	423,425,352	9,870.00	552,720,000	2.48
日本	株式	東宝	情報・通信業	113,000	4,947.03	559,014,498	4,785.00	540,705,000	2.43
日本	株式	神戸物産	卸売業	135,000	3,313.32	447,298,784	3,730.00	503,550,000	2.26
日本	株式	ダイセキ	サービス業	115,000	4,265.06	490,481,900	4,355.00	500,825,000	2.25
日本	株式	寿スピリッツ	食料品	58,000	7,593.15	440,402,885	8,500.00	493,000,000	2.22
日本	株式	物語コーポレーション	小売業	72,400	6,037.60	437,122,240	6,500.00	470,600,000	2.12
日本	株式	ロート製薬	医薬品	196,000	2,052.67	402,323,320	2,397.00	469,812,000	2.11
日本	株式	ビジョナル	情報・通信業	50,000	6,629.24	331,462,393	9,320.00	466,000,000	2.09
日本	株式	ネットワンシステムズ	情報・通信業	130,000	3,374.46	438,680,701	3,500.00	455,000,000	2.05
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	195,000	2,292.29	446,996,707	2,333.00	454,935,000	2.04
日本	株式	イー・ギャランティ	その他金融業	188,000	2,152.63	404,694,440	2,417.00	454,396,000	2.04
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	26,800	15,960.00	427,728,000	16,490.00	441,932,000	1.99
日本	株式	ナカニシ	精密機器	159,000	2,522.99	401,155,410	2,750.00	437,250,000	1.97
日本	株式	日本セラミック	電気機器	178,000	2,069.00	368,282,000	2,411.00	429,158,000	1.93
日本	株式	ワークマン	小売業	80,000	5,358.00	428,640,615	5,270.00	421,600,000	1.89
日本	株式	サイバーエージェント	サービス業	340,000	1,369.69	465,696,167	1,206.00	410,040,000	1.84
日本	株式	ニフコ	化学	120,500	3,199.84	385,580,720	3,355.00	404,277,500	1.82

日本	株式	SHOEI	その他製品	73,000	5,369.30	391,959,334	4,980.00	363,540,000	1.63
日本	株式	セーレン	繊維製品	148,200	2,034.00	301,438,800	2,380.00	352,716,000	1.59
日本	株式	ミルボン	化学	61,700	5,069.25	312,772,725	5,700.00	351,690,000	1.58
日本	株式	KHネオケム	化学	124,500	2,504.49	311,809,005	2,755.00	342,997,500	1.54
日本	株式	シスメックス	電気機器	40,000	8,299.40	331,976,108	8,561.00	342,440,000	1.54
日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	140,000	2,445.09	342,312,600	2,421.00	338,940,000	1.52
日本	株式	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	サービス業	185,200	1,469.40	272,132,880	1,819.00	336,878,800	1.51
日本	株式	Keeper 技研	サービス業	100,000	3,574.02	357,402,000	3,320.00	332,000,000	1.49
日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	97,200	2,683.15	260,802,180	3,380.00	328,536,000	1.48
日本	株式	三益半導体工業	金属製品	127,400	2,151.52	274,103,648	2,557.00	325,761,800	1.46
日本	株式	ネクステージ	小売業	110,000	2,548.10	280,291,249	2,911.00	320,210,000	1.44

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	1.37
		食料品	2.22
		繊維製品	1.59
		化学	8.66
		医薬品	3.38
		ガラス・土石製品	1.99
		金属製品	2.54
		機械	3.91
		電気機器	8.61
		精密機器	1.97
		その他製品	4.01
		電気・ガス業	1.13
		倉庫・運輸関連業	0.43
		情報・通信業	22.97
		卸売業	4.06
		小売業	6.33
		保険業	1.62
		その他金融業	2.04
		不動産業	2.53
サービス業	14.43		
	小計	95.78	
合計		95.78	

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	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。

日本株式ESGセレクト・リーダーズ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	9,960,919,590	97.93
投資証券	日本	142,382,800	1.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		68,621,719	0.67
合計(純資産総額)		10,171,924,109	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	67,167,000	0.66

(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	371,600	1,994.32	741,091,961	1,896.50	704,739,400	6.93
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	44,200	9,895.49	437,380,934	11,580.00	511,836,000	5.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	418,900	682.51	285,903,967	952.70	399,086,030	3.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	45,800	4,685.35	214,589,171	5,652.00	258,861,600	2.54
日本	株式	第一三共	医薬品	61,400	4,114.30	252,618,191	4,064.00	249,529,600	2.45
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,200	39,729.08	206,591,256	45,170.00	234,884,000	2.31
日本	株式	日立製作所	電気機器	34,000	6,411.82	218,002,217	6,782.00	230,588,000	2.27
日本	株式	KDDI	情報・通信業	56,500	4,247.51	239,984,510	4,059.00	229,333,500	2.25
日本	株式	任天堂	その他製品	38,700	5,995.93	232,042,597	5,625.00	217,687,500	2.14
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	50,500	4,363.52	220,358,110	4,144.00	209,272,000	2.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	8,700	22,888.89	199,133,379	22,470.00	195,489,000	1.92

日本	株式	三井物産	卸売業	50,200	3,232.75	162,284,491	3,820.00	191,764,000	1.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	64,300	2,825.70	181,692,911	2,714.00	174,510,200	1.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	41,700	3,766.06	157,044,742	4,183.00	174,431,100	1.71
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	2,000	78,177.61	156,355,220	78,420.00	156,840,000	1.54
日本	株式	ファナック	電気機器	6,700	20,859.39	139,757,972	22,905.00	153,463,500	1.51
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	7,000	19,728.35	138,098,480	21,580.00	151,060,000	1.49
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	100,700	1,465.89	147,615,467	1,486.50	149,690,550	1.47
日本	株式	村田製作所	電気機器	20,100	7,016.54	141,032,591	7,394.00	148,619,400	1.46
日本	株式	富士通	電気機器	6,900	16,332.96	112,697,478	18,510.00	127,719,000	1.26
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	64,300	1,945.77	125,113,263	1,912.50	122,973,750	1.21
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	34,300	2,352.38	80,686,750	3,041.00	104,306,300	1.03
日本	株式	小松製作所	機械	32,400	2,739.74	88,767,867	3,155.00	102,222,000	1.00
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,000	4,926.64	98,532,983	4,835.00	96,700,000	0.95
日本	株式	オリックス	その他金融業	41,900	2,140.82	89,700,500	2,275.00	95,322,500	0.94
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	77,400	1,059.78	82,027,614	1,200.00	92,880,000	0.91
日本	株式	花王	化学	16,700	5,759.31	96,180,532	5,256.00	87,775,200	0.86
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	12,600	6,887.38	86,781,109	6,836.00	86,133,600	0.85
日本	株式	丸紅	卸売業	54,200	1,346.86	73,000,011	1,586.50	85,988,300	0.85
日本	株式	テルモ	精密機器	22,600	4,239.36	95,809,595	3,763.00	85,043,800	0.84

(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	鉱業	0.51
		建設業	1.73
		食料品	3.44
		繊維製品	0.49
		化学	6.00
		医薬品	6.44
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.47
		鉄鋼	1.12
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.22
		機械	5.35
		電気機器	20.15
		輸送用機器	7.61
		精密機器	1.29
その他製品	2.94		

	電気・ガス業	1.05
	陸運業	2.29
	海運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.02
	情報・通信業	6.14
	卸売業	4.68
	小売業	3.30
	銀行業	7.72
	証券、商品先物取引業	0.83
	保険業	3.98
	その他金融業	1.00
	不動産業	2.18
	サービス業	4.27
	小計	97.93
投資証券		1.40
合計		99.33

(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	3円		56,631,650	59,265,000	0.58
	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	4円		7,917,352	7,902,000	0.08

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

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

マネープールマザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		345,589,394,496	100.00
合計(純資産総額)		345,589,394,496	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

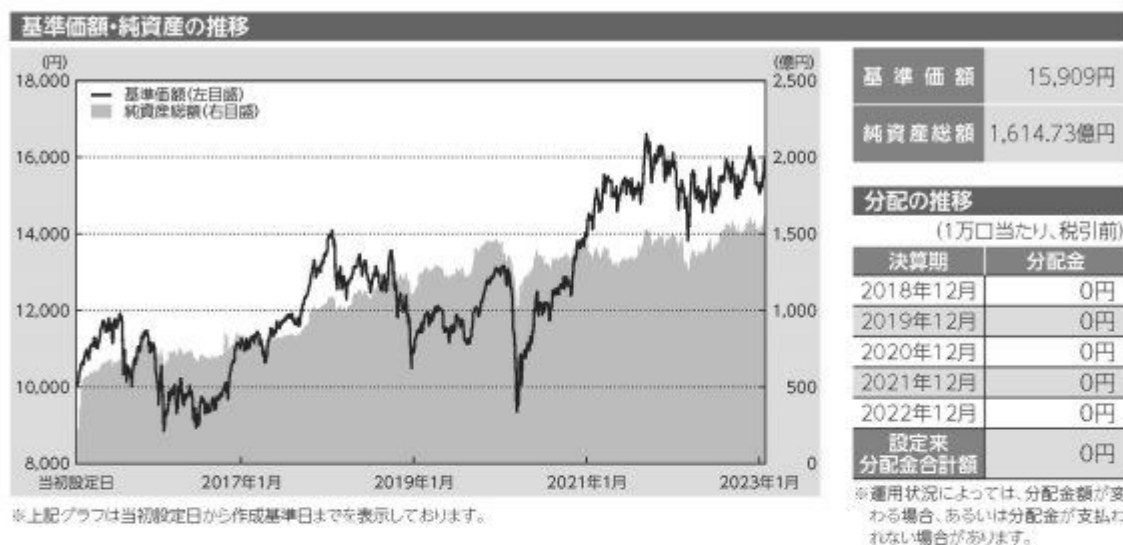
該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

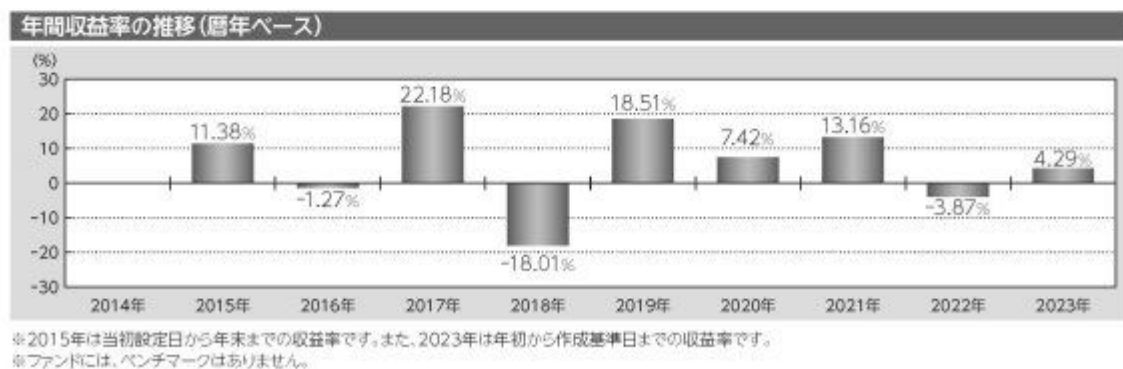
当初設定日：2015年2月6日
作成基準日：2023年1月31日



主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	34.5%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	19.7%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	15.0%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9.9%
中小型株式 マザーファンド	4.9%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	4.9%
マネープールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

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

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・公社債等

計算日における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

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

< 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】

2015年 2月 6日（設定日）から2024年12月20日までとします。

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

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2021年12月21日から2022年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2021年12月20日現在）	第8期 （2022年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,867,981,695	2,930,863,764
投資信託受益証券	57,922,832,369	84,786,707,478
親投資信託受益証券	85,306,480,599	67,644,038,321
流動資産合計	145,097,294,663	155,361,609,563
資産合計	145,097,294,663	155,361,609,563
負債の部		
流動負債		
未払解約金	118,327,380	142,496,086
未払受託者報酬	23,429,533	25,171,587
未払委託者報酬	406,111,780	436,307,418
未払利息	2,786	6,879
その他未払費用	1,130,829	1,163,935
流動負債合計	549,002,308	605,145,905
負債合計	549,002,308	605,145,905
純資産の部		
元本等		
元本	93,068,964,009	99,862,852,287
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	51,479,328,346	54,893,611,371
（分配準備積立金）	26,979,732,800	22,685,235,551
元本等合計	144,548,292,355	154,756,463,658
純資産合計	144,548,292,355	154,756,463,658
負債純資産合計	145,097,294,663	155,361,609,563

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自	2020年12月22日	自	2021年12月21日
	至	2021年12月20日	至	2022年12月20日
営業収益				
受取配当金		237,372,901		278,371,905
受取利息		6,833		6,644
有価証券売買等損益		16,602,263,477		384,954,631
営業収益合計		16,839,643,211		663,333,180
営業費用				
支払利息		670,464		1,039,155
受託者報酬		45,767,947		48,113,291
委託者報酬		793,310,871		833,963,646
その他費用		2,243,473		2,286,633
営業費用合計		841,992,755		885,402,725
営業利益又は営業損失（ ）		15,997,650,456		222,069,545
経常利益又は経常損失（ ）		15,997,650,456		222,069,545
当期純利益又は当期純損失（ ）		15,997,650,456		222,069,545
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（ ）		4,156,311,285		497,005,970
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		39,818,456,085		51,479,328,346
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,519,890,494		14,445,702,408
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,519,890,494		14,445,702,408
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,700,357,404		11,306,355,808
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,700,357,404		11,306,355,808
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		51,479,328,346		54,893,611,371

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 (2021年12月20日現在)	第8期 (2022年12月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,068,964,009口	99,862,852,287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 1.5531円 (1万口当たり純資産額) (15,531円)	1口当たり純資産額 1.5497円 (1万口当たり純資産額) (15,497円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日			第8期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,739,815,870円	費用控除後の配当等収益額	A	982,049,579円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	10,101,523,301円	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	24,499,595,546円	収益調整金額	C	33,336,615,134円
分配準備積立金額	D	15,138,393,629円	分配準備積立金額	D	21,703,185,972円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	51,479,328,346円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	56,021,850,685円
当ファンドの期末残存口数	F	93,068,964,009口	当ファンドの期末残存口数	F	99,862,852,287口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,531円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,609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

第7期 自 2020年12月22日 至 2021年12月20日			第8期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日		
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 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8期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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8期 (2022年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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7期	第8期
	自 2020年12月22日 至 2021年12月20日	自 2021年12月21日 至 2022年12月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	103,111,892,400円	93,068,964,009円
期中追加設定元本額	27,063,834,005円	27,355,134,067円
期中一部解約元本額	37,106,762,396円	20,561,245,789円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第7期	第8期
	(2021年12月20日現在)	(2022年12月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	6,131,032,106	835,863,629
親投資信託受益証券	6,693,849,798	236,334,703
合計	12,824,881,904	599,528,926

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表
(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	25,179,757,448	30,895,562,388	
	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,366,431,910	15,316,926,102	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	7,140,762,469	15,394,769,806	
	F0Fs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	21,526,234,382	23,179,449,182	
投資信託受益証券合計		63,213,186,209	84,786,707,478	
親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	1,518,080,035	7,219,381,414	
	国内株式インデックス マザーファンド	27,753,750,228	52,893,097,184	
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	7,317,868,014	7,531,549,760	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,963	
親投資信託受益証券合計		36,589,708,230	67,644,038,321	
合計			152,430,745,799	

(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。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

	2022年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,008,330,613
株式	20,095,029,200

項目	2022年12月20日現在	
	金額（円）	
未収入金	132,083,346	
未収配当金	26,490,200	
流動資産合計	21,261,933,359	
資産合計	21,261,933,359	
負債の部		
流動負債		
未払金	57,545,316	
未払解約金	5,311,333	
未払利息	2,366	
流動負債合計	62,859,015	
負債合計	62,859,015	
純資産の部		
元本等		
元本	4,457,754,428	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,741,319,916	
元本等合計	21,199,074,344	
純資産合計	21,199,074,344	
負債純資産合計	21,261,933,359	

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

(貸借対照表に関する注記)

2022年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,457,754,428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) 4.7556円 (47,556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12月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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

	2022年12月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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	2022年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月21日
期首元本額	5,990,300,623円
期中追加設定元本額	830,254,300円
期中一部解約元本額	2,362,800,495円
期末元本額	4,457,754,428円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,843,477,565円
中小型株式オープン（SMA専用）	70,475,351円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,518,080,035円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	25,721,477円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	423,586,760
合計	423,586,760

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

	評価額
--	-----

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
日揮ホールディングス	233,000	1,692.00	394,236,000	
寿スピリッツ	53,000	7,290.00	386,370,000	
セーレン	148,200	2,486.00	368,425,200	
KHネオケム	124,500	2,653.00	330,298,500	
トリケミカル研究所	195,000	2,065.00	402,675,000	
ミルボン	61,700	5,560.00	343,052,000	
OATアグリオ	96,400	1,570.00	151,348,000	
ニフコ	120,500	3,290.00	396,445,000	
ロート製薬	108,000	4,485.00	484,380,000	
ペプチドリーム	43,800	1,578.00	69,116,400	
MARUWA	26,800	16,150.00	432,820,000	
横河ブリッジホールディングス	120,000	1,865.00	223,800,000	
三益半導体工業	127,400	2,439.00	310,728,600	
技研製作所	60,000	3,015.00	180,900,000	
ローツェ	53,000	7,610.00	403,330,000	
富士電機	51,200	5,250.00	268,800,000	
ローランド ディー . ジー .	40,000	2,917.00	116,680,000	
シスメックス	40,000	8,289.00	331,560,000	
レーザーテック	11,000	23,230.00	255,530,000	
日本セラミック	178,000	2,511.00	446,958,000	
大真空	169,200	710.00	120,132,000	
ナカニシ	159,000	2,604.00	414,036,000	
ブシロード	360,000	660.00	237,600,000	
前田工織	84,900	3,005.00	255,124,500	
SHOEI	70,600	5,260.00	371,356,000	
イーレックス	200,000	2,328.00	465,600,000	
メタウォーター	92,000	1,683.00	154,836,000	
トランコム	16,000	7,570.00	121,120,000	
手間いらず	57,600	4,715.00	271,584,000	
ネクソン	15,800	2,871.00	45,361,800	
SHIFT	16,600	24,810.00	411,846,000	
GMOペイメントゲートウェイ	12,000	11,370.00	136,440,000	
インターネットイニシアティブ	271,500	2,409.00	654,043,500	
カナミックネットワーク	205,000	569.00	116,645,000	
チェンジ	32,000	2,347.00	75,104,000	
ビジョナル	46,000	9,060.00	416,760,000	
サスメド	61,500	1,309.00	80,503,500	
シンプレクス・ホールディングス	137,000	2,100.00	287,700,000	
Sansan	93,100	1,457.00	135,646,700	
ギフトィ	85,000	2,110.00	179,350,000	
JMDC	70,000	4,325.00	302,750,000	

ビザスク	18,000	1,542.00	27,756,000	
ウェザーニューズ	29,000	7,040.00	204,160,000	
ANYCOLOR	6,200	6,050.00	37,510,000	
ネットワンシステムズ	100,000	3,335.00	333,500,000	
ビジョン	200,000	1,280.00	256,000,000	
東宝	108,000	5,070.00	547,560,000	
カブコン	148,800	4,185.00	622,728,000	
神戸物産	120,600	3,630.00	437,778,000	
アズワン	55,000	5,530.00	304,150,000	
サンエー	59,200	4,270.00	252,784,000	
物語コーポレーション	72,400	6,250.00	452,500,000	
ネクステージ	50,000	2,549.00	127,450,000	
薬王堂ホールディングス	52,000	2,644.00	137,488,000	
アニコムホールディングス	346,000	590.00	204,140,000	
イー・ギャランティ	188,000	2,212.00	415,856,000	
SREホールディングス	62,000	3,790.00	234,980,000	
日本M&Aセンターホールディングス	147,500	1,611.00	237,622,500	
エス・エム・エス	97,200	3,210.00	312,012,000	
エスプール	429,200	898.00	385,421,600	
サイバーエージェント	330,600	1,126.00	372,255,600	
弁護士ドットコム	50,000	2,651.00	132,550,000	
Keeper 技研	124,000	3,805.00	471,820,000	
ジャパンマテリアル	231,000	2,278.00	526,218,000	
エラン	175,000	933.00	163,275,000	
インソース	145,000	2,925.00	424,125,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	185,200	1,594.00	295,208,800	
LITALICO	29,000	2,266.00	65,714,000	
ダイセキ	121,400	4,625.00	561,475,000	
合 計	7,826,600		20,095,029,200	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年12月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,528,458,517
株式	493,408,668,470
派生商品評価勘定	197,250
未収配当金	63,539,065
前払金	49,127,700
差入委託証拠金	55,495,000
流動資産合計	496,105,486,002
資産合計	496,105,486,002
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,333,200
未払解約金	131,335,735
未払利息	5,934
流動負債合計	180,674,869
負債合計	180,674,869
純資産の部	
元本等	
元本	260,215,059,922
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	235,709,751,211
元本等合計	495,924,811,133
純資産合計	495,924,811,133
負債純資産合計	496,105,486,002

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

	2022年12月20日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,215,059,922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 1.9058円 (1万口当たり純資産額) (19,058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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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	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

2022年12月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月21日
期首元本額	253,747,260,881円
期中追加設定元本額	30,758,143,458円
期中一部解約元本額	24,290,344,417円
期末元本額	260,215,059,922円

区分	2022年12月20日現在
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）	383,576,425円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,080,102,680円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,518,982円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,995,014,984円
世界経済インデックスファンド	4,432,275,222円
日本株式インデックス・オープン	3,232,689,548円
D C マイセレクション 2 5	6,139,025,278円
D C マイセレクション 5 0	18,991,677,810円
D C マイセレクション 7 5	19,347,917,819円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,218,628,741円
D C マイセレクション S 2 5	3,227,061,168円
D C マイセレクション S 5 0	9,498,521,916円
D C マイセレクション S 7 5	7,385,317,513円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,619,902,048円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	159,274,958円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	689,502,860円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	514,922,909円
D C 世界経済インデックスファンド	3,837,211,105円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,346,736,443円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,247,114円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	170,578,267円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	25,662,361円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	99,934,014円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	22,360,893円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	61,800,559円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	788,320,142円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	412,959,481円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,674,674,964円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	38,605,215円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	16,014,252円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	446,979,085円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	247,852,312円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	327,942,126円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	33,926,824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）	555,570,049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	1,995,265,447円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円

区分	2022年12月20日現在
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)	528,550,144円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	449,273,625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)	224,108,716円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,963,753円
SMT インデックスバランス・オープン	57,887,906円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,753,750,228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	54,490,044円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	206,420,562円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,331,128円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,077,387円
グローバル経済コア	221,390,945円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,442,928円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	388,947,778円
DCターゲット・イヤーフンド2055	25,555,952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)	237,665,782円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	21,158,258円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	18,556,525円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	7,405,055円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	9,498,324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)	44,234,261,075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)	768,096,014円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	339,906,498円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	25,774,945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
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	45,668,353,681円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	19,722,060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)	214,403,295円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,140,612,173
合計	4,140,612,173

(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12月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,220,257,700	-	2,171,130,000	49,127,700
合計		2,220,257,700	-	2,171,130,000	49,127,700

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,500	3,705.00	35,197,500	
ニッセイ	251,600	534.00	134,354,400	
マルハニチロ	38,900	2,437.00	94,799,300	
雪国まいたけ	21,400	993.00	21,250,200	
カネコ種苗	8,300	1,410.00	11,703,000	
サカタのタネ	31,800	4,340.00	138,012,000	
ホクト	22,400	1,869.00	41,865,600	
ホクリヨウ	3,600	674.00	2,426,400	
住石ホールディングス	39,100	393.00	15,366,300	
日鉄鉱業	10,100	2,999.00	30,289,900	
三井松島ホールディングス	11,400	3,070.00	34,998,000	
I N P E X	930,400	1,408.00	1,310,003,200	
石油資源開発	29,100	3,825.00	111,307,500	
K & O エナジーグループ	11,400	2,096.00	23,894,400	
ショーボンドホールディングス	34,300	5,730.00	196,539,000	
ミライト・ワン	87,200	1,511.00	131,759,200	
タマホーム	17,800	2,480.00	44,144,000	

サンヨーホームズ	3,000	707.00	2,121,000	
日本アクア	10,500	810.00	8,505,000	
ファーストコーポレーション	6,500	702.00	4,563,000	
ベストテラ	5,400	882.00	4,762,800	
Robot Home	42,800	168.00	7,190,400	
キャンディル	3,900	493.00	1,922,700	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	796.00	4,059,600	
第一カッター興業	6,400	1,030.00	6,592,000	
安藤・間	145,800	821.00	119,701,800	
東急建設	71,600	634.00	45,394,400	
コムシスホールディングス	85,100	2,358.00	200,665,800	
ビーアールホールディングス	39,900	329.00	13,127,100	
高松コンストラクショングループ	16,400	1,885.00	30,914,000	
東建コーポレーション	8,100	7,290.00	59,049,000	
ソネック	2,700	958.00	2,586,600	
ヤマウラ	12,700	997.00	12,661,900	
オリエンタル白石	90,400	281.00	25,402,400	
大成建設	175,200	4,175.00	731,460,000	
大林組	629,300	1,004.00	631,817,200	
清水建設	529,100	708.00	374,602,800	
飛鳥建設	19,400	998.00	19,361,200	
長谷工コーポレーション	181,600	1,489.00	270,402,400	
松井建設	16,400	560.00	9,184,000	
銭高組	2,200	2,610.00	5,742,000	
鹿島建設	390,200	1,503.00	586,470,600	
不動テトラ	12,200	1,446.00	17,641,200	
大末建設	6,400	1,161.00	7,430,400	
鉄建建設	12,600	1,754.00	22,100,400	
西松建設	29,800	3,910.00	116,518,000	
三井住友建設	141,900	414.00	58,746,600	
大豊建設	7,300	4,020.00	29,346,000	
佐田建設	11,200	443.00	4,961,600	
ナカノフドー建設	12,500	314.00	3,925,000	
奥村組	28,500	2,934.00	83,619,000	
東鉄工業	24,200	2,576.00	62,339,200	
イチケン	4,000	1,761.00	7,044,000	
富士ピー・エス	7,900	435.00	3,436,500	
浅沼組	14,100	2,947.00	41,552,700	
戸田建設	216,500	714.00	154,581,000	
熊谷組	30,500	2,562.00	78,141,000	
北野建設	3,300	2,464.00	8,131,200	
植木組	5,000	1,297.00	6,485,000	

矢作建設工業	23,900	749.00	17,901,100
ピーエス三菱	22,300	601.00	13,402,300
日本ハウスホールディングス	34,900	368.00	12,843,200
新日本建設	24,700	729.00	18,006,300
東亜道路工業	3,500	5,870.00	20,545,000
日本道路	3,500	5,790.00	20,265,000
東亜建設工業	15,100	2,307.00	34,835,700
日本国土開発	52,700	564.00	29,722,800
若築建設	7,800	2,864.00	22,339,200
東洋建設	57,000	841.00	47,937,000
五洋建設	249,500	622.00	155,189,000
世紀東急工業	23,200	768.00	17,817,600
福田組	6,600	4,600.00	30,360,000
住友林業	135,000	2,385.00	321,975,000
日本基礎技術	11,200	480.00	5,376,000
巴コーポレーション	19,700	395.00	7,781,500
大和ハウス工業	491,800	3,083.00	1,516,219,400
ライト工業	33,500	1,911.00	64,018,500
積水ハウス	551,300	2,385.00	1,314,850,500
日特建設	16,800	897.00	15,069,600
北陸電気工事	12,100	655.00	7,925,500
ユアテック	38,800	709.00	27,509,200
日本リーテック	11,600	763.00	8,850,800
四電工	7,400	1,700.00	12,580,000
中電工	27,300	2,059.00	56,210,700
関電工	96,400	865.00	83,386,000
きんでん	123,900	1,425.00	176,557,500
東京エネシス	17,500	902.00	15,785,000
トーエネック	5,800	3,385.00	19,633,000
住友電設	16,700	2,362.00	39,445,400
日本電設工業	28,900	1,516.00	43,812,400
エクシオグループ	86,200	2,155.00	185,761,000
新日本空調	9,800	1,848.00	18,110,400
九電工	42,800	3,210.00	137,388,000
三機工業	39,000	1,543.00	60,177,000
日揮ホールディングス	174,100	1,692.00	294,577,200
中外炉工業	5,800	1,598.00	9,268,400
ヤマト	14,600	679.00	9,913,400
太平電業	10,900	3,115.00	33,953,500
高砂熱学工業	42,400	1,761.00	74,666,400
三晃金属工業	2,200	2,962.00	6,516,400
朝日工業社	7,300	2,090.00	15,257,000

明星工業	30,300	737.00	22,331,100
大気社	21,200	3,415.00	72,398,000
ダイダン	11,600	2,186.00	25,357,600
日比谷総合設備	15,100	1,880.00	28,388,000
フィル・カンパニー	3,100	948.00	2,938,800
テスホールディングス	18,900	1,017.00	19,221,300
インフロニア・ホールディングス	184,400	1,009.00	186,059,600
東洋エンジニアリング	23,300	557.00	12,978,100
レイズネクスト	25,400	1,248.00	31,699,200
ニッポン	47,600	1,596.00	75,969,600
日清製粉グループ本社	163,400	1,540.00	251,636,000
日東富士製粉	3,100	4,360.00	13,516,000
昭和産業	15,400	2,416.00	37,206,400
鳥越製粉	14,200	619.00	8,789,800
中部飼料	24,500	1,022.00	25,039,000
フィード・ワン	25,800	676.00	17,440,800
東洋精糖	3,300	852.00	2,811,600
日本甜菜製糖	10,300	1,613.00	16,613,900
D M三井製糖ホールディングス	17,500	1,993.00	34,877,500
塩水港精糖	21,100	194.00	4,093,400
日新製糖	9,100	1,902.00	17,308,200
森永製菓	36,400	3,865.00	140,686,000
中村屋	4,400	3,090.00	13,596,000
江崎グリコ	50,500	3,675.00	185,587,500
名糖産業	7,000	1,602.00	11,214,000
井村屋グループ	9,700	2,224.00	21,572,800
不二家	12,100	2,584.00	31,266,400
山崎製パン	118,200	1,609.00	190,183,800
第一屋製パン	3,300	396.00	1,306,800
モロゾフ	5,700	3,475.00	19,807,500
亀田製菓	11,200	4,400.00	49,280,000
寿スピリッツ	18,800	7,290.00	137,052,000
カルビー	80,900	3,060.00	247,554,000
森永乳業	32,100	4,800.00	154,080,000
六甲バター	13,000	1,333.00	17,329,000
ヤクルト本社	126,200	8,830.00	1,114,346,000
明治ホールディングス	109,500	6,660.00	729,270,000
雪印メグミルク	42,700	1,758.00	75,066,600
プリマハム	23,700	2,095.00	49,651,500
日本ハム	69,100	3,635.00	251,178,500
林兼産業	5,400	434.00	2,343,600
丸大食品	17,800	1,406.00	25,026,800

S Foods	19,500	2,901.00	56,569,500
柿安本店	6,900	2,108.00	14,545,200
伊藤ハム米久ホールディングス	137,300	687.00	94,325,100
サッポロホールディングス	58,200	3,425.00	199,335,000
アサヒグループホールディングス	408,200	4,168.00	1,701,377,600
キリンホールディングス	797,200	2,059.50	1,641,833,400
宝ホールディングス	120,600	1,052.00	126,871,200
オエノンホールディングス	52,800	272.00	14,361,600
養命酒製造	5,800	1,794.00	10,405,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	138,400	1,444.00	199,849,600
サントリー食品インターナショナル	124,400	4,555.00	566,642,000
ダイトーグループホールディングス	10,000	4,805.00	48,050,000
伊藤園	65,800	4,905.00	322,749,000
キーコーヒー	19,800	2,054.00	40,669,200
ユニカフェ	5,900	968.00	5,711,200
ジャパンフーズ	2,800	1,080.00	3,024,000
日清オイリオグループ	24,900	3,210.00	79,929,000
不二製油グループ本社	41,100	2,045.00	84,049,500
かどや製油	2,100	3,510.00	7,371,000
J - オイルミルズ	18,000	1,502.00	27,036,000
キッコーマン	117,100	7,290.00	853,659,000
味の素	432,400	4,367.00	1,888,290,800
ブルドックソース	7,000	1,729.00	12,103,000
キューピー	94,900	2,438.00	231,366,200
ハウス食品グループ本社	54,100	2,754.00	148,991,400
カゴメ	82,300	3,055.00	251,426,500
焼津水産化学工業	7,900	830.00	6,557,000
アリアケジャパン	15,400	4,475.00	68,915,000
ピエトロ	2,600	1,817.00	4,724,200
エバラ食品工業	4,700	3,005.00	14,123,500
やまみ	1,700	1,344.00	2,284,800
ニチレイ	80,900	2,800.00	226,520,000
東洋水産	89,300	5,200.00	464,360,000
イトアンドホールディングス	7,500	2,267.00	17,002,500
大冷	2,200	1,875.00	4,125,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,200	568.00	6,361,600
日清食品ホールディングス	62,900	10,490.00	659,821,000
永谷園ホールディングス	8,700	2,001.00	17,408,700
一正蒲鉾	7,600	719.00	5,464,400
フジッコ	18,100	1,893.00	34,263,300
ロック・フィールド	21,600	1,496.00	32,313,600
日本たばこ産業	1,163,000	2,832.50	3,294,197,500

ケンコーマヨネーズ	12,200	1,485.00	18,117,000
わらべや日洋ホールディングス	13,000	1,878.00	24,414,000
なとり	11,100	2,025.00	22,477,500
イフジ産業	3,000	956.00	2,868,000
ファーマフーズ	27,300	1,438.00	39,257,400
ユーグレナ	113,800	987.00	112,320,600
紀文食品	13,800	950.00	13,110,000
ピクルスホールディングス	10,400	1,069.00	11,117,600
ミヨシ油脂	6,200	984.00	6,100,800
理研ビタミン	15,300	1,783.00	27,279,900
片倉工業	16,900	1,742.00	29,439,800
ゲンゼ	13,700	3,985.00	54,594,500
東洋紡	78,400	1,003.00	78,635,200
ユニチカ	57,000	243.00	13,851,000
富士紡ホールディングス	7,300	3,355.00	24,491,500
倉敷紡績	13,700	2,170.00	29,729,000
シキボウ	10,000	980.00	9,800,000
日本毛織	52,200	975.00	50,895,000
トーア紡コーポレーション	7,000	355.00	2,485,000
帝国繊維	20,700	1,626.00	33,658,200
帝人	173,200	1,310.00	226,892,000
東レ	1,205,100	754.60	909,368,460
住江織物	3,200	1,776.00	5,683,200
日本フェルト	11,600	405.00	4,698,000
イチカワ	2,800	1,308.00	3,662,400
日東製網	2,000	1,405.00	2,810,000
アツギ	11,000	393.00	4,323,000
ダイニック	4,600	607.00	2,792,200
セーレン	35,000	2,486.00	87,010,000
ソトー	5,900	827.00	4,879,300
東海染工	1,900	1,125.00	2,137,500
小松マテーレ	26,300	765.00	20,119,500
ワコールホールディングス	34,700	2,301.00	79,844,700
ホギメディカル	24,200	3,400.00	82,280,000
T S Iホールディングス	64,700	434.00	28,079,800
マツオカコーポレーション	5,100	1,063.00	5,421,300
ワールド	23,200	1,235.00	28,652,000
三陽商会	6,900	1,178.00	8,128,200
ナイガイ	6,700	282.00	1,889,400
オンワードホールディングス	117,200	306.00	35,863,200
ルックホールディングス	5,200	2,405.00	12,506,000
ゴールドウイン	31,900	9,330.00	297,627,000

デサント	31,000	2,986.00	92,566,000
キング	8,300	487.00	4,042,100
ヤマトインターナショナル	15,000	242.00	3,630,000
特種東海製紙	8,900	2,765.00	24,608,500
王子ホールディングス	748,700	534.00	399,805,800
日本製紙	93,600	952.00	89,107,200
三菱製紙	21,600	280.00	6,048,000
北越コーポレーション	113,600	770.00	87,472,000
中越パルプ工業	7,300	933.00	6,810,900
巴川製紙所	5,600	667.00	3,735,200
大王製紙	79,400	1,042.00	82,734,800
阿波製紙	4,300	300.00	1,290,000
レンゴー	163,700	908.00	148,639,600
トモク	10,400	1,598.00	16,619,200
ザ・パック	13,400	2,388.00	31,999,200
北の達人コーポレーション	75,700	267.00	20,211,900
クラレ	285,700	1,098.00	313,698,600
旭化成	1,122,300	965.40	1,083,468,420
共和レザー	10,400	490.00	5,096,000
昭和電工	173,700	2,131.00	370,154,700
住友化学	1,333,200	472.00	629,270,400
住友精化	7,500	4,140.00	31,050,000
日産化学	85,300	6,190.00	528,007,000
ラサ工業	6,900	1,895.00	13,075,500
クレハ	15,400	8,200.00	126,280,000
多木化学	7,000	4,690.00	32,830,000
テイカ	12,100	1,181.00	14,290,100
石原産業	32,500	1,061.00	34,482,500
片倉コープアグリ	3,700	1,532.00	5,668,400
日本曹達	19,300	4,235.00	81,735,500
東ソー	239,900	1,588.00	380,961,200
トクヤマ	58,000	1,838.00	106,604,000
セントラル硝子	28,800	3,045.00	87,696,000
東亜合成	92,400	1,113.00	102,841,200
大阪ソーダ	10,800	3,995.00	43,146,000
関東電化工業	34,800	928.00	32,294,400
デンカ	65,400	3,080.00	201,432,000
信越化学工業	307,500	16,920.00	5,202,900,000
日本カーバイド工業	6,800	1,259.00	8,561,200
堺化学工業	13,700	1,790.00	24,523,000
第一稀元素化学工業	16,400	1,044.00	17,121,600
エア・ウォーター	169,600	1,527.00	258,979,200

日本酸素ホールディングス	174,400	2,014.00	351,241,600
日本化学工業	6,000	1,749.00	10,494,000
東邦アセチレン	3,800	1,093.00	4,153,400
日本パーカラライジング	89,000	946.00	84,194,000
高压ガス工業	26,100	654.00	17,069,400
チタン工業	2,200	1,507.00	3,315,400
四国化成工業	21,300	1,305.00	27,796,500
戸田工業	4,100	2,529.00	10,368,900
ステラ ケミファ	10,600	2,501.00	26,510,600
保土谷化学工業	5,100	2,855.00	14,560,500
日本触媒	27,400	5,300.00	145,220,000
大日精化工業	12,500	1,695.00	21,187,500
カネカ	41,100	3,295.00	135,424,500
三菱瓦斯化学	134,200	1,860.00	249,612,000
三井化学	151,100	3,065.00	463,121,500
J S R	167,800	2,731.00	458,261,800
東京応化工業	31,400	6,450.00	202,530,000
大阪有機化学工業	13,500	1,961.00	26,473,500
三菱ケミカルグループ	1,212,800	695.70	843,744,960
K Hネオケム	29,900	2,653.00	79,324,700
ダイセル	264,200	977.00	258,123,400
住友ベークライト	26,600	4,035.00	107,331,000
積水化学工業	373,200	1,892.00	706,094,400
日本ゼオン	107,800	1,326.00	142,942,800
アイカ工業	45,400	3,215.00	145,961,000
U B E	92,600	1,946.00	180,199,600
積水樹脂	26,200	1,773.00	46,452,600
タキロンシーアイ	39,300	506.00	19,885,800
旭有機材	12,000	2,718.00	32,616,000
ニチバン	11,100	1,794.00	19,913,400
リケンテクノス	38,700	481.00	18,614,700
大倉工業	8,300	1,980.00	16,434,000
積水化成成品工業	25,200	391.00	9,853,200
群栄化学工業	4,200	2,332.00	9,794,400
タイガースポリマー	8,200	398.00	3,263,600
ミライアル	5,500	1,452.00	7,986,000
ダイキアクシス	6,600	702.00	4,633,200
ダイキョーニシカワ	39,700	560.00	22,232,000
竹本容器	6,100	749.00	4,568,900
森六ホールディングス	9,100	1,699.00	15,460,900
恵和	5,800	3,150.00	18,270,000
日本化薬	137,300	1,168.00	160,366,400

カーリットホールディングス	16,100	772.00	12,429,200
日本精化	10,200	2,279.00	23,245,800
扶桑化学工業	16,700	3,475.00	58,032,500
トリケミカル研究所	24,000	2,065.00	49,560,000
A D E K A	62,700	2,178.00	136,560,600
日油	55,600	5,410.00	300,796,000
新日本理化	24,800	242.00	6,001,600
ハリマ化成グループ	12,600	825.00	10,395,000
花王	437,600	5,301.00	2,319,717,600
第一工業製薬	6,500	1,869.00	12,148,500
石原ケミカル	8,200	1,230.00	10,086,000
日華化学	7,200	864.00	6,220,800
ニイタカ	3,600	2,144.00	7,718,400
三洋化成工業	11,100	4,030.00	44,733,000
有機合成薬品工業	13,300	288.00	3,830,400
大日本塗料	21,900	754.00	16,512,600
日本ペイントホールディングス	795,300	1,075.00	854,947,500
関西ペイント	164,600	1,665.00	274,059,000
神東塗料	15,000	123.00	1,845,000
中国塗料	33,300	979.00	32,600,700
日本特殊塗料	11,400	854.00	9,735,600
藤倉化成	24,100	407.00	9,808,700
太陽ホールディングス	27,300	2,344.00	63,991,200
D I C	70,200	2,402.00	168,620,400
サカタインクス	40,000	1,089.00	43,560,000
東洋インキＳＣホールディングス	35,200	1,871.00	65,859,200
T & K T O K A	16,000	1,089.00	17,424,000
富士フイルムホールディングス	345,300	6,822.00	2,355,636,600
資生堂	375,700	6,074.00	2,282,001,800
ライオン	215,900	1,482.00	319,963,800
高砂香料工業	12,200	2,591.00	31,610,200
マンダム	38,900	1,407.00	54,732,300
ミルボン	26,700	5,560.00	148,452,000
ファンケル	78,700	2,458.00	193,444,600
コーセー	36,600	13,980.00	511,668,000
コタ	15,100	1,674.00	25,277,400
シーボン	2,300	1,580.00	3,634,000
ポーラ・オルビスホールディングス	92,200	1,817.00	167,527,400
ノエビアホールディングス	16,000	5,780.00	92,480,000
アジュバンホールディングス	4,400	940.00	4,136,000
新日本製薬	10,300	1,332.00	13,719,600
エステー	13,900	1,509.00	20,975,100

アグロ カネショウ	7,200	1,674.00	12,052,800
コニシ	30,000	1,640.00	49,200,000
長谷川香料	37,300	2,963.00	110,519,900
星光PMC	9,200	528.00	4,857,600
小林製薬	55,100	8,340.00	459,534,000
荒川化学工業	15,200	983.00	14,941,600
メック	14,800	2,252.00	33,329,600
日本高純度化学	4,700	2,487.00	11,688,900
タカラバイオ	48,500	1,712.00	83,032,000
JCU	20,300	3,280.00	66,584,000
新田ゼラチン	11,100	906.00	10,056,600
OATアグリオ	7,400	1,570.00	11,618,000
デクセリアルズ	52,000	2,751.00	143,052,000
アース製薬	16,300	5,130.00	83,619,000
北興化学工業	18,100	824.00	14,914,400
大成ラミック	5,700	2,960.00	16,872,000
クミアイ化学工業	71,500	914.00	65,351,000
日本農薬	33,000	710.00	23,430,000
アキレス	11,700	1,258.00	14,718,600
有沢製作所	29,400	1,293.00	38,014,200
日東電工	130,600	7,890.00	1,030,434,000
レック	25,600	854.00	21,862,400
三光合成	24,700	435.00	10,744,500
きもと	26,500	224.00	5,936,000
藤森工業	14,200	3,120.00	44,304,000
前澤化成工業	11,600	1,362.00	15,799,200
未来工業	6,400	1,433.00	9,171,200
ウェーブロックホールディングス	5,400	637.00	3,439,800
JSP	12,600	1,479.00	18,635,400
エフピコ	34,000	3,520.00	119,680,000
天馬	15,300	2,049.00	31,349,700
信越ポリマー	33,300	1,164.00	38,761,200
東リ	40,400	221.00	8,928,400
ニフコ	64,900	3,290.00	213,521,000
バルカー	15,000	2,638.00	39,570,000
ユニ・チャーム	374,900	5,207.00	1,952,104,300
ショーエイコーポレーション	5,200	552.00	2,870,400
協和キリン	217,400	3,040.00	660,896,000
武田薬品工業	1,592,500	4,072.00	6,484,660,000
アステラス製薬	1,724,600	2,071.50	3,572,508,900
住友ファーマ	133,700	1,009.00	134,903,300
塩野義製薬	230,000	6,675.00	1,535,250,000

わかもと製薬	17,800	223.00	3,969,400
日本新薬	42,400	7,470.00	316,728,000
中外製薬	563,300	3,452.00	1,944,511,600
科研製薬	30,900	3,885.00	120,046,500
エーザイ	218,900	9,038.00	1,978,418,200
ロート製薬	87,200	4,485.00	391,092,000
小野薬品工業	347,200	3,357.00	1,165,550,400
久光製薬	40,000	3,785.00	151,400,000
持田製薬	21,600	3,400.00	73,440,000
参天製薬	338,800	1,098.00	372,002,400
扶桑薬品工業	5,800	1,998.00	11,588,400
日本ケミファ	1,900	1,675.00	3,182,500
ツムラ	56,700	2,960.00	167,832,000
キッセイ薬品工業	27,900	2,518.00	70,252,200
生化学工業	34,500	927.00	31,981,500
栄研化学	29,300	1,785.00	52,300,500
鳥居薬品	9,700	2,856.00	27,703,200
JCRファーマ	61,000	1,707.00	104,127,000
東和薬品	27,700	2,095.00	58,031,500
富士製薬工業	11,800	980.00	11,564,000
ゼリア新薬工業	25,000	2,256.00	56,400,000
第一三共	1,567,700	4,317.00	6,767,760,900
キョーリン製薬ホールディングス	39,100	1,719.00	67,212,900
大幸薬品	33,000	420.00	13,860,000
ダイト	13,600	2,473.00	33,632,800
大塚ホールディングス	411,800	4,450.00	1,832,510,000
大正製薬ホールディングス	40,000	5,730.00	229,200,000
ペプチドリーム	87,300	1,578.00	137,759,400
あすか製薬ホールディングス	18,600	1,240.00	23,064,000
サワイグループホールディングス	41,200	4,065.00	167,478,000
日本コークス工業	162,300	86.00	13,957,800
ニチレキ	21,300	1,249.00	26,603,700
ユシロ化学工業	9,300	781.00	7,263,300
ビーピー・カストロール	6,900	915.00	6,313,500
富士石油	36,700	256.00	9,395,200
MORESCO	5,900	1,132.00	6,678,800
出光興産	199,900	3,035.00	606,696,500
ENEOSホールディングス	3,251,100	444.80	1,446,089,280
コスモエネルギーホールディングス	68,300	3,570.00	243,831,000
横浜ゴム	102,400	2,114.00	216,473,600
TOYO TIRE	103,400	1,546.00	159,856,400
ブリヂストン	574,600	4,839.00	2,780,489,400

住友ゴム工業	176,500	1,176.00	207,564,000
藤倉コンポジット	12,700	825.00	10,477,500
オカモト	10,000	3,735.00	37,350,000
フコク	9,500	1,065.00	10,117,500
ニッタ	18,300	2,881.00	52,722,300
住友理工	34,900	597.00	20,835,300
三ツ星ベルト	26,300	3,425.00	90,077,500
バンドー化学	28,500	974.00	27,759,000
日東紡績	21,500	1,922.00	41,323,000
A G C	183,100	4,510.00	825,781,000
日本板硝子	91,700	602.00	55,203,400
石塚硝子	2,900	1,431.00	4,149,900
日本山村硝子	6,900	557.00	3,843,300
日本電気硝子	73,500	2,465.00	181,177,500
オハラ	8,600	1,056.00	9,081,600
住友大阪セメント	25,400	3,110.00	78,994,000
太平洋セメント	114,600	2,029.00	232,523,400
日本ヒューム	15,900	649.00	10,319,100
日本コンクリート工業	35,300	220.00	7,766,000
三谷セキサン	7,600	3,775.00	28,690,000
アジアパイルホールディングス	28,300	526.00	14,885,800
東海カーボン	151,000	1,096.00	165,496,000
日本カーボン	10,300	4,325.00	44,547,500
東洋炭素	11,300	3,810.00	43,053,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	3,975.00	35,775,000
T O T O	118,800	4,585.00	544,698,000
日本碍子	213,000	1,710.00	364,230,000
日本特殊陶業	137,000	2,513.00	344,281,000
M A R U W A	6,600	16,150.00	106,590,000
品川リフラクトリーズ	5,100	3,770.00	19,227,000
黒崎播磨	3,700	4,835.00	17,889,500
ヨータイ	12,100	1,385.00	16,758,500
東京窯業	16,900	264.00	4,461,600
ニッカトー	8,300	464.00	3,851,200
フジインコーポレーテッド	14,300	6,560.00	93,808,000
クニミネ工業	5,400	822.00	4,438,800
エーアンドエーマテリアル	3,400	867.00	2,947,800
ニチアス	45,500	2,366.00	107,653,000
ニチハ	22,600	2,637.00	59,596,200
日本製鉄	828,900	2,198.00	1,821,922,200
神戸製鋼所	372,400	624.00	232,377,600
中山製鋼所	38,200	750.00	28,650,000

合同製鐵	9,200	2,025.00	18,630,000
J F E ホールディングス	494,800	1,535.00	759,518,000
東京製鐵	52,100	1,204.00	62,728,400
共英製鋼	21,100	1,234.00	26,037,400
大和工業	30,500	4,495.00	137,097,500
東京鐵鋼	8,800	1,373.00	12,082,400
大阪製鐵	8,600	1,052.00	9,047,200
淀川製鋼所	21,100	2,496.00	52,665,600
丸一鋼管	56,400	2,745.00	154,818,000
モリ工業	4,200	2,777.00	11,663,400
大同特殊鋼	23,300	4,290.00	99,957,000
日本高周波鋼業	6,400	312.00	1,996,800
日本冶金工業	13,500	4,150.00	56,025,000
山陽特殊製鋼	18,300	2,129.00	38,960,700
愛知製鋼	10,700	2,122.00	22,705,400
日本金属	4,000	894.00	3,576,000
大平洋金属	13,200	1,910.00	25,212,000
新日本電工	118,400	365.00	43,216,000
栗本鐵工所	8,800	1,750.00	15,400,000
虹技	2,300	891.00	2,049,300
三菱製鋼	11,700	990.00	11,583,000
日亜鋼業	19,000	243.00	4,617,000
日本精線	2,500	4,220.00	10,550,000
エンビプロ・ホールディングス	12,800	724.00	9,267,200
シンニッタン	20,200	218.00	4,403,600
新家工業	4,000	2,186.00	8,744,000
大紀アルミニウム工業所	26,400	1,239.00	32,709,600
日本軽金属ホールディングス	50,000	1,497.00	74,850,000
三井金属鋁業	53,900	3,075.00	165,742,500
東邦亜鉛	11,000	2,066.00	22,726,000
三菱マテリアル	123,600	2,085.00	257,706,000
住友金属鋁山	214,700	4,588.00	985,043,600
D O W A ホールディングス	41,600	4,210.00	175,136,000
古河機械金属	27,200	1,301.00	35,387,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,200	4,075.00	110,840,000
東邦チタニウム	33,500	3,015.00	101,002,500
U A C J	26,000	2,156.00	56,056,000
C K サンエツ	4,500	3,980.00	17,910,000
古河電気工業	61,700	2,600.00	160,420,000
住友電気工業	639,300	1,537.50	982,923,750
フジクラ	198,600	1,063.00	211,111,800
昭和電線ホールディングス	20,800	1,751.00	36,420,800

東京特殊電線	2,500	5,630.00	14,075,000
タツタ電線	38,000	419.00	15,922,000
カナレ電気	2,900	1,464.00	4,245,600
平河ヒューテック	10,800	1,117.00	12,063,600
リョービ	19,800	1,202.00	23,799,600
アーレスティ	20,800	459.00	9,547,200
アサヒホールディングス	74,900	1,959.00	146,729,100
稲葉製作所	10,800	1,369.00	14,785,200
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,350.00	17,085,000
トーカロ	50,900	1,187.00	60,418,300
アルファC o	6,800	918.00	6,242,400
SUMCO	352,400	1,904.00	670,969,600
川田テクノロジーズ	4,400	3,305.00	14,542,000
RS Technologies	6,100	7,800.00	47,580,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	3,455.00	8,637,500
信和	10,200	781.00	7,966,200
東洋製罐グループホールディングス	122,500	1,606.00	196,735,000
ホッカンホールディングス	9,900	1,332.00	13,186,800
コロナ	10,300	867.00	8,930,100
横河ブリッジホールディングス	24,500	1,865.00	45,692,500
駒井ハルテック	3,000	1,512.00	4,536,000
高田機工	1,500	2,424.00	3,636,000
三和ホールディングス	170,500	1,223.00	208,521,500
文化シャッター	53,300	1,087.00	57,937,100
三協立山	25,400	535.00	13,589,000
アルインコ	14,100	994.00	14,015,400
東洋シャッター	4,200	501.00	2,104,200
LIXIL	269,700	2,019.00	544,524,300
日本フィルコン	12,000	450.00	5,400,000
ノーリツ	27,300	1,474.00	40,240,200
長府製作所	18,600	1,942.00	36,121,200
リンナイ	33,600	9,730.00	326,928,000
ダイニチ工業	9,200	656.00	6,035,200
日東精工	26,800	505.00	13,534,000
三洋工業	2,100	1,755.00	3,685,500
岡部	29,800	711.00	21,187,800
ジーテクト	20,600	1,450.00	29,870,000
東ブレ	32,600	1,159.00	37,783,400
高周波熱錬	30,200	677.00	20,445,400
東京製綱	10,900	827.00	9,014,300
サンコール	16,500	628.00	10,362,000
モリテック スチール	13,600	224.00	3,046,400

パイオラックス	25,500	1,669.00	42,559,500
エイチワン	19,100	623.00	11,899,300
日本発條	163,800	854.00	139,885,200
中央発條	10,300	700.00	7,210,000
アドバネクス	2,300	1,077.00	2,477,100
立川ブラインド工業	8,400	1,151.00	9,668,400
三益半導体工業	16,700	2,439.00	40,731,300
日本ドライケミカル	4,400	1,486.00	6,538,400
日本製鋼所	50,000	2,723.00	136,150,000
三浦工業	75,700	3,070.00	232,399,000
タクマ	55,800	1,244.00	69,415,200
ツガミ	40,400	1,188.00	47,995,200
オークマ	18,200	4,875.00	88,725,000
芝浦機械	20,200	2,558.00	51,671,600
アマダ	289,300	1,050.00	303,765,000
アイダエンジニアリング	37,500	801.00	30,037,500
TAKISAWA	4,900	1,070.00	5,243,000
FUJ I	78,800	1,978.00	155,866,400
牧野フライス製作所	20,100	4,485.00	90,148,500
オーエスジー	86,600	1,873.00	162,201,800
ダイジェット工業	2,000	822.00	1,644,000
旭ダイヤモンド工業	52,600	683.00	35,925,800
D M G 森精機	110,000	1,788.00	196,680,000
ソディック	50,100	726.00	36,372,600
ディスコ	29,100	39,150.00	1,139,265,000
日東工器	8,800	1,505.00	13,244,000
日進工具	15,200	1,047.00	15,914,400
パンチ工業	15,500	404.00	6,262,000
富士ダイス	8,600	572.00	4,919,200
豊和工業	10,100	969.00	9,786,900
ニデックオーケー	7,200	945.00	6,804,000
東洋機械金属	12,700	543.00	6,896,100
津田駒工業	3,300	601.00	1,983,300
エンシュウ	4,100	667.00	2,734,700
島精機製作所	28,900	1,917.00	55,401,300
オプトラン	26,800	2,374.00	63,623,200
N C ホールディングス	3,700	2,004.00	7,414,800
イワキポンプ	12,200	1,224.00	14,932,800
フリュー	19,100	1,140.00	21,774,000
ヤマシンフィルタ	43,400	473.00	20,528,200
日阪製作所	17,700	818.00	14,478,600
やまびこ	29,700	1,128.00	33,501,600

野村マイクロ・サイエンス	6,200	4,475.00	27,745,000
平田機工	8,700	5,510.00	47,937,000
ペガサスミシン製造	20,100	860.00	17,286,000
マルマエ	8,800	1,578.00	13,886,400
タツモ	10,000	1,654.00	16,540,000
ナブテスコ	113,800	3,315.00	377,247,000
三井海洋開発	22,800	1,346.00	30,688,800
レオン自動機	19,100	1,080.00	20,628,000
S M C	58,800	58,320.00	3,429,216,000
ホソカワミクロン	13,900	2,732.00	37,974,800
ユニオンツール	8,000	3,300.00	26,400,000
オイレス工業	25,400	1,463.00	37,160,200
日精エー・エス・ピー機械	8,300	4,480.00	37,184,000
サトーホールディングス	25,800	1,912.00	49,329,600
技研製作所	19,000	3,015.00	57,285,000
日本エアージェット	9,200	1,193.00	10,975,600
カワタ	5,300	820.00	4,346,000
日精樹脂工業	13,600	948.00	12,892,800
オカダアイヨン	5,600	1,497.00	8,383,200
ワイエイシイホールディングス	7,700	1,520.00	11,704,000
小松製作所	849,200	3,014.00	2,559,488,800
住友重機械工業	107,300	2,794.00	299,796,200
日立建機	72,200	3,025.00	218,405,000
日工	27,100	607.00	16,449,700
巴工業	7,800	2,393.00	18,665,400
井関農機	17,100	1,215.00	20,776,500
T O W A	18,500	1,791.00	33,133,500
丸山製作所	3,200	1,532.00	4,902,400
北川鉄工所	7,300	1,167.00	8,519,100
ローツェ	9,500	7,610.00	72,295,000
タカキタ	5,300	444.00	2,353,200
クボタ	959,000	1,900.50	1,822,579,500
荏原実業	9,100	2,295.00	20,884,500
三菱化工機	5,900	2,037.00	12,018,300
月島機械	24,700	962.00	23,761,400
帝国電機製作所	13,800	2,252.00	31,077,600
新東工業	36,900	653.00	24,095,700
澁谷工業	17,100	2,357.00	40,304,700
アイチ コーポレーション	25,900	776.00	20,098,400
小森コーポレーション	42,200	813.00	34,308,600
鶴見製作所	13,900	2,008.00	27,911,200
住友精密工業	2,600	3,645.00	9,477,000

日本ギア工業	6,400	306.00	1,958,400	
酒井重工業	3,000	3,415.00	10,245,000	
荏原製作所	74,200	4,895.00	363,209,000	
石井鐵工所	2,100	2,409.00	5,058,900	
西島製作所	15,700	1,439.00	22,592,300	
北越工業	18,300	1,266.00	23,167,800	
ダイキン工業	216,300	20,705.00	4,478,491,500	
オルガノ	24,900	3,035.00	75,571,500	
トーヨーカネツ	7,000	2,504.00	17,528,000	
栗田工業	101,400	5,650.00	572,910,000	
椿本チエイン	25,700	2,974.00	76,431,800	
大同工業	7,500	732.00	5,490,000	
木村化工機	14,100	699.00	9,855,900	
アネスト岩田	30,900	871.00	26,913,900	
ダイフク	93,500	6,450.00	603,075,000	
サムコ	6,000	3,700.00	22,200,000	
加藤製作所	8,700	712.00	6,194,400	
油研工業	2,800	1,790.00	5,012,000	
タダノ	95,800	940.00	90,052,000	
フジテック	66,400	3,140.00	208,496,000	
C K D	50,200	1,947.00	97,739,400	
平和	60,300	2,446.00	147,493,800	
理想科学工業	16,200	2,032.00	32,918,400	
S A N K Y O	35,600	5,310.00	189,036,000	
日本金銭機械	20,000	1,060.00	21,200,000	
マースグループホールディングス	10,700	2,260.00	24,182,000	
フクシマガリレイ	13,300	4,090.00	54,397,000	
オーイズミ	7,000	414.00	2,898,000	
ダイコク電機	10,000	1,968.00	19,680,000	
竹内製作所	32,900	2,944.00	96,857,600	
アマノ	51,500	2,418.00	124,527,000	
J U K I	28,200	670.00	18,894,000	
ジャノメ	18,500	588.00	10,878,000	
マックス	22,400	1,932.00	43,276,800	
グローリー	47,000	2,126.00	99,922,000	
新晃工業	18,300	1,418.00	25,949,400	
大和冷機工業	27,900	1,119.00	31,220,100	
セガサミーホールディングス	145,700	1,884.00	274,498,800	
日本ピストンリング	6,200	1,221.00	7,570,200	
リケン	7,200	2,234.00	16,084,800	
T P R	21,300	1,207.00	25,709,100	
ツバキ・ナカシマ	44,800	1,012.00	45,337,600	

ホシザキ	116,700	4,500.00	525,150,000
大豊工業	15,800	646.00	10,206,800
日本精工	333,000	707.00	235,431,000
N T N	357,300	274.00	97,900,200
ジェイテクト	161,300	934.00	150,654,200
不二越	13,400	3,665.00	49,111,000
日本トムソン	44,600	549.00	24,485,400
T H K	104,600	2,581.00	269,972,600
ユーシン精機	14,500	668.00	9,686,000
前澤給装工業	12,800	939.00	12,019,200
イーグル工業	20,100	1,055.00	21,205,500
前澤工業	11,800	604.00	7,127,200
日本ピラー工業	16,800	2,755.00	46,284,000
キッツ	66,800	801.00	53,506,800
マキタ	225,500	3,145.00	709,197,500
三井E & Sホールディングス	82,000	386.00	31,652,000
日立造船	148,700	830.00	123,421,000
三菱重工業	316,900	5,394.00	1,709,358,600
I H I	114,200	3,855.00	440,241,000
スター精密	34,300	1,673.00	57,383,900
日清紡ホールディングス	147,500	988.00	145,730,000
イビデン	104,000	4,835.00	502,840,000
コニカミノルタ	405,600	529.00	214,562,400
ブラザー工業	242,300	2,030.00	491,869,000
ミネベアミツミ	315,400	2,118.00	668,017,200
日立製作所	909,800	6,890.00	6,268,522,000
東芝	348,700	4,365.00	1,522,075,500
三菱電機	1,872,900	1,331.00	2,492,829,900
富士電機	110,200	5,250.00	578,550,000
東洋電機製造	6,500	846.00	5,499,000
安川電機	214,700	4,280.00	918,916,000
シンフォニアテクノロジー	20,000	1,452.00	29,040,000
明電舎	27,500	1,920.00	52,800,000
オリジン	4,000	1,220.00	4,880,000
山洋電気	7,900	5,730.00	45,267,000
デンヨー	13,800	1,480.00	20,424,000
P H Cホールディングス	25,500	1,481.00	37,765,500
ソシオネクスト	18,700	6,200.00	115,940,000
東芝テック	27,100	3,485.00	94,443,500
芝浦メカトロニクス	3,500	10,410.00	36,435,000
マブチモーター	45,100	3,865.00	174,311,500
日本電産	440,200	7,359.00	3,239,431,800

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,300	482.00	6,892,600
トレックス・セミコンダクター	8,700	2,702.00	23,507,400
東光高岳	11,200	1,793.00	20,081,600
ダブル・スコープ	59,200	1,439.00	85,188,800
ダイヘン	16,400	3,925.00	64,370,000
ヤーマン	35,600	1,341.00	47,739,600
JVCケンウッド	166,200	387.00	64,319,400
ミマキエンジニアリング	18,000	606.00	10,908,000
I - P E X	10,400	1,228.00	12,771,200
日新電機	43,400	1,266.00	54,944,400
大崎電気工業	43,000	535.00	23,005,000
オムロン	166,100	6,417.00	1,065,863,700
日東工業	24,400	2,312.00	56,412,800
I D E C	26,800	3,090.00	82,812,000
正興電機製作所	7,300	998.00	7,285,400
不二電機工業	4,000	1,116.00	4,464,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,700	2,052.00	122,504,400
サクサホールディングス	3,800	1,235.00	4,693,000
メルコホールディングス	5,000	3,010.00	15,050,000
テクノメディカ	4,700	1,685.00	7,919,500
日本電気	256,300	4,645.00	1,190,513,500
富士通	180,600	17,460.00	3,153,276,000
沖電気工業	81,900	705.00	57,739,500
岩崎通信機	7,900	782.00	6,177,800
電気興業	8,500	2,017.00	17,144,500
サンケン電気	16,800	6,610.00	111,048,000
ナカヨ	2,900	1,094.00	3,172,600
アイホン	11,000	1,830.00	20,130,000
ルネサスエレクトロニクス	1,182,800	1,218.00	1,440,650,400
セイコーエプソン	241,300	1,985.00	478,980,500
ワコム	144,300	602.00	86,868,600
アルバック	43,100	5,830.00	251,273,000
アクセル	7,100	1,491.00	10,586,100
E I Z O	13,300	3,340.00	44,422,000
日本信号	41,300	1,010.00	41,713,000
京三製作所	37,900	402.00	15,235,800
能美防災	24,800	1,552.00	38,489,600
ホーチキ	13,900	1,387.00	19,279,300
星和電機	8,300	445.00	3,693,500
エレコム	43,600	1,353.00	58,990,800
パナソニック ホールディングス	2,140,600	1,189.50	2,546,243,700
シャープ	218,200	956.00	208,599,200

アンリツ	127,600	1,351.00	172,387,600
富士通ゼネラル	51,400	3,080.00	158,312,000
ソニーグループ	1,269,200	10,350.00	13,136,220,000
T D K	287,000	4,535.00	1,301,545,000
帝国通信工業	8,500	1,363.00	11,585,500
タムラ製作所	77,800	751.00	58,427,800
アルプスアルパイン	162,200	1,239.00	200,965,800
池上通信機	5,700	531.00	3,026,700
日本電波工業	22,000	1,719.00	37,818,000
鈴木	11,100	861.00	9,557,100
メイコー	19,900	2,654.00	52,814,600
日本トリム	4,300	2,504.00	10,767,200
ローランド ディー . ジー .	10,300	2,917.00	30,045,100
フォスター電機	16,800	827.00	13,893,600
S M K	4,300	2,336.00	10,044,800
ヨコオ	14,600	2,218.00	32,382,800
ホシデン	43,700	1,553.00	67,866,100
ヒロセ電機	30,000	17,290.00	518,700,000
日本航空電子工業	37,200	2,128.00	79,161,600
T O A	20,900	773.00	16,155,700
マクセル	39,700	1,361.00	54,031,700
古野電気	24,000	995.00	23,880,000
スミダコーポレーション	16,900	1,416.00	23,930,400
アイコム	7,000	2,593.00	18,151,000
リオン	7,700	1,889.00	14,545,300
横河電機	198,300	2,307.00	457,478,100
新電元工業	6,900	3,015.00	20,803,500
アズビル	125,300	3,480.00	436,044,000
東亜ディーケーケー	9,000	820.00	7,380,000
日本光電工業	83,000	3,100.00	257,300,000
チノー	7,500	1,700.00	12,750,000
共和電業	16,900	355.00	5,999,500
日本電子材料	11,900	1,404.00	16,707,600
堀場製作所	40,000	6,000.00	240,000,000
アドバンテスト	141,400	9,110.00	1,288,154,000
小野測器	7,800	387.00	3,018,600
エスベック	14,600	1,879.00	27,433,400
キーエンス	179,500	53,370.00	9,579,915,000
日置電機	9,500	6,290.00	59,755,000
シスメックス	154,800	8,289.00	1,283,137,200
日本マイクロニクス	29,900	1,367.00	40,873,300
メガチップス	14,900	2,488.00	37,071,200

OBARA GROUP	8,500	3,435.00	29,197,500
澤藤電機	2,500	1,133.00	2,832,500
原田工業	8,500	832.00	7,072,000
コーセル	24,500	973.00	23,838,500
イリソ電子工業	16,600	4,205.00	69,803,000
オブテックスグループ	33,100	1,928.00	63,816,800
千代田インテグレ	7,500	2,320.00	17,400,000
レーザーテック	88,600	23,230.00	2,058,178,000
スタンレー電気	127,900	2,548.00	325,889,200
岩崎電気	6,000	2,324.00	13,944,000
ウシオ電機	94,000	1,692.00	159,048,000
岡谷電機産業	15,600	251.00	3,915,600
ハリオス テクノ ホールディング	17,600	421.00	7,409,600
エノモト	4,800	1,671.00	8,020,800
日本セラミック	18,500	2,511.00	46,453,500
遠藤照明	8,700	714.00	6,211,800
古河電池	13,600	1,116.00	15,177,600
双信電機	8,400	392.00	3,292,800
山一電機	15,900	1,675.00	26,632,500
図研	15,800	3,030.00	47,874,000
日本電子	45,100	3,780.00	170,478,000
カシオ計算機	133,700	1,293.00	172,874,100
ファナック	176,100	20,090.00	3,537,849,000
日本シイエムケイ	39,000	500.00	19,500,000
エンプラス	5,300	4,035.00	21,385,500
大真空	22,500	710.00	15,975,000
ローム	83,000	10,090.00	837,470,000
浜松ホトニクス	144,000	6,730.00	969,120,000
三井ハイテック	18,600	6,660.00	123,876,000
新光電気工業	63,600	3,470.00	220,692,000
京セラ	278,800	6,723.00	1,874,372,400
太陽誘電	87,500	4,000.00	350,000,000
村田製作所	544,200	6,946.00	3,780,013,200
双葉電子工業	35,000	539.00	18,865,000
北陸電気工業	7,100	1,239.00	8,796,900
ニチコン	37,000	1,273.00	47,101,000
日本ケミコン	18,000	1,640.00	29,520,000
K O A	27,400	1,962.00	53,758,800
市光工業	27,000	374.00	10,098,000
小糸製作所	216,000	2,005.00	433,080,000
ミツバ	33,600	476.00	15,993,600
S C R E E Nホールディングス	30,700	8,810.00	270,467,000

キヤノン電子	20,100	1,531.00	30,773,100
キヤノン	984,400	2,989.00	2,942,371,600
リコー	449,900	1,009.00	453,949,100
象印マホービン	53,900	1,622.00	87,425,800
MUTOHホールディングス	2,700	1,713.00	4,625,100
東京エレクトロン	126,600	41,590.00	5,265,294,000
イノテック	12,300	1,266.00	15,571,800
トヨタ紡織	75,600	1,782.00	134,719,200
芦森工業	3,300	1,135.00	3,745,500
ユニプレス	32,200	779.00	25,083,800
豊田自動織機	131,200	7,370.00	966,944,000
モリタホールディングス	31,500	1,130.00	35,595,000
三櫻工業	27,400	619.00	16,960,600
デンソー	370,100	6,905.00	2,555,540,500
東海理化電機製作所	50,600	1,418.00	71,750,800
川崎重工業	135,200	3,105.00	419,796,000
名村造船所	46,000	421.00	19,366,000
日本車輛製造	6,900	1,926.00	13,289,400
三菱ロジスネクスト	28,600	799.00	22,851,400
近畿車輛	2,500	1,053.00	2,632,500
日産自動車	2,548,800	428.00	1,090,886,400
いすゞ自動車	521,600	1,652.00	861,683,200
トヨタ自動車	9,852,100	1,845.00	18,177,124,500
日野自動車	231,300	540.00	124,902,000
三菱自動車工業	699,900	530.00	370,947,000
エフテック	12,400	507.00	6,286,800
レシップホールディングス	7,100	470.00	3,337,000
G M B	3,500	727.00	2,544,500
ファルテック	2,800	600.00	1,680,000
武蔵精密工業	43,800	1,620.00	70,956,000
日産車体	31,700	819.00	25,962,300
新明和工業	56,400	1,052.00	59,332,800
極東開発工業	31,500	1,370.00	43,155,000
トピー工業	14,500	1,600.00	23,200,000
ティラド	4,500	2,566.00	11,547,000
曙ブレーキ工業	109,500	155.00	16,972,500
タチエス	28,400	1,071.00	30,416,400
N O K	69,700	1,186.00	82,664,200
フタバ産業	48,100	343.00	16,498,300
K Y B	17,300	3,320.00	57,436,000
大同メタル工業	35,100	480.00	16,848,000
プレス工業	80,100	418.00	33,481,800

ミクニ	20,600	323.00	6,653,800
太平洋工業	41,100	1,039.00	42,702,900
河西工業	23,900	142.00	3,393,800
アイシン	138,400	3,575.00	494,780,000
マツダ	593,500	999.00	592,906,500
今仙電機製作所	11,300	651.00	7,356,300
本田技研工業	1,458,500	3,120.00	4,550,520,000
スズキ	329,500	4,470.00	1,472,865,000
S U B A R U	567,700	2,127.00	1,207,497,900
安永	7,800	669.00	5,218,200
ヤマハ発動機	282,000	3,130.00	882,660,000
T B K	17,800	242.00	4,307,600
エクセディ	29,300	1,595.00	46,733,500
豊田合成	52,400	2,058.00	107,839,200
愛三工業	29,600	692.00	20,483,200
盟和産業	2,500	912.00	2,280,000
日本プラスト	14,100	423.00	5,964,300
ヨロズ	16,800	703.00	11,810,400
エフ・シー・シー	31,800	1,347.00	42,834,600
シマノ	73,400	21,270.00	1,561,218,000
テイ・エス テック	82,100	1,563.00	128,322,300
ジャムコ	9,700	1,556.00	15,093,200
テルモ	560,600	3,785.00	2,121,871,000
クリエートメディック	5,900	889.00	5,245,100
日機装	44,900	990.00	44,451,000
日本エム・ディ・エム	10,700	983.00	10,518,100
島津製作所	218,500	3,830.00	836,855,000
J M S	16,700	509.00	8,500,300
長野計器	13,100	1,091.00	14,292,100
ブイ・テクノロジー	8,800	2,575.00	22,660,000
東京計器	13,800	1,322.00	18,243,600
愛知時計電機	7,000	1,324.00	9,268,000
インターアクション	10,800	1,504.00	16,243,200
オーバル	15,900	462.00	7,345,800
東京精密	39,400	4,430.00	174,542,000
マニー	78,900	2,090.00	164,901,000
ニコン	279,000	1,209.00	337,311,000
トプコン	94,500	1,496.00	141,372,000
オリンパス	1,121,600	2,443.50	2,740,629,600
理研計器	11,100	4,380.00	48,618,000
タムロン	13,400	3,320.00	44,488,000
H O Y A	387,600	13,125.00	5,087,250,000

シード	9,100	484.00	4,404,400
ノーリツ銅機	17,000	2,727.00	46,359,000
A & Dホロンホールディングス	26,200	1,016.00	26,619,200
朝日インテック	236,900	2,267.00	537,052,300
シチズン時計	197,300	581.00	114,631,300
リズム	5,600	1,670.00	9,352,000
大研医器	13,500	446.00	6,021,000
メニコン	61,600	2,836.00	174,697,600
シンシア	1,700	546.00	928,200
松風	8,100	2,312.00	18,727,200
セイコーグループ	27,800	2,946.00	81,898,800
ニプロ	149,600	1,018.00	152,292,800
K Y O R I T S U	26,600	120.00	3,192,000
中本パックス	5,400	1,551.00	8,375,400
スノーピーク	30,700	2,158.00	66,250,600
パラマウントベッドホールディングス	41,400	2,546.00	105,404,400
トランザクション	13,800	1,155.00	15,939,000
粧美堂	4,900	354.00	1,734,600
ニホンフラッシュ	16,800	872.00	14,649,600
前田工織	19,500	3,005.00	58,597,500
永大産業	19,100	220.00	4,202,000
アートネイチャー	18,500	742.00	13,727,000
バンダイナムコホールディングス	163,800	8,363.00	1,369,859,400
アイフィスジャパン	4,900	609.00	2,984,100
S H O E I	18,900	5,260.00	99,414,000
フランスベッドホールディングス	22,200	928.00	20,601,600
パイロットコーポレーション	28,100	4,685.00	131,648,500
萩原工業	12,000	1,190.00	14,280,000
フジシールインターナショナル	36,300	1,697.00	61,601,100
タカラトミー	82,900	1,242.00	102,961,800
広済堂ホールディングス	12,100	2,019.00	24,429,900
エステールホールディングス	4,200	631.00	2,650,200
タカノ	6,600	666.00	4,395,600
プロネクサス	14,900	936.00	13,946,400
ホクシン	13,700	149.00	2,041,300
ウッドワン	5,900	884.00	5,215,600
大建工業	10,900	2,131.00	23,227,900
凸版印刷	234,600	2,029.00	476,003,400
大日本印刷	212,900	2,687.00	572,062,300
共同印刷	5,100	2,732.00	13,933,200
N I S S H A	34,100	1,842.00	62,812,200
光村印刷	1,500	1,164.00	1,746,000

TAKARA & COMPANY	12,400	2,101.00	26,052,400
アシックス	165,600	2,849.00	471,794,400
ツツミ	4,000	1,911.00	7,644,000
ローランド	13,200	3,755.00	49,566,000
小松ウオール工業	6,600	1,804.00	11,906,400
ヤマハ	113,100	5,040.00	570,024,000
河合楽器製作所	4,800	2,533.00	12,158,400
クリナップ	20,100	644.00	12,944,400
ピジョン	114,300	2,159.00	246,773,700
兼松サステック	1,300	1,570.00	2,041,000
キングジム	15,800	880.00	13,904,000
リンテック	36,000	2,174.00	78,264,000
イトーキ	36,800	567.00	20,865,600
任天堂	1,132,800	5,541.00	6,276,844,800
三菱鉛筆	25,500	1,382.00	35,241,000
タカラスタANDARD	34,700	1,358.00	47,122,600
コクヨ	86,400	1,861.00	160,790,400
ナカバヤシ	19,300	483.00	9,321,900
グローブライド	14,500	2,562.00	37,149,000
オカムラ	54,000	1,351.00	72,954,000
美津濃	17,800	2,765.00	49,217,000
東京電力ホールディングス	1,617,400	499.00	807,082,600
中部電力	661,200	1,305.00	862,866,000
関西電力	692,800	1,174.00	813,347,200
中国電力	285,700	630.00	179,991,000
北陸電力	169,400	531.00	89,951,400
東北電力	438,600	663.00	290,791,800
四国電力	153,200	726.00	111,223,200
九州電力	413,600	695.00	287,452,000
北海道電力	173,300	439.00	76,078,700
沖縄電力	42,000	1,003.00	42,126,000
電源開発	135,100	2,105.00	284,385,500
エフオン	13,100	499.00	6,536,900
イーレックス	31,800	2,328.00	74,030,400
レノバ	47,700	2,516.00	120,013,200
東京瓦斯	379,300	2,574.00	976,318,200
大阪瓦斯	363,500	2,101.00	763,713,500
東邦瓦斯	70,600	2,526.00	178,335,600
北海道瓦斯	10,700	1,615.00	17,280,500
広島ガス	37,800	337.00	12,738,600
西部ガスホールディングス	16,800	1,663.00	27,938,400
静岡ガス	40,900	1,081.00	44,212,900

メタウォーター	22,400	1,683.00	37,699,200
SBSホールディングス	16,000	2,900.00	46,400,000
東武鉄道	197,100	3,130.00	616,923,000
相鉄ホールディングス	59,300	2,155.00	127,791,500
東急	503,100	1,659.00	834,642,900
京浜急行電鉄	203,500	1,338.00	272,283,000
小田急電鉄	272,000	1,701.00	462,672,000
京王電鉄	94,900	4,865.00	461,688,500
京成電鉄	115,700	3,760.00	435,032,000
富士急行	22,100	4,785.00	105,748,500
東日本旅客鉄道	304,300	7,537.00	2,293,509,100
西日本旅客鉄道	229,200	5,647.00	1,294,292,400
東海旅客鉄道	138,200	16,010.00	2,212,582,000
西武ホールディングス	217,000	1,398.00	303,366,000
鴻池運輸	30,600	1,549.00	47,399,400
西日本鉄道	47,900	2,534.00	121,378,600
ハマキョウレックス	14,000	3,230.00	45,220,000
サカイ引越センター	8,500	4,440.00	37,740,000
近鉄グループホールディングス	179,100	4,420.00	791,622,000
阪急阪神ホールディングス	238,900	3,970.00	948,433,000
南海電気鉄道	85,600	2,825.00	241,820,000
京阪ホールディングス	74,000	3,410.00	252,340,000
神戸電鉄	4,900	3,165.00	15,508,500
名古屋鉄道	198,000	2,182.00	432,036,000
山陽電気鉄道	13,500	2,104.00	28,404,000
アルプス物流	14,300	1,117.00	15,973,100
ヤマトホールディングス	229,400	2,205.00	505,827,000
山九	45,600	4,885.00	222,756,000
丸運	8,700	213.00	1,853,100
丸全昭和運輸	11,100	3,035.00	33,688,500
センコーグループホールディングス	94,900	966.00	91,673,400
トナミホールディングス	3,900	3,610.00	14,079,000
ニッコンホールディングス	57,300	2,352.00	134,769,600
日本石油輸送	1,800	2,190.00	3,942,000
福山通運	15,000	3,195.00	47,925,000
セイノーホールディングス	111,500	1,190.00	132,685,000
エスライン	5,000	831.00	4,155,000
神奈川中央交通	5,100	3,250.00	16,575,000
AZ-COM丸和ホールディングス	43,200	1,517.00	65,534,400
C&Fロジホールディングス	17,200	1,170.00	20,124,000
九州旅客鉄道	126,700	2,894.00	366,669,800
SGホールディングス	343,700	1,974.00	678,463,800

NIPPON EXPRESSホールディングス	66,900	7,820.00	523,158,000
日本郵船	479,800	3,143.00	1,508,011,400
商船三井	316,300	3,325.00	1,051,697,500
川崎汽船	153,300	2,725.00	417,742,500
NSユニテッド海運	10,100	3,780.00	38,178,000
飯野海運	67,600	923.00	62,394,800
共栄タンカー	5,100	923.00	4,707,300
乾汽船	23,700	1,938.00	45,930,600
日本航空	440,000	2,652.00	1,166,880,000
ANAホールディングス	487,400	2,819.50	1,374,224,300
パスコ	3,500	1,328.00	4,648,000
トランコム	5,200	7,570.00	39,364,000
日新	13,600	2,044.00	27,798,400
三菱倉庫	38,500	3,120.00	120,120,000
三井倉庫ホールディングス	16,700	3,600.00	60,120,000
住友倉庫	49,200	1,966.00	96,727,200
澁澤倉庫	7,100	2,048.00	14,540,800
東陽倉庫	23,700	248.00	5,877,600
日本トランスシティ	36,000	506.00	18,216,000
ケイヒン	3,200	1,463.00	4,681,600
中央倉庫	8,600	932.00	8,015,200
川西倉庫	3,000	989.00	2,967,000
安田倉庫	12,200	914.00	11,150,800
ファイズホールディングス	3,300	866.00	2,857,800
東洋埠頭	5,100	1,279.00	6,522,900
上組	89,100	2,728.00	243,064,800
サンリツ	4,000	709.00	2,836,000
キムラユニティー	8,500	754.00	6,409,000
キューソー流通システム	10,700	957.00	10,239,900
東海運	10,500	277.00	2,908,500
エーアイティー	11,200	1,408.00	15,769,600
内外トランスライン	6,500	2,210.00	14,365,000
日本コンセプト	5,600	1,581.00	8,853,600
NEC ネットズエスアイ	60,300	1,600.00	96,480,000
クロスキャット	10,400	1,394.00	14,497,600
システナ	303,100	404.00	122,452,400
デジタルアーツ	11,400	5,700.00	64,980,000
日鉄ソリューションズ	30,800	3,160.00	97,328,000
キューブシステム	10,900	1,054.00	11,488,600
コア	8,100	1,422.00	11,518,200
手間いらず	3,100	4,715.00	14,616,500
ラクーンホールディングス	18,100	1,075.00	19,457,500

ソリトンシステムズ	9,500	1,009.00	9,585,500
ソフトクリエイトホールディングス	7,500	3,090.00	23,175,000
T I S	202,300	3,540.00	716,142,000
J N Sホールディングス	8,800	320.00	2,816,000
グリー	96,800	686.00	66,404,800
G M Oペパボ	2,700	1,856.00	5,011,200
コーエーテクモホールディングス	112,800	2,259.00	254,815,200
三菱総合研究所	8,900	4,730.00	42,097,000
電算	2,300	1,586.00	3,647,800
A G S	7,900	670.00	5,293,000
ファインデックス	14,700	498.00	7,320,600
ブレインパッド	18,200	784.00	14,268,800
K L a b	35,400	406.00	14,372,400
ポルトゥウィンホールディングス	31,000	811.00	25,141,000
ネクソン	465,000	2,871.00	1,335,015,000
アイスタイル	57,900	553.00	32,018,700
エムアップホールディングス	22,200	1,256.00	27,883,200
エイチーム	13,500	769.00	10,381,500
エニグモ	23,200	606.00	14,059,200
テクノスジャパン	15,200	461.00	7,007,200
コロプラ	70,100	635.00	44,513,500
ブロードリーフ	105,600	418.00	44,140,800
クロス・マーケティンググループ	7,500	693.00	5,197,500
デジタルハーツホールディングス	11,300	1,793.00	20,260,900
システム情報	16,100	860.00	13,846,000
メディアドゥ	7,400	1,713.00	12,676,200
じげん	53,100	364.00	19,328,400
ブイキューブ	21,900	745.00	16,315,500
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	497.00	2,286,200
サイバーリンクス	6,000	940.00	5,640,000
フィックスターズ	20,500	1,222.00	25,051,000
C A R T A H O L D I N G S	8,800	1,562.00	13,745,600
オブティム	15,000	1,041.00	15,615,000
セレス	7,400	870.00	6,438,000
S H I F T	13,200	24,810.00	327,492,000
ティーガイア	18,900	1,683.00	31,808,700
セック	2,600	2,746.00	7,139,600
テクマトリックス	33,000	1,666.00	54,978,000
プロシップ	8,000	1,482.00	11,856,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	55,200	2,106.00	116,251,200
G M Oペイメントゲートウェイ	41,100	11,370.00	467,307,000
ザッパラス	7,200	362.00	2,606,400

システムリサーチ	5,700	2,096.00	11,947,200
インターネットイニシアティブ	100,500	2,409.00	242,104,500
さくらインターネット	20,600	496.00	10,217,600
ヴィンクス	5,500	1,519.00	8,354,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,600	3,740.00	20,944,000
SRAホールディングス	9,300	3,000.00	27,900,000
システムインテグレータ	5,800	441.00	2,557,800
朝日ネット	19,700	562.00	11,071,400
eBASE	25,700	561.00	14,417,700
アバントグループ	22,900	1,346.00	30,823,400
アドソル日進	7,700	1,382.00	10,641,400
ODKソリューションズ	4,300	598.00	2,571,400
フリービット	11,200	992.00	11,110,400
コムチュア	23,900	2,494.00	59,606,600
サイバーコム	3,100	1,416.00	4,389,600
アステリア	14,400	716.00	10,310,400
アイル	10,200	1,827.00	18,635,400
マークライنز	9,800	2,511.00	24,607,800
メディカル・データ・ビジョン	27,100	914.00	24,769,400
gumi	29,700	712.00	21,146,400
ショーケース	4,800	335.00	1,608,000
モバイルファクトリー	4,000	868.00	3,472,000
テラスカイ	7,800	2,571.00	20,053,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,500	1,889.00	17,945,500
PCIホールディングス	7,700	966.00	7,438,200
アイビーシー	3,300	408.00	1,346,400
ネオジャパン	6,200	982.00	6,088,400
PR TIMES	4,600	2,396.00	11,021,600
ラクス	85,200	1,589.00	135,382,800
ランドコンピュータ	4,600	904.00	4,158,400
ダブルスタンダード	7,400	2,045.00	15,133,000
オープンドア	12,700	1,718.00	21,818,600
マイネット	6,300	381.00	2,400,300
アカツキ	8,600	2,167.00	18,636,200
ベネフィットジャパン	1,300	1,227.00	1,595,100
Ubicomホールディングス	5,700	2,038.00	11,616,600
カナミックネットワーク	26,200	569.00	14,907,800
ノムラシステムコーポレーション	18,700	118.00	2,206,600
チェンジ	44,200	2,347.00	103,737,400
シンクロ・フード	11,900	417.00	4,962,300
オークネット	9,500	1,787.00	16,976,500
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	573.00	2,177,400

セグエグループ	5,200	810.00	4,212,000	
エイトレッド	2,900	1,368.00	3,967,200	
マクロミル	41,000	1,039.00	42,599,000	
ビーグリー	3,200	1,184.00	3,788,800	
オロ	5,500	1,783.00	9,806,500	
ユーザーローカル	6,600	1,378.00	9,094,800	
テモナ	4,200	263.00	1,104,600	
ニーズウェル	5,800	771.00	4,471,800	
マネーフォワード	43,400	4,120.00	178,808,000	
サインポスト	6,900	671.00	4,629,900	
電算システムホールディングス	8,800	2,168.00	19,078,400	
ソルクシーズ	15,200	369.00	5,608,800	
フェイス	5,400	510.00	2,754,000	
プロトコーポレーション	22,700	1,221.00	27,716,700	
ハイマックス	5,800	1,393.00	8,079,400	
野村総合研究所	369,200	3,115.00	1,150,058,000	
サイバネットシステム	15,300	902.00	13,800,600	
C Eホールディングス	9,600	547.00	5,251,200	
日本システム技術	7,600	1,547.00	11,757,200	
インテージホールディングス	24,600	1,392.00	34,243,200	
東邦システムサイエンス	5,200	999.00	5,194,800	
ソースネクスト	92,300	276.00	25,474,800	
インフォコム	23,300	1,966.00	45,807,800	
シンプレクス・ホールディングス	30,200	2,100.00	63,420,000	
HEROZ	6,200	971.00	6,020,200	
ラクスル	25,400	3,300.00	83,820,000	
メルカリ	81,000	2,668.00	216,108,000	
I P S	5,900	2,769.00	16,337,100	
F I G	21,300	419.00	8,924,700	
システムサポート	7,800	1,343.00	10,475,400	
イーソル	11,800	813.00	9,593,400	
アルテリア・ネットワークス	17,000	1,234.00	20,978,000	
東海ソフト	3,200	924.00	2,956,800	
ウイングアーク1st	18,600	2,100.00	39,060,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,900	1,546.00	7,575,400	
サーバーワークス	3,700	2,440.00	9,028,000	
東名	1,500	1,510.00	2,265,000	
ヴィッツ	2,000	979.00	1,958,000	
トピラシステムズ	4,700	852.00	4,004,400	
S a n s a n	67,300	1,457.00	98,056,100	
L i n k - U	3,700	847.00	3,133,900	
ギフティ	19,400	2,110.00	40,934,000	

ベース	6,200	3,420.00	21,204,000
J M D C	29,500	4,325.00	127,587,500
フォーカスシステムズ	13,300	976.00	12,980,800
クレスコ	14,000	1,722.00	24,108,000
フジ・メディア・ホールディングス	173,100	1,054.00	182,447,400
オービック	60,200	19,880.00	1,196,776,000
ジャストシステム	25,900	2,864.00	74,177,600
T D C ソフト	15,300	1,469.00	22,475,700
Zホールディングス	2,561,500	340.60	872,446,900
トレンドマイクロ	104,000	6,180.00	642,720,000
I Dホールディングス	12,400	896.00	11,110,400
日本オラクル	34,500	7,890.00	272,205,000
アルファシステムズ	5,700	3,970.00	22,629,000
フューチャー	44,900	1,618.00	72,648,200
C A C H o l d i n g s	11,200	1,459.00	16,340,800
S Bテクノロジー	7,800	1,893.00	14,765,400
トーセ	5,000	738.00	3,690,000
オービックビジネスコンサルタント	35,500	4,235.00	150,342,500
伊藤忠テクノソリューションズ	96,700	3,085.00	298,319,500
アイティフォー	24,000	833.00	19,992,000
東計電算	2,500	5,510.00	13,775,000
エクスネット	2,700	995.00	2,686,500
大塚商会	102,000	4,190.00	427,380,000
サイボウズ	24,900	2,326.00	57,917,400
電通国際情報サービス	21,900	3,980.00	87,162,000
A C C E S S	21,500	842.00	18,103,000
デジタルガレージ	32,000	4,085.00	130,720,000
E Mシステムズ	30,300	799.00	24,209,700
ウェザーニューズ	6,400	7,040.00	45,056,000
C I J	16,700	904.00	15,096,800
ビジネスエンジニアリング	3,900	2,360.00	9,204,000
日本エンタープライズ	20,200	132.00	2,666,400
WOWOW	10,300	1,204.00	12,401,200
スカラ	18,100	728.00	13,176,800
インテリジェント ウェイブ	9,800	687.00	6,732,600
WOW WORLD GROUP	3,400	1,088.00	3,699,200
I M A G I C A G R O U P	15,300	652.00	9,975,600
ネットワンシステムズ	67,100	3,335.00	223,778,500
システムソフト	64,900	94.00	6,100,600
アルゴグラフィックス	16,600	3,825.00	63,495,000
マーベラス	29,600	657.00	19,447,200
エイベックス	30,700	1,577.00	48,413,900

B I P R O G Y	66,300	3,300.00	218,790,000
兼松エレクトロニクス	11,600	4,215.00	48,894,000
都築電気	9,700	1,260.00	12,222,000
T B S ホールディングス	92,300	1,505.00	138,911,500
日本テレビホールディングス	159,500	1,027.00	163,806,500
朝日放送グループホールディングス	17,200	621.00	10,681,200
テレビ朝日ホールディングス	43,900	1,312.00	57,596,800
スカパーJ S A Tホールディングス	160,100	471.00	75,407,100
テレビ東京ホールディングス	13,100	1,769.00	23,173,900
日本BS放送	6,700	896.00	6,003,200
ビジョン	23,800	1,280.00	30,464,000
スマートバリュー	4,800	469.00	2,251,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,200	2,024.00	32,788,800
ワイヤレスゲート	8,600	264.00	2,270,400
コネクシオ	12,200	1,206.00	14,713,200
クロップス	3,100	971.00	3,010,100
日本電信電話	2,305,900	3,727.00	8,594,089,300
K D D I	1,390,600	3,989.00	5,547,103,400
ソフトバンク	2,891,000	1,484.00	4,290,244,000
光通信	21,200	17,290.00	366,548,000
エムティーアイ	16,900	508.00	8,585,200
G M O インターネットグループ	66,900	2,373.00	158,753,700
ファイバーゲート	9,900	872.00	8,632,800
アйдママーケティングコミュニケーション	4,900	274.00	1,342,600
K A D O K A W A	95,200	2,465.00	234,668,000
学研ホールディングス	30,200	922.00	27,844,400
ゼンリン	31,000	815.00	25,265,000
昭文社ホールディングス	8,500	286.00	2,431,000
インプレスホールディングス	16,900	206.00	3,481,400
アイネット	11,100	1,257.00	13,952,700
松竹	10,300	11,680.00	120,304,000
東宝	112,700	5,070.00	571,389,000
東映	5,000	18,420.00	92,100,000
エヌ・ティ・ティ・データ	564,700	1,917.00	1,082,529,900
ピー・シー・エー	11,000	1,241.00	13,651,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	1,797.00	14,016,600
D T S	39,200	3,070.00	120,344,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	90,500	6,020.00	544,810,000
シーイーシー	25,400	1,543.00	39,192,200
カブコン	178,900	4,185.00	748,696,500
アイ・エス・ビー	9,300	1,274.00	11,848,200
ジャステック	11,200	1,173.00	13,137,600

S C S K	147,000	2,014.00	296,058,000
N S W	7,100	2,080.00	14,768,000
アイネス	12,800	1,337.00	17,113,600
T K C	32,300	3,580.00	115,634,000
富士ソフト	20,400	7,510.00	153,204,000
N S D	64,300	2,331.00	149,883,300
コナミグループ	77,100	5,760.00	444,096,000
福井コンピュータホールディングス	12,600	2,711.00	34,158,600
J B C Cホールディングス	13,200	1,874.00	24,736,800
ミロク情報サービス	16,500	1,408.00	23,232,000
ソフトバンクグループ	1,040,500	5,726.00	5,957,903,000
高千穂交易	6,800	2,131.00	14,490,800
オルパヘルスケアホールディングス	3,100	1,554.00	4,817,400
伊藤忠食品	4,300	4,905.00	21,091,500
エレマテック	17,100	1,512.00	25,855,200
あらた	14,500	3,955.00	57,347,500
トーメンデバイス	2,700	5,540.00	14,958,000
東京エレクトロン デバイス	7,000	6,900.00	48,300,000
円谷フィールズホールディングス	16,300	2,570.00	41,891,000
双日	201,500	2,486.00	500,929,000
アルフレッサ ホールディングス	190,600	1,666.00	317,539,600
横浜冷凍	51,700	1,059.00	54,750,300
ラサ商事	8,700	1,036.00	9,013,200
アルコニックス	25,000	1,299.00	32,475,000
神戸物産	146,900	3,630.00	533,247,000
ハイパー	3,700	533.00	1,972,100
あい ホールディングス	30,400	2,117.00	64,356,800
ディーブイエックス	5,300	1,013.00	5,368,900
ダイワボウホールディングス	77,600	1,937.00	150,311,200
マクニカホールディングス	46,500	3,385.00	157,402,500
ラクト・ジャパン	7,300	2,099.00	15,322,700
グリムス	7,900	1,908.00	15,073,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,800	840.00	23,352,000
八洲電機	15,400	1,007.00	15,507,800
メディアスホールディングス	12,200	700.00	8,540,000
レスターホールディングス	18,200	2,054.00	37,382,800
ジュテックホールディングス	4,400	1,125.00	4,950,000
大光	8,200	665.00	5,453,000
O C H Iホールディングス	4,400	1,206.00	5,306,400
T O K A Iホールディングス	93,800	856.00	80,292,800
黒谷	5,300	573.00	3,036,900
C o m i n i x	3,800	725.00	2,755,000

三洋貿易	19,500	1,081.00	21,079,500
ビューティガレージ	3,400	3,080.00	10,472,000
ウイン・パートナーズ	13,900	974.00	13,538,600
ミタチ産業	4,800	1,114.00	5,347,200
シップヘルスケアホールディングス	68,200	2,634.00	179,638,800
明治電機工業	7,100	1,032.00	7,327,200
デリカフーズホールディングス	7,500	475.00	3,562,500
スターティアホールディングス	3,800	951.00	3,613,800
コメダホールディングス	46,500	2,457.00	114,250,500
ピーバンドットコム	2,800	522.00	1,461,600
アセンテック	6,400	449.00	2,873,600
富士興産	4,300	1,123.00	4,828,900
協栄産業	1,800	1,722.00	3,099,600
フルサト・マルカホールディングス	18,900	3,390.00	64,071,000
ヤマエグループホールディングス	10,800	1,388.00	14,990,400
小野建	17,500	1,438.00	25,165,000
南陽	3,600	1,883.00	6,778,800
佐島電機	12,000	1,313.00	15,756,000
エコートレーディング	3,700	634.00	2,345,800
伯東	10,900	4,085.00	44,526,500
コンドーテック	14,600	972.00	14,191,200
中山福	10,200	321.00	3,274,200
ナガイレーベン	24,000	2,020.00	48,480,000
三菱食品	17,500	3,125.00	54,687,500
松田産業	14,500	2,270.00	32,915,000
第一興商	36,700	3,890.00	142,763,000
メディバルホールディングス	196,900	1,752.00	344,968,800
S P K	8,400	1,383.00	11,617,200
萩原電気ホールディングス	7,300	2,427.00	17,717,100
アズワン	27,800	5,530.00	153,734,000
スズデン	6,700	2,215.00	14,840,500
尾家産業	4,500	893.00	4,018,500
シモジマ	13,100	915.00	11,986,500
ドウシシャ	20,100	1,555.00	31,255,500
小津産業	4,200	1,466.00	6,157,200
高速	9,900	1,686.00	16,691,400
たけびし	7,300	1,530.00	11,169,000
リックス	3,900	2,133.00	8,318,700
丸文	17,000	935.00	15,895,000
ハピネット	16,200	1,884.00	30,520,800
橋本総業ホールディングス	7,500	996.00	7,470,000
日本ライフライン	55,700	911.00	50,742,700

タカショー	16,600	696.00	11,553,600
I D O M	57,400	683.00	39,204,200
進和	12,600	1,951.00	24,582,600
エスケイジャパン	4,700	509.00	2,392,300
ダイترون	7,500	2,358.00	17,685,000
シークス	27,100	1,309.00	35,473,900
田中商事	5,400	564.00	3,045,600
オーハシテクニカ	9,500	1,385.00	13,157,500
白銅	6,900	2,417.00	16,677,300
ダイコー通産	2,300	1,054.00	2,424,200
伊藤忠商事	1,169,700	4,187.00	4,897,533,900
丸紅	1,498,700	1,532.00	2,296,008,400
高島	3,000	2,818.00	8,454,000
長瀬産業	89,300	2,004.00	178,957,200
蝶理	10,200	2,077.00	21,185,400
豊田通商	166,300	5,110.00	849,793,000
三共生興	27,300	463.00	12,639,900
兼松	73,700	1,501.00	110,623,700
ツカモトコーポレーション	2,700	1,398.00	3,774,600
三井物産	1,389,000	3,926.00	5,453,214,000
日本紙パルプ商事	10,100	4,900.00	49,490,000
カメイ	20,200	1,183.00	23,896,600
東都水産	1,000	5,260.00	5,260,000
O U Gホールディングス	2,800	2,390.00	6,692,000
スターゼン	14,400	2,058.00	29,635,200
山善	51,200	998.00	51,097,600
椿本興業	3,100	3,805.00	11,795,500
住友商事	1,175,700	2,230.50	2,622,398,850
内田洋行	8,400	4,320.00	36,288,000
三菱商事	1,186,900	4,330.00	5,139,277,000
第一実業	6,700	4,320.00	28,944,000
キャノンマーケティングジャパン	44,000	3,015.00	132,660,000
西華産業	7,500	1,563.00	11,722,500
佐藤商事	13,200	1,189.00	15,694,800
菱洋エレクトロ	16,200	2,327.00	37,697,400
東京産業	17,400	751.00	13,067,400
ユアサ商事	17,100	3,520.00	60,192,000
神鋼商事	4,800	4,540.00	21,792,000
トルク	10,300	205.00	2,111,500
阪和興業	34,100	3,685.00	125,658,500
正栄食品工業	12,600	3,780.00	47,628,000
カナデン	15,400	1,098.00	16,909,200

菱電商事	15,300	1,655.00	25,321,500
岩谷産業	43,200	5,730.00	247,536,000
ナイス	5,200	1,360.00	7,072,000
ニチモウ	2,100	2,785.00	5,848,500
極東貿易	11,400	1,340.00	15,276,000
アステナホールディングス	32,900	430.00	14,147,000
三愛オブリ	52,400	1,246.00	65,290,400
稲畑産業	38,300	2,341.00	89,660,300
G S I クレオス	11,000	1,414.00	15,554,000
明和産業	25,300	670.00	16,951,000
クワザワホールディングス	6,200	405.00	2,511,000
ワキタ	34,900	1,181.00	41,216,900
東邦ホールディングス	47,300	2,132.00	100,843,600
サンゲツ	47,700	2,097.00	100,026,900
ミツウロコグループホールディングス	24,500	1,121.00	27,464,500
シナネンホールディングス	6,100	3,685.00	22,478,500
伊藤忠エネクス	47,100	1,013.00	47,712,300
サンリオ	53,800	4,420.00	237,796,000
サンワテクノス	9,700	1,525.00	14,792,500
リョーサン	20,100	2,875.00	57,787,500
新光商事	25,500	1,205.00	30,727,500
トーホー	8,200	1,686.00	13,825,200
三信電気	7,700	2,271.00	17,486,700
東陽テクニカ	21,000	1,335.00	28,035,000
モスフードサービス	27,900	3,070.00	85,653,000
加賀電子	15,400	4,080.00	62,832,000
ソーダニッカ	13,900	668.00	9,285,200
立花エレテック	13,900	1,762.00	24,491,800
フォーバル	7,500	943.00	7,072,500
P A L T A C	29,900	4,330.00	129,467,000
三谷産業	33,300	309.00	10,289,700
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,800	3,500.00	16,800,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,525.00	2,592,500
コア商事ホールディングス	13,400	592.00	7,932,800
K P P グループホールディングス	44,300	785.00	34,775,500
ヤマタネ	8,400	1,645.00	13,818,000
丸紅建材リース	1,700	1,719.00	2,922,300
日鉄物産	13,000	5,020.00	65,260,000
泉州電業	9,500	3,195.00	30,352,500
トラスコ中山	39,900	2,076.00	82,832,400
オートバックスセブン	66,100	1,424.00	94,126,400
モリト	13,600	741.00	10,077,600

加藤産業	23,100	3,410.00	78,771,000
北恵	4,300	630.00	2,709,000
イエローハット	33,500	1,759.00	58,926,500
J Kホールディングス	15,000	997.00	14,955,000
日伝	11,300	1,711.00	19,334,300
北沢産業	10,300	191.00	1,967,300
杉本商事	8,400	1,950.00	16,380,000
因幡電機産業	49,200	2,708.00	133,233,600
東テク	6,300	3,105.00	19,561,500
ミスミグループ本社	286,400	3,070.00	879,248,000
アルテック	10,700	302.00	3,231,400
タキヒヨー	4,600	835.00	3,841,000
蔵王産業	3,100	1,700.00	5,270,000
スズケン	60,300	3,650.00	220,095,000
ジェコス	12,300	788.00	9,692,400
グローセル	20,800	426.00	8,860,800
ローソン	47,200	4,920.00	232,224,000
サンエー	14,600	4,270.00	62,342,000
カワチ薬品	15,000	2,156.00	32,340,000
エービーシー・マート	27,700	7,130.00	197,501,000
ハードオフコーポレーション	7,800	1,328.00	10,358,400
アスクル	46,000	1,609.00	74,014,000
ゲオホールディングス	20,100	1,932.00	38,833,200
アダストリア	23,100	1,923.00	44,421,300
くら寿司	22,300	3,115.00	69,464,500
キャンドウ	6,900	2,163.00	14,924,700
I Kホールディングス	6,800	400.00	2,720,000
パルグループホールディングス	18,800	2,197.00	41,303,600
エディオン	75,400	1,265.00	95,381,000
サーラコーポレーション	40,300	707.00	28,492,100
ワッツ	9,700	697.00	6,760,900
ハローズ	8,700	2,913.00	25,343,100
フジオフードグループ本社	15,800	1,388.00	21,930,400
あみやき亭	4,700	2,889.00	13,578,300
大黒天物産	6,900	5,050.00	34,845,000
ハニーズホールディングス	17,100	1,272.00	21,751,200
ファーマライズホールディングス	4,600	654.00	3,008,400
アルペン	15,800	1,991.00	31,457,800
ハブ	6,700	586.00	3,926,200
クオールホールディングス	26,400	1,160.00	30,624,000
ジーンズホールディングス	11,300	4,440.00	50,172,000
ビックカメラ	126,500	1,256.00	158,884,000

D C Mホールディングス	116,200	1,166.00	135,489,200
M o n o t a R O	269,300	1,877.00	505,476,100
東京一番フーズ	5,000	485.00	2,425,000
きちりホールディングス	5,100	606.00	3,090,600
アークランドサービスホールディングス	15,700	2,210.00	34,697,000
J . フロント リテイリング	236,300	1,135.00	268,200,500
ドトール・日レスホールディングス	33,900	1,692.00	57,358,800
マツキヨココカラ&カンパニー	115,200	5,990.00	690,048,000
ブロンコピリー	10,200	2,497.00	25,469,400
Z O Z O	125,600	3,175.00	398,780,000
トレジャー・ファクトリー	5,800	2,433.00	14,111,400
物語コーポレーション	10,600	6,250.00	66,250,000
三越伊勢丹ホールディングス	319,700	1,311.00	419,126,700
H a m e e	8,000	691.00	5,528,000
マーケットエンタープライズ	2,300	958.00	2,203,400
ウエルシアホールディングス	98,600	3,005.00	296,293,000
クリエイティブSDホールディングス	31,500	3,230.00	101,745,000
丸善C H Iホールディングス	23,400	324.00	7,581,600
ミサワ	4,000	613.00	2,452,000
ティーライフ	2,800	1,289.00	3,609,200
チムニー	5,800	1,107.00	6,420,600
シュッピン	14,400	1,217.00	17,524,800
オイシックス・ラ・大地	25,700	1,960.00	50,372,000
ネクステージ	43,500	2,549.00	110,881,500
ジョイフル本田	61,200	1,851.00	113,281,200
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,080.00	14,976,000
ホットランド	14,700	1,444.00	21,226,800
すかいらーくホールディングス	259,700	1,584.00	411,364,800
S F Pホールディングス	10,400	1,732.00	18,012,800
綿半ホールディングス	14,900	1,313.00	19,563,700
ヨシックスホールディングス	3,900	2,063.00	8,045,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62,100	1,128.00	70,048,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,800	1,543.00	13,578,400
B E E N O S	10,900	2,303.00	25,102,700
あさひ	16,100	1,347.00	21,686,700
日本調剤	13,200	1,174.00	15,496,800
コスモス薬品	21,500	13,670.00	293,905,000
トーエル	8,800	725.00	6,380,000
セブン&アイ・ホールディングス	654,300	5,585.00	3,654,265,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	142,800	911.00	130,090,800
ツルハホールディングス	46,500	9,140.00	425,010,000

サンマルクホールディングス	15,500	1,672.00	25,916,000
フェリシモ	4,600	1,001.00	4,604,600
トリドールホールディングス	47,300	2,706.00	127,993,800
TOKYO BASE	20,600	256.00	5,273,600
ウイルプラスホールディングス	3,900	1,045.00	4,075,500
JMホールディングス	16,300	1,694.00	27,612,200
サツドラホールディングス	9,100	702.00	6,388,200
アレンザホールディングス	14,500	985.00	14,282,500
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,701.00	8,845,200
パロックジャパンリミテッド	12,700	808.00	10,261,600
クスリのアオキホールディングス	19,100	8,210.00	156,811,000
力の源ホールディングス	10,700	865.00	9,255,500
FOOD & LIFE COMPANIES	109,200	2,666.00	291,127,200
メディカルシステムネットワーク	17,300	402.00	6,954,600
はるやまホールディングス	8,700	432.00	3,758,400
ノジマ	62,200	1,347.00	83,783,400
カップ・クリエイト	29,800	1,376.00	41,004,800
ライトオン	14,300	597.00	8,537,100
良品計画	245,100	1,460.00	357,846,000
パリミキホールディングス	24,900	263.00	6,548,700
アドヴァングループ	18,400	843.00	15,511,200
アルビス	6,400	2,345.00	15,008,000
コナカ	20,700	332.00	6,872,400
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,637.00	4,092,500
G-7ホールディングス	23,900	1,505.00	35,969,500
イオン北海道	28,300	1,124.00	31,809,200
コジマ	37,100	602.00	22,334,200
ヒマラヤ	6,300	926.00	5,833,800
コーナン商事	25,700	3,295.00	84,681,500
エコス	7,200	1,801.00	12,967,200
ワタミ	22,900	996.00	22,808,400
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	425,800	2,266.00	964,862,800
西松屋チェーン	42,300	1,434.00	60,658,200
ゼンショーホールディングス	104,000	3,345.00	347,880,000
幸楽苑ホールディングス	12,400	1,001.00	12,412,400
ハークスレイ	7,200	804.00	5,788,800
サイゼリヤ	31,700	2,940.00	93,198,000
VTホールディングス	72,700	496.00	36,059,200
魚力	6,000	2,097.00	12,582,000
フジ・コーポレーション	11,000	1,288.00	14,168,000
ユナイテッドアローズ	20,400	1,753.00	35,761,200

ハイデイ日高	28,300	1,933.00	54,703,900
YU-WA Creation Holdings	12,900	200.00	2,580,000
コロワイド	87,500	1,742.00	152,425,000
ピーシーデポコーポレーション	22,400	270.00	6,048,000
壱番屋	15,100	4,580.00	69,158,000
PLANT	4,900	628.00	3,077,200
スギホールディングス	38,300	6,120.00	234,396,000
薬王堂ホールディングス	10,700	2,644.00	28,290,800
スクロール	28,600	708.00	20,248,800
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,706.00	28,149,000
木曽路	28,900	2,086.00	60,285,400
SRSホールディングス	31,700	861.00	27,293,700
千趣会	35,700	397.00	14,172,900
リテールパートナーズ	28,400	1,264.00	35,897,600
ケーヨー	30,900	890.00	27,501,000
上新電機	17,100	1,912.00	32,695,200
日本瓦斯	101,900	2,146.00	218,677,400
ロイヤルホールディングス	36,800	2,386.00	87,804,800
いなげや	18,700	1,173.00	21,935,100
チヨダ	18,600	753.00	14,005,800
ライフコーポレーション	16,700	2,555.00	42,668,500
リンガーハット	24,500	2,202.00	53,949,000
MrMaxHD	27,100	654.00	17,723,400
AOKIホールディングス	35,800	654.00	23,413,200
オークワ	30,600	912.00	27,907,200
コメリ	29,300	2,643.00	77,439,900
青山商事	40,900	873.00	35,705,700
しまむら	22,300	12,620.00	281,426,000
はせがわ	10,000	327.00	3,270,000
高島屋	143,300	1,682.00	241,030,600
松屋	32,400	998.00	32,335,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	92,600	1,165.00	107,879,000
近鉄百貨店	6,200	2,457.00	15,233,400
丸井グループ	140,100	2,178.00	305,137,800
アクシアル リテイリング	13,000	3,305.00	42,965,000
イオン	643,600	2,786.00	1,793,069,600
イズミ	28,900	2,907.00	84,012,300
平和堂	31,800	2,074.00	65,953,200
フジ	29,300	1,801.00	52,769,300
ヤオコー	21,500	6,790.00	145,985,000
ゼビオホールディングス	26,100	914.00	23,855,400
ケースホールディングス	151,300	1,112.00	168,245,600

Olympicグループ	7,700	510.00	3,927,000
日産東京販売ホールディングス	25,300	287.00	7,261,100
シルバーライフ	4,600	1,815.00	8,349,000
Genky DrugStores	9,400	3,425.00	32,195,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	864.00	2,937,600
ブックオフグループホールディングス	11,400	1,315.00	14,991,000
ギフトホールディングス	4,100	3,885.00	15,928,500
アインホールディングス	26,200	5,970.00	156,414,000
元気寿司	6,100	3,075.00	18,757,500
ヤマダホールディングス	779,100	469.00	365,397,900
アークランズ	28,000	1,493.00	41,804,000
ニトリホールディングス	76,800	15,935.00	1,223,808,000
グルメ杵屋	15,700	989.00	15,527,300
愛眼	14,000	169.00	2,366,000
ケーユーホールディングス	11,400	1,264.00	14,409,600
吉野家ホールディングス	74,400	2,310.00	171,864,000
松屋フーズホールディングス	9,000	3,935.00	35,415,000
サガミホールディングス	30,800	1,191.00	36,682,800
関西フードマーケット	17,400	1,233.00	21,454,200
王将フードサービス	12,600	5,980.00	75,348,000
ミニストップ	14,000	1,421.00	19,894,000
アークス	35,000	2,131.00	74,585,000
パローホールディングス	36,400	1,770.00	64,428,000
ベルク	9,500	5,640.00	53,580,000
大庄	10,600	1,031.00	10,928,600
ファーストリテイリング	28,500	79,200.00	2,257,200,000
サンドラッグ	72,100	3,715.00	267,851,500
サックスパーホールディングス	18,500	722.00	13,357,000
ヤマザワ	3,700	1,279.00	4,732,300
やまや	4,100	2,457.00	10,073,700
ベルーナ	46,200	673.00	31,092,600
いよぎんホールディングス	210,300	712.00	149,733,600
しずおかフィナンシャルグループ	399,300	1,011.00	403,692,300
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	148,800	964.00	143,443,200
島根銀行	6,100	464.00	2,830,400
じもとホールディングス	11,700	409.00	4,785,300
めぶきフィナンシャルグループ	876,900	323.00	283,238,700
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,600	2,444.00	55,234,400
九州フィナンシャルグループ	310,900	428.00	133,065,200
ゆうちょ銀行	503,200	1,118.00	562,577,600
富山第一銀行	44,000	591.00	26,004,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	973,900	526.00	512,271,400

西日本フィナンシャルホールディングス	111,900	893.00	99,926,700
三十三フィナンシャルグループ	15,800	1,500.00	23,700,000
第四北越フィナンシャルグループ	27,700	2,658.00	73,626,600
ひろぎんホールディングス	230,500	642.00	147,981,000
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,163.00	36,338,400
十六フィナンシャルグループ	22,900	2,732.00	62,562,800
北國フィナンシャルホールディングス	14,900	4,630.00	68,987,000
プロクレアホールディングス	21,600	2,145.00	46,332,000
あいちフィナンシャルグループ	24,700	2,208.00	54,537,600
新生銀行	52,100	2,258.00	117,641,800
あおぞら銀行	111,100	2,627.00	291,859,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,585,300	818.40	9,481,409,520
りそなホールディングス	2,255,400	692.50	1,561,864,500
三井住友トラスト・ホールディングス	327,000	4,439.00	1,451,553,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,291,300	4,974.00	6,422,926,200
千葉銀行	492,500	914.00	450,145,000
群馬銀行	342,900	476.00	163,220,400
武蔵野銀行	22,700	1,963.00	44,560,100
千葉興業銀行	41,300	431.00	17,800,300
筑波銀行	77,500	218.00	16,895,000
七十七銀行	56,600	2,030.00	114,898,000
秋田銀行	11,800	1,839.00	21,700,200
山形銀行	19,600	1,180.00	23,128,000
岩手銀行	12,100	1,955.00	23,655,500
東邦銀行	139,800	215.00	30,057,000
東北銀行	8,600	1,013.00	8,711,800
ふくおかフィナンシャルグループ	141,100	2,849.00	401,993,900
スルガ銀行	155,800	428.00	66,682,400
八十二銀行	362,500	526.00	190,675,000
山梨中央銀行	18,100	1,084.00	19,620,400
大垣共立銀行	33,700	1,800.00	60,660,000
福井銀行	15,800	1,455.00	22,989,000
清水銀行	7,000	1,523.00	10,661,000
富山銀行	2,700	1,726.00	4,660,200
滋賀銀行	29,400	2,653.00	77,998,200
南都銀行	26,600	2,396.00	63,733,600
百五銀行	166,200	354.00	58,834,800
京都銀行	56,000	5,620.00	314,720,000
紀陽銀行	63,200	1,454.00	91,892,800
ほくほくフィナンシャルグループ	112,300	914.00	102,642,200
山陰合同銀行	110,600	747.00	82,618,200
鳥取銀行	5,700	1,116.00	6,361,200

百十四銀行	16,100	1,790.00	28,819,000
四国銀行	28,100	933.00	26,217,300
阿波銀行	26,100	2,040.00	53,244,000
大分銀行	10,600	1,942.00	20,585,200
宮崎銀行	11,500	2,342.00	26,933,000
佐賀銀行	10,300	1,614.00	16,624,200
琉球銀行	40,500	840.00	34,020,000
セブン銀行	633,000	264.00	167,112,000
みずほフィナンシャルグループ	2,555,600	1,767.00	4,515,745,200
高知銀行	6,000	694.00	4,164,000
山口フィナンシャルグループ	195,100	831.00	162,128,100
長野銀行	5,500	1,286.00	7,073,000
名古屋銀行	11,600	3,220.00	37,352,000
北洋銀行	267,800	242.00	64,807,600
大光銀行	5,300	1,175.00	6,227,500
愛媛銀行	23,800	876.00	20,848,800
トマト銀行	5,800	1,010.00	5,858,000
京葉銀行	82,100	561.00	46,058,100
栃木銀行	80,900	302.00	24,431,800
北日本銀行	6,200	1,968.00	12,201,600
東和銀行	32,400	544.00	17,625,600
福島銀行	18,600	225.00	4,185,000
大東銀行	6,900	645.00	4,450,500
トモニホールディングス	142,800	352.00	50,265,600
フィデアホールディングス	18,300	1,365.00	24,979,500
池田泉州ホールディングス	226,300	237.00	53,633,100
F P G	71,900	1,119.00	80,456,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	1,189.00	17,359,400
マーキュリアホールディングス	10,800	575.00	6,210,000
S B I ホールディングス	255,900	2,605.00	666,619,500
ジャフコ グループ	59,100	2,310.00	136,521,000
大和証券グループ本社	1,264,000	585.00	739,440,000
野村ホールディングス	3,254,900	476.20	1,549,983,380
岡三証券グループ	155,800	384.00	59,827,200
丸三証券	59,400	400.00	23,760,000
東洋証券	59,500	277.00	16,481,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	193,000	351.00	67,743,000
光世証券	4,700	365.00	1,715,500
水戸証券	48,500	211.00	10,233,500
いちよし証券	32,900	614.00	20,200,600
松井証券	104,700	772.00	80,828,400
マネックスグループ	198,000	402.00	79,596,000

極東証券	22,400	583.00	13,059,200
岩井コスモホールディングス	20,300	1,265.00	25,679,500
アイザワ証券グループ	25,900	706.00	18,285,400
マネーパートナーズグループ	19,200	274.00	5,260,800
スパークス・グループ	19,800	1,678.00	33,224,400
かんぽ生命保険	214,500	2,311.00	495,709,500
S O M P Oホールディングス	303,300	5,761.00	1,747,311,300
アニコム ホールディングス	60,000	590.00	35,400,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	398,400	4,108.00	1,636,627,200
第一生命ホールディングス	899,600	2,885.50	2,595,795,800
東京海上ホールディングス	1,779,400	2,891.50	5,145,135,100
T & Dホールディングス	474,200	1,789.00	848,343,800
アドバンスクリエイト	10,200	1,034.00	10,546,800
全国保証	46,300	4,990.00	231,037,000
あんしん保証	11,300	255.00	2,881,500
イントラスト	7,700	782.00	6,021,400
日本モーゲージサービス	10,600	860.00	9,116,000
C a s a	7,500	848.00	6,360,000
アルヒ	24,100	1,001.00	24,124,100
プレミアグループ	30,000	1,700.00	51,000,000
ネットプロテクションズホールディングス	59,800	489.00	29,242,200
クレディセゾン	112,400	1,699.00	190,967,600
芙蓉総合リース	16,300	8,460.00	137,898,000
みずほリース	26,500	3,275.00	86,787,500
東京センチュリー	33,200	4,495.00	149,234,000
日本証券金融	71,500	1,076.00	76,934,000
アイフル	294,300	399.00	117,425,700
リコーリース	17,000	3,640.00	61,880,000
イオンフィナンシャルサービス	101,900	1,414.00	144,086,600
アコム	317,500	314.00	99,695,000
ジャックス	19,000	4,135.00	78,565,000
オリエントコーポレーション	46,700	1,145.00	53,471,500
オリックス	1,182,300	2,139.50	2,529,530,850
三菱H C キャピタル	690,000	647.00	446,430,000
九州リースサービス	9,200	667.00	6,136,400
日本取引所グループ	496,900	1,825.00	906,842,500
イー・ギャランティ	28,800	2,212.00	63,705,600
アサックス	9,100	616.00	5,605,600
N E C キャピタルソリューション	9,000	2,055.00	18,495,000
大東建託	64,900	13,750.00	892,375,000
いちご	209,400	292.00	61,144,800
日本駐車場開発	218,200	290.00	63,278,000

スター・マイカ・ホールディングス	18,500	672.00	12,432,000
SREホールディングス	9,100	3,790.00	34,489,000
ADワークスグループ	44,500	148.00	6,586,000
ヒューリック	413,800	1,093.00	452,283,400
三栄建築設計	9,700	1,499.00	14,540,300
野村不動産ホールディングス	111,000	2,982.00	331,002,000
三重交通グループホールディングス	41,600	481.00	20,009,600
サムティ	28,900	2,157.00	62,337,300
ディア・ライフ	30,100	614.00	18,481,400
地主	14,400	1,920.00	27,648,000
プレサンスコーポレーション	24,400	1,480.00	36,112,000
ハウスコム	4,500	1,058.00	4,761,000
JPMC	10,700	1,010.00	10,807,000
サンセイランディック	7,300	842.00	6,146,600
フージャースホールディングス	27,200	727.00	19,774,400
オープンハウスグループ	65,000	5,170.00	336,050,000
東急不動産ホールディングス	533,900	664.00	354,509,600
飯田グループホールディングス	155,700	2,047.00	318,717,900
イーランド	3,900	1,514.00	5,904,600
ムゲンエステート	15,500	519.00	8,044,500
And Doホールディングス	10,500	825.00	8,662,500
シーアールイー	9,400	1,211.00	11,383,400
ケイアイスター不動産	8,900	4,535.00	40,361,500
グッドコムアセット	18,800	819.00	15,397,200
ジェイ・エス・ビー	4,800	3,785.00	18,168,000
ロードスターキャピタル	8,600	1,567.00	13,476,200
テンポイノベーション	7,200	955.00	6,876,000
フェイスネットワーク	3,700	1,322.00	4,891,400
パーク24	138,600	2,122.00	294,109,200
パラカ	7,200	1,836.00	13,219,200
三井不動産	768,700	2,441.50	1,876,781,050
三菱地所	1,121,300	1,712.50	1,920,226,250
平和不動産	29,200	3,855.00	112,566,000
東京建物	169,400	1,742.00	295,094,800
京阪神ビルディング	23,900	1,235.00	29,516,500
住友不動産	320,000	3,187.00	1,019,840,000
テーオーシー	34,700	665.00	23,075,500
東京楽天地	3,500	4,085.00	14,297,500
スターツコーポレーション	26,000	2,613.00	67,938,000
フジ住宅	27,600	643.00	17,746,800
空港施設	24,800	510.00	12,648,000
明和地所	12,000	688.00	8,256,000

ゴールドクレスト	17,900	1,689.00	30,233,100
エスリード	9,300	1,812.00	16,851,600
日神グループホールディングス	32,500	436.00	14,170,000
日本エスコン	39,700	818.00	32,474,600
M I R A R T Hホールディングス	89,300	368.00	32,862,400
A V A N T I A	11,300	783.00	8,847,900
イオンモール	92,700	1,685.00	156,199,500
毎日コムネット	9,100	669.00	6,087,900
ファースト住建	9,000	1,000.00	9,000,000
カチタス	48,100	2,937.00	141,269,700
トーセイ	30,700	1,352.00	41,506,400
穴吹興産	5,100	1,930.00	9,843,000
サンフロンティア不動産	31,100	1,095.00	34,054,500
F Jネクストホールディングス	20,500	948.00	19,434,000
インテリックス	4,300	514.00	2,210,200
ランドビジネス	6,500	222.00	1,443,000
サンネクスタグループ	7,700	954.00	7,345,800
グランディハウス	18,200	540.00	9,828,000
日本空港ビルデング	62,800	6,230.00	391,244,000
明豊ファシリティワークス	9,700	688.00	6,673,600
日本工営	13,200	3,250.00	42,900,000
L I F U L L	64,600	223.00	14,405,800
M I X I	42,100	2,380.00	100,198,000
ジェイエシーリクルートメント	16,800	2,484.00	41,731,200
日本M & Aセンターホールディングス	316,500	1,611.00	509,881,500
メンバーズ	5,500	1,991.00	10,950,500
中広	3,500	375.00	1,312,500
UTグループ	27,200	2,207.00	60,030,400
アイティメディア	7,200	1,622.00	11,678,400
E・Jホールディングス	12,100	1,283.00	15,524,300
夢真ビーネックスグループ	67,600	1,782.00	120,463,200
コシダカホールディングス	55,500	1,057.00	58,663,500
アルトナー	4,800	975.00	4,680,000
パソナグループ	22,600	1,845.00	41,697,000
C D S	4,800	1,788.00	8,582,400
リンクアンドモチベーション	53,100	641.00	34,037,100
エス・エム・エス	70,300	3,210.00	225,663,000
サニーサイドアップグループ	7,000	559.00	3,913,000
パーソルホールディングス	206,600	2,872.00	593,355,200
リニカル	11,000	688.00	7,568,000
クックパッド	52,200	194.00	10,126,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,600	636.00	6,105,600

学情	8,600	1,362.00	11,713,200
スタジオアリス	9,400	2,036.00	19,138,400
シミックホールディングス	10,400	1,677.00	17,440,800
エプロ	4,400	717.00	3,154,800
N J S	4,200	2,011.00	8,446,200
総合警備保障	68,600	3,455.00	237,013,000
カカクコム	137,900	2,057.00	283,660,300
アイロムグループ	6,800	2,404.00	16,347,200
セントケア・ホールディング	12,200	821.00	10,016,200
サイネックス	3,800	530.00	2,014,000
ルネサンス	13,300	861.00	11,451,300
ディップ	32,400	3,730.00	120,852,000
デジタルホールディングス	14,700	1,212.00	17,816,400
新日本科学	19,700	2,218.00	43,694,600
キャリアデザインセンター	4,100	1,572.00	6,445,200
ベネフィット・ワン	85,600	1,892.00	161,955,200
エムスリー	364,500	3,614.00	1,317,303,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,800	345.00	4,071,000
アウトソーシング	110,200	919.00	101,273,800
ウェルネット	17,000	593.00	10,081,000
ワールドホールディングス	8,400	2,733.00	22,957,200
ディー・エヌ・エー	78,800	1,750.00	137,900,000
博報堂D Yホールディングス	235,500	1,282.00	301,911,000
ぐるなび	34,700	385.00	13,359,500
タカミヤ	25,900	375.00	9,712,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	850.00	9,690,000
ファンコミュニケーションズ	36,900	427.00	15,756,300
ライク	7,000	1,955.00	13,685,000
ビジネス・ブレークスルー	7,800	382.00	2,979,600
エスプール	53,400	898.00	47,953,200
W D Bホールディングス	9,600	2,114.00	20,294,400
ティア	11,600	416.00	4,825,600
C D G	2,300	1,089.00	2,504,700
アドウェイズ	26,000	494.00	12,844,000
バリューコマース	14,100	1,802.00	25,408,200
インフォマート	192,300	383.00	73,650,900
J Pホールディングス	54,300	284.00	15,421,200
エコナックホールディングス	35,800	89.00	3,186,200
C Lホールディングス	5,500	786.00	4,323,000
プレステージ・インターナショナル	78,100	691.00	53,967,100
アミューズ	10,200	1,725.00	17,595,000
ドリームインキュベータ	5,700	2,225.00	12,682,500

クイック	14,300	1,993.00	28,499,900
T A C	10,600	209.00	2,215,400
電通グループ	193,600	4,105.00	794,728,000
イオンファンタジー	8,100	2,735.00	22,153,500
シーティーエス	20,800	848.00	17,638,400
ネクシィーズグループ	6,200	653.00	4,048,600
H . U . グループホールディングス	54,100	2,744.00	148,450,400
アルプス技研	16,200	2,069.00	33,517,800
日本空調サービス	20,300	693.00	14,067,900
オリエンタルランド	195,200	18,540.00	3,619,008,000
ダスキン	41,200	2,958.00	121,869,600
明光ネットワークジャパン	24,800	618.00	15,326,400
ファルコホールディングス	8,500	1,717.00	14,594,500
ラウンドワン	154,900	495.00	76,675,500
リゾートトラスト	73,000	2,313.00	168,849,000
ビー・エム・エル	23,000	3,360.00	77,280,000
りらいあコミュニケーションズ	30,800	994.00	30,615,200
リソー教育	84,900	348.00	29,545,200
早稲田アカデミー	10,500	1,098.00	11,529,000
ユー・エス・エス	189,800	2,148.00	407,690,400
東京個別指導学院	22,500	526.00	11,835,000
サイバーエージェント	441,600	1,126.00	497,241,600
楽天グループ	853,700	582.00	496,853,400
クリーク・アンド・リバー社	11,000	2,005.00	22,055,000
モーニングスター	30,800	459.00	14,137,200
テー・オー・ダブリュー	40,600	294.00	11,936,400
山田コンサルティンググループ	9,700	1,126.00	10,922,200
セントラルスポーツ	7,100	2,354.00	16,713,400
フルキャストホールディングス	17,700	2,859.00	50,604,300
エン・ジャパン	33,500	2,254.00	75,509,000
リソルホールディングス	1,800	4,510.00	8,118,000
テクノプロ・ホールディングス	123,800	3,495.00	432,681,000
アトラグループ	4,100	196.00	803,600
インターワークス	5,700	363.00	2,069,100
アイ・アールジャパンホールディングス	9,800	1,776.00	17,404,800
K e e P e r 技研	13,400	3,805.00	50,987,000
ファーストロジック	3,300	860.00	2,838,000
三機サービス	3,600	900.00	3,240,000
G u n o s y	11,900	623.00	7,413,700
デザインワン・ジャパン	7,300	202.00	1,474,600
イー・ガーディアン	7,100	2,626.00	18,644,600
リブセンス	9,700	283.00	2,745,100

ジャパンマテリアル	56,600	2,278.00	128,934,800
ベクトル	29,200	1,292.00	37,726,400
ウチヤマホールディングス	9,100	269.00	2,447,900
チャーム・ケア・コーポレーション	15,700	1,176.00	18,463,200
キャリアリンク	6,900	2,969.00	20,486,100
I B J	11,600	857.00	9,941,200
アサンテ	9,300	1,582.00	14,712,600
バリューHR	16,300	1,566.00	25,525,800
M & Aキャピタルパートナーズ	17,100	4,530.00	77,463,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,075.00	7,417,500
E R Iホールディングス	5,500	1,067.00	5,868,500
アビスト	3,000	2,898.00	8,694,000
シグマクシス・ホールディングス	28,200	1,367.00	38,549,400
ウィルグループ	15,600	1,195.00	18,642,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,700	145.00	3,146,500
メドピア	14,700	1,501.00	22,064,700
レアジョブ	3,900	904.00	3,525,600
リクルートホールディングス	1,365,600	4,091.00	5,586,669,600
エラン	24,800	933.00	23,138,400
土木管理総合試験所	8,800	306.00	2,692,800
日本郵政	2,417,700	1,099.00	2,657,052,300
ベルシステム24ホールディングス	25,000	1,354.00	33,850,000
鎌倉新書	21,300	930.00	19,809,000
S M N	5,200	474.00	2,464,800
グローバルキッズCOMPANY	3,400	555.00	1,887,000
エアトリ	12,000	2,372.00	28,464,000
アトラエ	14,700	1,265.00	18,595,500
ストライク	9,200	4,290.00	39,468,000
ソラスト	51,300	716.00	36,730,800
セラク	6,800	1,119.00	7,609,200
インソース	23,000	2,925.00	67,275,000
ベйкаレント・コンサルティング	146,100	4,520.00	660,372,000
Orchestra Holdings	4,100	1,804.00	7,396,400
アイモバイル	9,900	1,128.00	11,167,200
キャリアインデックス	7,400	316.00	2,338,400
MS - Japan	6,400	980.00	6,272,000
船場	3,600	743.00	2,674,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,900	1,594.00	105,044,600
フルテック	2,900	1,219.00	3,535,100
GameWith	6,500	335.00	2,177,500
MS & Consulting	2,700	602.00	1,625,400
ウェルビー	14,000	716.00	10,024,000

エル・ティー・エス	2,500	2,883.00	7,207,500
ミダックホールディングス	11,300	2,567.00	29,007,100
日総工産	14,400	561.00	8,078,400
キュービーネットホールディングス	9,800	1,319.00	12,926,200
R P Aホールディングス	26,200	267.00	6,995,400
スプリックス	6,800	884.00	6,011,200
マネジメントソリューションズ	10,200	3,725.00	37,995,000
プロレド・パートナーズ	5,200	465.00	2,418,000
テノ・ホールディングス	2,900	518.00	1,502,200
フロンティア・マネジメント	6,400	1,277.00	8,172,800
ピアラ	3,500	593.00	2,075,500
コプロ・ホールディングス	3,400	980.00	3,332,000
ギークス	3,000	822.00	2,466,000
カーブスホールディングス	57,000	889.00	50,673,000
フォーラムエンジニアリング	11,200	840.00	9,408,000
Fast Fitness Japan	6,600	1,085.00	7,161,000
ダイレクトマーケティングミックス	21,400	1,455.00	31,137,000
ポピンズ	3,000	1,535.00	4,605,000
L I T A L I C O	14,500	2,266.00	32,857,000
アドバンテッジリスクマネジメント	9,200	379.00	3,486,800
リログループ	102,800	2,070.00	212,796,000
東祥	13,200	1,104.00	14,572,800
ビーウィズ	5,800	1,059.00	6,142,200
T R Eホールディングス	39,100	1,474.00	57,633,400
人・夢・技術グループ	8,400	1,801.00	15,128,400
エイチ・アイ・エス	48,400	1,919.00	92,879,600
ラックランド	5,800	2,936.00	17,028,800
共立メンテナンス	31,600	5,610.00	177,276,000
イチネンホールディングス	19,800	1,240.00	24,552,000
建設技術研究所	9,600	3,320.00	31,872,000
スペース	13,800	906.00	12,502,800
燦ホールディングス	8,400	1,719.00	14,439,600
スバル興業	1,200	9,110.00	10,932,000
東京テアトル	6,800	1,118.00	7,602,400
タナベコンサルティンググループ	7,700	634.00	4,881,800
ナガワ	5,000	7,000.00	35,000,000
東京都競馬	15,500	3,680.00	57,040,000
カナモト	33,900	2,283.00	77,393,700
西尾レントオール	17,300	3,160.00	54,668,000
トランス・コスモス	23,000	3,235.00	74,405,000
乃村工藝社	80,800	924.00	74,659,200
藤田観光	8,200	2,759.00	22,623,800

KNT-CTホールディングス	11,000	1,568.00	17,248,000	
日本管財	19,500	2,508.00	48,906,000	
トーカイ	16,500	1,904.00	31,416,000	
セコム	187,900	7,784.00	1,462,613,600	
セントラル警備保障	10,100	2,297.00	23,199,700	
丹青社	36,200	685.00	24,797,000	
メイテック	73,700	2,376.00	175,111,200	
応用地質	18,100	2,193.00	39,693,300	
船井総研ホールディングス	38,900	2,706.00	105,263,400	
進学会ホールディングス	7,200	300.00	2,160,000	
オオバ	12,200	645.00	7,869,000	
いであ	4,300	1,712.00	7,361,600	
学究社	7,600	1,782.00	13,543,200	
ベネッセホールディングス	69,000	1,982.00	136,758,000	
イオンディライト	20,500	2,988.00	61,254,000	
ナック	8,500	919.00	7,811,500	
ダイセキ	37,700	4,625.00	174,362,500	
ステップ	7,700	1,772.00	13,644,400	
合 計	208,346,300		493,408,668,470	

(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。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2022年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	55,510,075
株式	9,536,769,110
投資証券	143,417,400
未収配当金	1,116,766

	2022年12月20日現在
項目	金額（円）
前払金	1,235,250
差入委託証拠金	1,377,000
流動資産合計	9,739,425,601
資産合計	9,739,425,601
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,237,890
未払解約金	176,081
未払利息	130
流動負債合計	1,414,101
負債合計	1,414,101
純資産の部	
元本等	
元本	9,461,648,258
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	276,363,242
元本等合計	9,738,011,500
純資産合計	9,738,011,500
負債純資産合計	9,739,425,601

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20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金

	2022年12月20日現在
	株式及び投資証券は、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12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,461,648,258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 1.0292円 (1万口当たり純資産額) (10,292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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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

2022年12月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月21日
期首元本額	438,786,131円
期中追加設定元本額	9,149,488,608円
期中一部解約元本額	126,626,481円
期末元本額	9,461,648,258円

区分	2022年12月20日現在
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	255,171,736円
コア投資戦略ファンド（成長型）	552,032,281円
コア投資戦略ファンド（切替型）	251,040,255円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,317,868,014円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	116,243,652円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	33,846,041円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	611,041,083円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	41,671,967円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	104,797,986円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	44,143,690
投資証券	10,739,911
合計	33,403,779

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式ESGセレクト・リーダーズ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12月20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	58,370,250	-	57,135,000	1,235,250
	合計	58,370,250	-	57,135,000	1,235,250

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
I N P E X	36,000	1,408.00	50,688,000	
大林組	22,500	1,004.00	22,590,000	
清水建設	19,100	708.00	13,522,800	
住友林業	4,900	2,385.00	11,686,500	
大和ハウス工業	20,700	3,083.00	63,818,100	
積水ハウス	21,300	2,385.00	50,800,500	
高砂熱学工業	1,600	1,761.00	2,817,600	
大気社	900	3,415.00	3,073,500	
千代田化工建設	5,400	356.00	1,922,400	
明治ホールディングス	3,900	6,660.00	25,974,000	
サッポロホールディングス	2,200	3,425.00	7,535,000	
アサヒグループホールディングス	15,800	4,168.00	65,854,400	
麒麟ホールディングス	28,500	2,059.50	58,695,750	
サントリー食品インターナショナル	4,800	4,555.00	21,864,000	
伊藤園	1,900	4,905.00	9,319,500	
不二製油グループ本社	1,500	2,045.00	3,067,500	
キッコーマン	5,000	7,290.00	36,450,000	
味の素	15,800	4,367.00	68,998,600	
キューピー	3,200	2,438.00	7,801,600	
ハウス食品グループ本社	2,100	2,754.00	5,783,400	
カゴメ	2,600	3,055.00	7,943,000	
ニチレイ	3,700	2,800.00	10,360,000	
日清食品ホールディングス	2,200	10,490.00	23,078,000	
東洋紡	2,800	1,003.00	2,808,400	
帝人	6,200	1,310.00	8,122,000	
東レ	48,000	754.60	36,220,800	
クラレ	11,000	1,098.00	12,078,000	
旭化成	43,400	965.40	41,898,360	
住友化学	51,600	472.00	24,355,200	
東ソー	9,000	1,588.00	14,292,000	
デンカ	2,600	3,080.00	8,008,000	
カネカ	1,600	3,295.00	5,272,000	
三井化学	6,400	3,065.00	19,616,000	
J S R	6,100	2,731.00	16,659,100	
東京応化工業	1,100	6,450.00	7,095,000	

三菱ケミカルグループ	44,300	695.70	30,819,510
ダイセル	8,900	977.00	8,695,300
積水化学工業	12,800	1,892.00	24,217,600
UBE	3,300	1,946.00	6,421,800
花王	16,400	5,301.00	86,936,400
日本ペイントホールディングス	28,700	1,075.00	30,852,500
関西ペイント	6,100	1,665.00	10,156,500
DIC	2,600	2,402.00	6,245,200
富士フイルムホールディングス	12,500	6,822.00	85,275,000
ライオン	8,100	1,482.00	12,004,200
小林製薬	1,800	8,340.00	15,012,000
デクセリアルズ	1,900	2,751.00	5,226,900
日東電工	4,900	7,890.00	38,661,000
信越ポリマー	1,400	1,164.00	1,629,600
ニフコ	2,800	3,290.00	9,212,000
ユニ・チャーム	14,000	5,207.00	72,898,000
協和キリン	9,300	3,040.00	28,272,000
アステラス製薬	63,500	2,071.50	131,540,250
塩野義製薬	9,200	6,675.00	61,410,000
中外製薬	23,200	3,452.00	80,086,400
エーザイ	8,700	9,038.00	78,630,600
小野薬品工業	12,500	3,357.00	41,962,500
参天製薬	12,500	1,098.00	13,725,000
第一三共	60,600	4,317.00	261,610,200
ENEOSホールディングス	106,200	444.80	47,237,760
ブリヂストン	19,800	4,839.00	95,812,200
住友理工	1,300	597.00	776,100
太平洋セメント	4,000	2,029.00	8,116,000
TOTO	4,900	4,585.00	22,466,500
日本特殊陶業	5,300	2,513.00	13,318,900
日本製鉄	27,900	2,198.00	61,324,200
神戸製鋼所	11,700	624.00	7,300,800
JFEホールディングス	17,000	1,535.00	26,095,000
日本軽金属ホールディングス	1,900	1,497.00	2,844,300
三井金属鉱業	1,900	3,075.00	5,842,500
三菱マテリアル	4,100	2,085.00	8,548,500
住友金属鉱山	8,600	4,588.00	39,456,800
DOWAホールディングス	1,800	4,210.00	7,578,000
UACJ	1,100	2,156.00	2,371,600
LIXIL	9,900	2,019.00	19,988,100
三浦工業	3,000	3,070.00	9,210,000
ナブテスコ	3,800	3,315.00	12,597,000

小松製作所	32,000	3,014.00	96,448,000
日立建機	3,700	3,025.00	11,192,500
クボタ	35,300	1,900.50	67,087,650
荏原製作所	3,200	4,895.00	15,664,000
ダイキン工業	8,600	20,705.00	178,063,000
栗田工業	3,600	5,650.00	20,340,000
ダイフク	3,500	6,450.00	22,575,000
グローリー	1,700	2,126.00	3,614,200
セガサミーホールディングス	5,400	1,884.00	10,173,600
日立造船	5,600	830.00	4,648,000
三菱重工業	11,100	5,394.00	59,873,400
イビデン	3,900	4,835.00	18,856,500
コニカミノルタ	15,700	529.00	8,305,300
日立製作所	33,500	6,890.00	230,815,000
富士電機	4,400	5,250.00	23,100,000
安川電機	8,300	4,280.00	35,524,000
明電舎	1,100	1,920.00	2,112,000
オムロン	6,400	6,417.00	41,068,800
富士通	6,800	17,460.00	118,728,000
セイコーエプソン	9,700	1,985.00	19,254,500
パナソニックホールディングス	76,400	1,189.50	90,877,800
アンリツ	4,700	1,351.00	6,349,700
ソニーグループ	43,600	10,350.00	451,260,000
TDK	13,500	4,535.00	61,222,500
アルプスアルパイン	6,800	1,239.00	8,425,200
日本航空電子工業	1,600	2,128.00	3,404,800
横河電機	7,900	2,307.00	18,225,300
アズビル	4,000	3,480.00	13,920,000
アドバンテスト	6,600	9,110.00	60,126,000
シスメックス	5,800	8,289.00	48,076,200
スタンレー電気	4,500	2,548.00	11,466,000
ファナック	6,600	20,090.00	132,594,000
ローム	3,000	10,090.00	30,270,000
京セラ	11,100	6,723.00	74,625,300
太陽誘電	4,100	4,000.00	16,400,000
村田製作所	19,900	6,946.00	138,225,400
リコー	19,800	1,009.00	19,978,200
東京エレクトロン	5,200	41,590.00	216,268,000
川崎重工業	5,200	3,105.00	16,146,000
トヨタ自動車	366,800	1,845.00	676,746,000
マツダ	19,700	999.00	19,680,300
ヤマハ発動機	10,300	3,130.00	32,239,000

テルモ	22,300	3,785.00	84,405,500
島津製作所	8,200	3,830.00	31,406,000
ニコン	10,500	1,209.00	12,694,500
前田工織	600	3,005.00	1,803,000
大建工業	400	2,131.00	852,400
大日本印刷	7,700	2,687.00	20,689,900
N I S S H A	1,300	1,842.00	2,394,600
アシックス	5,600	2,849.00	15,954,400
ヤマハ	4,900	5,040.00	24,696,000
リンテック	1,300	2,174.00	2,826,200
任天堂	38,200	5,541.00	211,666,200
コクヨ	2,900	1,861.00	5,396,900
美津濃	600	2,765.00	1,659,000
東北電力	15,700	663.00	10,409,100
九州電力	13,900	695.00	9,660,500
電源開発	5,100	2,105.00	10,735,500
レノバ	1,200	2,516.00	3,019,200
東京瓦斯	13,500	2,574.00	34,749,000
大阪瓦斯	13,000	2,101.00	27,313,000
東邦瓦斯	2,600	2,526.00	6,567,600
相鉄ホールディングス	2,700	2,155.00	5,818,500
東急	18,400	1,659.00	30,525,600
京王電鉄	3,600	4,865.00	17,514,000
西日本旅客鉄道	7,600	5,647.00	42,917,200
西武ホールディングス	7,800	1,398.00	10,904,400
西日本鉄道	2,100	2,534.00	5,321,400
阪急阪神ホールディングス	7,900	3,970.00	31,363,000
南海電気鉄道	3,500	2,825.00	9,887,500
京阪ホールディングス	3,300	3,410.00	11,253,000
山九	1,800	4,885.00	8,793,000
センコーグループホールディングス	3,500	966.00	3,381,000
九州旅客鉄道	4,600	2,894.00	13,312,400
S Gホールディングス	10,000	1,974.00	19,740,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	2,700	7,820.00	21,114,000
日本郵船	16,800	3,143.00	52,802,400
ランコム	300	7,570.00	2,271,000
T I S	7,800	3,540.00	27,612,000
S H I F T	400	24,810.00	9,924,000
オープンドア	400	1,718.00	687,200
マネーフォワード	1,500	4,120.00	6,180,000
ビジョナル	600	9,060.00	5,436,000
野村総合研究所	13,700	3,115.00	42,675,500

メルカリ	3,600	2,668.00	9,604,800
Zホールディングス	92,400	340.60	31,471,440
伊藤忠テクノソリューションズ	3,300	3,085.00	10,180,500
サイボウズ	800	2,326.00	1,860,800
B I P R O G Y	2,500	3,300.00	8,250,000
ビジョン	1,300	1,280.00	1,664,000
K D D I	55,800	3,989.00	222,586,200
ソフトバンク	99,400	1,484.00	147,509,600
エヌ・ティ・ティ・データ	21,800	1,917.00	41,790,600
カブコン	6,000	4,185.00	25,110,000
S C S K	5,400	2,014.00	10,875,600
あらた	500	3,955.00	1,977,500
T O K A Iホールディングス	3,400	856.00	2,910,400
アズワン	1,000	5,530.00	5,530,000
伊藤忠商事	41,100	4,187.00	172,085,700
丸紅	53,500	1,532.00	81,962,000
三井物産	49,600	3,926.00	194,729,600
キャノンマーケティングジャパン	1,600	3,015.00	4,824,000
サンゲツ	1,400	2,097.00	2,935,800
モスフードサービス	800	3,070.00	2,456,000
イエローハット	1,100	1,759.00	1,934,900
ローソン	1,600	4,920.00	7,872,000
ゲオホールディングス	800	1,932.00	1,545,600
ハローズ	300	2,913.00	873,900
大黒天物産	200	5,050.00	1,010,000
D C Mホールディングス	3,800	1,166.00	4,430,800
マツキヨココカラ&カンパニー	3,700	5,990.00	22,163,000
Z O Z O	4,300	3,175.00	13,652,500
オイシックス・ラ・大地	900	1,960.00	1,764,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,800	1,128.00	2,030,400
イオン北海道	700	1,124.00	786,800
スギホールディングス	1,200	6,120.00	7,344,000
日本瓦斯	3,600	2,146.00	7,725,600
マックスバリュ東海	300	2,859.00	857,700
丸井グループ	6,100	2,178.00	13,285,800
イオン	22,600	2,786.00	62,963,600
平和堂	900	2,074.00	1,866,600
ヤオコー	600	6,790.00	4,074,000
Genky DrugStores	300	3,425.00	1,027,500
ヤマダホールディングス	25,100	469.00	11,771,900
ファーストリテイリング	2,000	79,200.00	158,400,000
サンドラッグ	2,500	3,715.00	9,287,500

しずおかフィナンシャルグループ	15,400	1,011.00	15,569,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	413,500	818.40	338,408,400	
りそなホールディングス	74,700	692.50	51,729,750	
三井住友トラスト・ホールディングス	11,700	4,439.00	51,936,300	
三井住友フィナンシャルグループ	45,200	4,974.00	224,824,800	
大和証券グループ本社	46,100	585.00	26,968,500	
野村ホールディングス	100,700	476.20	47,953,340	
マネックスグループ	6,000	402.00	2,412,000	
S O M P Oホールディングス	10,800	5,761.00	62,218,800	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	15,400	4,108.00	63,263,200	
第一生命ホールディングス	33,900	2,885.50	97,818,450	
東京海上ホールディングス	63,500	2,891.50	183,610,250	
東京センチュリー	1,300	4,495.00	5,843,500	
オリックス	41,400	2,139.50	88,575,300	
ヒューリック	13,300	1,093.00	14,536,900	
野村不動産ホールディングス	4,100	2,982.00	12,226,200	
三井不動産	31,300	2,441.50	76,418,950	
三菱地所	40,900	1,712.50	70,041,250	
平和不動産	1,100	3,855.00	4,240,500	
東京建物	6,500	1,742.00	11,323,000	
住友不動産	10,700	3,187.00	34,100,900	
総合警備保障	2,600	3,455.00	8,983,000	
ディップ	1,300	3,730.00	4,849,000	
エスプール	2,300	898.00	2,065,400	
H . U . グループホールディングス	1,800	2,744.00	4,939,200	
オリエンタルランド	6,900	18,540.00	127,926,000	
ダスキン	1,400	2,958.00	4,141,200	
サイバーエージェント	14,900	1,126.00	16,777,400	
テクノプロ・ホールディングス	3,800	3,495.00	13,281,000	
リクルートホールディングス	49,900	4,091.00	204,140,900	
エラン	1,000	933.00	933,000	
インソース	800	2,925.00	2,340,000	
カーブスホールディングス	1,800	889.00	1,600,200	
L I T A L I C O	700	2,266.00	1,586,200	
乃村工藝社	2,700	924.00	2,494,800	
ベネッセホールディングス	2,500	1,982.00	4,955,000	
合 計	3,772,200		9,536,769,110	

(2) 株式以外の有価証券

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

投資証券	森ヒルズリート投資法人	53	8,098,400	
	日本プロロジスリート投資法人	74	22,644,000	
	ヒューリックリート投資法人	45	7,213,500	
	積水ハウス・リート投資法人	146	10,906,200	
	日本ビルファンド投資法人	53	30,740,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	43	24,252,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	29	10,541,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	102	14,596,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	29	8,932,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	42	5,493,600	
合計		616	143,417,400	

(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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

項目	2022年12月20日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	332,050,365,576	
流動資産合計	332,050,365,576	
資産合計	332,050,365,576	
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,218	
未払利息	779,363	
流動負債合計	785,581	
負債合計	785,581	
純資産の部		
元本等		
元本	331,700,391,948	
剰余金		
剰余金又は欠損金()	349,188,047	
元本等合計	332,049,579,995	
純資産合計	332,049,579,995	
負債純資産合計	332,050,365,576	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		331,700,391,948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)	1.0011円 (10,011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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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

	2022年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年12月20日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2022年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月21日
期首元本額	354,713,644,471円
期中追加設定元本額	114,151,992,809円
期中一部解約元本額	137,165,245,332円
期末元本額	331,700,391,948円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9,963円

区分	2022年12月20日現在
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	1,993円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SUMI TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)	997円

区分	2022年12月20日現在
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド(SMA専用)	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(年2回決算型)	9,990円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド(適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
225ベアファンド6(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	1,331,276,690円
225ベアファンド7(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	89,086,846,492円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド(適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
米国国債ベアファンド(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	5,106,360,016円
TOPIXベアファンド2(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	21,596,009,764円
TOPIXベアファンドR(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	15,577,844,099円
225ベアファンド8(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	21,190,058,269円
225ベアファンド9(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	2,876,900,848円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド(適格機関投資家専用)	4,138,099,571円
225ベアファンド10(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	2,616,273,059円
TOPIXベアファンドR2(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	30,921,835,681円
TOPIXベアファンドF(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	82,760,868,763円
TOPIXベアファンドF2(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	35,045,352,374円
TOPIXベアファンドF3(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,461円
リスクプレミア ファンド(適格機関投資家専用)	2,995,805,872円

区分	2022年12月20日現在
米国株価指数レバレッジ戦略ファンド(米国国債リスクコントロール型)(適格機関投資家専用)	99,396,417円
私募マネーブルファンドA L(適格機関投資家専用)	1,049,718,921円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

【純資産額計算書】

（2023年 1月31日現在）

資産総額	161,653,002,916円
負債総額	180,301,202円
純資産総額（ - ）	161,472,701,714円
発行済口数	101,498,718,104口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5909円
（1万口当たり純資産額）	（15,909円）

（参考）

中小型株式 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	22,791,138,448円
負債総額	542,715,835円
純資産総額（ - ）	22,248,422,613円
発行済口数	4,580,857,549口
1口当たり純資産額（ / ）	4.8568円
（1万口当たり純資産額）	（48,568円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（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）

日本株式ESGセレクト・リーダーズ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	10,225,069,868円
負債総額	53,145,759円
純資産総額（ - ）	10,171,924,109円
発行済口数	9,578,301,934口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0620円
（1万口当たり純資産額）	（10,620円）

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(2023年 1月31日現在)

資産総額	345,589,571,424円
負債総額	176,928円
純資産総額（ - ）	345,589,394,496円
発行済口数	345,240,425,461口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0010円
（1万口当たり純資産額）	（10,010円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2023年 3月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	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
評価・換算差額等		
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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファ

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針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、それら的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おります。

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おります。

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（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)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年3月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 3月18日	有価証券届出書
2022年 3月18日	有価証券報告書
2022年 9月20日	有価証券届出書
2022年 9月20日	半期報告書

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

2023年3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

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2021年12月21日から2022年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2022年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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。