

【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】	2024年1月19日提出
【計算期間】	第6期(自 2022年10月21日至 2023年10月20日)
【ファンド名】	My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)
【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】	上坪 直樹
【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 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<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 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	フ ァ ミ リ ー フ ァ ン ド フ ァ ン ド ・ オ ブ ・ フ ァ ン ズ	あり () なし	日経225 T O P I X その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ン グ				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

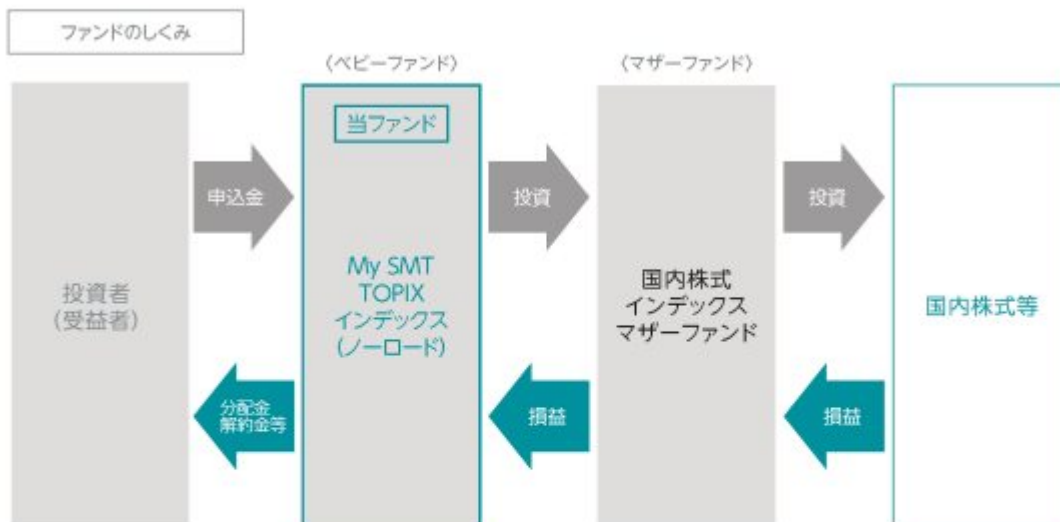
[特殊型]

- (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。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

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



? ファミリーファンド方式とは

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

〈マザーファンドの概要〉

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

特色2 TOPIX(東証株価指数)(配当込み)*に連動する投資成果を目指します。

※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。

JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIX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る。

JPXは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIX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配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

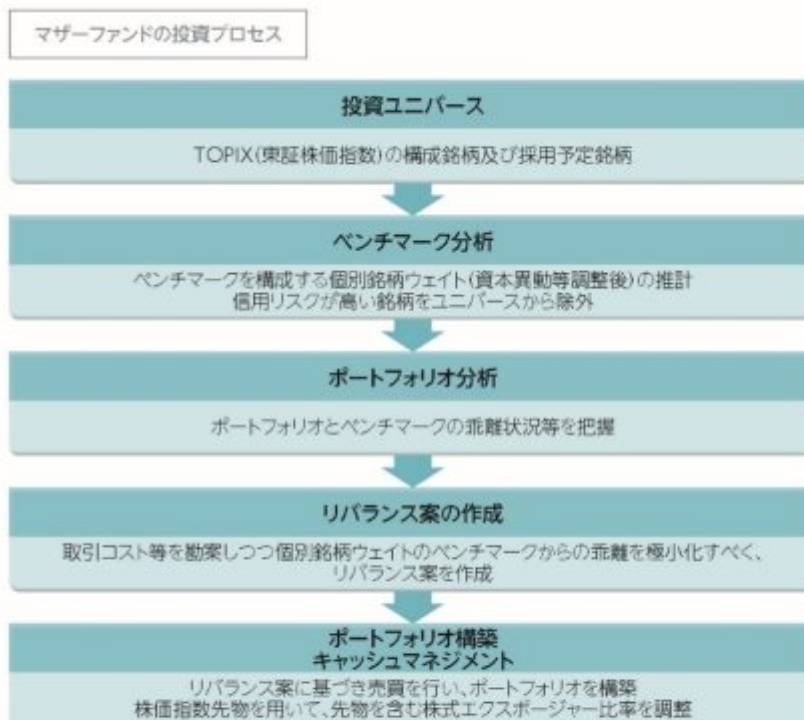
J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

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ない。

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わない。

J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みT O P I X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ない。

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ない。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色3 ノーロードファンドです。

●購入時手数料が無料のノーロードファンドです。

その他の費用等については、後掲「4 手数料等及び税金」をご参照ください。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
 - 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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2018年 1月12日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2022年 7月21日	当ファンドの名称を「i - SMT TOPIXインデックス (ノーロード)」から「My SMT TOPIXインデックス (ノーロード)」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年11月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、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。

投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）に連動する投資成果を目指します。

ロ．株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。

ハ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。

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

ホ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条に定めるものに限ります。）

3. 金銭債権

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

1. 株券又は新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、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
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

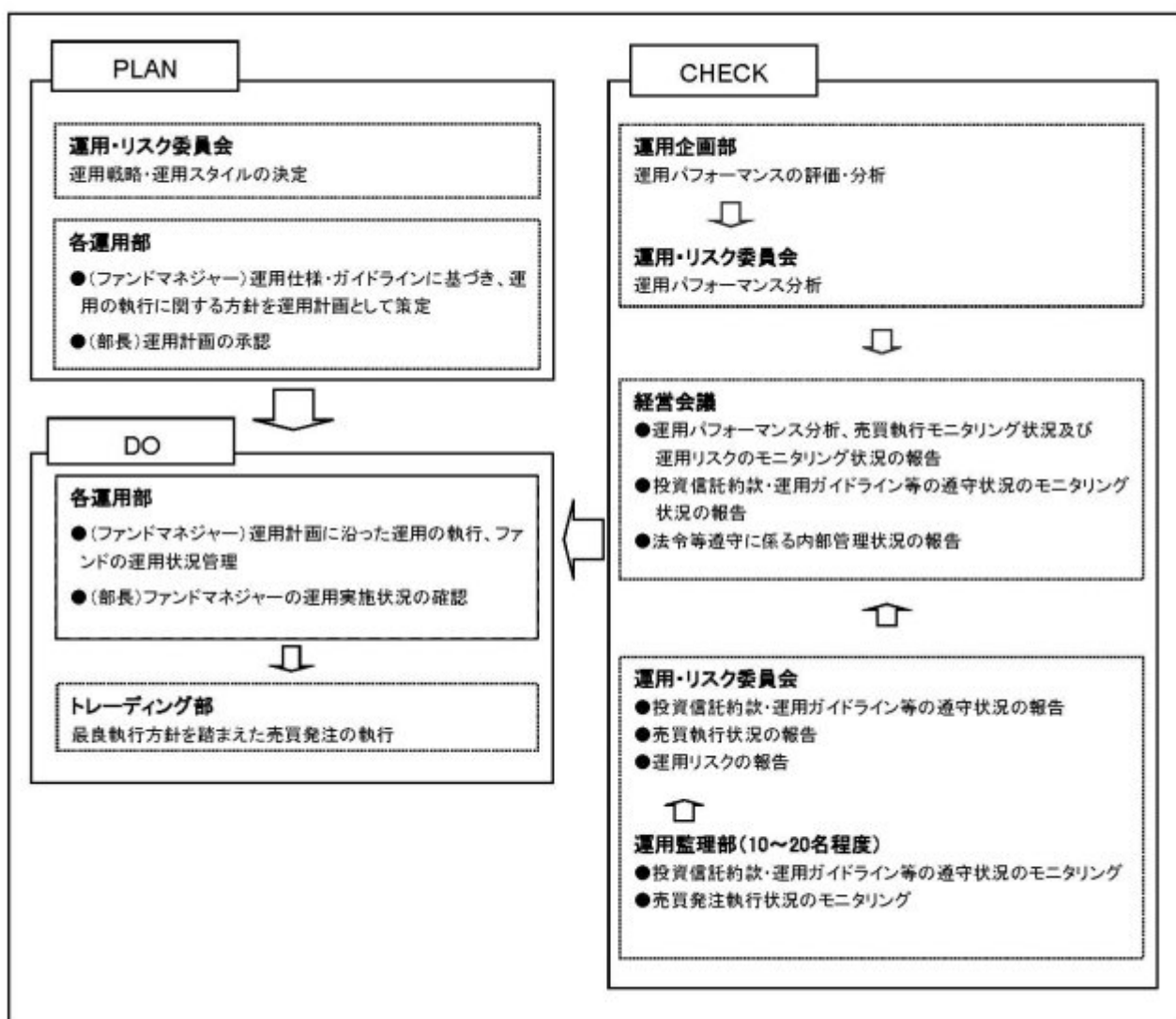
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式

等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・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。
- ・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．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

ニ．新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ホ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ヘ．信用取引の指図範囲

（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、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1

項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券

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

ト．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

チ．有価証券の貸付の指図、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、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

（ロ）上記（イ）a.及びb.に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

リ．公社債の空売りの指図、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、投資信託財産において有しない公社債又は下記ヌ.の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の売付の指図は、当該売付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）の売付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売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ヌ．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。

ル．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。

（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。

ヲ．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。

ワ．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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様はに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証

券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

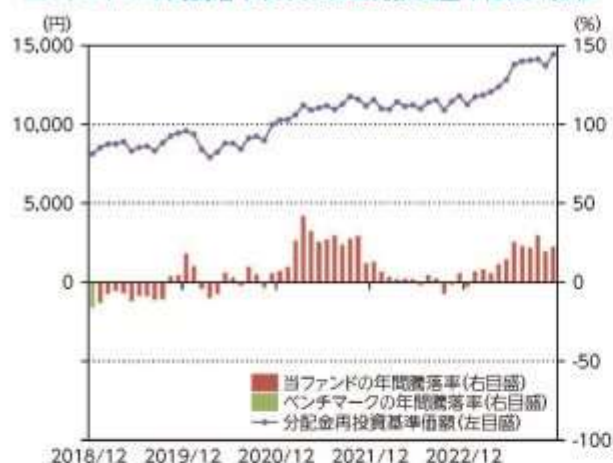
(2) リスクの管理体制

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。

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2018年12月～2023年11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。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX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、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の知的所有権及び同指数に係る標準又は商標は、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ロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロ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募固定利付国債の市場主単の動向を基準とした投資収益指数で、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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの錯誤、脱漏又は遅延につき自ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JP Morgan Emerging Markets Bond Index-Emerging Markets (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 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜 0.14%）（ ）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 0.066% (税抜 0.06%)	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 0.066% (税抜 0.06%)	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 0.022% (税抜 0.02%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の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

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」及び「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行

うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

- 八．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- 二．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

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、2024年1月1日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.17%	0.16%	0.01%

※対象期間は2022年10月21日～2023年10月20日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2023年11月30日現在の状況について記載してあります。

【My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,008,916,087	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,498,590	0.05
合計(純資産総額)		3,010,414,677	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,235,035,130	2.3170	2,861,668,857	2.4363	3,008,916,087	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2018年10月22日)	52,836,312	52,836,312	9,205	9,205
第2期計算期間末 (2019年10月21日)	65,609,096	65,609,096	9,053	9,053
第3期計算期間末 (2020年10月20日)	73,637,471	73,637,471	9,241	9,241
第4期計算期間末 (2021年10月20日)	177,526,478	177,526,478	11,746	11,746
第5期計算期間末 (2022年10月20日)	525,424,954	525,424,954	11,253	11,253
第6期計算期間末 (2023年10月20日)	2,888,428,456	2,888,428,456	13,712	13,712
2022年11月末日	562,045,237		11,790	
12月末日	965,783,973		11,250	
2023年1月末日	820,720,124		11,746	
2月末日	880,351,708		11,856	
3月末日	1,104,483,586		12,056	
4月末日	1,113,568,469		12,379	
5月末日	1,224,605,560		12,825	
6月末日	1,588,866,507		13,792	
7月末日	1,912,074,601		13,995	
8月末日	2,172,094,234		14,053	

9月末日	2,569,266,404		14,125
10月末日	3,075,639,660		13,701
11月末日	3,010,414,677		14,440

【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	2018年 1月12日～2018年10月22日	0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	0
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	0
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	0
第5期計算期間	2021年10月21日～2022年10月20日	0
第6期計算期間	2022年10月21日～2023年10月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	8.0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	1.7
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	2.1
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	27.1
第5期計算期間	2021年10月21日～2022年10月20日	4.2
第6期計算期間	2022年10月21日～2023年10月20日	21.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	108,701,841	51,304,223	57,397,618
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	50,853,131	35,774,595	72,476,154
第3期計算期間	2019年10月22日～2020年10月20日	64,823,463	57,612,303	79,687,314
第4期計算期間	2020年10月21日～2021年10月20日	280,298,231	208,842,771	151,142,774
第5期計算期間	2021年10月21日～2022年10月20日	971,174,185	655,380,902	466,936,057
第6期計算期間	2022年10月21日～2023年10月20日	4,569,835,695	2,930,283,065	2,106,488,687

(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)

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	585,530,811,600	98.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,557,284,416	1.27
合計(純資産総額)		593,088,096,016	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	7,436,880,000	1.25

(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	9,523,200	1,939.46	18,469,906,255	2,794.50	26,612,582,400	4.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,226,800	13,265.89	16,274,598,820	12,820.00	15,727,576,000	2.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,697,400	932.95	9,980,187,472	1,255.00	13,425,237,000	2.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,500	68,494.40	11,883,778,534	63,350.00	10,991,225,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	51,740,600	162.87	8,426,998,967	173.10	8,956,297,860	1.51
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	367,100	19,732.85	7,243,931,742	24,025.00	8,819,577,500	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,214,500	5,672.66	6,889,457,497	7,258.00	8,814,841,000	1.49
日本	株式	日立製作所	電気機器	842,300	8,151.34	6,865,873,682	10,285.00	8,663,055,500	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,212,000	6,004.29	7,277,206,437	6,886.00	8,345,832,000	1.41
日本	株式	信越化学工業	化学	1,575,300	4,412.24	6,950,614,790	5,212.00	8,210,463,600	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	1,095,000	5,917.03	6,479,157,439	6,912.00	7,568,640,000	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	1,382,600	4,700.59	6,499,042,689	5,392.00	7,454,979,200	1.26
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,320,000	4,444.98	5,867,375,447	5,505.00	7,266,600,000	1.23
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,233,500	4,989.42	6,154,457,475	5,738.00	7,077,823,000	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,539,400	4,534.95	6,981,111,922	4,165.00	6,411,601,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,229,400	1,345.49	5,690,642,880	1,509.00	6,382,164,600	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,344,100	4,357.71	5,857,204,434	4,625.00	6,216,462,500	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,688,400	3,114.96	5,259,311,192	3,648.00	6,159,283,200	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	1,515,300	4,536.70	6,874,470,520	4,000.00	6,061,200,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,305,600	2,082.05	4,800,394,067	2,512.00	5,791,667,200	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	344,500	17,133.38	5,902,452,381	16,665.00	5,741,092,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	858,100	5,563.29	4,773,864,377	6,020.00	5,165,762,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,798,400	1,513.01	4,234,018,246	1,798.50	5,032,922,400	0.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	943,600	5,370.07	5,067,204,414	5,025.00	4,741,590,000	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	209,100	26,724.02	5,587,993,967	22,155.00	4,632,610,500	0.78

日本	株式	村田製作所	電気機器	1,578,100	2,750.94	4,341,264,707	2,883.50	4,550,451,350	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,037,700	3,086.87	3,203,247,397	3,801.00	3,944,297,700	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,949,600	1,823.38	3,554,876,734	2,009.00	3,916,746,400	0.66
日本	株式	S M C	機械	52,400	74,502.10	3,903,910,219	74,450.00	3,901,180,000	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	1,529,900	2,116.76	3,238,433,557	2,307.00	3,529,479,300	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.37
		建設業	2.05
		食料品	3.39
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.90
		医薬品	4.69
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.97
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.52
		機械	5.15
		電気機器	17.08
		輸送用機器	8.56
		精密機器	2.30
		その他製品	2.27
		電気・ガス業	1.36
		陸運業	2.74
		海運業	0.74
		空運業	0.44
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.59
		卸売業	6.93
		小売業	4.22
銀行業	7.08		
証券、商品先物取引業	0.78		
保険業	2.41		
その他金融業	1.14		
不動産業	1.93		
サービス業	4.75		

	小計	98.73
合計		98.73

(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	東証株価指数先物	買建	313	円	7,152,618,900	7,436,880,000	1.25

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

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

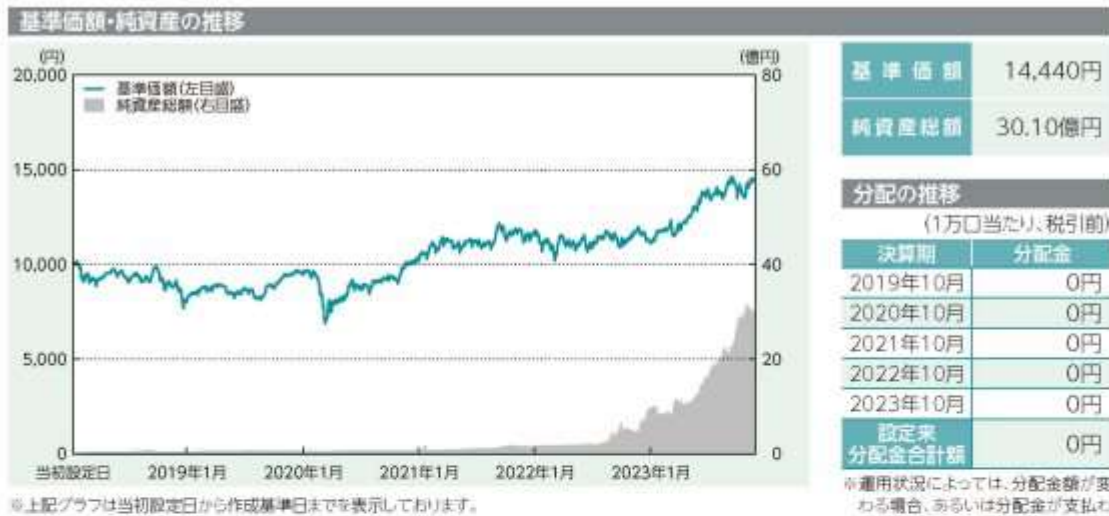
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



運用実績

当初設定日：2018年1月12日
作成基準日：2023年11月30日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.5%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.7%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	2.3%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.5%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.5%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.5%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.4%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.4%

※実質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。

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、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します。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、振り込まれることとなります。

< 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（受入担保金代用有価証券及び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1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

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

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2018年1月12日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月21日から翌年10月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年1月12日から2018年10月22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30億口を下回るようになった場合
- ・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は除きます。）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。受託会社が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します。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算

を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2022年10月21日から2023年10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】

【My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2022年10月20日現在）	第6期 （2023年10月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,746,710	47,102,024
親投資信託受益証券	525,160,925	2,886,978,832
未収入金	19,254,312	-
流動資産合計	551,161,947	2,934,080,856
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,493,782	44,200,654
未払受託者報酬	31,343	200,256
未払委託者報酬	204,084	1,201,469
未払利息	13	20
その他未払費用	7,771	50,001
流動負債合計	25,736,993	45,652,400
純資産の部		
元本等		
元本	466,936,057	2,106,488,687
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	58,488,897	781,939,769
（分配準備積立金）	9,677,700	38,792,431
元本等合計	525,424,954	2,888,428,456
純資産合計	525,424,954	2,888,428,456
負債純資産合計	551,161,947	2,934,080,856

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2021年10月21日	自	2022年10月21日
	至	2022年10月20日	至	2023年10月20日
営業収益				
受取利息		1		123
有価証券売買等損益		1,506,390		218,208,849
営業収益合計		1,506,391		218,208,972
営業費用				
支払利息		1,735		17,274
受託者報酬		50,232		289,886
委託者報酬		345,684		1,739,202
その他費用		12,431		72,351
営業費用合計		410,082		2,118,713
営業利益又は営業損失（ ）		1,096,309		216,090,259
経常利益又は経常損失（ ）		1,096,309		216,090,259
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,096,309		216,090,259
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,515,117		183,119,915
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,383,704		58,488,897
剰余金増加額又は欠損金減少額		124,352,328		1,313,381,593
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		124,352,328		1,313,381,593
剰余金減少額又は欠損金増加額		91,828,327		622,901,065
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		91,828,327		622,901,065
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		58,488,897		781,939,769

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2022年10月20日現在)	第6期 (2023年10月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	466,936,057口	2,106,488,687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) 1.1253円 (11,253円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3712円 (13,712円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2021年10月21日 至 2022年10月20日			第6期 自 2022年10月21日 至 2023年10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	8,897,180円	費用控除後の配当等収益額	A	38,434,749円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円
収益調整金額	C	54,630,476円	収益調整金額	C	743,147,338円
分配準備積立金額	D	780,520円	分配準備積立金額	D	357,682円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	64,308,176円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	781,939,769円
当ファンドの期末残存口数	F	466,936,057口	当ファンドの期末残存口数	F	2,106,488,687口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,377円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,712円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2022年10月21日 至 2023年10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6期 (2023年10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	(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5期	第6期
	自 2021年10月21日 至 2022年10月20日	自 2022年10月21日 至 2023年10月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	151,142,774円	466,936,057円
期中追加設定元本額	971,174,185円	4,569,835,695円
期中一部解約元本額	655,380,902円	2,930,283,065円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期	第6期
	(2022年10月20日現在)	(2023年10月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	221,716	102,936,583
合計	221,716	102,936,583

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,248,153,408	2,886,978,832	
	合計	1,248,153,408	2,886,978,832	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,953,991,024
株式	552,571,458,840
派生商品評価勘定	2,006,700
未収入金	7,490,000
未収配当金	5,298,901,266
前払金	237,378,100
差入委託証拠金	232,475,000
流動資産合計	561,303,700,930
資産合計	561,303,700,930
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	239,456,300
未払解約金	70,559,724
未払利息	1,308
その他未払費用	176
流動負債合計	310,017,508
負債合計	310,017,508
純資産の部	
元本等	
元本	242,540,893,459
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	318,452,789,963
元本等合計	560,993,683,422
純資産合計	560,993,683,422
負債純資産合計	561,303,700,930

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,540,893,459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 2.3130円 (1万口当たり純資産額) (23,130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

	2023年10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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。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

	2023年10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)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(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	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年10月21日
期首元本額	260,523,199,853円
期中追加設定元本額	21,522,918,435円
期中一部解約元本額	39,505,224,829円
期末元本額	242,540,893,459円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	314,584,840円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,485,955,415円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,152,969円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,146,332,980円
世界経済インデックスファンド	5,089,171,293円
日本株式インデックス・オープン	2,993,715,711円
DCマイセレクション25	5,418,039,395円

区分	2023年10月20日現在
DCマイセレクション50	17,375,988,692円
DCマイセレクション75	18,560,819,405円
DC日本株式インデックス・オープン	6,050,616,222円
DCマイセレクションS25	3,160,582,839円
DCマイセレクションS50	9,485,823,357円
DCマイセレクションS75	8,111,245,616円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,136,151,589円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,585,117円
DCターゲット・イヤーフンド2035	615,787,630円
DCターゲット・イヤーフンド2045	482,243,967円
DC世界経済インデックスファンド	3,753,850,982円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	895,059,473円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,789,509円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,017,403円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	14,276,826円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	156,785,770円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,043,492円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,358,838円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	70,516,841円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,579,511円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	46,691,759円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	531,085,139円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	325,131,870円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,179,700,366円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	29,343,477円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,687,773円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	340,592,161円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	188,895,125円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	252,340,789円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	20,328,385円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	420,188,230円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,881,716,620円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,653,328,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,868,498,313円
分散投資コア戦略ファンドS	6,163,116,493円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	585,192,776円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	404,697,520円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,171,089,468円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	201,566,527円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,711,834円
SMT インデックスバランス・オープン	49,756,098円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,130,032,401円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	274,541,578円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,370,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	212,086,642円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,709,487円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,855,151円
グローバル経済コア	216,917,123円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,609,608円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,248,153,408円
DCターゲット・イヤーフンド2055	27,362,412円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	964,175,269円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	237,451,996円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	51,611,599円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	49,159,540円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	20,935,476円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	23,019,113円
10資産分散投資ファンド	92,799,158円
グローバル10資産バランスファンド	1,466,922円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,401,146,940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）	500,600,878円

区分	2023年10月20日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	302,164,469円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,644,734円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	508,372,897円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,400,687,435円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,370,031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）	207,818,174円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	22,749,046,266	
合計	22,749,046,266	

(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

（2023年10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	7,373,048,100	-	7,135,670,000	237,378,100
合計		7,373,048,100	-	7,135,670,000	237,378,100

(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	9,200	3,750.00	34,500,000	
ニッスイ	242,500	693.00	168,052,500	
マルハニチロ	36,000	2,454.50	88,362,000	
雪国まいたけ	20,600	884.00	18,210,400	
カネコ種苗	7,400	1,394.00	10,315,600	
サカタのタネ	27,600	4,095.00	113,022,000	
ホクト	21,600	1,789.00	38,642,400	
ホクリヨウ	2,300	1,044.00	2,401,200	
住石ホールディングス	25,100	503.00	12,625,300	
日鉄鉱業	9,700	4,675.00	45,347,500	
三井松島ホールディングス	11,000	2,601.00	28,611,000	

INPEX	896,800	2,230.00	1,999,864,000
石油資源開発	28,100	5,360.00	150,616,000
K&Oエナジーグループ	11,000	2,427.00	26,697,000
ショーボンドホールディングス	33,000	5,683.00	187,539,000
ミライト・ワン	80,200	1,937.00	155,347,400
タマホーム	15,200	3,245.00	49,324,000
サンヨーホームズ	2,000	717.00	1,434,000
日本アクア	6,700	933.00	6,251,100
ファーストコーポレーション	4,100	750.00	3,075,000
ベステラ	3,500	1,004.00	3,514,000
キャンディル	2,900	554.00	1,606,600
ダイセキ環境ソリューション	3,300	948.00	3,128,400
第一カッター興業	6,200	1,221.00	7,570,200
安藤・間	140,500	1,137.00	159,748,500
東急建設	69,000	736.00	50,784,000
コムシスホールディングス	77,400	3,033.00	234,754,200
ビーアールホールディングス	38,500	364.00	14,014,000
高松コンストラクショングループ	15,800	2,774.00	43,829,200
東建コーポレーション	7,000	7,810.00	54,670,000
ソネック	1,700	953.00	1,620,100
ヤマウラ	12,300	1,212.00	14,907,600
オリエンタル白石	87,200	326.00	28,427,200
大成建設	158,700	4,920.00	780,804,000
大林組	606,600	1,253.50	760,373,100
清水建設	481,000	1,032.50	496,632,500
飛島建設	18,700	1,261.00	23,580,700
長谷工コーポレーション	175,100	1,849.00	323,759,900
松井建設	15,800	758.00	11,976,400
銭高組	1,400	3,680.00	5,152,000
鹿島建設	376,100	2,370.00	891,357,000
不動テトラ	11,700	2,010.00	23,517,000
大末建設	4,100	1,444.00	5,920,400
鉄建建設	12,200	1,999.00	24,387,800
西松建設	28,800	3,516.00	101,260,800
三井住友建設	136,800	387.00	52,941,600
大豊建設	7,000	3,910.00	27,370,000
佐田建設	7,200	594.00	4,276,800
ナカノフドー建設	8,000	390.00	3,120,000
奥村組	27,500	4,400.00	121,000,000
東鉄工業	23,300	2,893.00	67,406,900
イチケン	2,500	2,033.00	5,082,500
富士ピー・エス	5,100	450.00	2,295,000

浅沼組	13,600	3,585.00	48,756,000
戸田建設	208,700	799.40	166,834,780
熊谷組	28,400	3,625.00	102,950,000
北野建設	2,100	3,000.00	6,300,000
植木組	3,200	1,416.00	4,531,200
矢作建設工業	23,100	1,253.00	28,944,300
ピーエス三菱	21,500	800.00	17,200,000
日本ハウスホールディングス	36,200	367.00	13,285,400
新日本建設	23,800	1,194.00	28,417,200
東亜道路工業	6,800	5,360.00	36,448,000
日本道路	17,100	1,852.00	31,669,200
東亜建設工業	14,500	3,610.00	52,345,000
日本国土開発	48,200	590.00	28,438,000
若築建設	7,500	2,933.00	21,997,500
東洋建設	54,900	1,227.00	67,362,300
五洋建設	240,500	841.90	202,476,950
世紀東急工業	21,800	1,573.00	34,291,400
福田組	6,400	4,810.00	30,784,000
住友林業	146,600	3,492.00	511,927,200
日本基礎技術	6,800	452.00	3,073,600
巴コーポレーション	12,700	580.00	7,366,000
大和ハウス工業	469,000	3,982.00	1,867,558,000
ライト工業	31,400	1,923.00	60,382,200
積水ハウス	514,300	2,866.00	1,473,983,800
日特建設	16,200	1,044.00	16,912,800
北陸電気工事	11,600	979.00	11,356,400
ユアテック	37,400	940.00	35,156,000
日本リーテック	14,900	1,248.00	18,595,200
四電工	7,100	2,891.00	20,526,100
中電工	26,300	2,372.00	62,383,600
関電工	92,900	1,320.00	122,628,000
きんでん	119,400	2,101.00	250,859,400
東京エネシス	16,900	963.00	16,274,700
トーエネック	5,600	4,110.00	23,016,000
住友電設	16,100	2,711.00	43,647,100
日本電設工業	27,900	2,025.00	56,497,500
エクシオグループ	78,100	2,995.00	233,909,500
新日本空調	9,400	2,362.00	22,202,800
九電工	41,200	4,439.00	182,886,800
三機工業	37,500	1,650.00	61,875,000
日揮ホールディングス	167,800	1,835.00	307,913,000
中外炉工業	5,500	2,131.00	11,720,500

ヤマト	9,400	895.00	8,413,000	
太平電業	10,500	3,980.00	41,790,000	
高砂熱学工業	40,900	2,802.00	114,601,800	
三晃金属工業	1,400	4,140.00	5,796,000	
朝日工業社	7,000	2,405.00	16,835,000	
明星工業	29,200	1,009.00	29,462,800	
大気社	19,500	4,445.00	86,677,500	
ダイダン	22,300	1,448.00	32,290,400	
日比谷総合設備	13,800	2,226.00	30,718,800	
フィル・カンパニー	2,600	579.00	1,505,400	
テスホールディングス	36,500	478.00	17,447,000	
インフロニア・ホールディングス	177,700	1,541.50	273,924,550	
東洋エンジニアリング	22,400	585.00	13,104,000	
レイズネクスト	24,500	1,450.00	35,525,000	
ニッポン	45,900	2,145.00	98,455,500	
日清製粉グループ本社	157,500	1,810.50	285,153,750	
日東富士製粉	3,000	4,760.00	14,280,000	
昭和産業	14,800	2,955.00	43,734,000	
鳥越製粉	10,100	682.00	6,888,200	
中部飼料	23,600	1,074.00	25,346,400	
フィード・ワン	24,900	755.00	18,799,500	
東洋精糖	2,100	1,838.00	3,859,800	
日本甜菜製糖	9,900	1,859.00	18,404,100	
D M三井製糖ホールディングス	16,900	2,902.00	49,043,800	
塩水港精糖	13,600	238.00	3,236,800	
ウェルネオシュガー	8,800	2,014.00	17,723,200	
森永製菓	30,400	5,172.00	157,228,800	
中村屋	4,300	3,070.00	13,201,000	
江崎グリコ	48,700	4,168.00	202,981,600	
名糖産業	6,700	1,603.00	10,740,100	
井村屋グループ	9,300	2,276.00	21,166,800	
不二家	11,700	2,467.00	28,863,900	
山崎製パン	114,000	2,690.00	306,660,000	
第一屋製パン	2,200	473.00	1,040,600	
モロゾフ	5,500	3,685.00	20,267,500	
亀田製菓	10,800	3,955.00	42,714,000	
寿スピリッツ	90,600	2,053.00	186,001,800	
カルビー	78,000	2,696.00	210,288,000	
森永乳業	30,900	5,460.00	168,714,000	
六甲バター	12,500	1,360.00	17,000,000	
ヤクルト本社	243,400	3,540.00	861,636,000	
明治ホールディングス	208,800	3,688.00	770,054,400	

雪印メグミルク	41,200	2,259.00	93,070,800
プリマハム	22,900	2,267.00	51,914,300
日本ハム	66,600	4,273.00	284,581,800
林兼産業	3,500	534.00	1,869,000
丸大食品	17,100	1,617.00	27,650,700
S Foods	18,800	3,115.00	58,562,000
柿安本店	6,600	2,442.00	16,117,200
伊藤ハム米久ホールディングス	26,000	4,020.00	104,520,000
サッポロホールディングス	56,100	5,057.00	283,697,700
アサヒグループホールディングス	393,500	5,281.00	2,078,073,500
キリンホールディングス	709,300	2,071.50	1,469,314,950
宝ホールディングス	116,200	1,216.50	141,357,300
オエノンホールディングス	50,900	382.00	19,443,800
養命酒製造	5,600	1,833.00	10,264,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,400	1,887.00	251,725,800
ライフドリンク カンパニー	3,100	3,325.00	10,307,500
サントリー食品インターナショナル	119,900	4,378.00	524,922,200
ダイトーグループホールディングス	9,600	5,480.00	52,608,000
伊藤園	57,700	4,839.00	279,210,300
キーコーヒー	19,100	2,014.00	38,467,400
ユニカフェ	3,800	943.00	3,583,400
ジャパンフーズ	1,800	1,093.00	1,967,400
日清オイリオグループ	24,000	4,000.00	96,000,000
不二製油グループ本社	39,600	2,233.00	88,426,800
かどや製油	1,400	3,450.00	4,830,000
J - オイルミルズ	17,300	1,706.00	29,513,800
キッコーマン	112,900	8,228.00	928,941,200
味の素	411,200	5,565.00	2,288,328,000
ブルドックソース	9,000	2,039.00	18,351,000
キューピー	91,500	2,556.00	233,874,000
ハウス食品グループ本社	52,100	3,120.00	162,552,000
カゴメ	73,200	3,077.00	225,236,400
焼津水産化学工業	4,400	1,191.00	5,240,400
アリアケジャパン	14,900	4,624.00	68,897,600
ピエトロ	1,600	1,802.00	2,883,200
エバラ食品工業	4,600	2,872.00	13,211,200
やまみ	1,100	2,197.00	2,416,700
ニチレイ	78,000	3,214.00	250,692,000
東洋水産	86,100	5,980.00	514,878,000
イトアンドホールディングス	7,700	1,957.00	15,068,900
大冷	1,400	1,912.00	2,676,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,007.00	10,875,600

日清食品ホールディングス	59,900	12,240.00	733,176,000
永谷園ホールディングス	8,400	2,189.00	18,387,600
一正蒲鉾	4,900	738.00	3,616,200
フジッコ	17,500	1,893.00	33,127,500
ロック・フィールド	19,100	1,522.00	29,070,200
日本たばこ産業	1,034,800	3,423.00	3,542,120,400
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,491.00	17,444,700
わらべや日洋ホールディングス	12,500	3,015.00	37,687,500
なとり	10,700	1,971.00	21,089,700
イフジ産業	1,900	1,613.00	3,064,700
ファーマフーズ	24,400	1,400.00	34,160,000
ユーグレナ	106,000	729.00	77,274,000
紀文食品	13,300	1,111.00	14,776,300
ピクルスホールディングス	10,000	1,139.00	11,390,000
ミヨシ油脂	4,400	1,232.00	5,420,800
理研ビタミン	14,700	2,190.00	32,193,000
片倉工業	16,200	1,747.00	28,301,400
ゲンゼ	12,400	4,530.00	56,172,000
東洋紡	75,400	1,011.50	76,267,100
ユニチカ	54,900	188.00	10,321,200
富士紡ホールディングス	7,000	3,520.00	24,640,000
倉敷紡績	13,100	2,291.00	30,012,100
シキボウ	6,400	1,071.00	6,854,400
日本毛織	46,100	1,388.00	63,986,800
トーア紡コーポレーション	4,500	438.00	1,971,000
帝国繊維	19,800	1,834.00	36,313,200
帝人	166,800	1,372.00	228,849,600
東レ	1,161,300	726.30	843,452,190
住江織物	2,500	2,079.00	5,197,500
日本フェルト	7,600	415.00	3,154,000
イチカワ	1,800	1,505.00	2,709,000
日東製網	1,200	1,410.00	1,692,000
アツギ	7,100	420.00	2,982,000
ダイニック	3,000	777.00	2,331,000
セーレン	33,700	2,140.00	72,118,000
ソトー	3,800	724.00	2,751,200
東海染工	1,300	979.00	1,272,700
小松マテーレ	25,300	720.00	18,216,000
ワコールホールディングス	31,600	3,442.00	108,767,200
ホギメディカル	23,300	3,230.00	75,259,000
T S Iホールディングス	58,500	767.00	44,869,500
マツオカコーポレーション	3,200	1,643.00	5,257,600

ワールド	22,300	1,532.00	34,163,600
三陽商会	4,400	2,584.00	11,369,600
ナイガイ	4,400	284.00	1,249,600
オンワードホールディングス	112,600	472.00	53,147,200
ルックホールディングス	3,700	1,975.00	7,307,500
ゴールドウイン	30,700	9,851.00	302,425,700
デサント	29,900	4,305.00	128,719,500
キング	5,300	654.00	3,466,200
ヤマトインターナショナル	9,600	300.00	2,880,000
特種東海製紙	7,700	3,450.00	26,565,000
王子ホールディングス	721,600	618.20	446,093,120
日本製紙	90,200	1,288.00	116,177,600
三菱製紙	13,900	568.00	7,895,200
北越コーポレーション	109,500	1,037.00	113,551,500
中越パルプ工業	4,700	1,317.00	6,189,900
大王製紙	76,500	1,197.00	91,570,500
阿波製紙	2,800	475.00	1,330,000
レンゴー	157,800	992.70	156,648,060
トーモク	10,000	2,246.00	22,460,000
ザ・パック	12,900	3,240.00	41,796,000
北の達人コーポレーション	73,000	197.00	14,381,000
クラレ	252,400	1,701.50	429,458,600
旭化成	1,081,800	924.70	1,000,340,460
共和レザー	6,700	609.00	4,080,300
巴川製紙所	3,600	650.00	2,340,000
レゾナック・ホールディングス	167,400	2,457.50	411,385,500
住友化学	1,285,100	402.20	516,867,220
住友精化	7,200	4,440.00	31,968,000
日産化学	81,500	6,359.00	518,258,500
ラサ工業	6,700	1,988.00	13,319,600
クレハ	13,900	9,160.00	127,324,000
多木化学	6,700	3,390.00	22,713,000
テイカ	11,600	1,605.00	18,618,000
石原産業	31,300	1,435.00	44,915,500
片倉コープアグリ	2,400	1,086.00	2,606,400
日本曹達	18,600	5,420.00	100,812,000
東ソー	231,300	1,788.50	413,680,050
トクヤマ	55,900	2,251.50	125,858,850
セントラル硝子	27,800	2,918.00	81,120,400
東亜合成	86,900	1,338.50	116,315,650
大阪ソーダ	10,400	8,310.00	86,424,000
関東電化工業	33,500	810.00	27,135,000

デンカ	63,000	2,716.00	171,108,000
信越化学工業	1,440,000	4,297.00	6,187,680,000
日本カーバイド工業	4,400	1,740.00	7,656,000
堺化学工業	13,200	2,041.00	26,941,200
第一稀元素化学工業	15,800	937.00	14,804,600
エア・ウォーター	163,400	1,845.50	301,554,700
日本酸素ホールディングス	168,100	3,697.00	621,465,700
日本化学工業	5,800	1,920.00	11,136,000
東邦アセチレン	2,400	1,629.00	3,909,600
日本パーカラライジング	85,800	1,094.00	93,865,200
高压ガス工業	25,200	768.00	19,353,600
チタン工業	1,400	1,394.00	1,951,600
四国化成ホールディングス	22,200	1,703.00	37,806,600
戸田工業	3,900	1,760.00	6,864,000
ステラ ケミファ	10,300	3,195.00	32,908,500
保土谷化学工業	4,900	2,989.00	14,646,100
日本触媒	26,400	5,445.00	143,748,000
大日精化工業	12,000	2,166.00	25,992,000
カネカ	39,600	3,740.00	148,104,000
三菱瓦斯化学	129,400	2,019.50	261,323,300
三井化学	142,800	3,656.00	522,076,800
J S R	161,700	4,010.00	648,417,000
東京応化工業	27,600	8,603.00	237,442,800
大阪有機化学工業	14,500	2,579.00	37,395,500
三菱ケミカルグループ	1,169,000	855.20	999,728,800
K Hネオケム	26,400	2,226.00	58,766,400
ダイセル	241,200	1,226.50	295,831,800
住友ベークライト	25,700	6,659.00	171,136,300
積水化学工業	351,200	2,019.50	709,248,400
日本ゼオン	103,900	1,507.00	156,577,300
アイカ工業	43,700	3,276.00	143,161,200
U B E	89,300	2,287.50	204,273,750
積水樹脂	24,000	2,423.00	58,152,000
タキロンシーアイ	37,900	564.00	21,375,600
旭有機材	11,500	3,595.00	41,342,500
ニチバン	10,700	1,803.00	19,292,100
リケンテクノス	37,300	719.00	26,818,700
大倉工業	8,000	2,600.00	20,800,000
積水化成成品工業	24,300	439.00	10,667,700
群栄化学工業	4,100	3,165.00	12,976,500
タイガースポリマー	5,300	626.00	3,317,800
ミライアル	3,500	1,388.00	4,858,000

ダイキアクシス	4,800	721.00	3,460,800
ダイキョーニシカワ	38,200	762.00	29,108,400
竹本容器	4,400	790.00	3,476,000
森六ホールディングス	8,800	2,292.00	20,169,600
恵和	12,500	1,357.00	16,962,500
日本化薬	132,300	1,263.50	167,161,050
カーリットホールディングス	15,600	955.00	14,898,000
日本精化	9,800	2,649.00	25,960,200
扶桑化学工業	16,100	4,085.00	65,768,500
トリケミカル研究所	23,100	3,325.00	76,807,500
A D E K A	60,400	2,652.00	160,180,800
日油	53,600	6,006.00	321,921,600
新日本理化	15,900	211.00	3,354,900
ハリマ化成グループ	8,100	800.00	6,480,000
花王	391,700	5,444.00	2,132,414,800
第一工業製薬	6,200	1,663.00	10,310,600
石原ケミカル	7,900	1,599.00	12,632,100
日華化学	4,600	904.00	4,158,400
ニイタカ	2,100	2,106.00	4,422,600
三洋化成工業	10,700	3,940.00	42,158,000
有機合成薬品工業	8,500	287.00	2,439,500
大日本塗料	21,100	939.00	19,812,900
日本ペイントホールディングス	919,800	965.50	888,066,900
関西ペイント	138,900	2,177.50	302,454,750
神東塗料	9,600	126.00	1,209,600
中国塗料	28,500	1,317.00	37,534,500
日本特殊塗料	7,300	1,211.00	8,840,300
藤倉化成	23,300	438.00	10,205,400
太陽ホールディングス	26,300	2,460.00	64,698,000
D I C	67,700	2,385.50	161,498,350
サカタインクス	38,500	1,222.00	47,047,000
東洋インキS Cホールディングス	37,700	2,464.00	92,892,800
T & K T O K A	15,500	1,422.00	22,041,000
富士フイルムホールディングス	332,800	8,470.00	2,818,816,000
資生堂	362,200	4,711.00	1,706,324,200
ライオン	227,000	1,418.00	321,886,000
高砂香料工業	11,700	3,055.00	35,743,500
マンダム	37,500	1,350.00	50,625,000
ミルボン	23,600	4,001.00	94,423,600
ファンケル	75,900	2,224.00	168,801,600
コーセー	35,300	10,015.00	353,529,500
コタ	16,000	1,625.00	26,000,000

シーボン	1,500	1,513.00	2,269,500
ポーラ・オルビスホールディングス	88,900	1,664.50	147,974,050
ノエビアホールディングス	15,500	5,200.00	80,600,000
アジュバンホールディングス	2,800	920.00	2,576,000
新日本製薬	9,900	1,474.00	14,592,600
アクシージア	8,800	964.00	8,483,200
エステー	13,400	1,497.00	20,059,800
アグロ カネショウ	6,900	1,313.00	9,059,700
コニシ	29,000	2,179.00	63,191,000
長谷川香料	33,100	3,070.00	101,617,000
小林製薬	50,500	6,165.00	311,332,500
荒川化学工業	14,700	1,010.00	14,847,000
メック	14,300	3,580.00	51,194,000
日本高純度化学	4,300	2,470.00	10,621,000
タカラバイオ	46,700	1,287.00	60,102,900
J C U	19,400	3,165.00	61,401,000
新田ゼラチン	7,100	676.00	4,799,600
O A T アグリオ	4,300	1,830.00	7,869,000
デクセリアルズ	47,400	3,740.00	177,276,000
アース製薬	15,800	4,985.00	78,763,000
北興化学工業	17,500	913.00	15,977,500
大成ラミック	5,500	3,020.00	16,610,000
クミアイ化学工業	68,900	1,149.00	79,166,100
日本農薬	31,800	650.00	20,670,000
アキレス	10,900	1,503.00	16,382,700
有沢製作所	28,200	1,072.00	30,230,400
日東電工	125,900	9,414.00	1,185,222,600
レック	24,700	990.00	24,453,000
三光合成	21,800	540.00	11,772,000
きもと	17,000	183.00	3,111,000
藤森工業	13,700	3,785.00	51,854,500
前澤化成工業	11,200	1,493.00	16,721,600
未来工業	6,200	3,760.00	23,312,000
ウェーブロックホールディングス	3,500	626.00	2,191,000
J S P	12,200	1,896.00	23,131,200
エフピコ	32,800	2,577.50	84,542,000
天馬	14,200	2,451.00	34,804,200
信越ポリマー	32,100	1,317.00	42,275,700
東リ	25,900	343.00	8,883,700
ニフコ	62,600	3,729.00	233,435,400
バルカー	14,500	3,985.00	57,782,500
ユニ・チャーム	361,400	5,053.00	1,826,154,200

ショーエイコーポレーション	3,400	590.00	2,006,000	
協和キリン	209,500	2,374.00	497,353,000	
武田薬品工業	1,535,000	4,352.00	6,680,320,000	
アステラス製薬	1,638,500	1,882.00	3,083,657,000	
住友ファーマ	128,700	480.00	61,776,000	
塩野義製薬	218,700	6,993.00	1,529,369,100	
わかもと製薬	10,800	211.00	2,278,800	
日本新薬	40,900	5,510.00	225,359,000	
中外製薬	542,900	4,548.00	2,469,109,200	
科研製薬	29,700	3,344.00	99,316,800	
エーザイ	211,000	8,085.00	1,705,935,000	
ロート製薬	168,000	3,395.00	570,360,000	
小野薬品工業	334,600	2,631.50	880,499,900	
久光製薬	38,600	4,806.00	185,511,600	
持田製薬	19,900	3,310.00	65,869,000	
参天製薬	316,100	1,294.50	409,191,450	
扶桑薬品工業	5,500	1,930.00	10,615,000	
日本ケミファ	1,200	1,802.00	2,162,400	
ツムラ	54,600	2,621.00	143,106,600	
キッセイ薬品工業	25,500	3,210.00	81,855,000	
生化学工業	33,100	769.00	25,453,900	
栄研化学	28,200	1,463.00	41,256,600	
鳥居薬品	9,300	3,850.00	35,805,000	
JCRファーマ	58,700	1,115.50	65,479,850	
東和薬品	26,700	2,681.00	71,582,700	
富士製薬工業	12,800	1,152.00	14,745,600	
ゼリア新薬工業	24,000	2,008.00	48,192,000	
そーせいグループ	55,900	1,344.00	75,129,600	
第一三共	1,511,000	4,095.00	6,187,545,000	
杏林製薬	37,600	1,785.00	67,116,000	
大幸薬品	35,400	328.00	11,611,200	
ダイト	13,300	1,917.00	25,496,100	
大塚ホールディングス	360,800	4,980.00	1,796,784,000	
大正製薬ホールディングス	38,500	5,926.00	228,151,000	
ペプチドリーム	84,100	1,256.00	105,629,600	
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,717.00	30,562,600	
サワイグループホールディングス	39,700	4,575.00	181,627,500	
日本コークス工業	156,400	109.00	17,047,600	
ニチレキ	20,500	2,038.00	41,779,000	
ユシロ化学工業	9,000	1,494.00	13,446,000	
ビーピー・カストロール	4,500	902.00	4,059,000	
富士石油	35,400	326.00	11,540,400	

MORESCO	3,800	1,196.00	4,544,800
出光興産	192,600	3,332.00	641,743,200
Eneosホールディングス	2,942,100	565.00	1,662,286,500
コスモエネルギーホールディングス	68,600	5,324.00	365,226,400
横浜ゴム	87,700	2,849.50	249,901,150
TOYO TIRE	99,700	2,225.00	221,832,500
ブリヂストン	507,700	5,808.00	2,948,721,600
住友ゴム工業	170,100	1,490.00	253,449,000
藤倉コンポジット	8,200	1,140.00	9,348,000
オカモト	9,400	5,040.00	47,376,000
フコク	9,100	1,461.00	13,295,100
ニッタ	17,600	3,390.00	59,664,000
住友理工	33,600	1,017.00	34,171,200
三ツ星ベルト	25,300	4,450.00	112,585,000
バンドー化学	25,700	1,514.00	38,909,800
日東紡績	19,600	3,550.00	69,580,000
AGC	161,800	5,169.00	836,344,200
日本板硝子	88,500	685.00	60,622,500
石塚硝子	1,900	2,521.00	4,789,900
日本山村硝子	4,500	1,590.00	7,155,000
日本電気硝子	70,900	2,770.00	196,393,000
オハラ	8,400	1,329.00	11,163,600
住友大阪セメント	24,500	3,501.00	85,774,500
太平洋セメント	110,500	2,514.50	277,852,250
日本ヒューム	15,400	866.00	13,336,400
日本コンクリート工業	34,300	300.00	10,290,000
三谷セキサン	7,300	4,365.00	31,864,500
アジアパイルホールディングス	27,400	679.00	18,604,600
東海カーボン	160,200	1,134.00	181,666,800
日本カーボン	9,200	4,430.00	40,756,000
東洋炭素	12,300	5,200.00	63,960,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,700	5,830.00	50,721,000
TOTO	114,500	3,674.00	420,673,000
日本碍子	201,800	1,774.00	357,993,200
日本特殊陶業	132,100	3,184.00	420,606,400
MARUWA	6,400	22,490.00	143,936,000
品川リフラクトリーズ	24,500	1,445.00	35,402,500
黒崎播磨	3,600	9,230.00	33,228,000
ヨータイ	9,500	1,429.00	13,575,500
東京窯業	11,200	330.00	3,696,000
ニッカトー	5,500	596.00	3,278,000
フジインコーポレーテッド	41,500	2,920.00	121,180,000

クニミネ工業	3,600	997.00	3,589,200
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,103.00	2,536,900
ニチアス	43,900	3,020.00	132,578,000
ニチハ	21,800	2,940.00	64,092,000
日本製鉄	799,000	3,219.00	2,571,981,000
神戸製鋼所	358,900	1,788.00	641,713,200
中山製鋼所	36,800	848.00	31,206,400
合同製鐵	8,900	4,195.00	37,335,500
J F E ホールディングス	496,300	2,069.50	1,027,092,850
東京製鐵	50,200	1,637.00	82,177,400
共英製鋼	20,300	1,854.00	37,636,200
大和工業	29,400	6,969.00	204,888,600
東京鐵鋼	8,500	3,275.00	27,837,500
大阪製鐵	8,200	1,690.00	13,858,000
淀川製鋼所	20,300	3,525.00	71,557,500
中部鋼鈹	14,700	2,051.00	30,149,700
丸一鋼管	54,300	3,649.00	198,140,700
モリ工業	2,700	4,010.00	10,827,000
大同特殊鋼	22,500	5,895.00	132,637,500
日本高周波鋼業	4,100	601.00	2,464,100
日本冶金工業	13,000	4,145.00	53,885,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,646.00	46,569,600
愛知製鋼	10,300	3,745.00	38,573,500
日本金属	2,600	854.00	2,220,400
大平洋金属	12,700	1,283.00	16,294,100
新日本電工	88,900	288.00	25,603,200
栗本鐵工所	8,500	2,816.00	23,936,000
虹技	1,500	1,391.00	2,086,500
三菱製鋼	11,200	1,385.00	15,512,000
日亜鋼業	12,200	286.00	3,489,200
日本精線	2,400	4,805.00	11,532,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	627.00	5,141,400
シンニッタン	13,000	241.00	3,133,000
新家工業	2,600	3,060.00	7,956,000
大紀アルミニウム工業所	25,500	1,214.00	30,957,000
日本輕金属ホールディングス	48,200	1,583.00	76,300,600
三井金属鈹業	51,900	3,762.00	195,247,800
東邦亜鉛	10,600	1,608.00	17,044,800
三菱マテリアル	119,100	2,325.00	276,907,500
住友金属鈹山	206,900	4,138.00	856,152,200
D O W A ホールディングス	40,100	4,500.00	180,450,000
古河機械金属	26,200	1,907.00	49,963,400

大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	3,120.00	81,744,000
東邦チタニウム	32,300	1,818.00	58,721,400
U A C J	25,000	3,000.00	75,000,000
C Kサンエツ	4,300	3,550.00	15,265,000
古河電気工業	59,400	2,245.50	133,382,700
住友電気工業	616,200	1,606.00	989,617,200
フジクラ	191,400	1,135.50	217,334,700
S W C C	20,000	1,998.00	39,960,000
タツタ電線	36,400	694.00	25,261,600
カナレ電気	2,100	1,409.00	2,958,900
平河ヒューテック	10,300	1,455.00	14,986,500
リョービ	19,000	2,682.00	50,958,000
アーレスティ	13,200	682.00	9,002,400
A R Eホールディングス	72,200	1,880.00	135,736,000
稲葉製作所	9,300	1,477.00	13,736,100
宮地エンジニアリンググループ	9,800	3,060.00	29,988,000
トーカロ	47,500	1,370.00	65,075,000
アルファC o	4,400	1,373.00	6,041,200
S U M C O	317,100	1,953.50	619,454,850
川田テクノロジーズ	4,200	6,340.00	26,628,000
R S Technologies	11,900	2,645.00	31,475,500
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,240.00	3,584,000
信和	6,600	746.00	4,923,600
東洋製罐グループホールディングス	106,400	2,460.50	261,797,200
ホッカンホールディングス	9,600	1,525.00	14,640,000
コロナ	10,000	915.00	9,150,000
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,657.00	59,251,100
駒井ハルテック	1,900	2,162.00	4,107,800
高田機工	1,000	3,105.00	3,105,000
三和ホールディングス	164,300	2,028.00	333,200,400
文化シャッター	51,400	1,130.00	58,082,000
三協立山	20,400	775.00	15,810,000
アルインコ	13,600	1,043.00	14,184,800
東洋シャッター	2,700	630.00	1,701,000
L I X I L	260,000	1,616.50	420,290,000
日本フィルコン	7,700	470.00	3,619,000
ノーリツ	29,600	1,565.00	46,324,000
長府製作所	17,700	2,105.00	37,258,500
リンナイ	97,000	2,688.00	260,736,000
ダイニチ工業	5,900	717.00	4,230,300
日東精工	25,900	573.00	14,840,700
三洋工業	1,400	2,041.00	2,857,400

岡部	31,900	718.00	22,904,200
ジーテクト	19,900	1,738.00	34,586,200
東プレ	31,400	1,603.00	50,334,200
高周波熱錬	27,500	1,012.00	27,830,000
東京製綱	10,500	1,382.00	14,511,000
サンコール	10,600	491.00	5,204,600
モリテック スチール	8,800	286.00	2,516,800
パイオラックス	24,600	2,147.00	52,816,200
エイチワン	18,400	789.00	14,517,600
日本発條	157,800	1,049.50	165,611,100
中央発條	13,200	715.00	9,438,000
アドバネクス	1,500	968.00	1,452,000
立川ブラインド工業	8,100	1,363.00	11,040,300
三益半導体工業	13,800	2,594.00	35,797,200
日本ドライケミカル	2,800	2,096.00	5,868,800
日本製鋼所	48,100	2,539.50	122,149,950
三浦工業	73,000	2,953.00	215,569,000
タクマ	53,700	1,467.00	78,777,900
ツガミ	38,900	1,115.00	43,373,500
オークマ	17,500	6,502.00	113,785,000
芝浦機械	17,500	3,890.00	68,075,000
アマダ	278,800	1,470.50	409,975,400
アイダエンジニアリング	36,000	925.00	33,300,000
TAKISAWA	3,100	2,597.00	8,050,700
FUJI	75,900	2,355.50	178,782,450
牧野フライス製作所	19,300	6,200.00	119,660,000
オーエスジー	77,000	1,716.00	132,132,000
ダイジェット工業	1,300	883.00	1,147,900
旭ダイヤモンド工業	48,900	813.00	39,755,700
D M G 森精機	105,900	2,467.50	261,308,250
ソディック	42,600	764.00	32,546,400
ディスコ	84,100	28,000.00	2,354,800,000
日東工器	8,500	1,926.00	16,371,000
日進工具	14,600	1,078.00	15,738,800
パンチ工業	10,700	415.00	4,440,500
富士ダイス	5,500	644.00	3,542,000
豊和工業	6,500	763.00	4,959,500
リケンN P R	17,700	1,735.00	30,709,500
東洋機械金属	8,100	677.00	5,483,700
エンシュウ	2,600	755.00	1,963,000
島精機製作所	27,800	1,623.00	45,119,400
オプトラン	28,700	1,829.00	52,492,300

NCホールディングス	2,400	1,655.00	3,972,000
イワキポンプ	11,700	1,894.00	22,159,800
フリュー	18,300	1,427.00	26,114,100
ヤマシンフィルタ	41,800	304.00	12,707,200
日阪製作所	17,000	956.00	16,252,000
やまびこ	28,600	1,387.00	39,668,200
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,800.00	34,220,000
平田機工	8,400	7,000.00	58,800,000
P E G A S U S	19,400	610.00	11,834,000
マルマエ	7,600	1,409.00	10,708,400
タツモ	10,600	2,956.00	31,333,600
ナプテスコ	109,700	2,692.00	295,312,400
三井海洋開発	22,100	1,689.00	37,326,900
レオン自動機	18,400	1,320.00	24,288,000
S M C	56,600	70,110.00	3,968,226,000
ホソカワミクロン	11,200	4,140.00	46,368,000
ユニオンツール	7,700	3,730.00	28,721,000
瑞光	12,600	1,152.00	14,515,200
オイレス工業	24,400	1,927.00	47,018,800
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,525.00	31,675,000
サトーホールディングス	24,900	2,044.00	50,895,600
技研製作所	16,400	1,933.00	31,701,200
日本エアージェット	8,200	1,317.00	10,799,400
カワタ	3,400	1,030.00	3,502,000
日精樹脂工業	13,100	1,029.00	13,479,900
オカダアイヨン	3,600	1,936.00	6,969,600
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,484.00	12,171,600
小松製作所	818,500	3,810.00	3,118,485,000
住友重機械工業	103,400	3,533.00	365,312,200
日立建機	69,600	4,089.00	284,594,400
日工	26,000	659.00	17,134,000
巴工業	6,800	2,808.00	19,094,400
井関農機	16,400	1,098.00	18,007,200
T O W A	17,800	5,370.00	95,586,000
丸山製作所	2,000	2,056.00	4,112,000
北川鉄工所	6,900	1,445.00	9,970,500
ローツェ	9,100	12,020.00	109,382,000
タカキタ	3,400	451.00	1,533,400
クボタ	916,700	2,018.00	1,849,900,600
荏原実業	9,200	2,619.00	24,094,800
三菱化工機	5,700	2,695.00	15,361,500
月島ホールディングス	23,700	1,253.00	29,696,100

帝国電機製作所	12,300	2,446.00	30,085,800
新東工業	35,400	1,041.00	36,851,400
澁谷工業	16,400	2,450.00	40,180,000
アイチ コーポレーション	24,400	921.00	22,472,400
小森コーポレーション	40,600	1,039.00	42,183,400
鶴見製作所	13,400	3,160.00	42,344,000
日本ギア工業	4,100	378.00	1,549,800
酒井重工業	1,900	5,280.00	10,032,000
荏原製作所	71,700	6,556.00	470,065,200
石井鐵工所	1,400	2,944.00	4,121,600
西島製作所	15,100	1,794.00	27,089,400
北越工業	17,600	1,876.00	33,017,600
ダイキン工業	208,500	22,015.00	4,590,127,500
オルガノ	24,000	3,935.00	94,440,000
トーヨーカネツ	6,700	3,325.00	22,277,500
栗田工業	97,700	4,332.00	423,236,400
椿本チエイン	24,800	3,840.00	95,232,000
大同工業	4,800	738.00	3,542,400
木村化工機	13,500	700.00	9,450,000
アネスト岩田	29,800	1,114.00	33,197,200
ダイフク	270,300	2,573.00	695,481,900
サムコ	4,700	4,250.00	19,975,000
加藤製作所	5,600	1,185.00	6,636,000
油研工業	1,800	2,216.00	3,988,800
タダノ	100,600	1,156.00	116,293,600
フジテック	61,300	3,235.00	198,305,500
C K D	48,300	2,038.00	98,435,400
平和	58,100	2,115.00	122,881,500
理想科学工業	14,000	2,357.00	32,998,000
S A N K Y O	34,300	6,260.00	214,718,000
日本金銭機械	19,300	965.00	18,624,500
マースグループホールディングス	10,300	2,524.00	25,997,200
フクシマガリレイ	12,900	4,870.00	62,823,000
オーイズミ	4,500	373.00	1,678,500
ダイコク電機	9,600	4,350.00	41,760,000
竹内製作所	31,700	4,580.00	145,186,000
アマノ	49,600	3,156.00	156,537,600
J U K I	27,200	594.00	16,156,800
ジャノメ	17,800	690.00	12,282,000
マックス	21,500	2,534.00	54,481,000
グローリー	42,000	2,780.00	116,760,000
新晃工業	17,600	2,153.00	37,892,800

大和冷機工業	26,800	1,322.00	35,429,600
セガサミーホールディングス	140,400	2,405.00	337,662,000
T P R	20,000	1,738.00	34,760,000
ツバキ・ナカシマ	35,100	716.00	25,131,600
ホシザキ	103,100	4,825.00	497,457,500
大豊工業	15,200	802.00	12,190,400
日本精工	291,100	821.20	239,051,320
N T N	344,400	270.30	93,091,320
ジェイテクト	155,500	1,259.50	195,852,250
不二越	12,900	3,755.00	48,439,500
日本トムソン	42,900	549.00	23,552,100
T H K	100,800	2,730.50	275,234,400
ユーシン精機	13,900	666.00	9,257,400
前澤給装工業	12,300	1,266.00	15,571,800
イーグル工業	19,300	1,648.00	31,806,400
前澤工業	6,700	885.00	5,929,500
日本ピラー工業	16,200	3,795.00	61,479,000
キッツ	58,500	1,015.00	59,377,500
マキタ	217,300	3,616.00	785,756,800
三井E & S	86,500	432.00	37,368,000
日立造船	143,200	793.00	113,557,600
三菱重工業	305,500	7,914.00	2,417,727,000
I H I	110,100	2,821.00	310,592,100
スター精密	32,900	1,843.00	60,634,700
日清紡ホールディングス	131,300	1,089.00	142,985,700
イビデン	100,300	7,414.00	743,624,200
コニカミノルタ	390,900	450.20	175,983,180
ブラザー工業	233,500	2,365.00	552,227,500
ミネベアミツミ	304,000	2,352.00	715,008,000
日立製作所	849,400	8,750.00	7,432,250,000
三菱電機	1,805,200	1,765.00	3,186,178,000
富士電機	106,200	6,237.00	662,369,400
東洋電機製造	3,800	942.00	3,579,600
安川電機	207,000	5,155.00	1,067,085,000
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,540.00	29,722,000
明電舎	26,500	2,052.00	54,378,000
オリジン	2,600	1,269.00	3,299,400
山洋電気	7,600	6,190.00	47,044,000
デンヨー	13,300	2,117.00	28,156,100
P H C ホールディングス	24,700	1,443.00	35,642,100
ソシオネクスト	25,300	14,830.00	375,199,000
東芝テック	26,100	3,165.00	82,606,500

芝浦メカトロニクス	9,100	7,010.00	63,791,000
マブチモーター	43,500	4,355.00	189,442,500
ニデック	425,000	6,699.00	2,847,075,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	452.00	6,147,200
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,005.00	16,842,000
東光高岳	10,700	1,921.00	20,554,700
ダブル・スコープ	50,000	986.00	49,300,000
ダイヘン	15,800	4,700.00	74,260,000
ヤーマン	30,500	1,018.00	31,049,000
JVCケンウッド	159,600	626.00	99,909,600
ミマキエンジニアリング	17,000	748.00	12,716,000
I - P E X	12,300	1,525.00	18,757,500
大崎電気工業	41,400	635.00	26,289,000
オムロン	160,100	6,210.00	994,221,000
日東工業	23,500	3,455.00	81,192,500
I D E C	25,800	2,792.00	72,033,600
正興電機製作所	4,200	1,143.00	4,800,600
不二電機工業	2,600	1,094.00	2,844,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,500	2,440.00	140,300,000
サクサホールディングス	2,400	2,317.00	5,560,800
メルコホールディングス	4,500	3,335.00	15,007,500
テクノメディカ	4,400	2,222.00	9,776,800
日本電気	247,000	7,636.00	1,886,092,000
富士通	174,000	17,020.00	2,961,480,000
沖電気工業	79,000	945.00	74,655,000
岩崎通信機	5,100	789.00	4,023,900
電気興業	7,000	2,455.00	17,185,000
サンケン電気	16,200	8,030.00	130,086,000
ナカヨ	1,900	1,218.00	2,314,200
アイホン	10,600	2,986.00	31,651,600
ルネサスエレクトロニクス	1,140,100	2,249.00	2,564,084,900
セイコーエプソン	224,100	2,309.00	517,446,900
ワコム	133,400	559.00	74,570,600
アルバック	41,500	5,483.00	227,544,500
アクセル	4,600	1,827.00	8,404,200
E I Z O	12,800	4,860.00	62,208,000
日本信号	39,800	914.00	36,377,200
京三製作所	36,600	484.00	17,714,400
能美防災	23,800	1,772.00	42,173,600
ホーチキ	13,300	1,632.00	21,705,600
星和電機	5,900	484.00	2,855,600
エレコム	42,000	1,735.00	72,870,000

パナソニック ホールディングス	2,063,100	1,487.50	3,068,861,250
シャープ	210,300	934.40	196,504,320
アンリツ	123,000	997.10	122,643,300
富士通ゼネラル	49,500	2,655.50	131,447,250
ソニーグループ	1,223,400	12,555.00	15,359,787,000
T D K	276,600	5,606.00	1,550,619,600
帝国通信工業	8,000	1,828.00	14,624,000
タムラ製作所	74,900	500.00	37,450,000
アルプスアルパイン	156,300	1,236.50	193,264,950
池上通信機	3,700	847.00	3,133,900
日本電波工業	21,200	1,216.00	25,779,200
鈴木	9,600	1,131.00	10,857,600
メイコー	19,200	3,225.00	61,920,000
日本トリム	4,000	2,915.00	11,660,000
ローランド ディー・ジー・	9,700	3,300.00	32,010,000
フォスター電機	16,200	948.00	15,357,600
S M K	4,200	2,344.00	9,844,800
ヨコオ	14,100	1,350.00	19,035,000
ホシデン	40,800	1,750.00	71,400,000
ヒロセ電機	28,100	17,820.00	500,742,000
日本航空電子工業	35,800	2,876.00	102,960,800
T O A	19,900	1,057.00	21,034,300
マクセル	35,600	1,605.00	57,138,000
古野電気	22,900	1,585.00	36,296,500
スミダコーポレーション	23,600	1,321.00	31,175,600
アイコム	6,700	3,495.00	23,416,500
リオン	7,300	2,375.00	17,337,500
横河電機	191,100	2,711.50	518,167,650
新電元工業	6,700	2,961.00	19,838,700
アズビル	120,800	4,492.00	542,633,600
東亜ディーケーケー	5,800	859.00	4,982,200
日本光電工業	80,000	3,571.00	285,680,000
チノー	7,200	2,046.00	14,731,200
共和電業	10,800	375.00	4,050,000
日本電子材料	11,400	1,409.00	16,062,600
堀場製作所	33,000	7,790.00	257,070,000
アドバンテスト	545,100	4,259.00	2,321,580,900
小野測器	5,500	434.00	2,387,000
エスベック	14,000	2,209.00	30,926,000
キーエンス	173,000	54,630.00	9,450,990,000
日置電機	8,200	6,740.00	55,268,000
シスメックス	149,300	7,056.00	1,053,460,800

日本マイクロニクス	31,200	2,349.00	73,288,800
メガチップス	14,200	4,115.00	58,433,000
O B A R A G R O U P	9,500	3,685.00	35,007,500
澤藤電機	1,600	1,247.00	1,995,200
原田工業	5,500	811.00	4,460,500
コーセル	21,100	1,155.00	24,370,500
イリソ電子工業	16,000	3,755.00	60,080,000
オブテックスグループ	31,900	1,669.00	53,241,100
千代田インテグレ	6,900	2,806.00	19,361,400
レーザーテック	79,300	26,500.00	2,101,450,000
スタンレー電気	121,900	2,388.00	291,097,200
ウシオ電機	88,000	1,935.50	170,324,000
岡谷電機産業	10,100	290.00	2,929,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	379.00	4,358,500
エノモト	3,100	1,650.00	5,115,000
日本セラミック	15,200	2,690.00	40,888,000
遠藤照明	5,400	1,191.00	6,431,400
古河電池	13,100	923.00	12,091,300
双信電機	5,700	337.00	1,920,900
山一電機	14,300	1,737.00	24,839,100
図研	15,100	3,620.00	54,662,000
日本電子	43,400	4,841.00	210,099,400
カシオ計算機	128,800	1,184.50	152,563,600
ファナック	843,300	3,823.00	3,223,935,900
日本シイエムケイ	37,200	668.00	24,849,600
エンプラス	5,100	9,620.00	49,062,000
大真空	21,500	738.00	15,867,000
ローム	319,900	2,724.50	871,567,550
浜松ホトニクス	138,800	5,921.00	821,834,800
三井ハイテック	17,900	6,730.00	120,467,000
新光電気工業	61,300	5,476.00	335,678,800
京セラ	268,700	7,324.00	1,967,958,800
太陽誘電	84,300	3,472.00	292,689,600
村田製作所	1,573,600	2,632.00	4,141,715,200
双葉電子工業	33,600	507.00	17,035,200
北陸電気工業	4,600	1,309.00	6,021,400
ニチコン	35,600	1,274.00	45,354,400
日本ケミコン	17,300	1,295.00	22,403,500
K O A	26,400	1,661.00	43,850,400
市光工業	31,800	529.00	16,822,200
小糸製作所	208,100	2,219.50	461,877,950
ミツバ	32,400	682.00	22,096,800

SCREENホールディングス	59,100	7,243.00	428,061,300
キャノン電子	19,300	1,819.00	35,106,700
キャノン	862,600	3,695.00	3,187,307,000
リコー	433,600	1,226.50	531,810,400
象印マホービン	48,400	1,516.00	73,374,400
MUTOHホールディングス	1,700	1,957.00	3,326,900
東京エレクトロン	366,000	20,085.00	7,351,110,000
イノテック	11,700	1,590.00	18,603,000
トヨタ紡織	72,900	2,549.00	185,822,100
芦森工業	2,200	2,022.00	4,448,400
ユニプレス	31,100	1,048.00	32,592,800
豊田自動織機	126,400	11,140.00	1,408,096,000
モリタホールディングス	30,400	1,554.00	47,241,600
三櫻工業	26,500	878.00	23,267,000
デンソー	1,426,900	2,312.50	3,299,706,250
東海理化電機製作所	48,800	2,204.00	107,555,200
川崎重工業	130,300	3,433.00	447,319,900
名村造船所	29,600	816.00	24,153,600
日本車輛製造	6,600	2,008.00	13,252,800
三菱ロジスネクスト	27,600	1,214.00	33,506,400
近畿車輛	1,600	1,972.00	3,155,200
日産自動車	2,456,700	600.90	1,476,231,030
いすゞ自動車	502,800	1,771.00	890,458,800
トヨタ自動車	9,496,200	2,617.00	24,851,555,400
日野自動車	223,000	531.40	118,502,200
三菱自動車工業	674,700	524.40	353,812,680
エフテック	8,100	710.00	5,751,000
レシップホールディングス	4,500	500.00	2,250,000
GMB	2,300	1,804.00	4,149,200
ファルテック	2,000	557.00	1,114,000
武蔵精密工業	42,300	1,462.00	61,842,600
日産車体	30,500	808.00	24,644,000
新明和工業	54,300	1,211.00	65,757,300
極東開発工業	28,600	1,767.00	50,536,200
トピー工業	14,100	2,367.00	33,374,700
ティラド	4,400	2,073.00	9,121,200
曙ブレーキ工業	105,500	126.00	13,293,000
タチエス	27,400	1,609.00	44,086,600
NOK	67,200	1,887.00	126,806,400
フタバ産業	46,500	696.00	32,364,000
カヤバ	16,700	4,375.00	73,062,500
大同メタル工業	34,000	513.00	17,442,000

プレス工業	77,400	642.00	49,690,800
ミクニ	13,400	438.00	5,869,200
太平洋工業	39,700	1,353.00	53,714,100
アイシン	133,400	5,386.00	718,492,400
マツダ	572,000	1,513.50	865,722,000
今仙電機製作所	7,400	587.00	4,343,800
本田技研工業	4,217,400	1,632.00	6,882,796,800
スズキ	317,600	5,788.00	1,838,268,800
S U B A R U	547,200	2,683.50	1,468,411,200
安永	5,100	737.00	3,758,700
ヤマハ発動機	249,100	3,778.00	941,099,800
T B K	11,700	389.00	4,551,300
エクセディ	28,300	2,486.00	70,353,800
豊田合成	50,500	2,953.00	149,126,500
愛三工業	28,700	1,160.00	33,292,000
盟和産業	1,700	989.00	1,681,300
日本プラスト	9,300	436.00	4,054,800
ヨロズ	16,300	890.00	14,507,000
エフ・シー・シー	30,700	1,768.00	54,277,600
シマノ	70,200	20,570.00	1,444,014,000
テイ・エス テック	79,200	1,663.50	131,749,200
ジャムコ	6,300	1,484.00	9,349,200
テルモ	531,900	3,869.00	2,057,921,100
クリエートメディック	3,800	908.00	3,450,400
日機装	40,300	927.00	37,358,100
日本エム・ディ・エム	10,300	714.00	7,354,200
島津製作所	210,600	3,701.00	779,430,600
J M S	16,000	526.00	8,416,000
長野計器	12,600	2,304.00	29,030,400
ブイ・テクノロジー	8,500	1,964.00	16,694,000
東京計器	13,300	1,474.00	19,604,200
愛知時計電機	6,700	1,920.00	12,864,000
インターアクション	8,200	1,026.00	8,413,200
オーバル	10,200	425.00	4,335,000
東京精密	38,100	7,080.00	269,748,000
マニー	69,200	2,058.00	142,413,600
ニコン	250,100	1,490.00	372,649,000
トプコン	91,000	1,705.00	155,155,000
オリンパス	1,064,500	1,965.50	2,092,274,750
理研計器	10,700	6,110.00	65,377,000
タムロン	10,600	4,275.00	45,315,000
H O Y A	366,400	14,615.00	5,354,936,000

シード	5,900	771.00	4,548,900
ノーリツ銅機	16,400	3,185.00	52,234,000
A & Dホロンホールディングス	25,200	1,555.00	39,186,000
朝日インテック	193,200	2,550.00	492,660,000
シチズン時計	159,100	881.00	140,167,100
リズム	3,600	2,500.00	9,000,000
大研医器	8,700	529.00	4,602,300
メニコン	59,400	1,710.00	101,574,000
シンシア	1,400	522.00	730,800
松風	7,800	2,211.00	17,245,800
セイコーグループ	26,800	2,351.00	63,006,800
ニプロ	144,200	1,085.00	156,457,000
K Y O R I T S U	17,200	169.00	2,906,800
中本パックス	3,500	1,628.00	5,698,000
スノーピーク	24,700	1,021.00	25,218,700
パラマウントベッドホールディングス	39,900	2,369.00	94,523,100
トランザクション	11,400	1,958.00	22,321,200
粧美堂	3,100	460.00	1,426,000
ニホンフラッシュ	16,200	862.00	13,964,400
前田工織	14,600	2,891.00	42,208,600
永大産業	12,300	215.00	2,644,500
アートネイチャー	17,800	814.00	14,489,200
バンダイナムコホールディングス	473,800	3,107.00	1,472,096,600
アイフィスジャパン	3,200	602.00	1,926,400
S H O E I	39,100	2,089.00	81,679,900
フランスベッドホールディングス	19,900	1,184.00	23,561,600
パイロットコーポレーション	24,300	5,164.00	125,485,200
萩原工業	11,600	1,721.00	19,963,600
フジシールインターナショナル	35,000	1,678.00	58,730,000
タカラトミー	78,700	2,015.00	158,580,500
広済堂ホールディングス	7,800	2,743.00	21,395,400
エステールホールディングス	2,700	625.00	1,687,500
タカノ	4,300	811.00	3,487,300
プロネクサス	14,300	1,176.00	16,816,800
ホクシン	8,800	122.00	1,073,600
ウッドワン	3,800	1,059.00	4,024,200
T O P P A Nホールディングス	212,600	3,302.00	702,005,200
大日本印刷	189,000	3,870.00	731,430,000
共同印刷	4,900	2,996.00	14,680,400
N I S S H A	29,600	1,593.00	47,152,800
光村印刷	1,000	1,281.00	1,281,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,100	2,271.00	25,208,100

アシックス	147,400	4,646.00	684,820,400
ツツミ	3,000	2,428.00	7,284,000
ローランド	12,700	4,185.00	53,149,500
小松ウオール工業	6,300	2,882.00	18,156,600
ヤマハ	109,000	3,945.00	430,005,000
河合楽器製作所	4,700	3,980.00	18,706,000
クリナップ	19,400	688.00	13,347,200
ピジョン	110,100	1,607.00	176,930,700
キングジム	15,300	890.00	13,617,000
リンテック	34,700	2,525.00	87,617,500
イトーキ	35,400	1,414.00	50,055,600
任天堂	1,091,900	6,101.00	6,661,681,900
三菱鉛筆	24,600	1,853.00	45,583,800
タカラスタANDARD	31,900	1,800.00	57,420,000
コクヨ	74,700	2,346.00	175,246,200
ナカバヤシ	18,600	509.00	9,467,400
グローブライド	14,000	1,891.00	26,474,000
オカムラ	52,100	2,134.00	111,181,400
美津濃	17,200	4,425.00	76,110,000
東京電力ホールディングス	1,559,000	636.20	991,835,800
中部電力	637,300	1,795.00	1,143,953,500
関西電力	667,800	1,943.00	1,297,535,400
中国電力	275,400	921.30	253,726,020
北陸電力	163,200	761.90	124,342,080
東北電力	422,800	940.70	397,727,960
四国電力	147,600	1,020.00	150,552,000
九州電力	398,700	953.30	380,080,710
北海道電力	167,100	633.90	105,924,690
沖縄電力	40,500	1,066.00	43,173,000
電源開発	130,200	2,319.50	301,998,900
エフオン	11,200	459.00	5,140,800
イーレックス	30,700	722.00	22,165,400
レノバ	46,100	1,082.00	49,880,200
東京瓦斯	365,600	3,402.00	1,243,771,200
大阪瓦斯	350,300	2,466.00	863,839,800
東邦瓦斯	68,100	2,590.00	176,379,000
北海道瓦斯	10,300	2,286.00	23,545,800
広島ガス	36,500	389.00	14,198,500
西部ガスホールディングス	16,200	1,950.00	31,590,000
静岡ガス	36,300	1,009.00	36,626,700
メタウォーター	20,700	1,836.00	38,005,200
SBSホールディングス	15,400	2,583.00	39,778,200

東武鉄道	190,000	3,520.00	668,800,000
相鉄ホールディングス	57,100	2,680.00	153,028,000
東急	484,900	1,645.00	797,660,500
京浜急行電鉄	196,200	1,243.50	243,974,700
小田急電鉄	262,100	2,066.00	541,498,600
京王電鉄	91,500	4,374.00	400,221,000
京成電鉄	111,500	5,541.00	617,821,500
富士急行	21,300	4,065.00	86,584,500
東日本旅客鉄道	293,300	7,739.00	2,269,848,700
西日本旅客鉄道	220,900	5,635.00	1,244,771,500
東海旅客鉄道	666,100	3,335.00	2,221,443,500
西武ホールディングス	209,200	1,427.00	298,528,400
鴻池運輸	29,500	1,904.00	56,168,000
西日本鉄道	46,200	2,391.50	110,487,300
ハマキョウレックス	13,500	3,775.00	50,962,500
サカイ引越センター	16,400	2,515.00	41,246,000
近鉄グループホールディングス	172,600	4,144.00	715,254,400
阪急阪神ホールディングス	230,200	4,637.00	1,067,437,400
南海電気鉄道	82,500	2,810.50	231,866,250
京阪ホールディングス	95,200	3,572.00	340,054,400
神戸電鉄	4,700	2,805.00	13,183,500
名古屋鉄道	190,800	2,077.00	396,291,600
山陽電気鉄道	13,000	2,066.00	26,858,000
アルプス物流	13,800	1,640.00	22,632,000
ヤマトホールディングス	221,100	2,381.00	526,439,100
山九	43,900	5,090.00	223,451,000
丸運	5,600	243.00	1,360,800
丸全昭和運輸	10,700	3,760.00	40,232,000
センコーグループホールディングス	91,400	1,028.00	93,959,200
トナミホールディングス	3,800	4,345.00	16,511,000
ニッコンホールディングス	55,300	3,239.00	179,116,700
日本石油輸送	1,200	2,735.00	3,282,000
福山通運	13,100	4,055.00	53,120,500
セイノーホールディングス	97,100	2,129.50	206,774,450
エスライングループ本社	3,200	875.00	2,800,000
神奈川中央交通	4,900	3,015.00	14,773,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,700	2,034.00	84,817,800
C & F ロジホールディングス	16,600	1,372.00	22,775,200
九州旅客鉄道	122,100	3,021.00	368,864,100
S Gホールディングス	331,300	1,905.00	631,126,500
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,600	7,580.00	444,188,000
日本郵船	462,200	3,863.00	1,785,478,600

商船三井	304,700	4,088.00	1,245,613,600
川崎汽船	129,900	5,225.00	678,727,500
N S ユナイテッド海運	9,600	4,255.00	40,848,000
飯野海運	64,600	1,035.00	66,861,000
共栄タンカー	3,600	832.00	2,995,200
乾汽船	23,000	1,221.00	28,083,000
日本航空	424,100	2,657.00	1,126,833,700
A N A ホールディングス	469,800	2,871.50	1,349,030,700
パスコ	2,200	1,582.00	3,480,400
ランコム	5,000	7,140.00	35,700,000
日新	13,100	2,559.00	33,522,900
三菱倉庫	37,100	3,879.00	143,910,900
三井倉庫ホールディングス	16,100	4,220.00	67,942,000
住友倉庫	46,600	2,385.00	111,141,000
澁澤倉庫	6,900	2,968.00	20,479,200
東陽倉庫	3,000	1,415.00	4,245,000
日本トランスシティ	34,700	651.00	22,589,700
ケイヒン	2,000	1,862.00	3,724,000
中央倉庫	8,300	1,065.00	8,839,500
川西倉庫	1,900	1,033.00	1,962,700
安田倉庫	11,800	1,082.00	12,767,600
ファイズホールディングス	2,100	1,031.00	2,165,100
東洋埠頭	3,300	1,391.00	4,590,300
上組	82,800	3,054.00	252,871,200
サンリツ	2,600	719.00	1,869,400
キムラユニティー	5,500	1,216.00	6,688,000
キューソー流通システム	5,900	940.00	5,546,000
東海運	6,700	283.00	1,896,100
エーアイティー	10,800	1,626.00	17,560,800
内外トランスライン	6,900	2,398.00	16,546,200
日本コンセプト	6,300	1,727.00	10,880,100
N E C ネットズエスアイ	58,000	1,977.00	114,666,000
クロスキャット	9,900	1,004.00	9,939,600
システナ	291,700	253.00	73,800,100
デジタルアーツ	11,000	4,250.00	46,750,000
日鉄ソリューションズ	29,600	4,090.00	121,064,000
キューブシステム	10,300	1,067.00	10,990,100
コア	7,700	1,665.00	12,820,500
手間いらず	2,900	2,138.00	6,200,200
ラクーンホールディングス	14,400	683.00	9,835,200
ソリトンシステムズ	9,000	1,109.00	9,981,000
ソフトクリエイイトホールディングス	14,300	1,740.00	24,882,000

T I S	189,700	3,142.00	596,037,400
テクミラホールディングス	5,400	400.00	2,160,000
グリー	46,600	561.00	26,142,600
GMOペパボ	2,300	1,212.00	2,787,600
コーエーテクモホールディングス	108,700	2,026.50	220,280,550
三菱総合研究所	8,500	4,810.00	40,885,000
電算	1,400	1,571.00	2,199,400
A G S	4,900	675.00	3,307,500
ファインデックス	13,800	884.00	12,199,200
ブレインパッド	13,000	818.00	10,634,000
K L a b	31,900	270.00	8,613,000
ポルトゥウィンホールディングス	29,700	477.00	14,166,900
ネクソン	387,300	2,500.00	968,250,000
アイスタイル	51,500	433.00	22,299,500
エムアップホールディングス	21,300	1,147.00	24,431,100
エイチーム	10,300	555.00	5,716,500
エニグモ	22,200	324.00	7,192,800
テクノスジャパン	9,500	723.00	6,868,500
コロプラ	67,300	581.00	39,101,300
ブロードリーフ	94,600	518.00	49,002,800
クロス・マーケティンググループ	7,000	644.00	4,508,000
デジタルハーツホールディングス	10,900	912.00	9,940,800
システム情報	13,800	928.00	12,806,400
メディアドゥ	6,900	1,197.00	8,259,300
じげん	50,600	506.00	25,603,600
ブイキューブ	20,900	349.00	7,294,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	490.00	1,372,000
サイバーリンクス	4,500	719.00	3,235,500
フィックスターズ	19,600	1,000.00	19,600,000
C A R T A H O L D I N G S	8,200	1,182.00	9,692,400
オブティム	14,300	806.00	11,525,800
セレス	7,000	911.00	6,377,000
S H I F T	11,500	26,420.00	303,830,000
ティーガイア	18,200	1,745.00	31,759,000
セック	1,600	3,635.00	5,816,000
テクマトリックス	31,700	1,487.00	47,137,900
プロシップ	7,600	1,299.00	9,872,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,200	2,303.50	104,118,200
GMOペイメントゲートウェイ	34,700	6,281.00	217,950,700
ザッパラス	3,300	435.00	1,435,500
システムリサーチ	5,400	3,175.00	17,145,000
インターネットイニシアティブ	94,800	2,452.00	232,449,600

さくらインターネット	19,500	1,119.00	21,820,500
ヴィンクス	2,800	1,190.00	3,332,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,503.00	13,265,900
SRAホールディングス	8,900	3,375.00	30,037,500
システムインテグレータ	3,500	404.00	1,414,000
朝日ネット	18,700	603.00	11,276,100
eBASE	24,500	652.00	15,974,000
アバントグループ	21,900	1,208.00	26,455,200
アドソル日進	7,300	1,563.00	11,409,900
ODKソリューションズ	2,600	547.00	1,422,200
フリービット	9,100	1,041.00	9,473,100
コムチュア	23,000	2,128.00	48,944,000
サイバーコム	1,900	1,220.00	2,318,000
アステリア	13,600	668.00	9,084,800
アイル	8,100	3,610.00	29,241,000
マークラインズ	9,400	2,803.00	26,348,200
メディカル・データ・ビジョン	20,800	687.00	14,289,600
gumi	25,700	451.00	11,590,700
ショーケース	2,800	319.00	893,200
モバイルファクトリー	2,500	802.00	2,005,000
テラスカイ	7,500	1,523.00	11,422,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,606.00	16,060,000
PCIホールディングス	4,400	1,009.00	4,439,600
アイビーシー	1,800	508.00	914,400
ネオジャパン	5,800	954.00	5,533,200
PR TIMES	4,400	1,619.00	7,123,600
ラクス	82,100	1,800.50	147,821,050
ランドコンピュータ	2,800	1,314.00	3,679,200
ダブルスタンダード	7,000	1,431.00	10,017,000
オープンドア	12,200	766.00	9,345,200
アカツキ	8,200	2,054.00	16,842,800
ベネフィットジャパン	700	1,186.00	830,200
Ubicomホールディングス	5,400	1,066.00	5,756,400
カナミックネットワーク	18,700	453.00	8,471,100
ノムラシステムコーポレーション	12,900	109.00	1,406,100
チェンジホールディングス	42,500	1,507.00	64,047,500
シンクロ・フード	7,400	546.00	4,040,400
オークネット	7,500	1,699.00	12,742,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	761.00	1,750,300
セグエグループ	3,700	972.00	3,596,400
エイトレッド	1,800	1,319.00	2,374,200
マクロミル	34,100	667.00	22,744,700

ビーグリー	2,500	1,073.00	2,682,500
オロ	6,300	2,017.00	12,707,100
ユーザーローカル	6,300	1,571.00	9,897,300
テモナ	2,800	254.00	711,200
ニーズウェル	6,400	626.00	4,006,400
マネーフォワード	38,600	3,772.00	145,599,200
サインポスト	4,500	488.00	2,196,000
Sun Asterisk	12,300	1,141.00	14,034,300
プラスアルファ・コンサルティング	10,200	2,494.00	25,438,800
電算システムホールディングス	7,700	2,722.00	20,959,400
Appier Group	59,200	1,375.00	81,400,000
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,300	487.00	1,607,100
プロトコーポレーション	21,700	1,111.00	24,108,700
ハイマックス	5,400	1,390.00	7,506,000
野村総合研究所	345,500	3,739.00	1,291,824,500
サイバネットシステム	13,900	776.00	10,786,400
CEホールディングス	6,000	514.00	3,084,000
日本システム技術	4,800	2,174.00	10,435,200
インテージホールディングス	19,600	1,767.00	34,633,200
東邦システムサイエンス	4,900	1,258.00	6,164,200
ソースネクスト	88,400	175.00	15,470,000
インフォコム	22,400	2,607.00	58,396,800
シンプレクス・ホールディングス	29,800	2,646.00	78,850,800
HEROZ	5,900	1,366.00	8,059,400
ラクスル	41,800	1,138.00	47,568,400
メルカリ	105,100	3,054.00	320,975,400
I P S	5,600	2,420.00	13,552,000
F I G	13,500	340.00	4,590,000
システムサポート	6,700	1,883.00	12,616,100
イーソル	12,500	698.00	8,725,000
東海ソフト	1,700	1,113.00	1,892,100
ウイングアーク1st	17,900	2,746.00	49,153,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,210.00	5,687,000
サーバーワークス	3,500	3,520.00	12,320,000
東名	900	1,884.00	1,695,600
ヴィッツ	1,200	890.00	1,068,000
トビラシステムズ	3,300	878.00	2,897,400
Sansan	56,900	1,102.00	62,703,800
Link-U	2,800	721.00	2,018,800
ギフトィ	15,200	1,265.00	19,228,000
メドレー	23,300	4,230.00	98,559,000

ベース	5,900	4,130.00	24,367,000
JMDC	28,700	4,870.00	139,769,000
フォーカスシステムズ	12,700	967.00	12,280,900
クレスコ	13,400	1,628.00	21,815,200
フジ・メディア・ホールディングス	166,600	1,510.00	251,566,000
オービック	58,000	22,290.00	1,292,820,000
ジャストシステム	24,900	2,728.50	67,939,650
TDCソフト	14,600	1,528.00	22,308,800
LINEヤフー	2,468,900	382.30	943,860,470
トレンドマイクロ	82,000	5,597.00	458,954,000
IDホールディングス	11,700	1,445.00	16,906,500
日本オラクル	33,200	10,575.00	351,090,000
アルファシステムズ	5,500	2,789.00	15,339,500
フューチャー	37,000	1,446.00	53,502,000
CAC Holdings	10,000	1,757.00	17,570,000
SBテクノロジー	7,400	2,117.00	15,665,800
トーセ	3,400	713.00	2,424,200
オービックビジネスコンサルタント	34,100	6,060.00	206,646,000
アイティフォー	22,900	1,067.00	24,434,300
東計電算	2,400	6,140.00	14,736,000
エクスネット	1,600	1,046.00	1,673,600
大塚商会	86,000	5,952.00	511,872,000
サイボウズ	23,900	1,701.00	40,653,900
電通国際情報サービス	21,100	5,210.00	109,931,000
ACCESS	20,600	733.00	15,099,800
デジタルガレージ	30,800	2,809.00	86,517,200
EMシステムズ	29,000	713.00	20,677,000
ウェザーニューズ	5,400	5,820.00	31,428,000
CIJ	28,900	534.00	15,432,600
ビジネスエンジニアリング	2,500	3,345.00	8,362,500
日本エンタープライズ	12,200	121.00	1,476,200
WOWOW	13,100	1,090.00	14,279,000
スカラ	16,100	753.00	12,123,300
インテリジェント ウェイブ	6,200	903.00	5,598,600
ANYCOLOR	6,100	3,420.00	20,862,000
IMAGICA GROUP	14,500	576.00	8,352,000
ネットワンシステムズ	64,600	2,663.50	172,062,100
システムソフト	60,800	66.00	4,012,800
アルゴグラフィックス	15,900	3,135.00	49,846,500
マーベラス	28,200	685.00	19,317,000
エイベックス	29,500	1,328.00	39,176,000
BIPROGY	63,800	3,669.00	234,082,200

都築電気	9,200	2,195.00	20,194,000
TBSホールディングス	88,800	2,400.00	213,120,000
日本テレビホールディングス	153,600	1,471.50	226,022,400
朝日放送グループホールディングス	16,300	664.00	10,823,200
テレビ朝日ホールディングス	42,100	1,621.00	68,244,100
スカパーJSATホールディングス	153,900	704.00	108,345,600
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,883.00	36,037,500
日本BS放送	4,200	887.00	3,725,400
ビジョン	26,100	1,280.00	33,408,000
スマートバリュー	2,900	373.00	1,081,700
USEN-NEXT HOLDINGS	19,400	3,450.00	66,930,000
ワイヤレスゲート	5,200	188.00	977,600
日本通信	160,200	204.00	32,680,800
クロップス	1,900	941.00	1,787,900
日本電信電話	55,562,800	173.60	9,645,702,080
KDDI	1,340,300	4,452.00	5,967,015,600
ソフトバンク	2,789,200	1,673.50	4,667,726,200
光通信	20,400	21,335.00	435,234,000
エムティーアイ	11,900	577.00	6,866,300
GMOインターネットグループ	64,100	2,182.50	139,898,250
ファイバーゲート	9,400	1,121.00	10,537,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	243.00	680,400
KADOKAWA	91,700	2,995.50	274,687,350
学研ホールディングス	28,900	825.00	23,842,500
ゼンリン	29,700	927.00	27,531,900
昭文社ホールディングス	5,000	346.00	1,730,000
インプレスホールディングス	10,300	172.00	1,771,600
アイネット	10,500	1,705.00	17,902,500
松竹	9,900	9,048.00	89,575,200
東宝	108,600	4,866.00	528,447,600
東映	4,800	17,950.00	86,160,000
NTTデータグループ	544,200	1,768.00	962,145,600
ピー・シー・エー	10,000	1,163.00	11,630,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,029.00	15,014,600
DTS	36,900	3,235.00	119,371,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,200	5,048.00	440,185,600
シーイーシー	24,300	1,530.00	37,179,000
カブコン	172,400	5,288.00	911,651,200
アイ・エス・ビー	8,900	1,319.00	11,739,100
ジャステック	10,700	1,502.00	16,071,400
SCSK	141,600	2,466.00	349,185,600
NSW	6,800	2,704.00	18,387,200

アイネス	12,200	1,588.00	19,373,600
T K C	27,700	3,500.00	96,950,000
富士ソフト	34,900	5,410.00	188,809,000
N S D	61,900	2,772.00	171,586,800
コナミグループ	74,200	8,116.00	602,207,200
福井コンピュータホールディングス	12,100	2,570.00	31,097,000
J B C Cホールディングス	12,700	2,832.00	35,966,400
ミロク情報サービス	15,800	1,560.00	24,648,000
ソフトバンクグループ	855,600	6,255.00	5,351,778,000
高千穂交易	4,400	3,190.00	14,036,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,862.00	3,351,600
伊藤忠食品	4,100	6,600.00	27,060,000
エレマテック	16,400	1,755.00	28,782,000
あらた	14,000	5,390.00	75,460,000
トーメンデバイス	2,600	4,875.00	12,675,000
東京エレクトロン デバイス	20,300	4,130.00	83,839,000
円谷フィールズホールディングス	31,400	1,558.00	48,921,200
双日	182,400	3,109.00	567,081,600
アルフレッサ ホールディングス	183,700	2,381.50	437,481,550
横浜冷凍	49,900	1,154.00	57,584,600
ラサ商事	5,600	1,668.00	9,340,800
アルコニックス	24,100	1,340.00	32,294,000
神戸物産	141,600	3,768.00	533,548,800
ハイパー	2,800	325.00	910,000
あい ホールディングス	29,300	2,323.00	68,063,900
ディーブイエックス	3,400	1,059.00	3,600,600
ダイワボウホールディングス	74,800	2,790.00	208,692,000
マクニカホールディングス	43,300	7,190.00	311,327,000
ラクト・ジャパン	7,100	1,843.00	13,085,300
グリムス	7,700	1,997.00	15,376,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,800	987.00	22,503,600
八洲電機	14,800	1,252.00	18,529,600
メディアスホールディングス	11,700	723.00	8,459,100
レスターホールディングス	17,500	2,480.00	43,400,000
ジオリーブグループ	2,800	1,180.00	3,304,000
大光	5,200	677.00	3,520,400
O C H Iホールディングス	2,800	1,387.00	3,883,600
T O K A Iホールディングス	90,400	941.00	85,066,400
黒谷	3,400	589.00	2,002,600
C o m i n i x	2,400	818.00	1,963,200
三洋貿易	20,700	1,295.00	26,806,500
ビューティガレージ	2,900	4,350.00	12,615,000

ウイン・パートナーズ	13,300	1,084.00	14,417,200
ミタチ産業	3,100	1,018.00	3,155,800
シップヘルスケアホールディングス	65,800	2,150.00	141,470,000
明治電機工業	6,800	1,380.00	9,384,000
デリカフーズホールディングス	4,800	619.00	2,971,200
スターティアホールディングス	2,400	1,516.00	3,638,400
コメダホールディングス	44,900	2,667.00	119,748,300
ピーバンドットコム	1,800	402.00	723,600
アセンテック	6,200	493.00	3,056,600
富士興産	2,700	1,751.00	4,727,700
協栄産業	1,100	2,415.00	2,656,500
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,749.00	47,007,900
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,195.00	33,228,000
小野建	18,000	1,662.00	29,916,000
南陽	2,300	2,095.00	4,818,500
佐島電機	7,700	1,905.00	14,668,500
エコートレーディング	2,400	1,402.00	3,364,800
伯東	10,500	5,070.00	53,235,000
コンドーテック	14,100	1,113.00	15,693,300
中山福	6,600	354.00	2,336,400
ナガイレーベン	23,100	2,061.00	47,609,100
三菱食品	16,900	3,920.00	66,248,000
松田産業	13,900	2,505.00	34,819,500
第一興商	70,800	2,252.00	159,441,600
メディバルホールディングス	175,000	2,485.00	434,875,000
S P K	8,100	1,825.00	14,782,500
萩原電気ホールディングス	7,600	4,255.00	32,338,000
アズワン	26,100	4,694.00	122,513,400
スズデン	6,400	2,146.00	13,734,400
尾家産業	2,900	1,934.00	5,608,600
シモジマ	12,600	1,124.00	14,162,400
ドウシシャ	19,400	2,170.00	42,098,000
小津産業	2,700	1,588.00	4,287,600
高速	9,500	2,059.00	19,560,500
たけびし	7,000	1,821.00	12,747,000
リックス	2,500	3,040.00	7,600,000
丸文	16,400	1,138.00	18,663,200
ハピネット	15,600	2,417.00	37,705,200
橋本総業ホールディングス	7,300	1,175.00	8,577,500
日本ライフライン	53,700	1,110.00	59,607,000
タカショー	16,000	604.00	9,664,000
I D O M	55,400	857.00	47,477,800

進和	11,200	2,440.00	27,328,000
エスケイジャパン	3,000	761.00	2,283,000
ダイترون	7,200	2,940.00	21,168,000
シークス	26,100	1,445.00	37,714,500
田中商事	3,500	677.00	2,369,500
オーハシテクニカ	8,900	1,631.00	14,515,900
白銅	6,600	2,176.00	14,361,600
ダイコー通産	1,300	1,108.00	1,440,400
伊藤忠商事	1,127,500	5,312.00	5,989,280,000
丸紅	1,416,400	2,215.50	3,138,034,200
高島	7,700	904.00	6,960,800
長瀬産業	83,900	2,305.00	193,389,500
蝶理	9,800	2,919.00	28,606,200
豊田通商	160,300	8,061.00	1,292,178,300
三共生興	25,400	810.00	20,574,000
兼松	71,000	1,940.00	137,740,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,268.00	2,155,600
三井物産	1,280,000	5,518.00	7,063,040,000
日本紙パルプ商事	9,700	4,615.00	44,765,500
カメイ	19,500	1,420.00	27,690,000
東都水産	600	6,390.00	3,834,000
OUGホールディングス	1,800	2,340.00	4,212,000
スターゼン	13,900	2,472.00	34,360,800
山善	49,300	1,193.00	58,814,900
椿本興業	2,900	4,720.00	13,688,000
住友商事	1,107,200	2,951.00	3,267,347,200
内田洋行	7,400	6,820.00	50,468,000
三菱商事	1,115,600	6,947.00	7,750,073,200
第一実業	19,400	1,887.00	36,607,800
キャノンマーケティングジャパン	42,400	3,863.00	163,791,200
西華産業	7,200	2,149.00	15,472,800
佐藤商事	12,700	1,455.00	18,478,500
菱洋エレクトロ	15,600	3,470.00	54,132,000
東京産業	16,700	819.00	13,677,300
ユアサ商事	15,700	4,080.00	64,056,000
神鋼商事	4,600	5,440.00	25,024,000
トルク	6,600	283.00	1,867,800
阪和興業	32,900	4,410.00	145,089,000
正栄食品工業	12,200	4,360.00	53,192,000
カナデン	12,200	1,473.00	17,970,600
R Y O D E N	14,800	2,336.00	34,572,800
岩谷産業	41,700	7,216.00	300,907,200

ナイス	3,300	1,427.00	4,709,100
ニチモウ	1,600	3,850.00	6,160,000
極東貿易	10,900	1,773.00	19,325,700
アステナホールディングス	34,400	528.00	18,163,200
三愛オブリ	48,400	1,604.00	77,633,600
稲畑産業	36,200	3,070.00	111,134,000
G S I クレオス	10,600	2,018.00	21,390,800
明和産業	24,400	641.00	15,640,400
クワザワホールディングス	4,000	529.00	2,116,000
ワキタ	33,700	1,518.00	51,156,600
東邦ホールディングス	45,600	3,253.00	148,336,800
サンゲツ	46,000	2,860.00	131,560,000
ミツウロコグループホールディングス	23,400	1,287.00	30,115,800
シナネンホールディングス	5,900	3,915.00	23,098,500
伊藤忠エネクス	45,400	1,510.00	68,554,000
サンリオ	51,800	6,431.00	333,125,800
サンワテクノス	9,400	2,106.00	19,796,400
リョーサン	19,400	4,620.00	89,628,000
新光商事	24,600	1,160.00	28,536,000
トーホー	7,800	2,810.00	21,918,000
三信電気	7,400	2,116.00	15,658,400
東陽テクニカ	18,600	1,277.00	23,752,200
モスフードサービス	26,900	3,225.00	86,752,500
加賀電子	14,900	6,120.00	91,188,000
ソーダニッカ	8,900	992.00	8,828,800
立花エレテック	13,400	2,619.00	35,094,600
フォーバル	7,200	1,109.00	7,984,800
P A L T A C	28,800	4,522.00	130,233,600
三谷産業	32,100	319.00	10,239,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,600	5,220.00	24,012,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,944.00	1,944,000
コア商事ホールディングス	10,300	722.00	7,436,600
K P P グループホールディングス	42,700	623.00	26,602,100
ヤマタネ	8,100	2,145.00	17,374,500
丸紅建材リース	1,100	2,520.00	2,772,000
泉州電業	9,200	3,275.00	30,130,000
トラスコ中山	38,400	2,315.00	88,896,000
オートバックスセブン	63,700	1,508.50	96,091,450
モリト	13,100	1,302.00	17,056,200
加藤産業	22,600	3,990.00	90,174,000
北恵	3,100	959.00	2,972,900
イエローハット	32,300	1,795.00	57,978,500

J Kホールディングス	14,100	939.00	13,239,900
日伝	10,800	2,582.00	27,885,600
北沢産業	6,600	266.00	1,755,600
杉本商事	8,100	2,143.00	17,358,300
因幡電機産業	47,400	3,175.00	150,495,000
東テク	6,100	4,940.00	30,134,000
ミスミグループ本社	276,200	2,333.00	644,374,600
アルテック	6,600	259.00	1,709,400
タキヒヨー	3,000	995.00	2,985,000
蔵王産業	2,000	2,468.00	4,936,000
スズケン	53,600	4,580.00	245,488,000
ジェコス	11,000	930.00	10,230,000
グローセル	14,700	469.00	6,894,300
ローソン	45,400	6,935.00	314,849,000
サンエー	14,100	4,775.00	67,327,500
カワチ薬品	14,500	2,447.00	35,481,500
エービーシー・マート	80,300	2,332.00	187,259,600
ハードオフコーポレーション	5,200	1,433.00	7,451,600
アスクル	38,100	2,014.00	76,733,400
ゲオホールディングス	18,200	2,115.00	38,493,000
アダストリア	22,200	3,050.00	67,710,000
くら寿司	21,600	3,255.00	70,308,000
キャンドウ	6,700	2,467.00	16,528,900
I Kホールディングス	5,200	364.00	1,892,800
パルグループホールディングス	36,200	1,709.00	61,865,800
エディオン	72,800	1,474.00	107,307,200
サーラコーポレーション	39,100	721.00	28,191,100
ワッツ	6,800	555.00	3,774,000
ハローズ	8,400	4,005.00	33,642,000
あみやき亭	4,600	3,515.00	16,169,000
大黒天物産	5,700	6,330.00	36,081,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,495.00	22,126,000
ファーマライズホールディングス	3,400	644.00	2,189,600
アルペン	15,400	1,923.00	29,614,200
ハブ	4,600	709.00	3,261,400
クオールホールディングス	25,400	1,685.00	42,799,000
ジズホールディングス	11,000	3,890.00	42,790,000
ビックカメラ	97,800	1,084.00	106,015,200
D C Mホールディングス	106,800	1,199.00	128,053,200
Monotaro	259,700	1,215.50	315,665,350
東京一番フーズ	3,800	502.00	1,907,600
きちりホールディングス	2,900	896.00	2,598,400

J・フロント リテイリング	227,800	1,385.00	315,503,000
ドトール・日レスホールディングス	32,700	2,114.00	69,127,800
マツキヨココカラ&カンパニー	333,000	2,560.00	852,480,000
ブロンコビリー	10,900	2,977.00	32,449,300
Z O Z O	121,100	2,792.00	338,111,200
トレジャー・ファクトリー	8,000	1,120.00	8,960,000
物語コーポレーション	30,700	3,605.00	110,673,500
三越伊勢丹ホールディングス	308,400	1,632.00	503,308,800
H a m e e	6,900	909.00	6,272,100
マーケットエンタープライズ	1,600	1,357.00	2,171,200
ウエルシアホールディングス	95,100	2,373.50	225,719,850
クリエイトSDホールディングス	30,400	3,230.00	98,192,000
丸善CHIホールディングス	15,800	324.00	5,119,200
ミサワ	3,000	612.00	1,836,000
ティーライフ	2,000	1,359.00	2,718,000
チムニー	3,800	1,371.00	5,209,800
シュッピン	14,000	1,003.00	14,042,000
オイシックス・ラ・大地	25,000	1,143.00	28,575,000
ネクステージ	42,000	2,110.00	88,620,000
ジョイフル本田	53,500	1,754.00	93,839,000
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,861.00	19,740,900
ホットランド	14,300	1,898.00	27,141,400
すかいらーくホールディングス	250,400	2,095.00	524,588,000
SFPホールディングス	10,000	2,133.00	21,330,000
綿半ホールディングス	14,500	1,299.00	18,835,500
ヨシックスホールディングス	2,600	2,658.00	6,910,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	60,100	1,043.00	62,684,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	682.00	6,138,000
B E E N O S	8,000	1,463.00	11,704,000
あさひ	15,700	1,252.00	19,656,400
日本調剤	12,800	1,380.00	17,664,000
コスモス薬品	18,100	14,265.00	258,196,500
トーエル	6,100	739.00	4,507,900
セブン&アイ・ホールディングス	630,600	5,227.00	3,296,146,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,600	984.00	135,398,400
ツルハホールディングス	38,500	10,530.00	405,405,000
サンマルクホールディングス	15,000	1,859.00	27,885,000
フェリシモ	3,200	936.00	2,995,200
トリドールホールディングス	45,700	3,450.00	157,665,000
T O K Y O B A S E	20,500	290.00	5,945,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,186.00	2,846,400

J Mホールディングス	14,100	1,934.00	27,269,400
サツドラホールディングス	6,200	758.00	4,699,600
アレンザホールディングス	14,200	991.00	14,072,200
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,662.00	8,642,400
パロックジャパンリミテッド	12,500	781.00	9,762,500
クスリのアオキホールディングス	16,400	9,265.00	151,946,000
力の源ホールディングス	7,000	1,819.00	12,733,000
FOOD & LIFE COMPANIES	97,800	2,486.50	243,179,700
メディカルシステムネットワーク	17,100	429.00	7,335,900
はるやまホールディングス	6,100	515.00	3,141,500
ノジマ	60,100	1,306.00	78,490,600
カッパ・クリエイト	28,800	1,543.00	44,438,400
ライトオン	9,200	439.00	4,038,800
良品計画	200,000	2,001.00	400,200,000
パリミキホールディングス	16,500	340.00	5,610,000
アドヴァングループ	17,900	1,014.00	18,150,600
アルビス	6,200	2,391.00	14,824,200
コナカ	13,300	381.00	5,067,300
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,604.00	2,887,200
G - 7ホールディングス	23,200	1,181.00	27,399,200
イオン北海道	27,200	865.00	23,528,000
コジマ	31,000	633.00	19,623,000
ヒマラヤ	4,400	920.00	4,048,000
コーナン商事	24,800	3,935.00	97,588,000
エコス	7,000	2,095.00	14,665,000
ワタミ	22,100	1,116.00	24,663,600
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	369,500	2,825.50	1,044,022,250
西松屋チェーン	40,800	1,863.00	76,010,400
ゼンショーホールディングス	100,200	7,032.00	704,606,400
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,091.00	12,982,900
ハークスレイ	5,000	697.00	3,485,000
サイゼリヤ	27,100	5,690.00	154,199,000
V Tホールディングス	70,500	503.00	35,461,500
魚力	5,900	2,146.00	12,661,400
フジ・コーポレーション	9,300	1,681.00	15,633,300
ユナイテッドアローズ	19,800	1,879.00	37,204,200
ハイデイ日高	27,300	2,577.00	70,352,100
YU - WA Creation Holdings	10,200	164.00	1,672,800
コロワイド	84,300	2,255.50	190,138,650
壱番屋	14,500	5,200.00	75,400,000

PLANT	3,500	805.00	2,817,500	
スギホールディングス	36,900	5,667.00	209,112,300	
薬王堂ホールディングス	10,400	2,682.00	27,892,800	
スクロール	27,700	1,062.00	29,417,400	
ヨンドシーホールディングス	16,000	1,893.00	30,288,000	
木曽路	27,900	2,520.00	70,308,000	
SRSホールディングス	30,700	1,023.00	31,406,100	
千趣会	34,900	400.00	13,960,000	
リテールパートナーズ	27,400	1,705.00	46,717,000	
ケーヨー	29,600	1,297.00	38,391,200	
上新電機	16,500	2,327.00	38,395,500	
日本瓦斯	97,200	2,201.50	213,985,800	
ロイヤルホールディングス	32,200	2,434.00	78,374,800	
いなげや	17,900	1,591.00	28,478,900	
チヨダ	18,000	828.00	14,904,000	
ライフコーポレーション	16,000	3,550.00	56,800,000	
リンガーハット	23,600	2,281.00	53,831,600	
MrMaxHD	26,400	610.00	16,104,000	
AOKIホールディングス	34,100	969.00	33,042,900	
オークワ	29,400	825.00	24,255,000	
コメリ	28,300	3,090.00	87,447,000	
青山商事	39,400	1,417.00	55,829,800	
しまむら	21,500	14,675.00	315,512,500	
はせがわ	7,300	332.00	2,423,600	
高島屋	138,000	1,972.50	272,205,000	
松屋	31,200	906.00	28,267,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	89,200	1,591.00	141,917,200	
近鉄百貨店	8,000	2,787.00	22,296,000	
丸井グループ	135,000	2,352.00	317,520,000	
アクシアル リテイリング	12,600	3,730.00	46,998,000	
イオン	620,300	3,059.00	1,897,497,700	
イズミ	27,800	3,803.00	105,723,400	
平和堂	30,600	2,411.00	73,776,600	
フジ	28,200	1,823.00	51,408,600	
ヤオコー	20,700	7,489.00	155,022,300	
ゼビオホールディングス	25,300	952.00	24,085,600	
ケーズホールディングス	129,700	1,383.00	179,375,100	
Olympicグループ	5,500	499.00	2,744,500	
日産東京販売ホールディングス	16,600	454.00	7,536,400	
シルバーライフ	4,000	1,040.00	4,160,000	
Genky DrugStores	8,100	5,180.00	41,958,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,108.00	2,659,200	

ブックオフグループホールディングス	8,400	1,035.00	8,694,000
ギフトホールディングス	8,000	2,106.00	16,848,000
アインホールディングス	25,300	4,072.00	103,021,600
元気寿司	5,300	5,120.00	27,136,000
ヤマダホールディングス	751,300	461.40	346,649,820
アークランズ	55,100	1,527.00	84,137,700
ニトリホールディングス	74,000	15,615.00	1,155,510,000
グルメ杵屋	15,300	1,055.00	16,141,500
愛眼	9,000	171.00	1,539,000
ケーユーホールディングス	11,100	1,108.00	12,298,800
吉野家ホールディングス	71,800	3,160.00	226,888,000
松屋フーズホールディングス	8,800	4,115.00	36,212,000
サガミホールディングス	29,800	1,306.00	38,918,800
関西フードマーケット	16,900	1,354.00	22,882,600
王将フードサービス	12,100	6,900.00	83,490,000
ミニストップ	13,400	1,487.00	19,925,800
アークス	33,700	2,772.00	93,416,400
パローホールディングス	35,100	2,193.00	76,974,300
ベルク	9,200	6,910.00	63,572,000
大庄	7,000	1,187.00	8,309,000
ファーストリテイリング	82,300	33,840.00	2,785,032,000
サンドラッグ	69,600	3,955.00	275,268,000
サックスパー ホールディングス	17,900	838.00	15,000,200
ヤマザワ	2,600	1,251.00	3,252,600
やまや	2,700	2,874.00	7,759,800
ベルーナ	44,800	630.00	28,224,000
いよぎんホールディングス	202,700	1,066.50	216,179,550
しずおかフィナンシャルグループ	378,400	1,236.00	467,702,400
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,400	1,155.00	165,627,000
楽天銀行	59,200	2,390.00	141,488,000
京都フィナンシャルグループ	54,000	8,461.00	456,894,000
島根銀行	3,900	519.00	2,024,100
じもとホールディングス	10,000	407.00	4,070,000
めぶきフィナンシャルグループ	845,200	425.90	359,970,680
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	4,435.00	96,683,000
九州フィナンシャルグループ	299,700	886.00	265,534,200
ゆうちょ銀行	467,900	1,334.00	624,178,600
富山第一銀行	54,100	934.00	50,529,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	913,900	689.00	629,677,100
西日本フィナンシャルホールディングス	105,700	1,728.00	182,649,600
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,853.00	28,165,600
第四北越フィナンシャルグループ	26,700	3,790.00	101,193,000

ひろぎんホールディングス	222,200	942.70	209,467,940
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,425.00	37,830,000
十六フィナンシャルグループ	22,100	3,805.00	84,090,500
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	5,150.00	92,185,000
プロクレアホールディングス	20,900	1,884.00	39,375,600
あいちフィナンシャルグループ	23,800	2,367.00	56,334,600
あおぞら銀行	107,100	2,858.50	306,145,350
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,667,100	1,235.00	13,173,868,500
りそなホールディングス	2,138,900	807.40	1,726,947,860
三井住友トラスト・ホールディングス	305,100	5,603.00	1,709,475,300
三井住友フィナンシャルグループ	1,210,500	7,190.00	8,703,495,000
千葉銀行	474,700	1,103.00	523,594,100
群馬銀行	330,500	693.90	229,333,950
武蔵野銀行	21,900	2,726.00	59,699,400
千葉興業銀行	26,600	903.00	24,019,800
筑波銀行	74,700	281.00	20,990,700
七十七銀行	54,500	3,220.00	175,490,000
秋田銀行	11,400	2,003.00	22,834,200
山形銀行	18,900	1,132.00	21,394,800
岩手銀行	11,700	2,661.00	31,133,700
東邦銀行	134,700	277.00	37,311,900
東北銀行	5,500	1,131.00	6,220,500
ふくおかフィナンシャルグループ	136,000	3,742.00	508,912,000
スルガ銀行	150,100	628.00	94,262,800
八十二銀行	359,800	821.00	295,395,800
山梨中央銀行	17,500	1,765.00	30,887,500
大垣共立銀行	32,500	1,979.00	64,317,500
福井銀行	15,200	1,548.00	23,529,600
清水銀行	6,800	1,611.00	10,954,800
富山銀行	1,700	1,750.00	2,975,000
滋賀銀行	28,300	3,730.00	105,559,000
南都銀行	25,600	2,616.00	66,969,600
百五銀行	160,200	536.00	85,867,200
紀陽銀行	60,900	1,485.00	90,436,500
ほくほくフィナンシャルグループ	108,300	1,652.00	178,911,600
山陰合同銀行	106,600	992.00	105,747,200
鳥取銀行	3,600	1,334.00	4,802,400
百十四銀行	15,500	2,710.00	42,005,000
四国銀行	27,100	1,029.00	27,885,900
阿波銀行	23,900	2,357.00	56,332,300
大分銀行	10,200	2,733.00	27,876,600
宮崎銀行	11,100	2,717.00	30,158,700

佐賀銀行	10,000	1,972.00	19,720,000
琉球銀行	39,000	1,183.00	46,137,000
セブン銀行	610,200	293.80	179,276,760
みずほフィナンシャルグループ	2,463,300	2,546.00	6,271,561,800
高知銀行	3,900	1,019.00	3,974,100
山口フィナンシャルグループ	167,000	1,292.50	215,847,500
名古屋銀行	11,200	5,350.00	59,920,000
北洋銀行	258,100	361.00	93,174,100
大光銀行	3,400	1,482.00	5,038,800
愛媛銀行	22,900	1,058.00	24,228,200
トマト銀行	3,700	1,165.00	4,310,500
京葉銀行	78,000	661.00	51,558,000
栃木銀行	78,000	325.00	25,350,000
北日本銀行	6,000	2,238.00	13,428,000
東和銀行	31,300	659.00	20,626,700
福島銀行	12,000	247.00	2,964,000
大東銀行	4,400	757.00	3,330,800
トモニホールディングス	137,700	474.00	65,269,800
フィデアホールディングス	17,600	1,584.00	27,878,400
池田泉州ホールディングス	218,100	329.00	71,754,900
F P G	57,700	1,273.00	73,452,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,680.00	23,520,000
マーキュリアホールディングス	6,000	737.00	4,422,000
S B Iホールディングス	248,300	3,121.00	774,944,300
ジャフコ グループ	57,000	1,547.00	88,179,000
大和証券グループ本社	1,218,100	851.30	1,036,968,530
野村ホールディングス	3,069,200	581.50	1,784,739,800
岡三証券グループ	149,800	705.00	105,609,000
丸三証券	56,900	803.00	45,690,700
東洋証券	57,000	324.00	18,468,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,700	497.00	92,292,900
光世証券	2,900	580.00	1,682,000
水戸証券	46,100	452.00	20,837,200
いちよし証券	31,500	718.00	22,617,000
松井証券	100,800	754.00	76,003,200
マネックスグループ	183,800	638.00	117,264,400
極東証券	21,400	1,000.00	21,400,000
岩井コスモホールディングス	19,500	1,733.00	33,793,500
アイザワ証券グループ	24,700	1,140.00	28,158,000
マネーパートナーズグループ	12,400	295.00	3,658,000
スパークス・グループ	19,100	1,428.00	27,274,800
かんぽ生命保険	198,300	2,717.00	538,781,100

S O M P Oホールディングス	292,300	6,370.00	1,861,951,000
アニコム ホールディングス	57,800	556.00	32,136,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	346,600	5,427.00	1,880,998,200
第一生命ホールディングス	832,100	3,089.00	2,570,356,900
東京海上ホールディングス	1,683,600	3,353.00	5,645,110,800
T & Dホールディングス	457,100	2,543.50	1,162,633,850
アドバンスクリエイト	9,800	962.00	9,427,600
全国保証	44,600	4,888.00	218,004,800
あんしん保証	6,600	276.00	1,821,600
イントラスト	4,700	846.00	3,976,200
日本モーゲージサービス	6,800	530.00	3,604,000
C a s a	4,700	821.00	3,858,700
アルヒ	21,300	823.00	17,529,900
プレミアグループ	28,900	1,398.00	40,402,200
ネットプロテクションズホールディングス	57,300	275.00	15,757,500
クレディセゾン	108,100	2,253.50	243,603,350
芙蓉総合リース	15,700	11,690.00	183,533,000
みずほリース	25,400	4,715.00	119,761,000
東京センチュリー	31,900	5,831.00	186,008,900
日本証券金融	62,800	1,481.00	93,006,800
アイフル	282,900	386.00	109,199,400
リコーリース	16,200	4,360.00	70,632,000
イオンフィナンシャルサービス	98,000	1,226.00	120,148,000
アコム	304,800	353.90	107,868,720
ジャックス	18,200	5,140.00	93,548,000
オリエントコーポレーション	44,700	1,112.00	49,706,400
オリックス	1,118,200	2,699.50	3,018,580,900
三菱H C キャピタル	664,400	959.60	637,558,240
九州リースサービス	5,600	955.00	5,348,000
日本取引所グループ	478,700	2,954.00	1,414,079,800
イー・ギャランティ	27,800	1,753.00	48,733,400
アサックス	5,600	651.00	3,645,600
N E C キャピタルソリューション	8,400	3,090.00	25,956,000
R o b o t H o m e	51,000	188.00	9,588,000
大東建託	62,400	15,465.00	965,016,000
いちご	198,400	328.00	65,075,200
日本駐車場開発	183,900	207.00	38,067,300
スター・マイカ・ホールディングス	21,000	603.00	12,663,000
S R E ホールディングス	8,600	2,174.00	18,696,400
A Dワークスグループ	28,600	259.00	7,407,400
ヒューリック	397,900	1,345.50	535,374,450
野村不動産ホールディングス	106,800	3,687.00	393,771,600

三重交通グループホールディングス	37,800	538.00	20,336,400
サムティ	27,400	2,436.00	66,746,400
ディア・ライフ	30,000	757.00	22,710,000
地主	13,400	1,944.00	26,049,600
プレサンスコーポレーション	27,400	1,670.00	45,758,000
ハウスコム	2,600	875.00	2,275,000
JPMC	10,500	1,127.00	11,833,500
サンセイランディック	4,100	1,015.00	4,161,500
フージャースホールディングス	26,300	1,051.00	27,641,300
オープンハウスグループ	62,500	4,754.00	297,125,000
東急不動産ホールディングス	512,900	884.50	453,660,050
飯田グループホールディングス	145,400	2,312.00	336,164,800
イーランド	2,200	1,461.00	3,214,200
ムゲンエステート	8,300	1,005.00	8,341,500
And Doホールディングス	10,300	979.00	10,083,700
シーアールイー	9,900	1,560.00	15,444,000
ケイアイスター不動産	8,400	4,345.00	36,498,000
グッドコムアセット	16,500	994.00	16,401,000
ジェイ・エス・ビー	4,400	4,940.00	21,736,000
ロードスターキャピタル	11,500	1,842.00	21,183,000
テンポイノベーション	4,100	1,113.00	4,563,300
フェイスネットワーク	3,600	1,350.00	4,860,000
パーク24	111,000	1,659.00	184,149,000
パラカ	6,400	1,921.00	12,294,400
三井不動産	727,100	3,290.00	2,392,159,000
三菱地所	1,028,100	1,954.50	2,009,421,450
平和不動産	27,800	3,980.00	110,644,000
東京建物	149,200	2,031.50	303,099,800
京阪神ビルディング	29,200	1,365.00	39,858,000
住友不動産	308,100	3,726.00	1,147,980,600
テーオーシー	31,900	644.00	20,543,600
東京楽天地	3,000	4,135.00	12,405,000
レオパレス21	191,700	332.00	63,644,400
スターツコーポレーション	24,700	2,808.00	69,357,600
フジ住宅	24,900	720.00	17,928,000
空港施設	21,900	560.00	12,264,000
明和地所	6,100	1,160.00	7,076,000
ゴールドクレスト	16,500	2,386.00	39,369,000
エスリード	8,300	3,020.00	25,066,000
日神グループホールディングス	28,700	526.00	15,096,200
日本エスコン	31,900	893.00	28,486,700
MIRARTHホールディングス	86,100	469.00	40,380,900

AVANTIA	7,200	824.00	5,932,800
イオンモール	88,700	1,736.50	154,027,550
毎日コムネット	5,200	730.00	3,796,000
ファースト住建	5,200	1,176.00	6,115,200
カチタス	46,100	2,057.00	94,827,700
トーセイ	28,700	1,768.00	50,741,600
穴吹興産	2,600	1,974.00	5,132,400
サンフロンティア不動産	28,900	1,457.00	42,107,300
FJネクストホールディングス	18,600	1,041.00	19,362,600
インテリックス	2,800	509.00	1,425,200
ランドビジネス	4,200	298.00	1,251,600
サンネクスタグループ	4,100	975.00	3,997,500
グランディハウス	10,700	627.00	6,708,900
日本空港ビルデング	60,400	6,407.00	386,982,800
明豊ファシリティワークス	6,400	790.00	5,056,000
LIFULL	62,100	226.00	14,034,600
MIXI	40,600	2,289.00	92,933,400
ジェイエイシーリクルートメント	16,200	2,338.00	37,875,600
日本M&Aセンターホールディングス	305,500	665.30	203,249,150
メンバーズ	5,500	1,176.00	6,468,000
中広	2,400	410.00	984,000
UTグループ	26,300	1,932.00	50,811,600
アイティメディア	7,000	1,100.00	7,700,000
E・Jホールディングス	10,600	1,491.00	15,804,600
オープンアップグループ	53,500	1,869.00	99,991,500
コシダカホールディングス	53,500	1,009.00	53,981,500
アルトナー	3,100	1,674.00	5,189,400
パソナグループ	21,800	1,362.00	29,691,600
CDS	3,100	1,711.00	5,304,100
リンクアンドモチベーション	51,200	376.00	19,251,200
エス・エム・エス	68,100	2,275.00	154,927,500
サニーサイドアップグループ	3,900	792.00	3,088,800
パーソルホールディングス	1,961,900	216.40	424,555,160
リニカル	7,200	582.00	4,190,400
クックパッド	51,000	110.00	5,610,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	700.00	4,410,000
学情	9,200	1,705.00	15,686,000
スタジオアリス	9,000	2,030.00	18,270,000
シミックホールディングス	8,700	1,655.00	14,398,500
エプコ	3,700	766.00	2,834,200
NJS	4,000	2,799.00	11,196,000
総合警備保障	330,300	850.60	280,953,180

カカクコム	130,700	1,414.00	184,809,800
アイロムグループ	6,600	1,662.00	10,969,200
セントケア・ホールディング	11,700	823.00	9,629,100
サイネックス	2,500	858.00	2,145,000
ルネサンス	12,800	855.00	10,944,000
ディップ	31,200	2,935.00	91,572,000
デジタルホールディングス	12,900	1,008.00	13,003,200
新日本科学	19,000	1,682.00	31,958,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,895.00	4,927,000
ベネフィット・ワン	82,700	970.90	80,293,430
エムスリー	351,400	2,399.50	843,184,300
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	385.00	2,926,000
アウトソーシング	114,400	1,095.00	125,268,000
ウェルネット	9,600	563.00	5,404,800
ワールドホールディングス	8,100	2,331.00	18,881,100
ディー・エヌ・エー	71,300	1,435.00	102,315,500
博報堂D Yホールディングス	227,000	1,213.00	275,351,000
ぐるなび	33,700	262.00	8,829,400
タカミヤ	24,700	501.00	12,374,700
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	612.00	5,385,600
ファンコミュニケーションズ	32,300	400.00	12,920,000
ライク	6,800	1,362.00	9,261,600
A o b a - B B T	5,200	383.00	1,991,600
エスプール	51,900	325.00	16,867,500
W D Bホールディングス	9,200	2,022.00	18,602,400
ティア	7,700	443.00	3,411,100
C D G	1,500	1,177.00	1,765,500
アドウェイズ	25,000	535.00	13,375,000
バリューコマース	15,900	1,225.00	19,477,500
インフォマート	185,400	369.00	68,412,600
J Pホールディングス	52,000	334.00	17,368,000
エコナックホールディングス	12,300	137.00	1,685,100
C Lホールディングス	5,100	792.00	4,039,200
プレステージ・インターナショナル	75,400	599.00	45,164,600
アミューズ	9,800	1,482.00	14,523,600
ドリームインキュベータ	5,500	2,904.00	15,972,000
クイック	13,700	2,033.00	27,852,100
T A C	7,300	198.00	1,445,400
電通グループ	174,800	4,416.00	771,916,800
イオンファンタジー	7,800	2,742.00	21,387,600
シーティーエス	20,100	676.00	13,587,600
ネクシィーズグループ	4,000	880.00	3,520,000

H . U . グループホールディングス	52,200	2,444.50	127,602,900
アルプス技研	17,000	2,527.00	42,959,000
日本空調サービス	19,500	762.00	14,859,000
オリエンタルランド	940,900	4,578.00	4,307,440,200
ダスキン	39,700	3,250.00	129,025,000
明光ネットワークジャパン	22,100	695.00	15,359,500
ファルコホールディングス	8,200	1,965.00	16,113,000
ラウンドワン	149,300	534.00	79,726,200
リゾートトラスト	70,300	2,097.00	147,419,100
ビー・エム・エル	22,000	2,749.00	60,478,000
リソー教育	82,100	257.00	21,099,700
早稲田アカデミー	10,100	1,388.00	14,018,800
ユー・エス・エス	183,000	2,586.50	473,329,500
東京個別指導学院	21,700	500.00	10,850,000
サイバーエージェント	393,200	777.90	305,870,280
楽天グループ	1,522,600	575.00	875,495,000
クリーク・アンド・リバー社	10,600	1,868.00	19,800,800
S B I グローバルアセットマネジメント	29,600	538.00	15,924,800
テー・オー・ダブリュー	35,800	309.00	11,062,200
山田コンサルティンググループ	9,200	1,539.00	14,158,800
セントラルスポーツ	6,800	2,369.00	16,109,200
フルキャストホールディングス	17,100	1,699.00	29,052,900
エン・ジャパン	32,300	2,125.00	68,637,500
リソルホールディングス	1,100	4,980.00	5,478,000
テクノプロ・ホールディングス	105,300	2,953.00	310,950,900
アトラグループ	3,600	196.00	705,600
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	1,388.00	13,047,200
K e e P e r 技研	11,000	5,660.00	62,260,000
ファーストロジック	3,400	494.00	1,679,600
三機サービス	2,100	1,183.00	2,484,300
G u n o s y	14,600	721.00	10,526,600
デザインワン・ジャパン	4,800	171.00	820,800
イー・ガーディアン	6,900	1,692.00	11,674,800
リブセンス	6,500	290.00	1,885,000
ジャパンマテリアル	54,500	2,364.00	128,838,000
ベクトル	28,200	1,128.00	31,809,600
ウチヤマホールディングス	5,900	344.00	2,029,600
チャーム・ケア・コーポレーション	15,100	1,089.00	16,443,900
キャリアリンク	6,600	2,425.00	16,005,000
I B J	14,100	633.00	8,925,300
アサンテ	9,000	1,586.00	14,274,000
バリューHR	15,800	1,212.00	19,149,600

M & Aキャピタルパートナーズ	14,500	2,520.00	36,540,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,000.00	6,600,000
E R Iホールディングス	3,200	1,763.00	5,641,600
アビスト	1,900	3,095.00	5,880,500
シグマクシス・ホールディングス	27,200	1,455.00	39,576,000
ウィルグループ	15,100	1,095.00	16,534,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	137.00	2,013,900
メドピア	15,900	955.00	15,184,500
レアジョブ	2,600	906.00	2,355,600
リクルートホールディングス	1,316,300	4,498.00	5,920,717,400
エラン	23,900	749.00	17,901,100
土木管理総合試験所	6,400	330.00	2,112,000
日本郵政	2,139,500	1,278.50	2,735,350,750
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,476.00	35,424,000
鎌倉新書	20,700	590.00	12,213,000
S M N	3,600	376.00	1,353,600
グローバルキッズCOMPANY	2,700	620.00	1,674,000
エアトリ	13,200	1,717.00	22,664,400
アトラエ	10,800	1,029.00	11,113,200
ストライク	7,600	3,250.00	24,700,000
ソラスト	49,500	561.00	27,769,500
セラク	5,700	1,242.00	7,079,400
インソース	38,900	852.00	33,142,800
ベイカレント・コンサルティング	140,800	3,969.00	558,835,200
Orchestra Holdings	4,100	910.00	3,731,000
アイモバイル	8,100	1,339.00	10,845,900
キャリアインデックス	5,100	267.00	1,361,700
MS - Japan	4,100	1,136.00	4,657,600
船場	2,800	888.00	2,486,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,500	1,915.00	121,602,500
フルテック	1,900	1,154.00	2,192,600
GameWith	4,500	294.00	1,323,000
MS&Consulting	1,900	643.00	1,221,700
ウェルビー	13,500	610.00	8,235,000
エル・ティー・エス	2,100	3,175.00	6,667,500
ミダックホールディングス	10,900	1,711.00	18,649,900
キュービーネットホールディングス	8,600	1,567.00	13,476,200
R P Aホールディングス	25,000	297.00	7,425,000
スプリックス	3,800	798.00	3,032,400
マネジメントソリューションズ	7,700	2,396.00	18,449,200
プロレド・パートナーズ	5,000	401.00	2,005,000
テノ・ホールディングス	2,000	510.00	1,020,000

フロンティア・マネジメント	5,200	1,560.00	8,112,000
ピアラ	2,900	400.00	1,160,000
コプロ・ホールディングス	4,200	1,185.00	4,977,000
ギークス	2,000	653.00	1,306,000
アンビスホールディングス	19,100	2,312.00	44,159,200
カーブスホールディングス	49,000	653.00	31,997,000
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,294.00	13,716,400
Fast Fitness Japan	6,300	1,203.00	7,578,900
ダイレクトマーケティングミックス	19,000	410.00	7,790,000
ポピンズ	2,900	1,191.00	3,453,900
LITALICO	14,000	1,875.00	26,250,000
コンフィデンス・インターワークス	800	1,497.00	1,197,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	422.00	2,574,200
リログループ	99,200	1,459.50	144,782,400
東祥	12,700	988.00	12,547,600
ID&Eホールディングス	10,800	3,325.00	35,910,000
ビーウィズ	4,600	2,022.00	9,301,200
TREホールディングス	37,700	1,128.00	42,525,600
人・夢・技術グループ	6,900	1,627.00	11,226,300
NISSOホールディングス	13,800	740.00	10,212,000
大栄環境	45,400	2,064.00	93,705,600
日本管財ホールディングス	18,800	2,451.00	46,078,800
M&A総研ホールディングス	8,500	2,716.00	23,086,000
エイチ・アイ・エス	51,800	1,630.00	84,434,000
ラックランド	8,200	2,842.00	23,304,400
共立メンテナンス	30,500	5,577.00	170,098,500
イチネンホールディングス	19,100	1,367.00	26,109,700
建設技術研究所	9,200	4,440.00	40,848,000
スペース	12,300	906.00	11,143,800
燦ホールディングス	15,400	1,047.00	16,123,800
スバル興業	700	12,790.00	8,953,000
東京テアトル	4,400	1,090.00	4,796,000
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,117.00	5,473,300
ナガワ	4,800	6,610.00	31,728,000
東京都競馬	15,000	3,835.00	57,525,000
カナモト	27,700	2,444.00	67,698,800
ニシオホールディングス	16,600	3,260.00	54,116,000
トランス・コスモス	22,200	3,105.00	68,931,000
乃村工藝社	77,900	872.00	67,928,800
藤田観光	7,100	4,030.00	28,613,000
KNT-CTホールディングス	10,600	1,211.00	12,836,600
トーカイ	15,900	1,872.00	29,764,800

セコム	181,100	10,090.00	1,827,299,000	
セントラル警備保障	9,700	2,480.00	24,056,000	
丹青社	34,800	836.00	29,092,800	
メイテックグループホールディングス	69,500	2,586.50	179,761,750	
応用地質	16,700	2,250.00	37,575,000	
船井総研ホールディングス	37,100	2,504.00	92,898,400	
進学会ホールディングス	4,900	283.00	1,386,700	
オオバ	7,700	890.00	6,853,000	
いであ	3,400	1,629.00	5,538,600	
学究社	7,200	2,003.00	14,421,600	
ベネッセホールディングス	66,500	1,778.00	118,237,000	
イオンディライト	19,800	3,260.00	64,548,000	
ナック	7,900	962.00	7,599,800	
ダイセキ	36,400	4,060.00	147,784,000	
ステップ	6,600	1,714.00	11,312,400	
合 計	263,249,200		552,571,458,840	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

【純資産額計算書】

(2023年11月30日現在)

資産総額	3,019,944,217円
負債総額	9,529,540円
純資産総額（ - ）	3,010,414,677円
発行済口数	2,084,768,808口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4440円
（1万口当たり純資産額）	（14,440円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年11月30日現在)

資産総額	593,783,273,527円
負債総額	695,177,511円
純資産総額（ - ）	593,088,096,016円
発行済口数	243,435,511,696口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4363円
（1万口当たり純資産額）	（24,363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、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、

- 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、

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、）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11月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2024年 1月19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11月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	528	14,380,411
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	64	217,711
単体型公社債投資信託	51	174,255
合計	643	14,772,377

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（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37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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38期事業年度の間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918

その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				株主資本合計
	利益準備金	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

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. 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）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21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。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（表示方法の変更）

（貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額の重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

（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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

（株主資本等変動計算書関係）

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

(2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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	当事業年度末
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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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・カテゴリ毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払い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。

(4) 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。

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 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（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	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)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
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	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*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（貸借対照表計上額は960百万円）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貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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(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

当事業年度(2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

(デリバティブ取引関係)

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

前事業年度(2022年3月31日)

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)
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	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。

当事業年度(2023年3月31日)

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	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計	7,458	-	48	48	

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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	

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

(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。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(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 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

(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	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	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100百万円、当事業年度109百万円であります。

(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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

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。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

[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]

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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(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（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）

当事業年度（2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

負債の部

流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023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		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間
（自 2023年4月1日
至 2023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。

（表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」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38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
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38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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38期中間会計期間末（2023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)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(*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1,041百万円）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16,243百万円であります。

(*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271百万円）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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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38期中間会計期間末（2023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)

区 分	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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(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271百万円）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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(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	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

〔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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86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38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこ

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年1月19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（2023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） （2023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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
a uカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023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
2023年 1月20日	有価証券届出書
2023年 1月20日	有価証券報告書
2023年 7月20日	有価証券届出書
2023年 7月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2023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2023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12月27日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之

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My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2022年10月21日から2023年10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、My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2023年10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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

2023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

田中洋一

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。