

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	国内株式SMTBセレクション（SMA専用）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

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

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

### （７）【申込期間】

2024年 9月21日から2025年 3月19日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

2024年11月5日受付分からは、取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半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所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

#### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

- (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MRF及びMMF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)...「MRF及びMMF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 >

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

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

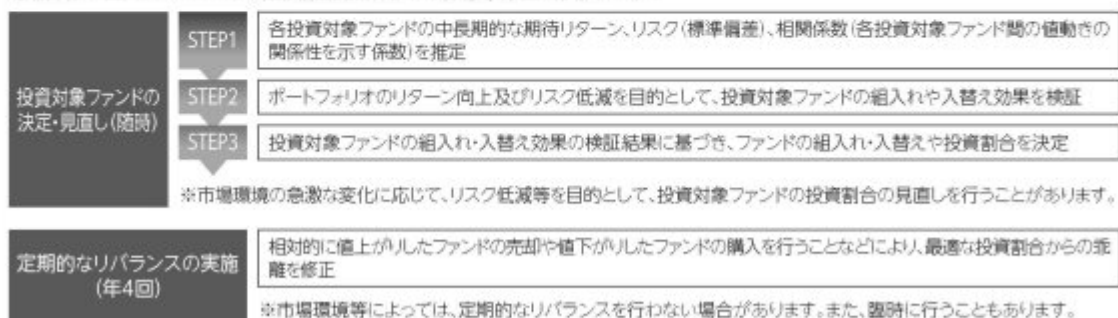
投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

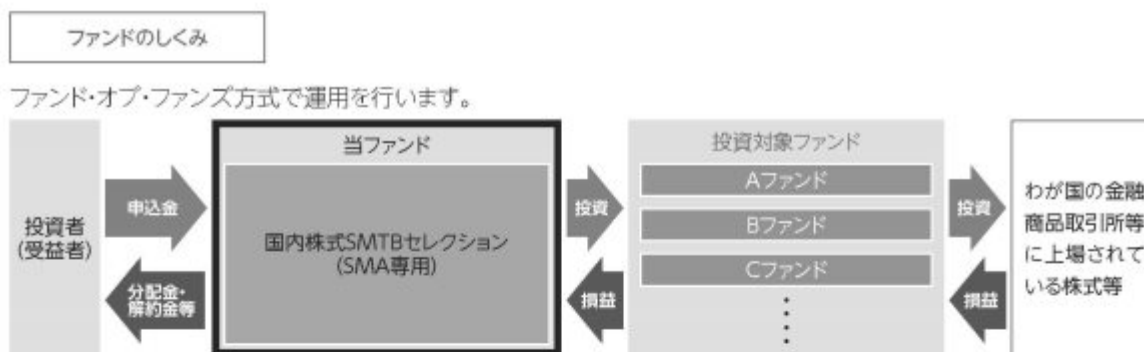
- 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。
- 投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

### ポートフォリオ構築プロセス

- 運用に当たっては三井住友信託銀行から投資助言を受けます。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

### 分配方針

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

### 主な投資制限

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始  
 2023年9月21日 信託期間の延長（終了日を2024年12月20日から無期限へ変更）

## (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（2024年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

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

### 投資対象

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

### 投資態度

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

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

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

### 有価証券の指図範囲

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

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

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

#### （参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2024年7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

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

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

投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、T O P I X（東証株価指数）（配当込み）（ ）の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	T O P I X（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2035年2月15日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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T O P I X」という。）の指数値及び配当込みT O P I Xに係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以

下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みT O P I Xに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みT O P I Xに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、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、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

## 2.国内株式インデックス マザーファンド

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



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

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社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が有する。

J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みT O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みT O P I X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。

J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値及び配当込みT O P I X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T O P I X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。

### 3. 日本株式E S Gセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

#### 4. 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ）に対する超過リターンを目指します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として信託財産総額の90%以上とします。</p> <p>信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の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、金利先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002年12月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社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。

## 5. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社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。

#### 6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

## 7.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
------	----------------------



運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、T O P I X (東証株価指数)(配当込み) ( ) をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・日本の株式を主要投資対象とします。</li> <li>・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュースコア指標（P B R、P E R、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。</li> </ul> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>安定した収益の確保および効率的な運用を行うためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。</p> <p>イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的</p> <p>ロ．信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 8. SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
------	----------------------

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、GARP（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。</p> <p>TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <p>株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>資金動向、市況動向、残存期間等及びやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>

信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜 0.45%）</li> <li>・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜 0.4%）</li> <li>・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜 0.35%）</li> </ul>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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に関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）に帰属します。J P Xは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

#### 9. マネープールマザーファンド

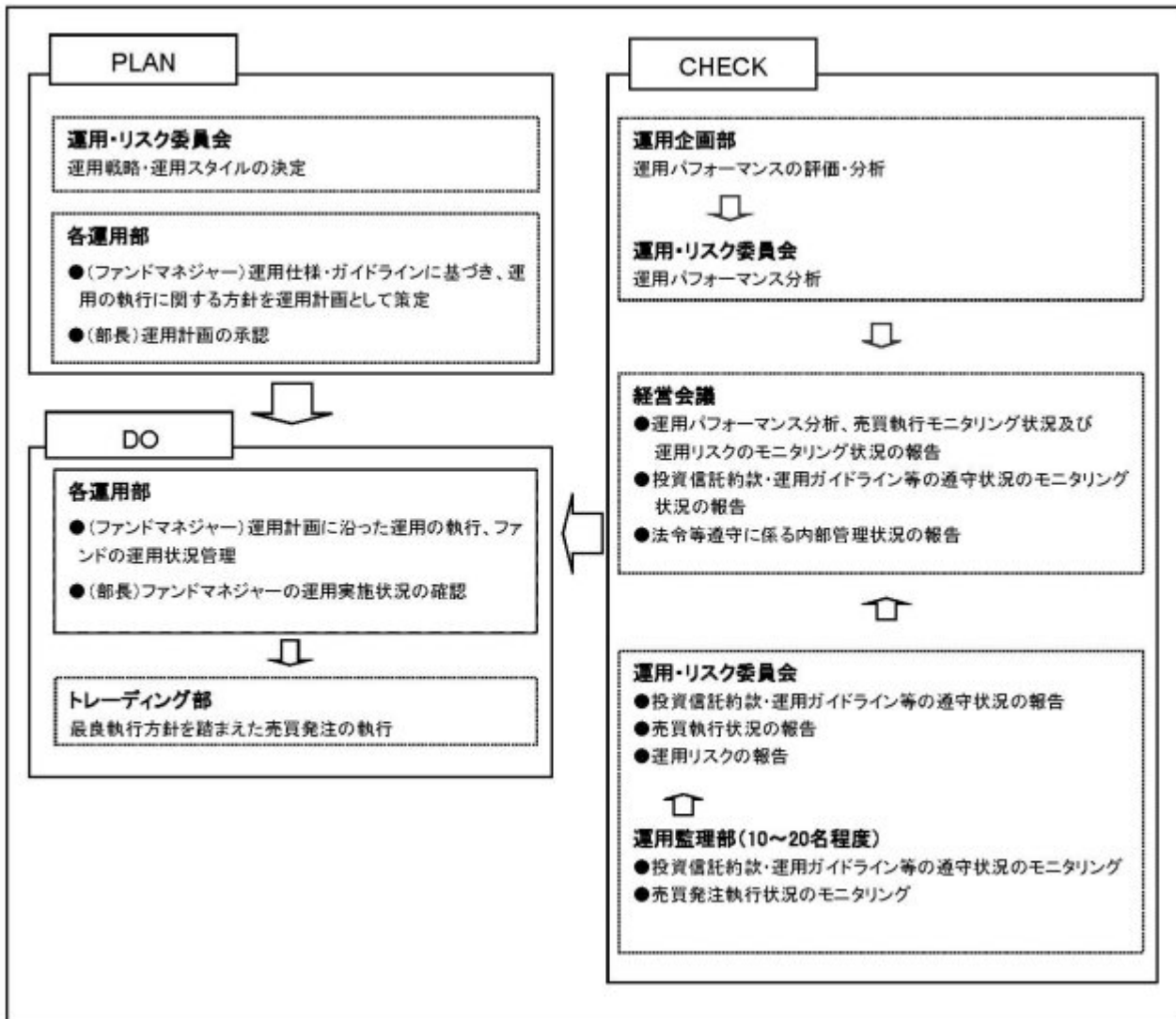
運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。

投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>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、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の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、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
------	---

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

### ハ．外貨建資産への投資

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

### ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

### ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

### ヘ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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



### <その他の投資制限>

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

## 3【投資リスク】

### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

#### 信用リスク

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

#### 有価証券の貸付等に係るリスク

投資対象ファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### ESGの投資リスク

一部の投資対象ファンドにおいては、ESGを投資対象選定の主要な要素としており、ESG評価が相対的に高い企業の発行する有価証券を選別して組み入れます。

ESG評価と短期的な有価証券の値動きには必ずしも関連性があるわけではありません。また、ESG評価がファンドの収益源となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合もあります。

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

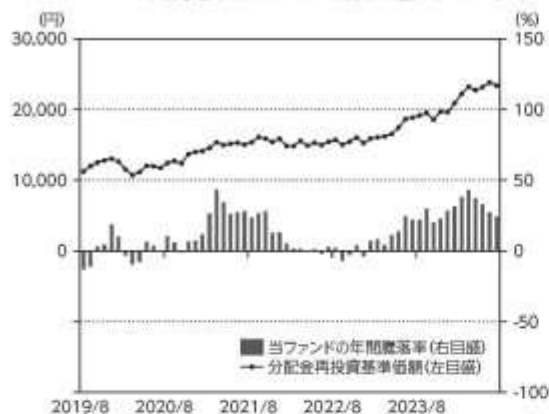
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

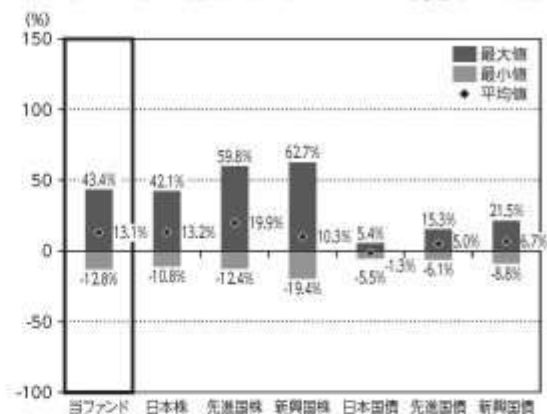
## 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2019年8月～2024年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、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、配当対象としての継続性を有するマーケットベンチマークで、浮動時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] 変動は、配当収益を考慮して算出した時価総額です。同指数の相対値及び相対値に基く権利又は指標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社（以下「JPX」といふ。）の承認を得た後、指数の算出、指数値の公表、利用など権利に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は指標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の相対値の算出又は公表の承認、承認又は中絶に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はAMSCI 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AMSCI 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 NOWJURA-BPI国債	NOWJURA-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、日本で発行された公募定期付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運用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、本ファンドの組織、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず。またデータの誤差、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPE&Mグローバル・エマージング・マーケット・ローリング・ハイブリッド・インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP, Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。JP, Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP, Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

なお、当ファンドが投資対象ファンドに投資する際に信託財産留保額（ ）がかかる場合、当該信託財産留保額を当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。

## (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

## (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、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

ロ．投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合は、マザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年9月21日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

なお上記のほかにも、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

## (参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.374% (税抜 0.34%)
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ESGセレクト・リーダーズイン デックスマザーファンド	ありません。

日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517% （税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095% （税抜 0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495% （税抜 0.45%）
SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜 0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜 0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜 0.35%）
マネープールマザーファンド	ありません。

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

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

品貸料の額は運用状況等によって変動するため、品貸料及び品貸料に対する信託報酬の額については、上記「実質的な信託報酬率」及び「投資対象とする投資信託証券」では考慮しておりません。

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの

純資産総額に年率0.055%（税抜0.05%）を乗じて得たものとします。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

##### ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）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）」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。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について）をご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年7月31日現在のもので、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
0.91%	0.60%	0.31%

※対象期間は2022年12月21日～2023年12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。

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

※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、2024年7月31日現在の状況について記載してあります。

### 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	157,608,173,207	68.56
親投資信託受益証券	日本	69,393,846,157	30.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,879,658,994	1.25
合計（純資産総額）		229,881,678,358	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	16,085,533,365	2.4508	39,422,765,628	2.9044	46,718,823,105	20.32
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	23,800,560,043	1.5932	37,919,756,073	1.8985	45,185,363,241	19.66
日本	投資信託受益証券	FOfs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	23,897,137,444	1.4749	35,247,391,736	1.8771	44,857,316,696	19.51
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	11,401,967,365	2.6131	29,794,560,735	2.9821	34,001,806,879	14.79
日本	投資信託受益証券	FOfs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,215,817,435	2.0732	19,106,499,964	2.4504	22,582,439,042	9.82
日本	親投資信託受益証券	日本株式エクセレント・フォーカスマザーファンド	1,828,525,783	6.1190	11,188,923,077	6.2778	11,479,119,160	4.99
日本	親投資信託受益証券	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	7,014,531,631	1.3189	9,251,465,769	1.5961	11,195,893,936	4.87
日本	投資信託受益証券	SM DAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	10,544,696,898	1.025	10,809,105,172	1.0414	10,981,247,349	4.78
日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	9,953	1.0006	9,958	1.0004	9,956	0.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	68.56
親投資信託受益証券	30.19
合計	98.75

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末	(2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末	(2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末	(2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282



第5期計算期間末	(2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
第6期計算期間末	(2020年12月21日)	142,930,348,485	142,930,348,485	13,862	13,862
第7期計算期間末	(2021年12月20日)	144,548,292,355	144,548,292,355	15,531	15,531
第8期計算期間末	(2022年12月20日)	154,756,463,658	154,756,463,658	15,497	15,497
第9期計算期間末	(2023年12月20日)	193,100,062,864	193,100,062,864	19,400	19,400
	2023年 7月末日	176,326,318,899		18,865	
	8月末日	182,889,134,083		19,173	
	9月末日	182,203,683,301		19,528	
	10月末日	180,769,639,622		18,572	
	11月末日	193,921,945,536		19,698	
	12月末日	195,945,182,756		19,614	
	2024年 1月末日	206,822,704,319		20,895	
	2月末日	220,800,126,321		22,220	
	3月末日	230,861,281,280		23,214	
	4月末日	216,070,373,396		22,739	
	5月末日	223,306,256,164		23,184	
	6月末日	234,872,922,074		23,807	
	7月末日	229,881,678,358		23,414	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	0
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	0
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	0
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	0
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	0
第9期計算期間	2022年12月21日～2023年12月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	10.5
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	1.1
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	19.7
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	15.6
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	15.9
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	6.0
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	12.0
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	0.2
第9期計算期間	2022年12月21日～2023年12月20日	25.2
第10期中間計算期間	2023年12月21日～2024年 6月20日	19.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	81,752,097,825	11,939,046,387	69,813,051,438
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	32,549,745,987	26,264,044,984	76,098,752,441
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	25,222,310,539	24,029,412,202	77,291,650,778
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	39,648,856,359	16,087,379,469	100,853,127,668
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	35,149,470,870	24,542,896,159	111,459,702,379
第6期計算期間	2019年12月21日～2020年12月21日	23,651,763,751	31,999,573,730	103,111,892,400
第7期計算期間	2020年12月22日～2021年12月20日	27,063,834,005	37,106,762,396	93,068,964,009
第8期計算期間	2021年12月21日～2022年12月20日	27,355,134,067	20,561,245,789	99,862,852,287
第9期計算期間	2022年12月21日～2023年12月20日	26,608,308,961	26,932,739,568	99,538,421,680
第10期中間計算期間	2023年12月21日～2024年 6月20日	15,397,226,633	17,109,791,002	97,825,857,311

(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	674,704,322,780	99.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,213,661,178	0.77
合計(純資産総額)		679,917,983,958	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	4,754,900,000	0.70

(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	9,113,600	3,387.36	30,871,108,820	2,949.00	26,876,006,400	3.95

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,282,700	1,638.58	16,849,031,988	1,750.00	17,994,725,000	2.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,200,600	12,514.83	15,025,310,147	13,530.00	16,244,118,000	2.39
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,160,900	3,178.45	13,225,240,810	3,288.00	13,681,039,200	2.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,182,400	10,051.73	11,885,169,680	10,915.00	12,905,896,000	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,500	70,010.00	12,006,715,967	65,890.00	11,300,135,000	1.66
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	362,800	35,353.89	12,826,392,400	31,020.00	11,254,056,000	1.66
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,269,300	7,774.97	9,868,779,486	8,658.00	10,989,599,400	1.62
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,482,900	3,354.82	11,684,524,236	3,144.00	10,950,237,600	1.61
日本	株式	信越化学工業	化学	1,540,000	5,894.82	9,078,037,551	6,748.00	10,391,920,000	1.53
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,648,500	5,372.42	8,856,443,136	6,022.00	9,927,267,000	1.46
日本	株式	三井物産	卸売業	2,717,200	4,026.25	10,940,141,141	3,530.00	9,591,716,000	1.41
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,219,300	7,295.57	8,895,489,096	7,783.00	9,489,811,900	1.40
日本	株式	第一三共	医薬品	1,497,900	5,452.27	8,166,965,716	6,148.00	9,209,089,200	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	1,082,400	8,275.97	8,957,913,640	8,388.00	9,079,171,200	1.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	51,145,400	152.06	7,777,448,090	160.40	8,203,722,160	1.21
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,279,100	3,136.02	7,147,315,922	3,448.00	7,858,336,800	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	848,200	8,983.95	7,620,192,764	9,162.00	7,771,208,400	1.14
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,062,000	1,739.96	7,067,753,446	1,647.00	6,690,114,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,521,800	4,114.25	6,261,065,708	4,302.00	6,546,783,600	0.96
日本	株式	HOYA	精密機器	337,500	18,634.69	6,289,210,911	18,940.00	6,392,250,000	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,264,700	4,277.59	5,409,871,368	4,520.00	5,716,444,000	0.84
日本	株式	三菱重工業	機械	3,028,000	1,314.86	3,981,400,990	1,830.00	5,541,240,000	0.81
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,747,000	1,876.20	5,153,938,792	1,965.00	5,397,855,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,531,500	2,950.46	4,518,641,406	3,351.00	5,132,056,500	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,896,700	2,695.92	5,113,369,045	2,601.00	4,933,316,700	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,025,800	4,411.02	4,524,834,004	4,434.00	4,548,397,200	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	206,700	22,931.04	4,739,846,224	21,905.00	4,527,763,500	0.67
日本	株式	富士通	電気機器	1,593,400	2,255.47	3,593,877,591	2,732.50	4,353,965,500	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	1,504,600	3,091.74	4,651,845,041	2,860.50	4,303,908,300	0.63

(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	0.30
		建設業	2.12
		食料品	3.20
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.69
		医薬品	4.77

石油・石炭製品	0.53
ゴム製品	0.63
ガラス・土石製品	0.68
鉄鋼	0.85
非鉄金属	0.73
金属製品	0.54
機械	5.48
電気機器	17.07
輸送用機器	7.71
精密機器	2.24
その他製品	2.41
電気・ガス業	1.38
陸運業	2.28
海運業	0.75
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.11
卸売業	7.47
小売業	4.00
銀行業	8.28
証券、商品先物取引業	0.94
保険業	3.27
その他金融業	1.20
不動産業	2.00
サービス業	4.53
小計	99.23
合計	99.23

(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	170円		4,735,618,500	4,754,900,000	0.70

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

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

#### 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	14,870,703,600	98.64
投資証券	日本	68,587,600	0.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		136,354,243	0.90
合計(純資産総額)		15,075,645,443	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	72,722,000	0.48

(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	393,400	3,600.99	1,416,629,466	2,949.00	1,160,136,600	7.70
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	46,300	12,788.62	592,113,106	13,530.00	626,439,000	4.16
日本	株式	日立製作所	電気機器	172,000	2,800.94	481,761,680	3,288.00	565,536,000	3.75
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	17,500	37,111.40	649,449,500	31,020.00	542,850,000	3.60
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	46,400	8,789.24	407,820,736	10,915.00	506,456,000	3.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	55,100	6,772.16	373,146,016	8,658.00	477,055,800	3.16
日本	株式	第一三共	医薬品	68,600	4,709.44	323,067,584	6,148.00	421,752,800	2.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	69,700	4,821.95	336,089,915	6,022.00	419,733,400	2.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	44,100	6,821.89	300,845,349	7,783.00	343,230,300	2.28
日本	株式	任天堂	その他製品	38,500	7,776.07	299,378,695	8,388.00	322,938,000	2.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	89,500	2,944.54	263,536,330	3,448.00	308,596,000	2.05
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	6,500	43,939.25	285,605,125	41,650.00	270,725,000	1.80
日本	株式	KDDI	情報・通信業	55,500	4,395.98	243,976,890	4,520.00	250,860,000	1.66
日本	株式	HOYA	精密機器	13,000	17,500.87	227,511,310	18,940.00	246,220,000	1.63
日本	株式	三菱重工業	機械	118,900	1,338.26	159,119,114	1,830.00	217,587,000	1.44
日本	株式	ダイキン工業	機械	9,800	20,295.60	198,896,880	21,905.00	214,669,000	1.42
日本	株式	村田製作所	電気機器	63,900	2,743.55	175,312,845	3,351.00	214,128,900	1.42
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	105,900	1,921.21	203,456,139	1,965.00	208,093,500	1.38
日本	株式	富士通	電気機器	65,300	2,384.41	155,701,973	2,732.50	178,432,250	1.18
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	40,500	4,680.92	189,577,260	4,282.00	173,421,000	1.15
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	28,400	6,011.48	170,726,032	6,029.00	171,223,600	1.14

日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	保険業	47,700	2,766.93	131,982,561	3,582.00	170,861,400	1.13
日本	株式	ファナック	電気機器	35,300	4,237.41	149,580,573	4,510.00	159,203,000	1.06
日本	株式	オリックス	その他金融業	42,800	3,197.32	136,845,296	3,664.00	156,819,200	1.04
日本	株式	三井不動産	不動産業	99,000	1,583.67	156,783,330	1,573.50	155,776,500	1.03
日本	株式	TDK	電気機器	14,400	7,473.46	107,617,824	10,535.00	151,704,000	1.01
日本	株式	丸紅	卸売業	52,900	2,626.05	138,918,045	2,860.50	151,320,450	1.00
日本	株式	小松製作所	機械	34,300	4,474.52	153,476,036	4,357.00	149,445,100	0.99
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	41,500	3,350.52	139,046,580	3,580.00	148,570,000	0.99
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	55,500	2,714.15	150,635,325	2,578.00	143,079,000	0.95

(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、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	鉱業	0.54
		建設業	1.71
		食料品	3.04
		繊維製品	0.35
		化学	5.66
		医薬品	4.76
		石油・石炭製品	0.56
		ゴム製品	0.88
		ガラス・土石製品	0.48
		鉄鋼	1.18
		非鉄金属	0.58
		金属製品	0.12
		機械	5.66
		電気機器	22.72
		輸送用機器	8.21
		精密機器	2.04
		その他製品	3.12
		電気・ガス業	1.10
		陸運業	1.80
		海運業	0.55
		空運業	0.11
		倉庫・運輸関連業	0.01
		情報・通信業	4.38
卸売業	3.68		
小売業	3.93		
銀行業	6.03		
証券、商品先物取引業	1.11		
保険業	5.02		

	その他金融業	1.10
	不動産業	2.55
	サービス業	5.67
	小計	98.64
投資証券		0.45
合計		99.10

(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	ミニTOPIX先物	買建	26円		72,019,038	72,722,000	0.48

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

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

#### 日本株式エクセレント・フォーカス 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	46,382,562,050	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		426,230,492	0.91
合計(純資産総額)		46,808,792,542	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	65,600	30,780.80	2,019,220,560	40,600.00	2,663,360,000	5.69
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,279,400	1,371.76	1,755,039,946	1,750.00	2,238,950,000	4.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	186,600	7,873.96	1,469,282,694	10,915.00	2,036,739,000	4.35
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	359,700	3,898.84	1,402,415,688	5,606.00	2,016,478,200	4.31
日本	株式	三越伊勢丹ホールディングス	小売業	598,400	1,911.04	1,143,568,594	3,031.00	1,813,750,400	3.87
日本	株式	信越化学工業	化学	260,600	5,593.23	1,457,597,353	6,748.00	1,758,528,800	3.76
日本	株式	第一三共	医薬品	278,700	4,251.38	1,184,861,335	6,148.00	1,713,447,600	3.66
日本	株式	三菱商事	卸売業	536,000	2,636.69	1,413,266,825	3,144.00	1,685,184,000	3.60

日本	株式	三菱重工業	機械	914,500	1,039.55	950,676,574	1,830.00	1,673,535,000	3.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	53,700	28,973.97	1,555,902,289	31,020.00	1,665,774,000	3.56
日本	株式	日立製作所	電気機器	465,900	2,256.16	1,051,148,656	3,288.00	1,531,879,200	3.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	176,300	5,849.49	1,031,265,999	8,658.00	1,526,405,400	3.26
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	112,800	12,870.58	1,451,802,162	13,530.00	1,526,184,000	3.26
日本	株式	ディスコ	機械	28,000	39,614.23	1,109,198,599	49,460.00	1,384,880,000	2.96
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,800	64,948.61	1,350,931,240	65,890.00	1,370,512,000	2.93
日本	株式	マツキヨココカラ&カンパニー	小売業	504,100	2,532.90	1,276,836,978	2,450.50	1,235,297,050	2.64
日本	株式	西武ホールディングス	陸運業	403,100	2,002.06	807,031,342	2,817.00	1,135,532,700	2.43
日本	株式	村田製作所	電気機器	323,700	2,930.46	948,589,984	3,351.00	1,084,718,700	2.32
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	217,500	4,190.37	911,407,225	4,670.00	1,015,725,000	2.17
日本	株式	S M C	機械	12,100	77,167.79	933,730,259	74,150.00	897,215,000	1.92
日本	株式	富士電機	電気機器	97,900	7,336.23	718,216,945	8,532.00	835,282,800	1.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	324,700	2,469.87	801,969,447	2,514.00	816,295,800	1.74
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	229,600	3,622.52	831,732,589	3,545.00	813,932,000	1.74
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	264,900	3,118.61	826,120,022	2,949.00	781,190,100	1.67
日本	株式	荏原製作所	機械	341,800	2,679.97	916,015,933	2,194.00	749,909,200	1.60
日本	株式	NTTデータグループ	情報・通信業	309,400	2,423.92	749,962,427	2,359.50	730,029,300	1.56
日本	株式	J.フロント リテイリング	小売業	395,900	1,440.26	570,202,302	1,828.00	723,705,200	1.55
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	115,300	5,235.93	603,703,418	6,029.00	695,143,700	1.49
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	298,700	1,987.06	593,535,809	2,310.00	689,997,000	1.47
日本	株式	H O Y A	精密機器	35,500	17,248.35	612,316,486	18,940.00	672,370,000	1.44

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	0.74
		化学	5.05
		医薬品	4.50
		ガラス・土石製品	5.69
		鉄鋼	0.80
		非鉄金属	2.15
		機械	12.21
		電気機器	19.00
		輸送用機器	8.15
		精密機器	1.44
		陸運業	4.16
		情報・通信業	5.28
		卸売業	3.60
		小売業	10.22
銀行業	9.13		



	保険業	0.59
	不動産業	1.81
	サービス業	4.57
	小計	99.09
合計		99.09

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### マネープールマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	94,847,020,000	53.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		81,459,652,028	46.20
合計(純資産総額)		176,306,672,028	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第1220回国庫短期証券	45,000,000,000	99.91	44,963,775,000	99.85	44,934,300,000		2025/3/21	25.49
日本	国債証券	第1226回国庫短期証券	40,000,000,000	99.87	39,948,480,000	99.83	39,935,240,000		2025/4/21	22.65
日本	国債証券	第1238回国庫短期証券	10,000,000,000	99.83	9,983,230,000	99.77	9,977,480,000		2025/6/20	5.66

(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. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	53.80
合計	53.80

(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。

## 参考情報

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2015年2月6日

作成基準日：2024年7月31日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

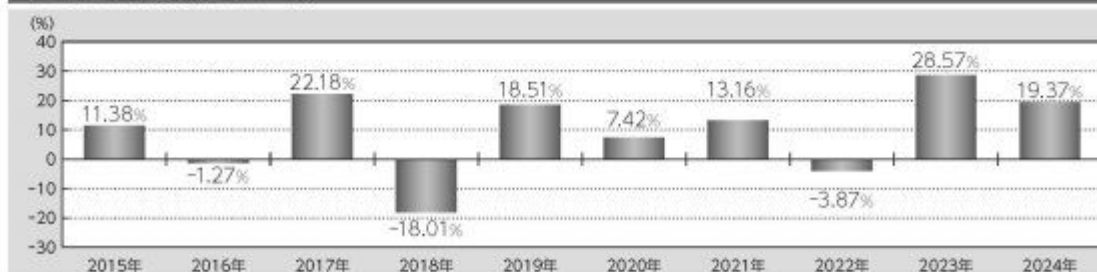
決算期	分配金
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
2023年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	20.3%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	19.7%
FOFs用国内株式EVI/バリューファンド(適格機関投資家専用)	19.5%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	14.8%
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9.8%
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	5.0%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	4.9%
SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	4.8%
マネーボールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

### < 申込手続 >

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

### < 申込コース >

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

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

### < 申込みの受付 >

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

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### < 申込単位 >

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

### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### < 申込手数料 >

ありません。

### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

### < 受付不可日 >

ありません。

### < 申込受付の中止等 >

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

### < その他 >

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

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3 【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・公社債等

計算日における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2015年2月6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12月21日から翌年12月20日までとします。

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

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

#### （5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国



において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 換金（解約）請求権

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

有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2022年12月21日から2023年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2022年12月20日現在）	第9期 （2023年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,930,863,764	2,795,849,990
投資信託受益証券	84,786,707,478	123,913,255,193
親投資信託受益証券	67,644,038,321	67,127,123,773
流動資産合計	155,361,609,563	193,836,228,956
<b>資産合計</b>		
155,361,609,563		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	142,496,086	179,715,401
未払受託者報酬	25,171,587	30,283,666
未払委託者報酬	436,307,418	524,916,896
未払利息	6,879	995
その他未払費用	1,163,935	1,249,134
流動負債合計	605,145,905	736,166,092
<b>負債合計</b>		
605,145,905		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	99,862,852,287	99,538,421,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,893,611,371	93,561,641,184
（分配準備積立金）	22,685,235,551	49,461,251,446
元本等合計	154,756,463,658	193,100,062,864
<b>純資産合計</b>		
154,756,463,658		
<b>負債純資産合計</b>		
155,361,609,563		

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	2021年12月21日 至 2022年12月20日	自	2022年12月21日 至 2023年12月20日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		278,371,905		370,669,580
受取利息		6,644		11,726
有価証券売買等損益		384,954,631		39,915,759,113
<b>営業収益合計</b>		<b>663,333,180</b>		<b>40,286,440,419</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,039,155		1,169,198
受託者報酬		48,113,291		57,515,166
委託者報酬		833,963,646		996,929,493
その他費用		2,286,633		2,443,421
<b>営業費用合計</b>		<b>885,402,725</b>		<b>1,058,057,278</b>
営業利益又は営業損失（ ）		222,069,545		39,228,383,141
経常利益又は経常損失（ ）		222,069,545		39,228,383,141
当期純利益又は当期純損失（ ）		222,069,545		39,228,383,141
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（ ）		497,005,970		6,456,248,925
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		51,479,328,346		54,893,611,371
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,445,702,408		21,071,809,548
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,445,702,408		21,071,809,548
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,306,355,808		15,175,913,951
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,306,355,808		15,175,913,951
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,893,611,371		93,561,641,184

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2022年12月20日現在)	第9期 (2023年12月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,862,852,287口	99,538,421,680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) 1.5497円 (15,497円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9400円 (19,400円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日			第9期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	982,049,579円	費用控除後の配当等収益額	A	1,945,964,388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	30,289,222,490円
収益調整金額	C	33,336,615,134円	収益調整金額	C	44,100,389,738円
分配準備積立金額	D	21,703,185,972円	分配準備積立金額	D	17,226,064,568円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	56,021,850,685円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	93,561,641,184円
当ファンドの期末残存口数	F	99,862,852,287口	当ファンドの期末残存口数	F	99,538,421,680口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,609円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,399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9期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2023年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	第9期 (2023年12月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。  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8期 自 2021年12月21日 至 2022年12月20日	第9期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	93,068,964,009円	99,862,852,287円
期中追加設定元本額	27,355,134,067円	26,608,308,961円
期中一部解約元本額	20,561,245,789円	26,932,739,568円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第8期 (2022年12月20日現在)	第9期 (2023年12月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	835,863,629	22,196,910,701
親投資信託受益証券	236,334,703	11,601,154,183
合計	599,528,926	33,798,064,884

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	24,216,351,562	38,000,298,871	
	FOfs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,323,525,264	19,032,112,121	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	11,372,159,803	29,277,625,412	
	FOfs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	25,829,934,599	37,603,218,789	
投資信託受益証券合計		70,741,971,228	123,913,255,193	
親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	1,870,972,582	9,631,018,463	
	国内株式インデックス マザーファンド	19,888,144,852	47,934,406,722	

	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	7,328,087,546	9,561,688,630	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,958	
	親投資信託受益証券合計	29,087,214,933	67,127,123,773	
	合計		191,040,378,966	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 中小型株式 マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	900,252,587
株式	23,095,481,550
未収入金	45,225,664
未収配当金	23,886,900
流動資産合計	24,064,846,701
資産合計	24,064,846,701
負債の部	
流動負債	
未払金	75,299,866
未払解約金	6,970,082
未払利息	320
流動負債合計	82,270,268
負債合計	82,270,268
純資産の部	
元本等	
元本	4,659,019,280
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	19,323,557,153
元本等合計	23,982,576,433
純資産合計	23,982,576,433
負債純資産合計	24,064,846,701

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。



2023年12月20日現在	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,659,019,280口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 5.1476円 (51,476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12月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年12月21日
期首元本額	4,457,754,428円
期中追加設定元本額	586,959,948円
期中一部解約元本額	385,695,096円
期末元本額	4,659,019,280円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,715,789,852円

区分	2023年12月20日現在
中小型株式オープン（SMA専用）	47,792,051円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,870,972,582円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	24,464,795円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	697,358,110	
合計	697,358,110	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
寿スピリッツ	174,100	2,159.50	375,968,950	
わらべや日洋ホールディングス	40,000	3,410.00	136,400,000	
セーレン	119,000	2,480.00	295,120,000	
トリケミカル研究所	162,000	3,595.00	582,390,000	
ニフコ	126,000	3,524.00	444,024,000	
ロート製薬	147,900	2,828.50	418,335,150	
ペプチドリーム	356,400	1,200.50	427,858,200	
MARUWA	18,200	29,100.00	529,620,000	
横河ブリッジホールディングス	160,000	2,516.00	402,560,000	
三益半導体工業	148,200	2,772.00	410,810,400	
芝浦機械	60,000	3,560.00	213,600,000	
ローツェ	8,000	14,910.00	119,280,000	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	36,300	4,305.00	156,271,500	
竹内製作所	112,000	4,275.00	478,800,000	
ホシザキ	30,000	5,048.00	151,440,000	
イビデン	81,700	7,820.00	638,894,000	
富士電機	100,000	6,126.00	612,600,000	
日本マイクロニクス	37,400	3,585.00	134,079,000	
日本セラミック	124,500	2,825.00	351,712,500	
図研	15,400	3,935.00	60,599,000	
エンプラス	31,500	12,590.00	396,585,000	
大真空	220,100	813.00	178,941,300	
AeroEdge	25,000	3,110.00	77,750,000	
ナカニシ	112,800	2,394.00	270,043,200	

前田工織	144,900	3,030.00	439,047,000
SHOEI	58,000	1,848.00	107,184,000
アシックス	87,000	4,861.00	422,907,000
メタウォーター	135,000	2,044.00	275,940,000
富士急行	83,200	4,125.00	343,200,000
AZ-COM丸和ホールディングス	199,400	1,481.00	295,311,400
ブレインパッド	187,000	1,049.00	196,163,000
SHIFT	13,800	35,280.00	486,864,000
インターネットイニシアティブ	73,900	2,767.50	204,518,250
カナミックネットワーク	305,100	390.00	118,989,000
チェンジホールディングス	84,800	1,432.00	121,433,600
マネーフォワード	107,700	4,181.00	450,293,700
ビジョナル	17,200	8,930.00	153,596,000
エクサウィザーズ	532,900	396.00	211,028,400
サスメド	120,100	1,262.00	151,566,200
シンプレクス・ホールディングス	168,700	2,566.00	432,884,200
Finatextホールディングス	166,200	640.00	106,368,000
Sansan	102,300	1,616.00	165,316,800
ギフトィ	199,200	1,813.00	361,149,600
JMDC	50,000	4,199.00	209,950,000
JTOWER	83,800	5,000.00	419,000,000
AnyMind Group	75,000	860.00	64,500,000
ANYCOLOR	117,200	3,295.00	386,174,000
ネットワンシステムズ	80,000	2,367.50	189,400,000
ビジョン	259,400	1,203.00	312,058,200
東宝	115,000	4,788.00	550,620,000
カブコン	105,000	4,595.00	482,475,000
神戸物産	109,600	4,059.00	444,866,400
アズワン	50,000	5,373.00	268,650,000
BuySell Technologies	53,000	3,030.00	160,590,000
パルグループホールディングス	230,000	2,498.00	574,540,000
物語コーポレーション	84,100	4,355.00	366,255,500
薬王堂ホールディングス	90,000	2,646.00	238,140,000
京都フィナンシャルグループ	49,600	8,600.00	426,560,000
FPパートナー	40,000	5,310.00	212,400,000
アニコムホールディングス	400,000	524.00	209,600,000
イー・ギャランティ	165,100	1,888.00	311,708,800
SREホールディングス	123,300	2,802.00	345,486,600
東急不動産ホールディングス	246,000	908.90	223,589,400
ティーケーピー	156,000	1,725.00	269,100,000
エス・エム・エス	127,000	2,782.00	353,314,000
エスプール	284,800	422.00	120,185,600

イオンファンタジー	75,000	2,454.00	184,050,000	
弁護士ドットコム	110,200	4,295.00	473,309,000	
K e e P e r 技研	52,000	7,020.00	365,040,000	
ジャパンマテリアル	194,800	2,430.00	473,364,000	
E R I ホールディングス	113,300	1,642.00	186,038,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	180,000	2,325.00	418,500,000	
マネジメントソリューションズ	63,100	3,215.00	202,866,500	
L I T A L I C O	133,200	2,048.00	272,793,600	
東祥	120,800	780.00	94,224,000	
ダイセキ	97,100	3,900.00	378,690,000	
合 計	9,466,300		23,095,481,550	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年12月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,377,418,476
株式	583,070,348,420
派生商品評価勘定	14,679,350
未収配当金	77,383,838
差入委託証拠金	241,631,630
流動資産合計	587,781,461,714
資産合計	587,781,461,714
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	431,600
前受金	14,267,000
未払解約金	95,488,935
未払利息	1,559
流動負債合計	110,189,094
負債合計	110,189,094
純資産の部	
元本等	
元本	243,831,636,576
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	343,839,636,044
元本等合計	587,671,272,620
純資産合計	587,671,272,620
負債純資産合計	587,781,461,714

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,831,636,576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 2.4102円 (1万口当たり純資産額) (24,102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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)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。

2023年12月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年12月21日
期首元本額	260,215,059,922円
期中追加設定元本額	22,979,406,038円
期中一部解約元本額	39,362,829,384円
期末元本額	243,831,636,576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）	309,069,895円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,413,046,105円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,094,963円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,015,051,702円
世界経済インデックスファンド	5,199,133,305円
日本株式インデックス・オープン	2,960,415,472円
DCマイセレクション25	5,338,984,479円
DCマイセレクション50	17,243,960,204円
DCマイセレクション75	18,637,958,597円
DC日本株式インデックス・オープン	6,019,360,580円
DCマイセレクションS25	3,163,598,047円
DCマイセレクションS50	9,555,935,851円
DCマイセレクションS75	8,292,918,774円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,159,661,957円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,290,792円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	620,985,895円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	487,361,219円
DC世界経済インデックスファンド	3,799,612,524円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	856,745,822円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,504,090円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,124,653円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,704,323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）	146,005,445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）	15,104,137円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	68,790,685円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,046,582円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	42,929,946円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	502,941,599円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	319,283,606円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,135,197,626円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	30,004,333円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,227,818円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	331,117,128円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	181,936,971円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	247,914,966円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	19,486,404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）	420,001,180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	1,922,201,014円

区分	2023年12月20日現在
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）	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	603,299,653円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,260,628円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,206,404,459円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	198,280,076円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,678,442円
SMT インデックスバランス・オープン	48,642,299円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,888,144,852円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,394,062円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	216,831,759円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,345,255円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,164,425円
グローバル経済コア	217,823,294円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,638,598円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,368,678,865円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,399,723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）	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	53,055,870円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	50,848,643円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	22,155,423円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,228,915円
10資産分散投資ファンド	92,514,572円
グローバル10資産バランスファンド	4,544,590円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340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）	41,972,279,453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）	493,657,797円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	300,752,776円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	20,892,929円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	346,365,787円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	47,159,783,749円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,679,855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）	213,479,625円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		45,974,175,324
合計		45,974,175,324

(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12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,629,823,000	-	4,644,090,000	14,267,000
合計		4,629,823,000	-	4,644,090,000	14,267,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	9,300	3,730.00	34,689,000	
ニッスイ	244,800	753.00	184,334,400	
マルハニチロ	36,300	2,720.00	98,736,000	
雪国まいたけ	20,800	927.00	19,281,600	
カネコ種苗	7,500	1,396.00	10,470,000	
サカタのタネ	27,900	3,900.00	108,810,000	
ホクト	19,600	1,727.00	33,849,200	
ホクリヨウ	2,300	1,038.00	2,387,400	
住石ホールディングス	25,100	1,126.00	28,262,600	
日鉄鉱業	9,800	5,150.00	50,470,000	
三井松島ホールディングス	14,500	2,703.00	39,193,500	
I N P E X	905,300	1,945.50	1,761,261,150	
石油資源開発	28,400	5,220.00	148,248,000	
K & O エナジーグループ	11,100	2,093.00	23,232,300	
ショーボンドホールディングス	33,300	6,070.00	202,131,000	
ミライト・ワン	80,900	1,835.00	148,451,500	
タマホーム	15,400	3,790.00	58,366,000	
サンヨーホームズ	2,000	729.00	1,458,000	
日本アクア	6,700	862.00	5,775,400	
ファーストコーポレーション	4,100	728.00	2,984,800	
ベステラ	3,500	1,039.00	3,636,500	
キャンディル	2,900	557.00	1,615,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,102.00	3,636,600	
第一カッター興業	6,300	1,317.00	8,297,100	
安藤・間	141,800	1,075.00	152,435,000	
東急建設	76,700	783.00	60,056,100	
コムシスホールディングス	78,100	3,108.00	242,734,800	
ピーアールホールディングス	38,500	351.00	13,513,500	
高松コンストラクショングループ	18,200	2,652.00	48,266,400	
東建コーポレーション	7,000	9,050.00	63,350,000	
ソネック	1,700	949.00	1,613,300	
ヤマウラ	12,400	1,373.00	17,025,200	
オリエンタル白石	90,600	332.00	30,079,200	



大成建設	160,200	4,829.00	773,605,800
大林組	612,300	1,187.50	727,106,250
清水建設	485,500	912.90	443,212,950
飛島建設	18,700	1,265.00	23,655,500
長谷工コーポレーション	157,100	1,785.50	280,502,050
松井建設	16,000	807.00	12,912,000
銭高組	1,400	3,980.00	5,572,000
鹿島建設	379,600	2,297.00	871,941,200
不動テトラ	11,800	2,174.00	25,653,200
大末建設	4,100	1,296.00	5,313,600
鉄建建設	12,300	1,904.00	23,419,200
西松建設	32,700	3,819.00	124,881,300
三井住友建設	127,400	393.00	50,068,200
大豊建設	5,900	3,680.00	21,712,000
佐田建設	7,200	616.00	4,435,200
ナカノフドー建設	8,000	456.00	3,648,000
奥村組	27,800	4,415.00	122,737,000
東鉄工業	21,200	3,030.00	64,236,000
イチケン	2,500	2,228.00	5,570,000
富士ピー・エス	5,100	456.00	2,325,600
浅沼組	12,700	3,625.00	46,037,500
戸田建設	231,700	914.80	211,959,160
熊谷組	28,700	3,495.00	100,306,500
北野建設	2,100	3,090.00	6,489,000
植木組	3,200	1,460.00	4,672,000
矢作建設工業	23,300	1,315.00	30,639,500
ピーエス三菱	21,700	865.00	18,770,500
日本ハウスホールディングス	36,600	301.00	11,016,600
新日本建設	24,000	1,072.00	25,728,000
東亜道路工業	6,800	6,750.00	45,900,000
日本道路	20,100	1,956.00	39,315,600
東亜建設工業	13,200	3,395.00	44,814,000
日本国土開発	48,700	563.00	27,418,100
若築建設	5,900	2,962.00	17,475,800
東洋建設	42,800	1,207.00	51,659,600
五洋建設	242,700	778.80	189,014,760
世紀東急工業	22,000	1,590.00	34,980,000
福田組	6,500	5,010.00	32,565,000
住友林業	148,000	4,241.00	627,668,000
日本基礎技術	6,800	429.00	2,917,200
巴コーポレーション	12,700	560.00	7,112,000
大和ハウス工業	473,500	4,150.00	1,965,025,000

ライト工業	35,200	1,900.00	66,880,000
積水ハウス	519,300	2,997.00	1,556,342,100
日特建設	16,300	1,019.00	16,609,700
北陸電気工事	11,700	971.00	11,360,700
ユアテック	37,700	1,032.00	38,906,400
日本リーテック	14,900	1,139.00	16,971,100
四電工	7,200	3,025.00	21,780,000
中電工	26,600	2,556.00	67,989,600
関電工	107,200	1,348.00	144,505,600
きんでん	120,500	2,326.00	280,283,000
東京エネシス	17,000	1,032.00	17,544,000
トーエネック	5,700	4,350.00	24,795,000
住友電設	16,300	2,620.00	42,706,000
日本電設工業	32,100	1,926.00	61,824,600
エクシオグループ	86,000	3,061.00	263,246,000
新日本空調	11,100	2,237.00	24,830,700
九電工	37,000	4,948.00	183,076,000
三機工業	37,500	1,705.00	63,937,500
日揮ホールディングス	169,400	1,605.00	271,887,000
中外炉工業	5,600	2,183.00	12,224,800
ヤマト	9,400	912.00	8,572,800
太平電業	10,600	4,120.00	43,672,000
高砂熱学工業	45,900	3,210.00	147,339,000
三晃金属工業	1,400	4,560.00	6,384,000
朝日工業社	8,000	2,947.00	23,576,000
明星工業	33,100	1,091.00	36,112,100
大気社	19,700	4,140.00	81,558,000
ダイダン	22,500	1,404.00	31,590,000
日比谷総合設備	12,400	2,419.00	29,995,600
フィル・カンパニー	2,600	568.00	1,476,800
テスホールディングス	36,900	409.00	15,092,100
インフロニア・ホールディングス	197,400	1,397.50	275,866,500
東洋エンジニアリング	25,200	740.00	18,648,000
レイズネクスト	24,800	1,446.00	35,860,800
ニッポン	51,500	2,243.00	115,514,500
日清製粉グループ本社	159,000	1,882.50	299,317,500
日東富士製粉	3,100	4,745.00	14,709,500
昭和産業	16,600	3,080.00	51,128,000
鳥越製粉	10,100	670.00	6,767,000
中部飼料	23,800	1,077.00	25,632,600
フィード・ワン	25,100	759.00	19,050,900
東洋精糖	2,100	1,976.00	4,149,600

日本甜菜製糖	10,000	1,925.00	19,250,000
D M三井製糖ホールディングス	17,000	2,863.00	48,671,000
塩水港精糖	13,600	226.00	3,073,600
ウェルネオシュガー	8,800	2,068.00	18,198,400
森永製菓	36,800	5,056.00	186,060,800
中村屋	4,300	3,050.00	13,115,000
江崎グリコ	49,200	4,086.00	201,031,200
名糖産業	6,800	1,655.00	11,254,000
井村屋グループ	10,300	2,331.00	24,009,300
不二家	11,800	2,490.00	29,382,000
山崎製パン	115,000	3,156.00	362,940,000
第一屋製パン	2,200	643.00	1,414,600
モロゾフ	5,600	3,745.00	20,972,000
亀田製菓	9,800	3,915.00	38,367,000
寿スピリッツ	81,300	2,159.50	175,567,350
カルビー	78,700	2,774.00	218,313,800
森永乳業	62,500	2,628.50	164,281,250
六甲バター	12,600	1,313.00	16,543,800
ヤクルト本社	245,700	3,141.00	771,743,700
明治ホールディングス	210,700	3,308.00	696,995,600
雪印メグミルク	41,600	2,077.00	86,403,200
プリマハム	23,100	2,261.00	52,229,100
日本ハム	73,900	4,613.00	340,900,700
林兼産業	3,500	570.00	1,995,000
丸大食品	17,300	1,587.00	27,455,100
S Foods	19,000	3,290.00	62,510,000
柿安本店	6,700	2,402.00	16,093,400
伊藤ハム米久ホールディングス	26,300	3,775.00	99,282,500
サッポロホールディングス	56,600	6,015.00	340,449,000
アサヒグループホールディングス	397,200	5,378.00	2,136,141,600
キリンホールディングス	716,000	2,066.00	1,479,256,000
宝ホールディングス	117,300	1,231.50	144,454,950
オエノンホールディングス	51,400	360.00	18,504,000
養命酒製造	5,700	1,841.00	10,493,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,700	2,053.00	276,539,100
ライフドリンク カンパニー	2,500	4,640.00	11,600,000
サントリー食品インターナショナル	121,000	4,707.00	569,547,000
ダイドーグループホールディングス	9,700	5,810.00	56,357,000
伊藤園	58,200	4,138.00	240,831,600
キーコーヒー	19,300	2,041.00	39,391,300
ユニカフェ	3,800	965.00	3,667,000
ジャパンフーズ	1,800	1,225.00	2,205,000

日清オイリオグループ	24,200	4,135.00	100,067,000
不二製油グループ本社	40,000	2,314.50	92,580,000
かどや製油	1,400	3,515.00	4,921,000
J・オイルミルズ	19,700	1,900.00	37,430,000
キッコーマン	113,900	8,806.00	1,003,003,400
味の素	408,500	5,466.00	2,232,861,000
ブルドックソース	9,100	2,121.00	19,301,100
キューピー	92,400	2,446.00	226,010,400
ハウス食品グループ本社	59,200	3,045.00	180,264,000
カゴメ	73,900	3,082.00	227,759,800
焼津水産化学工業	4,400	1,222.00	5,376,800
アリアケジャパン	17,100	4,555.00	77,890,500
ピエトロ	1,600	1,850.00	2,960,000
エバラ食品工業	4,600	2,781.00	12,792,600
やまみ	1,100	3,380.00	3,718,000
ニチレイ	78,800	3,466.00	273,120,800
東洋水産	86,900	7,269.00	631,676,100
イトアンドホールディングス	8,000	2,060.00	16,480,000
大冷	1,400	1,919.00	2,686,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	1,038.00	8,096,400
日清食品ホールディングス	60,400	14,340.00	866,136,000
永谷園ホールディングス	8,400	2,109.00	17,715,600
一正蒲鉾	4,900	734.00	3,596,600
フジッコ	17,700	1,886.00	33,382,200
ロック・フィールド	19,200	1,530.00	29,376,000
日本たばこ産業	1,044,500	3,715.00	3,880,317,500
ケンコーマヨネーズ	11,800	1,659.00	19,576,200
わらべや日洋ホールディングス	11,500	3,410.00	39,215,000
なとり	10,800	2,040.00	22,032,000
イフジ産業	1,900	1,393.00	2,646,700
ファーマフーズ	24,700	1,028.00	25,391,600
ユーグレナ	107,000	720.00	77,040,000
紀文食品	14,900	1,180.00	17,582,000
ピククルスホールディングス	10,100	1,198.00	12,099,800
ミヨシ油脂	4,400	1,357.00	5,970,800
理研ビタミン	14,900	2,196.00	32,720,400
片倉工業	16,400	1,644.00	26,961,600
ゲンゼ	12,500	5,010.00	62,625,000
東洋紡	76,100	1,037.00	78,915,700
ユニチカ	59,600	175.00	10,430,000
富士紡ホールディングス	7,800	3,700.00	28,860,000
倉敷紡績	13,300	2,706.00	35,989,800

シキボウ	8,100	1,058.00	8,569,800
日本毛織	46,500	1,269.00	59,008,500
トーア紡コーポレーション	4,500	436.00	1,962,000
帝国繊維	20,000	2,015.00	40,300,000
帝人	168,400	1,306.00	219,930,400
東レ	1,172,300	737.60	864,688,480
住江織物	2,500	2,089.00	5,222,500
日本フェルト	7,600	422.00	3,207,200
イチカワ	1,800	1,590.00	2,862,000
日東製網	1,200	1,506.00	1,807,200
アツギ	7,100	501.00	3,557,100
ダイニック	3,100	724.00	2,244,400
セーレン	34,000	2,480.00	84,320,000
ソトー	3,800	694.00	2,637,200
東海染工	1,300	895.00	1,163,500
小松マテーレ	25,500	737.00	18,793,500
ワコールホールディングス	35,900	3,341.00	119,941,900
ホギメディカル	23,300	3,530.00	82,249,000
T S Iホールディングス	58,600	752.00	44,067,200
マツオカコーポレーション	3,200	1,575.00	5,040,000
ワールド	24,800	1,698.00	42,110,400
三陽商会	5,800	2,753.00	15,967,400
ナイガイ	4,400	269.00	1,183,600
オンワードホールディングス	103,300	500.00	51,650,000
ルックホールディングス	4,300	2,522.00	10,844,600
ゴールドウイン	31,000	10,735.00	332,785,000
デサント	30,200	3,785.00	114,307,000
キング	5,300	685.00	3,630,500
ヤマトインターナショナル	9,600	297.00	2,851,200
特種東海製紙	9,600	3,780.00	36,288,000
王子ホールディングス	728,500	532.20	387,707,700
日本製紙	98,700	1,277.00	126,039,900
三菱製紙	13,900	508.00	7,061,200
北越コーポレーション	85,900	1,595.00	137,010,500
中越パルプ工業	4,700	1,706.00	8,018,200
大王製紙	77,200	1,122.50	86,657,000
阿波製紙	2,800	374.00	1,047,200
レンゴー	159,300	928.00	147,830,400
トーモク	10,100	2,112.00	21,331,200
ザ・パック	13,000	3,200.00	41,600,000
北の達人コーポレーション	73,700	205.00	15,108,500
クラレ	254,800	1,450.00	369,460,000

旭化成	1,183,000	1,023.00	1,210,209,000
共和レザー	6,700	724.00	4,850,800
巴川製紙所	3,600	901.00	3,243,600
レゾナック・ホールディングス	169,000	2,890.50	488,494,500
住友化学	1,297,700	334.10	433,561,570
住友精化	8,200	4,785.00	39,237,000
日産化学	82,100	5,512.00	452,535,200
ラサ工業	6,700	2,108.00	14,123,600
クレハ	12,700	8,560.00	108,712,000
多木化学	6,800	3,370.00	22,916,000
テイカ	15,100	1,332.00	20,113,200
石原産業	29,000	1,334.00	38,686,000
片倉コープアグリ	2,400	1,032.00	2,476,800
日本曹達	20,600	5,420.00	111,652,000
東ソー	233,400	1,793.50	418,602,900
トクヤマ	56,500	2,327.00	131,475,500
セントラル硝子	18,700	2,633.00	49,237,100
東亜合成	87,700	1,312.50	115,106,250
大阪ソーダ	12,200	9,380.00	114,436,000
関東電化工業	33,800	855.00	28,899,000
デンカ	63,600	2,428.00	154,420,800
信越化学工業	1,585,700	5,640.00	8,943,348,000
日本カーバイド工業	6,500	1,409.00	9,158,500
堺化学工業	13,300	1,848.00	24,578,400
第一稀元素化学工業	19,100	949.00	18,125,900
エア・ウォーター	165,000	1,855.00	306,075,000
日本酸素ホールディングス	169,600	3,795.00	643,632,000
日本化学工業	6,400	1,869.00	11,961,600
東邦アセチレン	2,400	1,942.00	4,660,800
日本パーカライズニング	77,900	1,114.00	86,780,600
高压ガス工業	25,400	861.00	21,869,400
チタン工業	1,400	1,197.00	1,675,800
四国化成ホールディングス	22,400	1,623.00	36,355,200
戸田工業	4,000	1,529.00	6,116,000
ステラ ケミファ	9,500	3,255.00	30,922,500
保土谷化学工業	5,500	3,460.00	19,030,000
日本触媒	26,600	5,291.00	140,740,600
大日精化工業	12,200	2,456.00	29,963,200
カネカ	44,400	3,510.00	155,844,000
三菱瓦斯化学	130,600	2,225.00	290,585,000
三井化学	144,200	4,310.00	621,502,000
J S R	190,500	4,019.00	765,619,500

東京応化工業	27,800	9,205.00	255,899,000
大阪有機化学工業	14,600	2,639.00	38,529,400
三菱ケミカルグループ	1,278,400	938.50	1,199,778,400
KHネオケム	26,700	2,257.00	60,261,900
ダイセル	224,800	1,338.00	300,782,400
住友ベークライト	24,500	7,255.00	177,747,500
積水化学工業	354,500	2,024.50	717,685,250
日本ゼオン	119,900	1,323.50	158,687,650
アイカ工業	44,100	3,301.00	145,574,100
UBE	83,200	2,241.50	186,492,800
積水樹脂	26,100	2,452.00	63,997,200
タキロンシーアイ	44,600	632.00	28,187,200
旭有機材	11,600	3,835.00	44,486,000
ニチバン	9,500	1,718.00	16,321,000
リケンテクノス	37,700	823.00	31,027,100
大倉工業	8,100	2,682.00	21,724,200
積水化成成品工業	24,500	478.00	11,711,000
群栄化学工業	4,100	2,991.00	12,263,100
タイガースポリマー	5,300	822.00	4,356,600
ミライアル	3,500	1,422.00	4,977,000
ダイキアクシス	4,800	780.00	3,744,000
ダイキョーニシカワ	38,600	711.00	27,444,600
竹本容器	4,400	792.00	3,484,800
森六ホールディングス	10,000	2,812.00	28,120,000
恵和	12,600	1,212.00	15,271,200
日本化薬	133,600	1,353.50	180,827,600
カーリットホールディングス	18,800	916.00	17,220,800
日本精化	11,600	2,898.00	33,616,800
扶桑化学工業	18,500	4,120.00	76,220,000
トリケミカル研究所	21,200	3,595.00	76,214,000
ADEKA	61,000	2,797.50	170,647,500
日油	54,100	6,899.00	373,235,900
新日本理化	15,900	180.00	2,862,000
ハリマ化成グループ	9,500	785.00	7,457,500
花王	395,400	5,852.00	2,313,880,800
第一工業製薬	7,000	1,781.00	12,467,000
石原ケミカル	8,000	1,898.00	15,184,000
日華化学	4,600	937.00	4,310,200
ニイタカ	2,100	1,917.00	4,025,700
三洋化成工業	10,800	4,245.00	45,846,000
有機合成薬品工業	8,500	277.00	2,354,500
大日本塗料	21,100	998.00	21,057,800

日本ペイントホールディングス	928,500	1,111.00	1,031,563,500
関西ペイント	171,400	2,360.00	404,504,000
神東塗料	9,600	126.00	1,209,600
中国塗料	35,900	1,639.00	58,840,100
日本特殊塗料	7,300	1,163.00	8,489,900
藤倉化成	23,300	421.00	9,809,300
太陽ホールディングス	30,400	3,125.00	95,000,000
D I C	68,300	2,554.00	174,438,200
サカタインクス	38,900	1,310.00	50,959,000
東洋インキＳＣホールディングス	38,100	2,663.00	101,460,300
T & K T O K A	16,700	1,443.00	24,098,100
富士フィルムホールディングス	324,800	8,705.00	2,827,384,000
資生堂	365,600	4,073.00	1,489,088,800
ライオン	229,200	1,317.50	301,971,000
高砂香料工業	13,200	3,350.00	44,220,000
マンダム	37,800	1,267.00	47,892,600
ミルボン	23,800	3,627.00	86,322,600
ファンケル	76,600	2,344.00	179,550,400
コーセー	35,600	10,375.00	369,350,000
コタ	16,100	1,527.00	24,584,700
シーボン	1,500	1,481.00	2,221,500
ポーラ・オルビスホールディングス	89,800	1,593.50	143,096,300
ノエビアホールディングス	15,600	5,070.00	79,092,000
アジュバンホールディングス	2,800	921.00	2,578,800
新日本製薬	10,000	1,662.00	16,620,000
I - n e	3,500	2,427.00	8,494,500
アクシージア	8,900	959.00	8,535,100
エステー	13,500	1,506.00	20,331,000
アグロ カネショウ	7,000	1,562.00	10,934,000
コニシ	29,000	2,582.00	74,878,000
長谷川香料	33,500	3,135.00	105,022,500
小林製薬	51,000	6,530.00	333,030,000
荒川化学工業	14,800	1,006.00	14,888,800
メック	14,400	4,325.00	62,280,000
日本高純度化学	4,300	2,388.00	10,268,400
タカラバイオ	47,200	1,207.00	56,970,400
J C U	19,600	3,640.00	71,344,000
新田ゼラチン	7,100	740.00	5,254,000
O A T アグリオ	5,100	1,780.00	9,078,000
デクセリアルズ	43,900	4,283.00	188,023,700
アース製薬	15,900	4,660.00	74,094,000
北興化学工業	17,600	975.00	17,160,000



大成ラミック	5,500	2,798.00	15,389,000
クミアイ化学工業	69,600	788.00	54,844,800
日本農薬	32,100	637.00	20,447,700
アキレス	11,000	1,554.00	17,094,000
有沢製作所	30,700	1,031.00	31,651,700
日東電工	112,500	10,610.00	1,193,625,000
レック	22,400	1,025.00	22,960,000
三光合成	22,000	503.00	11,066,000
きもと	17,000	186.00	3,162,000
藤森工業	13,800	3,715.00	51,267,000
前澤化成工業	11,300	1,518.00	17,153,400
未来工業	6,300	3,055.00	19,246,500
ウェーブロックホールディングス	3,600	630.00	2,268,000
J S P	12,300	1,762.00	21,672,600
エフピコ	33,100	2,886.00	95,526,600
天馬	12,700	2,172.00	27,584,400
信越ポリマー	37,800	1,572.00	59,421,600
東リ	25,900	325.00	8,417,500
ニフコ	52,400	3,524.00	184,657,600
バルカー	14,600	3,955.00	57,743,000
ユニ・チャーム	364,800	4,938.00	1,801,382,400
ショーエイコーポレーション	3,400	572.00	1,944,800
協和キリン	211,500	2,384.00	504,216,000
武田薬品工業	1,549,600	3,996.00	6,192,201,600
アステラス製薬	1,535,800	1,672.00	2,567,857,600
住友ファーマ	129,900	451.00	58,584,900
塩野義製薬	220,700	6,955.00	1,534,968,500
わかもと製薬	10,800	193.00	2,084,400
日本新薬	45,900	4,951.00	227,250,900
中外製薬	548,100	5,450.00	2,987,145,000
科研製薬	30,000	3,216.00	96,480,000
エーザイ	213,000	7,070.00	1,505,910,000
ロート製薬	169,600	2,828.50	479,713,600
小野薬品工業	371,600	2,503.50	930,300,600
久光製薬	38,900	4,281.00	166,530,900
持田製薬	20,100	3,255.00	65,425,500
参天製薬	319,100	1,380.00	440,358,000
扶桑薬品工業	6,200	1,864.00	11,556,800
日本ケミファ	1,200	1,606.00	1,927,200
ツムラ	55,100	2,631.50	144,995,650
キッセイ薬品工業	29,000	3,205.00	92,945,000
生化学工業	29,700	739.00	21,948,300

栄研化学	34,100	1,713.00	58,413,300
鳥居薬品	9,400	3,540.00	33,276,000
JCRファーマ	59,300	1,141.00	67,661,300
東和薬品	26,900	2,330.00	62,677,000
富士製薬工業	12,900	1,636.00	21,104,400
ゼリア新薬工業	24,300	1,975.00	47,992,500
そーせいグループ	56,400	1,423.00	80,257,200
第一三共	1,525,300	3,911.00	5,965,448,300
杏林製薬	38,000	1,760.00	66,880,000
大幸薬品	36,100	283.00	10,216,300
ダイト	13,500	1,853.00	25,015,500
大塚ホールディングス	364,200	5,273.00	1,920,426,600
大正製薬ホールディングス	38,700	8,626.00	333,826,200
ペプチドリーム	84,900	1,200.50	101,922,450
セルソース	4,800	1,470.00	7,056,000
あすか製薬ホールディングス	18,000	1,744.00	31,392,000
サワイグループホールディングス	40,000	4,969.00	198,760,000
日本コークス工業	177,600	123.00	21,844,800
ニチレキ	22,800	2,402.00	54,765,600
ユシロ化学工業	9,100	1,639.00	14,914,900
ビーピー・カストロール	4,500	889.00	4,000,500
富士石油	51,000	351.00	17,901,000
MORESCO	3,800	1,249.00	4,746,200
出光興産	194,500	3,861.00	750,964,500
ENEOSホールディングス	2,771,900	562.30	1,558,639,370
コスモエネルギーホールディングス	51,900	5,538.00	287,422,200
横浜ゴム	88,600	3,219.00	285,203,400
TOYO TIRE	100,600	2,383.50	239,780,100
ブリヂストン	512,500	5,940.00	3,044,250,000
住友ゴム工業	171,700	1,592.50	273,432,250
藤倉コンポジット	11,800	1,347.00	15,894,600
オカモト	8,300	5,030.00	41,749,000
フコク	9,200	1,350.00	12,420,000
ニッタ	17,800	3,555.00	63,279,000
住友理工	27,200	1,031.00	28,043,200
三ツ星ベルト	21,300	4,355.00	92,761,500
バンドー化学	26,000	1,562.00	40,612,000
日東紡績	22,200	4,350.00	96,570,000
AGC	156,200	5,317.00	830,515,400
日本板硝子	83,500	549.00	45,841,500
石塚硝子	1,900	3,545.00	6,735,500
日本山村硝子	4,500	1,341.00	6,034,500

日本電気硝子	71,500	3,061.00	218,861,500
オハラ	8,500	1,084.00	9,214,000
住友大阪セメント	29,200	3,653.00	106,667,600
太平洋セメント	103,600	2,699.00	279,616,400
日本ヒューム	15,500	871.00	13,500,500
日本コンクリート工業	34,600	316.00	10,933,600
三谷セキサン	7,400	4,545.00	33,633,000
アジアパイルホールディングス	27,400	676.00	18,522,400
東海カーボン	161,700	1,033.00	167,036,100
日本カーボン	9,300	4,570.00	42,501,000
東洋炭素	12,400	4,890.00	60,636,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	6,630.00	64,311,000
TOTO	115,600	3,689.00	426,448,400
日本碍子	203,800	1,667.00	339,734,600
日本特殊陶業	146,700	3,293.00	483,083,100
MARUWA	6,500	29,100.00	189,150,000
品川リフラクトリーズ	21,700	1,690.00	36,673,000
黒崎播磨	3,600	11,310.00	40,716,000
ヨータイ	10,900	1,534.00	16,720,600
東京窯業	11,200	425.00	4,760,000
ニッカトー	5,500	553.00	3,041,500
フジインコーポレーテッド	47,100	3,060.00	144,126,000
クニミネ工業	3,600	980.00	3,528,000
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,256.00	2,888,800
ニチアス	44,300	3,260.00	144,418,000
ニチハ	22,000	2,903.00	63,866,000
日本製鉄	806,500	3,199.00	2,579,993,500
神戸製鋼所	362,300	1,722.00	623,880,600
中山製鋼所	41,200	795.00	32,754,000
合同製鐵	10,100	4,370.00	44,137,000
JFEホールディングス	501,000	2,166.00	1,085,166,000
東京製鐵	50,600	1,739.00	87,993,400
共英製鋼	20,500	1,923.00	39,421,500
大和工業	34,000	7,369.00	250,546,000
東京鐵鋼	8,500	3,890.00	33,065,000
大阪製鐵	8,300	2,089.00	17,338,700
淀川製鋼所	20,500	3,760.00	77,080,000
中部鋼鈹	11,900	2,064.00	24,561,600
丸一鋼管	54,800	3,709.00	203,253,200
モリ工業	3,200	4,215.00	13,488,000
大同特殊鋼	22,700	7,200.00	163,440,000
日本高周波鋼業	4,100	545.00	2,234,500

日本冶金工業	13,200	4,105.00	54,186,000
山陽特殊製鋼	17,800	2,603.00	46,333,400
愛知製鋼	10,400	3,055.00	31,772,000
日本金属	2,600	857.00	2,228,200
大太平洋金属	15,400	1,203.00	18,526,200
新日本電工	89,700	276.00	24,757,200
栗本鐵工所	8,500	3,075.00	26,137,500
虹技	1,500	1,135.00	1,702,500
三菱製鋼	13,400	1,437.00	19,255,800
日亜鋼業	12,200	320.00	3,904,000
日本精線	2,900	4,790.00	13,891,000
エンビプロ・ホールディングス	9,700	593.00	5,752,100
シンニッタン	13,000	253.00	3,289,000
新家工業	2,600	2,805.00	7,293,000
大紀アルミニウム工業所	22,800	1,157.00	26,379,600
日本軽金属ホールディングス	52,600	1,691.00	88,946,600
三井金属鉱業	52,400	4,340.00	227,416,000
東邦亜鉛	11,600	1,097.00	12,725,200
三菱マテリアル	128,800	2,438.50	314,078,800
住友金属鉱山	208,900	4,279.00	893,883,100
D O W Aホールディングス	44,500	5,078.00	225,971,000
古河機械金属	23,800	1,865.00	44,387,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,300	2,831.00	88,610,300
東邦チタニウム	37,300	1,910.00	71,243,000
U A C J	25,300	3,780.00	95,634,000
C Kサンエツ	4,400	3,775.00	16,610,000
古河電気工業	60,000	2,217.50	133,050,000
住友電気工業	673,800	1,798.00	1,211,492,400
フジクラ	212,500	1,087.50	231,093,750
S W C C	20,100	2,698.00	54,229,800
タツタ電線	31,900	679.00	21,660,100
カナレ電気	2,100	1,533.00	3,219,300
平河ヒューテック	11,600	1,256.00	14,569,600
リョービ	19,200	2,691.00	51,667,200
アーレスティ	13,200	715.00	9,438,000
A R Eホールディングス	67,700	1,898.00	128,494,600
稲葉製作所	9,300	1,451.00	13,494,300
宮地エンジニアリンググループ	9,000	3,165.00	28,485,000
トーカロ	51,900	1,459.00	75,722,100
アルファC o	4,400	1,389.00	6,111,600
S U M C O	320,100	2,186.00	699,738,600
川田テクノロジーズ	4,200	6,210.00	26,082,000

RS Technologies	12,000	3,005.00	36,060,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,840.00	2,944,000
信和	6,600	735.00	4,851,000
東洋製罐グループホールディングス	107,400	2,235.50	240,092,700
ホッカンホールディングス	9,600	1,599.00	15,350,400
コロナ	10,100	948.00	9,574,800
横河ブリッジホールディングス	28,200	2,516.00	70,951,200
駒井ハルテック	1,900	2,045.00	3,885,500
高田機工	1,000	3,290.00	3,290,000
三和ホールディングス	181,000	2,167.00	392,227,000
文化シャッター	47,100	1,356.00	63,867,600
三協立山	20,600	770.00	15,862,000
アルインコ	13,700	979.00	13,412,300
東洋シャッター	2,700	657.00	1,773,900
LIXIL	281,300	1,726.00	485,523,800
日本フィルコン	7,700	466.00	3,588,200
ノーリツ	29,800	1,509.00	44,968,200
長府製作所	17,900	2,016.00	36,086,400
リンナイ	88,200	3,194.00	281,710,800
ダイニチ工業	5,900	702.00	4,141,800
日東精工	26,100	532.00	13,885,200
三洋工業	1,400	2,526.00	3,536,400
岡部	32,200	716.00	23,055,200
ジーテクト	22,900	1,664.00	38,105,600
東プレ	31,700	1,906.00	60,420,200
高周波熱錬	27,800	962.00	26,743,600
東京製綱	11,700	1,301.00	15,221,700
サンコール	14,000	441.00	6,174,000
モリテック スチール	8,800	285.00	2,508,000
パイオラックス	22,400	2,190.00	49,056,000
エイチワン	18,500	760.00	14,060,000
日本発條	159,300	1,096.50	174,672,450
中央発條	13,300	693.00	9,216,900
アドバネクス	1,500	899.00	1,348,500
立川ブラインド工業	8,100	1,459.00	11,817,900
三益半導体工業	13,900	2,772.00	38,530,800
日本ドライケミカル	2,800	2,765.00	7,742,000
日本製鋼所	48,600	2,461.50	119,628,900
三浦工業	73,600	2,808.00	206,668,800
タクマ	59,700	1,719.00	102,624,300
ツガミ	39,300	1,218.00	47,867,400
オークマ	15,400	6,057.00	93,277,800

芝浦機械	17,600	3,560.00	62,656,000
アマダ	281,400	1,482.50	417,175,500
アイダエンジニアリング	40,900	823.00	33,660,700
F U J I	83,000	2,459.00	204,097,000
牧野フライス製作所	19,500	5,970.00	116,415,000
オーエスジー	77,800	1,970.00	153,266,000
ダイジェット工業	1,300	840.00	1,092,000
旭ダイヤモンド工業	42,300	828.00	35,024,400
D M G 森精機	106,900	2,671.50	285,583,350
ソディック	43,000	722.00	31,046,000
ディスコ	84,900	33,620.00	2,854,338,000
日東工器	8,600	1,834.00	15,772,400
日進工具	16,400	997.00	16,350,800
パンチ工業	10,700	401.00	4,290,700
富士ダイス	9,200	638.00	5,869,600
豊和工業	6,500	743.00	4,829,500
リケンNPR	19,200	1,949.00	37,420,800
東洋機械金属	8,200	660.00	5,412,000
エンシュウ	2,600	675.00	1,755,000
島精機製作所	28,100	1,489.00	41,840,900
オプトラン	29,000	1,714.00	49,706,000
NCホールディングス	2,400	1,636.00	3,926,400
イワキポンプ	11,800	2,136.00	25,204,800
フリー	16,700	1,424.00	23,780,800
ヤマシンフィルタ	42,500	310.00	13,175,000
日阪製作所	19,300	911.00	17,582,300
やまびこ	28,800	1,488.00	42,854,400
野村マイクロ・サイエンス	6,000	13,480.00	80,880,000
平田機工	8,400	6,120.00	51,408,000
P E G A S U S	19,600	439.00	8,604,400
マルマエ	7,700	1,867.00	14,375,900
タツモ	10,700	2,950.00	31,565,000
ナブテスコ	110,700	2,831.00	313,391,700
三井海洋開発	22,300	1,867.00	41,634,100
レオン自動機	20,400	1,466.00	29,906,400
S M C	52,800	76,960.00	4,063,488,000
ホソカワミクロン	11,300	4,010.00	45,313,000
ユニオンツール	7,800	3,435.00	26,793,000
瑞光	12,700	1,410.00	17,907,000
オイレス工業	24,400	1,915.00	46,726,000
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,680.00	32,760,000
サトーホールディングス	25,100	2,032.00	51,003,200

技研製作所	16,600	1,784.00	29,614,400
日本エアージェット	8,300	1,338.00	11,105,400
カワタ	3,400	1,051.00	3,573,400
日精樹脂工業	13,200	1,110.00	14,652,000
オカダアイヨン	3,600	2,281.00	8,211,600
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,226.00	12,910,800
小松製作所	826,500	3,756.00	3,104,334,000
住友重機械工業	104,300	3,606.00	376,105,800
日立建機	70,200	3,756.00	263,671,200
日工	26,300	663.00	17,436,900
巴工業	6,900	4,105.00	28,324,500
井関農機	16,600	1,100.00	18,260,000
TOWA	19,600	7,160.00	140,336,000
丸山製作所	2,000	2,501.00	5,002,000
北川鉄工所	7,000	1,235.00	8,645,000
ローツェ	9,200	14,910.00	137,172,000
タカキタ	3,400	498.00	1,693,200
クボタ	925,300	2,125.50	1,966,725,150
荏原実業	9,300	2,834.00	26,356,200
三菱化工機	6,200	3,160.00	19,592,000
月島ホールディングス	23,900	1,298.00	31,022,200
帝国電機製作所	12,400	3,045.00	37,758,000
新東工業	35,700	1,072.00	38,270,400
澁谷工業	16,600	2,451.00	40,686,600
アイチ コーポレーション	24,600	1,077.00	26,494,200
小森コーポレーション	44,400	1,110.00	49,284,000
鶴見製作所	13,500	3,695.00	49,882,500
日本ギア工業	4,100	583.00	2,390,300
酒井重工業	2,400	5,800.00	13,920,000
荏原製作所	72,400	8,609.00	623,291,600
石井鐵工所	1,400	2,701.00	3,781,400
西島製作所	15,200	2,163.00	32,877,600
北越工業	17,700	2,610.00	46,197,000
ダイキン工業	210,500	22,930.00	4,826,765,000
オルガノ	21,200	5,790.00	122,748,000
トーヨーカネツ	6,700	3,755.00	25,158,500
栗田工業	98,600	5,472.00	539,539,200
椿本チエイン	25,000	3,985.00	99,625,000
大同工業	4,800	729.00	3,499,200
木村化工機	13,600	745.00	10,132,000
アネスト岩田	27,300	1,083.00	29,565,900
ダイフク	297,600	2,892.50	860,808,000

サムコ	4,700	3,995.00	18,776,500
加藤製作所	5,600	1,262.00	7,067,200
油研工業	1,800	2,133.00	3,839,400
タダノ	101,500	1,122.50	113,933,750
フジテック	41,200	3,547.00	146,136,400
C K D	48,800	2,481.00	121,072,800
平和	52,200	2,048.00	106,905,600
理想科学工業	14,100	2,683.00	37,830,300
S A N K Y O	43,300	8,041.00	348,175,300
日本金銭機械	21,400	1,310.00	28,034,000
マースグループホールディングス	8,900	2,440.00	21,716,000
フクシマガリレイ	11,500	4,860.00	55,890,000
オーイズミ	4,500	400.00	1,800,000
ダイコク電機	8,700	3,270.00	28,449,000
竹内製作所	32,000	4,275.00	136,800,000
アマノ	50,100	3,261.00	163,376,100
J U K I	27,400	477.00	13,069,800
ジャノメ	17,900	662.00	11,849,800
マックス	24,800	3,015.00	74,772,000
グローリー	42,300	2,811.50	118,926,450
新晃工業	17,800	2,610.00	46,458,000
大和冷機工業	27,000	1,487.00	40,149,000
セガサミーホールディングス	157,500	1,954.50	307,833,750
T P R	22,400	1,575.00	35,280,000
ツバキ・ナカシマ	35,400	717.00	25,381,800
ホシザキ	104,000	5,048.00	524,992,000
大豊工業	15,300	814.00	12,454,200
日本精工	326,500	759.50	247,976,750
N T N	382,600	263.10	100,662,060
ジェイテクト	156,900	1,219.00	191,261,100
不二越	13,000	3,620.00	47,060,000
日本トムソン	48,100	582.00	27,994,200
T H K	101,700	2,837.00	288,522,900
ユーシン精機	14,000	663.00	9,282,000
前澤給装工業	13,600	1,256.00	17,081,600
イーグル工業	19,500	1,584.00	30,888,000
前澤工業	6,700	947.00	6,344,900
日本ピラー工業	16,400	4,360.00	71,504,000
キッツ	59,100	1,168.00	69,028,800
マキタ	201,100	3,939.00	792,132,900
三井E & S	86,500	607.00	52,505,500
日立造船	155,700	913.00	142,154,100



三菱重工業	308,400	7,881.00	2,430,500,400
I H I	131,300	2,617.00	343,612,100
スター精密	32,900	1,767.00	58,134,300
日清紡ホールディングス	132,500	1,113.00	147,472,500
イビデン	92,000	7,820.00	719,440,000
コニカミノルタ	394,400	415.30	163,794,320
ブラザー工業	235,700	2,356.00	555,309,200
ミネベアミツミ	306,800	2,919.00	895,549,200
日立製作所	847,400	9,933.00	8,417,224,200
三菱電機	1,962,500	2,036.50	3,996,631,250
富士電機	107,200	6,126.00	656,707,200
東洋電機製造	3,800	951.00	3,613,800
安川電機	191,500	5,860.00	1,122,190,000
シンフォニアテクノロジー	19,400	2,101.00	40,759,400
明電舎	32,700	2,372.00	77,564,400
オリジン	2,600	1,204.00	3,130,400
山洋電気	7,700	6,090.00	46,893,000
デンヨー	13,400	2,220.00	29,748,000
PHCホールディングス	33,100	1,422.00	47,068,200
KOKUSAI ELECTRIC	67,800	3,080.00	208,824,000
ソシオネクスト	25,600	11,840.00	303,104,000
東芝テック	22,600	2,879.00	65,065,400
芝浦メカトロニクス	10,100	6,650.00	67,165,000
マブチモーター	43,800	4,689.00	205,378,200
ニデック	389,300	5,627.00	2,190,591,100
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	352.00	4,787,200
トレックス・セミコンダクター	9,200	1,746.00	16,063,200
東光高岳	10,800	2,060.00	22,248,000
ダブル・スコープ	50,500	912.00	46,056,000
ダイヘン	17,700	6,140.00	108,678,000
ヤーマン	30,700	999.00	30,669,300
JVCケンウッド	139,500	745.00	103,927,500
ミマキエンジニアリング	17,100	907.00	15,509,700
I - P E X	12,400	1,495.00	18,538,000
大崎電気工業	41,400	631.00	26,123,400
オムロン	134,600	6,392.00	860,363,200
日東工業	23,800	3,480.00	82,824,000
I D E C	26,000	2,785.00	72,410,000
正興電機製作所	4,200	1,118.00	4,695,600
不二電機工業	2,600	1,157.00	3,008,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	68,900	1,979.00	136,353,100
サクサホールディングス	2,400	2,654.00	6,369,600

メルコホールディングス	5,600	3,435.00	19,236,000
テクノメディカ	4,400	2,284.00	10,049,600
日本電気	231,600	8,183.00	1,895,182,800
富士通	162,300	20,680.00	3,356,364,000
沖電気工業	79,700	898.00	71,570,600
岩崎通信機	5,100	774.00	3,947,400
電気興業	7,900	2,274.00	17,964,600
サンケン電気	16,400	7,805.00	128,002,000
ナカヨ	1,900	1,215.00	2,308,500
アイホン	9,500	2,634.00	25,023,000
ルネサスエレクトロニクス	1,150,800	2,579.50	2,968,488,600
セイコーエプソン	226,200	2,072.00	468,686,400
ワコム	134,500	678.00	91,191,000
アルバック	41,900	6,746.00	282,657,400
アクセル	6,300	2,129.00	13,412,700
E I Z O	12,900	4,810.00	62,049,000
日本信号	40,200	935.00	37,587,000
京三製作所	36,900	455.00	16,789,500
能美防災	24,000	2,007.00	48,168,000
ホーチキ	13,300	1,600.00	21,280,000
星和電機	5,900	485.00	2,861,500
エレコム	42,300	1,735.00	73,390,500
パナソニック ホールディングス	2,082,900	1,390.50	2,896,272,450
シャープ	297,200	1,011.50	300,617,800
アンリツ	124,200	1,301.00	161,584,200
富士通ゼネラル	50,000	2,191.00	109,550,000
ソニーグループ	1,234,900	13,155.00	16,245,109,500
T D K	279,200	6,805.00	1,899,956,000
帝国通信工業	8,000	1,868.00	14,944,000
タムラ製作所	70,200	531.00	37,276,200
アルプスアルパイン	157,700	1,231.50	194,207,550
池上通信機	3,700	888.00	3,285,600
日本電波工業	21,400	1,159.00	24,802,600
鈴木	9,700	1,112.00	10,786,400
メイコー	17,600	4,080.00	71,808,000
日本トリム	4,100	3,050.00	12,505,000
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,705.00	35,938,500
フォスター電機	13,100	1,003.00	13,139,300
S M K	4,700	2,512.00	11,806,400
ヨコオ	15,800	1,424.00	22,499,200
ホシデン	40,800	1,650.00	67,320,000
ヒロセ電機	26,000	16,260.00	422,760,000

日本航空電子工業	42,200	3,105.00	131,031,000
TOA	20,100	1,010.00	20,301,000
マクセル	39,100	1,568.00	61,308,800
古野電気	23,100	1,775.00	41,002,500
スミダコーポレーション	23,800	1,172.00	27,893,600
アイコム	6,800	3,395.00	23,086,000
リオン	7,400	2,292.00	16,960,800
横河電機	192,900	2,764.00	533,175,600
新電元工業	6,700	3,010.00	20,167,000
アズビル	120,100	4,707.00	565,310,700
東亜ディーケーケー	5,800	897.00	5,202,600
日本光電工業	75,000	3,757.00	281,775,000
チノー	7,300	2,066.00	15,081,800
共和電業	10,800	409.00	4,417,200
日本電子材料	11,400	1,808.00	20,611,200
堀場製作所	33,300	10,615.00	353,479,500
アドバンテスト	500,200	4,986.00	2,493,997,200
小野測器	5,500	447.00	2,458,500
エスベック	14,100	2,283.00	32,190,300
キーエンス	174,700	62,580.00	10,932,726,000
日置電機	8,300	6,180.00	51,294,000
シスメックス	150,700	7,931.00	1,195,201,700
日本マイクロニクス	31,400	3,585.00	112,569,000
メガチップス	14,200	4,655.00	66,101,000
OBARA GROUP	9,600	3,715.00	35,664,000
澤藤電機	1,600	1,195.00	1,912,000
原田工業	5,500	758.00	4,169,000
コーセル	21,200	1,263.00	26,775,600
イリソ電子工業	16,100	3,685.00	59,328,500
オブテックスグループ	32,200	1,739.00	55,995,800
千代田インテグレ	6,900	2,912.00	20,092,800
レーザーテック	80,000	35,150.00	2,812,000,000
スタンレー電気	111,900	2,641.50	295,583,850
ウシオ電機	88,800	2,076.00	184,348,800
岡谷電機産業	10,100	281.00	2,838,100
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	501.00	5,761,500
エノモト	3,100	1,535.00	4,758,500
日本セラミック	15,200	2,825.00	42,940,000
遠藤照明	5,400	1,188.00	6,415,200
古河電池	13,200	844.00	11,140,800
双信電機	5,700	291.00	1,658,700
山一電機	15,800	1,850.00	29,230,000

図研	15,300	3,935.00	60,205,500
日本電子	43,800	6,083.00	266,435,400
カシオ計算機	126,100	1,205.50	152,013,550
ファナック	851,300	4,187.00	3,564,393,100
日本シイエムケイ	37,400	727.00	27,189,800
エンプラス	5,100	12,590.00	64,209,000
大真空	26,400	813.00	21,463,200
ローム	322,900	2,804.50	905,573,050
浜松ホトニクス	140,100	5,843.00	818,604,300
三井ハイテック	15,500	7,781.00	120,605,500
新光電気工業	61,800	5,520.00	341,136,000
京セラ	271,200	8,196.00	2,222,755,200
太陽誘電	85,100	3,662.00	311,636,200
村田製作所	1,588,400	2,833.00	4,499,937,200
双葉電子工業	33,800	499.00	16,866,200
北陸電気工業	4,600	1,331.00	6,122,600
ニチコン	46,000	1,327.00	61,042,000
日本ケミコン	18,800	1,303.00	24,496,400
K O A	26,600	1,524.00	40,538,400
市光工業	32,000	538.00	17,216,000
小糸製作所	189,100	2,253.00	426,042,300
ミツバ	32,700	942.00	30,803,400
S C R E E Nホールディングス	59,700	11,720.00	699,684,000
キャノン電子	19,400	2,023.00	39,246,200
キャノン	870,700	3,681.00	3,205,046,700
リコー	437,700	1,069.50	468,120,150
象印マホービン	48,400	1,521.00	73,616,400
M U T O Hホールディングス	1,700	1,916.00	3,257,200
東京エレクトロン	369,500	25,255.00	9,331,722,500
イノテック	11,800	1,596.00	18,832,800
トヨタ紡織	73,500	2,263.50	166,367,250
芦森工業	2,200	2,069.00	4,551,800
ユニプレス	31,400	947.00	29,735,800
豊田自動織機	148,900	11,655.00	1,735,429,500
モリタホールディングス	30,700	1,500.00	46,050,000
三櫻工業	26,800	780.00	20,904,000
デンソー	1,440,400	2,136.00	3,076,694,400
東海理化電機製作所	49,300	2,220.00	109,446,000
川崎重工業	142,500	3,064.00	436,620,000
名村造船所	38,000	1,277.00	48,526,000
日本車輛製造	6,600	2,065.00	13,629,000
三菱ロジスネクスト	27,900	1,371.00	38,250,900

近畿車輛	1,600	1,757.00	2,811,200
日産自動車	2,479,900	579.30	1,436,606,070
いすゞ自動車	507,500	1,829.00	928,217,500
トヨタ自動車	9,585,900	2,644.00	25,345,119,600
日野自動車	262,600	455.30	119,561,780
三菱自動車工業	681,000	444.40	302,636,400
エフテック	8,100	628.00	5,086,800
レシップホールディングス	4,500	585.00	2,632,500
G M B	2,300	1,186.00	2,727,800
ファルテック	2,000	531.00	1,062,000
武蔵精密工業	42,700	1,426.00	60,890,200
日産車体	20,500	920.00	18,860,000
新明和工業	50,300	1,129.00	56,788,700
極東開発工業	28,800	1,917.00	55,209,600
トピー工業	14,200	2,530.00	35,926,000
ティラド	4,400	3,045.00	13,398,000
曙ブレーキ工業	106,500	108.00	11,502,000
タチエス	32,300	1,691.00	54,619,300
N O K	67,900	1,856.00	126,022,400
フタバ産業	46,900	797.00	37,379,300
カヤバ	16,800	4,815.00	80,892,000
大同メタル工業	34,300	544.00	18,659,200
プレス工業	69,900	583.00	40,751,700
ミクニ	13,400	443.00	5,936,200
太平洋工業	40,100	1,297.00	52,009,700
アイシン	134,700	5,011.00	674,981,700
マツダ	577,500	1,598.00	922,845,000
今仙電機製作所	7,400	641.00	4,743,400
本田技研工業	4,257,300	1,485.50	6,324,219,150
スズキ	320,600	5,773.00	1,850,823,800
S U B A R U	552,400	2,655.00	1,466,622,000
安永	5,100	642.00	3,274,200
ヤマハ発動機	251,500	3,906.00	982,359,000
T B K	11,700	371.00	4,340,700
エクセディ	28,600	2,452.00	70,127,200
豊田合成	51,000	2,663.00	135,813,000
愛三工業	29,000	1,156.00	33,524,000
盟和産業	1,700	981.00	1,667,700
日本プラスト	9,300	520.00	4,836,000
ヨロズ	16,500	852.00	14,058,000
エフ・シー・シー	31,000	1,730.00	53,630,000
シマノ	70,900	22,070.00	1,564,763,000

テイ・エス テック	62,200	1,687.00	104,931,400
ジャムコ	7,400	1,498.00	11,085,200
テルモ	488,100	4,737.00	2,312,129,700
クリエートメディック	3,800	906.00	3,442,800
日機装	40,700	965.00	39,275,500
日本エム・ディ・エム	13,900	749.00	10,411,100
島津製作所	231,900	3,956.00	917,396,400
JMS	16,200	499.00	8,083,800
長野計器	12,700	1,986.00	25,222,200
ブイ・テクノロジー	9,200	2,659.00	24,462,800
東京計器	13,400	1,693.00	22,686,200
愛知時計電機	7,600	2,298.00	17,464,800
インターアクション	8,300	944.00	7,835,200
オーバル	10,200	469.00	4,783,800
東京精密	35,700	8,532.00	304,592,400
マニー	69,900	2,173.00	151,892,700
ニコン	252,400	1,396.00	352,350,400
トプコン	84,900	1,500.00	127,350,000
オリンパス	1,074,600	2,121.50	2,279,763,900
理研計器	12,400	7,030.00	87,172,000
タムロン	10,700	5,120.00	54,784,000
HOYA	346,700	17,255.00	5,982,308,500
シード	5,900	793.00	4,678,700
ノーリツ鋼機	16,500	2,959.00	48,823,500
A & Dホロンホールディングス	25,500	1,790.00	45,645,000
朝日インテック	195,100	2,850.00	556,035,000
シチズン時計	160,600	841.00	135,064,600
リズム	3,600	3,065.00	11,034,000
大研医器	8,700	493.00	4,289,100
メニコン	60,000	2,378.00	142,680,000
シンシア	1,400	559.00	782,600
松風	7,900	2,690.00	21,251,000
セイコーグループ	24,300	2,627.00	63,836,100
ニプロ	145,500	1,097.50	159,686,250
KYORITSU	17,200	174.00	2,992,800
中本パックス	3,500	1,628.00	5,698,000
スノーピーク	24,900	936.00	23,306,400
パラマウントベッドホールディングス	36,300	2,732.00	99,171,600
トランザクション	11,500	2,147.00	24,690,500
粧美堂	3,100	642.00	1,990,200
ニホンフラッシュ	16,400	898.00	14,727,200
前田工織	14,700	3,030.00	44,541,000

永大産業	12,300	224.00	2,755,200
アートネイチャー	17,800	782.00	13,919,600
バンダイナムコホールディングス	478,300	2,830.50	1,353,828,150
アイフィスジャパン	3,200	636.00	2,035,200
S H O E I	39,400	1,848.00	72,811,200
フランスベッドホールディングス	22,600	1,299.00	29,357,400
パイロットコーポレーション	24,600	4,219.00	103,787,400
萩原工業	11,700	1,428.00	16,707,600
フジシールインターナショナル	35,300	1,677.00	59,198,100
タカラトミー	79,500	2,241.00	178,159,500
広済堂ホールディングス	39,300	767.00	30,143,100
エステールホールディングス	2,700	628.00	1,695,600
タカノ	4,300	899.00	3,865,700
プロネクサス	18,100	1,261.00	22,824,100
ホクシン	8,800	110.00	968,000
ウッドワン	3,800	1,024.00	3,891,200
T O P P A Nホールディングス	214,600	4,043.00	867,627,800
大日本印刷	190,800	4,270.00	814,716,000
共同印刷	4,900	3,200.00	15,680,000
N I S S H A	29,900	1,455.00	43,504,500
光村印刷	1,000	1,347.00	1,347,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,200	2,550.00	28,560,000
アシックス	148,700	4,861.00	722,830,700
ツツミ	4,100	2,310.00	9,471,000
ローランド	12,900	4,365.00	56,308,500
小松ウオール工業	7,100	2,852.00	20,249,200
ヤマハ	110,000	3,261.00	358,710,000
河合楽器製作所	5,300	3,770.00	19,981,000
クリナップ	19,400	666.00	12,920,400
ピジョン	111,200	1,637.50	182,090,000
キングジム	15,400	863.00	13,290,200
リンテック	35,000	2,709.00	94,815,000
イトーキ	35,800	1,299.00	46,504,200
任天堂	1,102,200	6,965.00	7,676,823,000
三菱鉛筆	24,800	2,083.00	51,658,400
タカラスタANDARD	36,800	1,666.00	61,308,800
コクヨ	74,700	2,277.50	170,129,250
ナカバヤシ	18,800	540.00	10,152,000
グローブライド	15,700	1,935.00	30,379,500
オカムラ	52,600	2,030.00	106,778,000
美津濃	17,400	3,910.00	68,034,000
東京電力ホールディングス	1,573,700	725.80	1,142,191,460

中部電力	643,300	1,792.00	1,152,793,600
関西電力	674,100	1,815.00	1,223,491,500
中国電力	303,300	978.30	296,718,390
北陸電力	178,500	710.00	126,735,000
東北電力	459,600	931.80	428,255,280
四国電力	162,600	989.00	160,811,400
九州電力	402,400	985.60	396,605,440
北海道電力	168,700	612.10	103,261,270
沖縄電力	44,600	1,079.00	48,123,400
電源開発	143,400	2,237.50	320,857,500
エフオン	11,300	451.00	5,096,300
イーレックス	31,100	746.00	23,200,600
レノバ	46,500	1,079.00	50,173,500
東京瓦斯	369,100	3,346.00	1,235,008,600
大阪瓦斯	353,600	2,921.00	1,032,865,600
東邦瓦斯	75,600	2,699.50	204,082,200
北海道瓦斯	10,400	2,178.00	22,651,200
広島ガス	36,900	370.00	13,653,000
西部ガスホールディングス	18,200	1,885.00	34,307,000
静岡ガス	36,300	1,000.00	36,300,000
メタウォーター	20,900	2,044.00	42,719,600
SBSホールディングス	15,600	2,449.00	38,204,400
東武鉄道	191,800	3,719.00	713,304,200
相鉄ホールディングス	62,500	2,696.50	168,531,250
東急	489,500	1,680.00	822,360,000
京浜急行電鉄	216,000	1,261.00	272,376,000
小田急電鉄	288,700	2,158.00	623,014,600
京王電鉄	83,900	4,263.00	357,665,700
京成電鉄	112,600	6,512.00	733,251,200
富士急行	21,500	4,125.00	88,687,500
東日本旅客鉄道	320,700	8,003.00	2,566,562,100
西日本旅客鉄道	207,100	5,746.00	1,189,996,600
東海旅客鉄道	672,400	3,544.00	2,382,985,600
西武ホールディングス	211,200	1,910.00	403,392,000
鴻池運輸	29,700	1,884.00	55,954,800
西日本鉄道	46,600	2,368.00	110,348,800
ハマキョウレックス	14,900	4,010.00	59,749,000
サカイ引越センター	19,300	2,687.00	51,859,100
近鉄グループホールディングス	174,300	4,337.00	755,939,100
阪急阪神ホールディングス	232,400	4,454.00	1,035,109,600
南海電気鉄道	77,700	2,808.00	218,181,600
京阪ホールディングス	96,100	3,641.00	349,900,100



神戸電鉄	4,700	2,867.00	13,474,900
名古屋鉄道	179,800	2,194.50	394,571,100
山陽電気鉄道	13,100	2,119.00	27,758,900
アルプス物流	13,900	1,625.00	22,587,500
ヤマトホールディングス	223,200	2,649.00	591,256,800
山九	44,300	5,061.00	224,202,300
丸運	5,700	264.00	1,504,800
丸全昭和運輸	10,800	3,790.00	40,932,000
センコーグループホールディングス	92,300	1,099.00	101,437,700
トナミホールディングス	3,800	4,695.00	17,841,000
ニッコンホールディングス	55,800	2,991.00	166,897,800
日本石油輸送	1,200	2,886.00	3,463,200
福山通運	19,900	3,870.00	77,013,000
セイノーホールディングス	98,000	2,090.00	204,820,000
エスライングループ本社	3,200	867.00	2,774,400
神奈川中央交通	4,900	2,978.00	14,592,200
A Z - C O M丸和ホールディングス	44,600	1,481.00	66,052,600
C & F ロジホールディングス	16,800	1,451.00	24,376,800
九州旅客鉄道	123,200	3,081.00	379,579,200
S Gホールディングス	292,700	2,018.50	590,814,950
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	59,100	7,912.00	467,599,200
日本郵船	499,900	4,333.00	2,166,066,700
商船三井	378,500	4,493.00	1,700,600,500
川崎汽船	147,500	6,115.00	901,962,500
N Sユナイテッド海運	9,600	4,920.00	47,232,000
飯野海運	64,900	1,240.00	80,476,000
共栄タンカー	3,600	821.00	2,955,600
乾汽船	23,000	1,104.00	25,392,000
日本航空	428,100	2,765.00	1,183,696,500
A N Aホールディングス	474,200	3,054.00	1,448,206,800
パスコ	2,200	1,686.00	3,709,200
ランコム	5,100	7,340.00	37,434,000
日新	13,200	2,445.00	32,274,000
三菱倉庫	42,800	4,275.00	182,970,000
三井倉庫ホールディングス	16,300	4,665.00	76,039,500
住友倉庫	47,000	2,424.00	113,928,000
澁澤倉庫	7,900	2,838.00	22,420,200
東陽倉庫	3,000	1,523.00	4,569,000
日本トランスシティ	35,100	612.00	21,481,200
ケイヒン	2,000	1,756.00	3,512,000
中央倉庫	9,300	1,094.00	10,174,200
川西倉庫	1,900	1,114.00	2,116,600

安田倉庫	11,900	1,116.00	13,280,400
ファイズホールディングス	2,100	1,120.00	2,352,000
東洋埠頭	3,300	1,384.00	4,567,200
上組	83,600	3,278.00	274,040,800
サンリツ	2,600	738.00	1,918,800
キムラユニティー	5,500	1,330.00	7,315,000
キューソー流通システム	7,000	890.00	6,230,000
東海運	6,700	283.00	1,896,100
エーアイティー	10,900	1,661.00	18,104,900
内外トランスライン	7,000	2,484.00	17,388,000
日本コンセプト	6,300	1,647.00	10,376,100
NEC ネットエスアイ	68,200	2,260.00	154,132,000
クロスキャット	11,100	1,064.00	11,810,400
システナ	265,000	305.00	80,825,000
デジタルアーツ	11,100	4,930.00	54,723,000
日鉄ソリューションズ	29,900	4,575.00	136,792,500
キューブシステム	10,300	1,085.00	11,175,500
コア	7,800	1,729.00	13,486,200
手間いらず	3,000	2,935.00	8,805,000
ラクーンホールディングス	14,500	627.00	9,091,500
ソリトンシステムズ	9,000	1,402.00	12,618,000
ソフトクリエイイトホールディングス	14,400	1,689.00	24,321,600
T I S	191,500	3,036.00	581,394,000
テクミラホールディングス	5,400	459.00	2,478,600
グリー	47,000	553.00	25,991,000
GMOペパボ	2,300	1,183.00	2,720,900
コーエーテクモホールディングス	109,700	1,669.50	183,144,150
三菱総合研究所	8,600	4,660.00	40,076,000
電算	1,400	1,501.00	2,101,400
A G S	4,900	798.00	3,910,200
ファインデックス	13,900	1,011.00	14,052,900
ブレインパッド	13,100	1,049.00	13,741,900
K L a b	32,200	298.00	9,595,600
ポールトゥウィンホールディングス	29,900	443.00	13,245,700
ネクソン	391,300	2,964.50	1,160,008,850
アイスタイル	52,000	428.00	22,256,000
エムアップホールディングス	21,500	1,042.00	22,403,000
エイチーム	10,400	563.00	5,855,200
エニグモ	22,300	340.00	7,582,000
テクノスジャパン	9,500	628.00	5,966,000
コロブラ	68,000	571.00	38,828,000
ブロードリーフ	94,600	565.00	53,449,000

クロス・マーケティンググループ	7,000	550.00	3,850,000
デジタルハーツホールディングス	10,900	955.00	10,409,500
メディアドゥ	7,900	1,439.00	11,368,100
じげん	51,100	532.00	27,185,200
ブイキューブ	21,100	318.00	6,709,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	523.00	1,464,400
サイバーリンクス	4,500	721.00	3,244,500
フィックスターズ	19,800	1,301.00	25,759,800
CARTA HOLDINGS	8,200	1,335.00	10,947,000
オブティム	18,000	784.00	14,112,000
セレス	7,100	1,134.00	8,051,400
SHIFT	11,600	35,280.00	409,248,000
ティーガイア	18,300	1,871.00	34,239,300
セック	1,900	4,680.00	8,892,000
テクマトリックス	32,000	1,711.00	54,752,000
プロシップ	8,400	1,344.00	11,289,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,600	2,323.50	105,951,600
GMOペイメントゲートウェイ	35,000	9,255.00	323,925,000
ザッパラス	3,300	476.00	1,570,800
システムリサーチ	6,000	2,968.00	17,808,000
インターネットイニシアティブ	83,700	2,767.50	231,639,750
さくらインターネット	19,700	1,953.00	38,474,100
ヴィンクス	2,800	2,017.00	5,647,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,591.00	13,991,400
SRAホールディングス	9,000	3,495.00	31,455,000
システムインテグレータ	3,500	390.00	1,365,000
朝日ネット	18,800	606.00	11,392,800
eBASE	24,700	748.00	18,475,600
アバントグループ	22,100	1,369.00	30,254,900
アドソル日進	7,400	1,544.00	11,425,600
ODKソリューションズ	2,600	584.00	1,518,400
フリービット	9,200	1,394.00	12,824,800
コムチュア	25,300	1,783.00	45,109,900
サイバーコム	1,900	1,902.00	3,613,800
アステリア	13,700	651.00	8,918,700
アイル	8,200	3,230.00	26,486,000
マークライنز	9,500	2,716.00	25,802,000
メディカル・データ・ビジョン	20,900	608.00	12,707,200
gumi	25,900	376.00	9,738,400
ショーケース	2,800	335.00	938,000
モバイルファクトリー	2,500	606.00	1,515,000
テラスカイ	7,600	1,574.00	11,962,400

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,100	1,605.00	16,210,500
P C Iホールディングス	4,400	1,028.00	4,523,200
アイビーシー	1,800	456.00	820,800
ネオジャパン	5,900	1,015.00	5,988,500
P R T I M E S	4,400	1,766.00	7,770,400
ラクス	82,800	2,552.00	211,305,600
ランドコンピュータ	5,600	874.00	4,894,400
ダブルスタンダード	5,300	1,481.00	7,849,300
オープンドア	12,200	753.00	9,186,600
アカツキ	8,300	2,096.00	17,396,800
ベネフィットジャパン	700	1,244.00	870,800
U b i c o mホールディングス	5,500	1,589.00	8,739,500
カナミックネットワーク	18,900	390.00	7,371,000
ノムラシステムコーポレーション	12,900	114.00	1,470,600
チェンジホールディングス	38,100	1,432.00	54,559,200
シンクロ・フード	7,400	721.00	5,335,400
オークネット	7,500	1,808.00	13,560,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	683.00	1,570,900
セグエグループ	3,700	939.00	3,474,300
エイトレッド	1,800	1,394.00	2,509,200
マクロミル	34,400	789.00	27,141,600
ビーグリー	2,500	1,215.00	3,037,500
オロ	6,300	2,831.00	17,835,300
ユーザーローカル	6,300	1,851.00	11,661,300
テモナ	2,800	221.00	618,800
ニーズウェル	6,400	751.00	4,806,400
マネーフォワード	38,900	4,181.00	162,640,900
サインポスト	4,500	371.00	1,669,500
S u n A s t e r i s k	12,500	904.00	11,300,000
プラスアルファ・コンサルティング	10,300	2,820.00	29,046,000
電算システムホールディングス	7,800	2,715.00	21,177,000
A p p i e r G r o u p	59,800	1,692.00	101,181,600
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,300	479.00	1,580,700
プロトコーポレーション	19,200	1,345.00	25,824,000
ハイマックス	5,500	1,390.00	7,645,000
野村総合研究所	387,900	4,068.00	1,577,977,200
サイバネットシステム	13,900	1,091.00	15,164,900
C Eホールディングス	6,000	629.00	3,774,000
日本システム技術	5,700	2,848.00	16,233,600
インテージホールディングス	19,800	1,570.00	31,086,000
東邦システムサイエンス	5,700	1,230.00	7,011,000

ソースネクスト	88,400	163.00	14,409,200
インフォコム	22,600	2,337.00	52,816,200
シンプレクス・ホールディングス	26,300	2,566.00	67,485,800
HEROZ	5,900	1,843.00	10,873,700
ラクスル	42,100	1,224.00	51,530,400
メルカリ	106,200	2,659.50	282,438,900
I P S	5,600	1,928.00	10,796,800
F I G	13,500	345.00	4,657,500
システムサポート	6,800	1,877.00	12,763,600
イーソル	12,700	555.00	7,048,500
東海ソフト	1,700	1,122.00	1,907,400
ウイングアーク1st	18,100	3,015.00	54,571,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,222.00	5,743,400
サーバーワークス	3,600	3,190.00	11,484,000
東名	900	1,781.00	1,602,900
ヴィッツ	1,200	889.00	1,066,800
トピラシステムズ	3,300	870.00	2,871,000
S a n s a n	57,400	1,616.00	92,758,400
L i n k - U	2,800	720.00	2,016,000
ギフトィ	15,300	1,813.00	27,738,900
メドレー	23,500	4,705.00	110,567,500
ベース	6,000	3,505.00	21,030,000
J M D C	29,900	4,199.00	125,550,100
フォーカスシステムズ	12,700	979.00	12,433,300
クレスコ	14,400	1,832.00	26,380,800
フジ・メディア・ホールディングス	168,200	1,655.00	278,371,000
オービック	58,500	23,470.00	1,372,995,000
ジャストシステム	25,200	3,005.00	75,726,000
T D C ソフト	16,400	2,062.00	33,816,800
L I N E ヤフー	2,492,400	478.30	1,192,114,920
トレンドマイクロ	82,800	8,102.00	670,845,600
I D ホールディングス	11,800	1,671.00	19,717,800
日本オラクル	33,500	11,530.00	386,255,000
アルファシステムズ	4,600	2,941.00	13,528,600
フューチャー	37,400	1,679.00	62,794,600
C A C H o l d i n g s	10,000	1,758.00	17,580,000
S B テクノロジー	7,400	2,465.00	18,241,000
トーセ	3,400	693.00	2,356,200
オービックビジネスコンサルタント	24,600	6,467.00	159,088,200
アイティフォー	22,900	1,179.00	26,999,100
東計電算	2,400	7,120.00	17,088,000
エクスネット	1,600	1,080.00	1,728,000

大塚商会	86,800	5,957.00	517,067,600
サイボウズ	24,100	2,147.00	51,742,700
電通国際情報サービス	21,300	5,640.00	120,132,000
A C C E S S	20,600	777.00	16,006,200
デジタルガレージ	28,000	3,640.00	101,920,000
E Mシステムズ	29,200	686.00	20,031,200
ウェザーニューズ	5,400	5,460.00	29,484,000
C I J	29,100	644.00	18,740,400
ビジネスエンジニアリング	2,900	4,255.00	12,339,500
日本エンタープライズ	12,200	119.00	1,451,800
WOWOW	13,200	1,044.00	13,780,800
スカラ	16,200	758.00	12,279,600
インテリジェント ウェイブ	6,200	1,052.00	6,522,400
A N Y C O L O R	6,200	3,295.00	20,429,000
I M A G I C A G R O U P	17,600	643.00	11,316,800
ネットワンシステムズ	70,700	2,367.50	167,382,250
システムソフト	61,300	62.00	3,800,600
アルゴグラフィックス	16,100	3,550.00	57,155,000
マーベラス	28,500	692.00	19,722,000
エイベックス	29,800	1,354.00	40,349,200
B I P R O G Y	57,300	4,234.00	242,608,200
都築電気	9,200	2,171.00	19,973,200
T B Sホールディングス	89,600	2,990.00	267,904,000
日本テレビホールディングス	155,000	1,515.00	234,825,000
朝日放送グループホールディングス	16,400	649.00	10,643,600
テレビ朝日ホールディングス	42,500	1,632.00	69,360,000
スカパーJ S A Tホールディングス	136,000	653.00	88,808,000
テレビ東京ホールディングス	12,600	3,000.00	37,800,000
日本BS放送	4,200	888.00	3,729,600
ビジョン	26,400	1,203.00	31,759,200
スマートバリュー	2,900	429.00	1,244,100
U S E N - N E X T H O L D I N G S	19,600	3,755.00	73,598,000
ワイヤレスゲート	5,200	241.00	1,253,200
日本通信	172,500	228.00	39,330,000
クロップス	1,900	1,046.00	1,987,400
日本電信電話	52,081,600	169.30	8,817,414,880
K D D I	1,353,000	4,434.00	5,999,202,000
ソフトバンク	2,817,100	1,715.50	4,832,735,050
光通信	17,600	23,410.00	412,016,000
エムティーアイ	12,000	619.00	7,428,000
G M Oインターネットグループ	64,700	2,469.50	159,776,650
ファイバーゲート	9,400	903.00	8,488,200

アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	225.00	630,000
KADOKAWA	92,600	2,795.50	258,863,300
学研ホールディングス	29,200	979.00	28,586,800
ゼンリン	30,000	856.00	25,680,000
昭文社ホールディングス	5,000	360.00	1,800,000
インプレスホールディングス	10,300	178.00	1,833,400
アイネット	10,600	1,701.00	18,030,600
松竹	9,100	9,247.00	84,147,700
東宝	97,400	4,788.00	466,351,200
東映	5,800	20,800.00	120,640,000
NTTデータグループ	457,800	1,937.50	886,987,500
ピー・シー・エー	10,100	1,069.00	10,796,900
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,124.00	15,717,600
DTS	37,300	3,455.00	128,871,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,000	4,760.00	380,800,000
シーイーシー	22,100	1,595.00	35,249,500
カブコン	156,600	4,595.00	719,577,000
アイ・エス・ビー	9,000	1,524.00	13,716,000
ジャステック	10,800	1,420.00	15,336,000
SCSK	122,500	2,736.50	335,221,250
NSW	7,800	2,787.00	21,738,600
アイネス	13,700	1,600.00	21,920,000
TKC	27,800	3,565.00	99,107,000
富士ソフト	35,200	5,750.00	202,400,000
NSD	62,500	2,664.00	166,500,000
コナミグループ	65,600	7,468.00	489,900,800
福井コンピュータホールディングス	10,800	2,551.00	27,550,800
JBCホールディングス	11,600	3,570.00	41,412,000
ミロク情報サービス	15,900	1,648.00	26,203,200
ソフトバンクグループ	863,700	6,073.00	5,245,250,100
高千穂交易	5,100	3,470.00	17,697,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,746.00	3,142,800
伊藤忠食品	4,200	7,870.00	33,054,000
エレマテック	16,600	1,710.00	28,386,000
あらた	14,100	6,190.00	87,279,000
トーメンデバイス	2,700	4,965.00	13,405,500
東京エレクトロン デバイス	18,400	5,300.00	97,520,000
円谷フィールズホールディングス	31,700	1,219.00	38,642,300
双日	205,600	3,211.00	660,181,600
アルフレッサ ホールディングス	185,400	2,400.50	445,052,700
横浜冷凍	50,300	1,053.00	52,965,900
ラサ商事	6,600	1,481.00	9,774,600

アルコニックス	24,300	1,286.00	31,249,800
神戸物産	142,900	4,059.00	580,031,100
ハイパー	2,800	321.00	898,800
あい ホールディングス	29,600	2,354.00	69,678,400
ディーブイエックス	3,400	1,043.00	3,546,200
ダイワボウホールディングス	81,800	2,985.00	244,173,000
マクニカホールディングス	43,700	7,770.00	339,549,000
ラクト・ジャパン	7,200	1,906.00	13,723,200
グリムス	7,800	1,972.00	15,381,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,000	1,045.00	29,260,000
八洲電機	15,000	1,252.00	18,780,000
メディアスホールディングス	11,900	773.00	9,198,700
レスターホールディングス	15,700	2,733.00	42,908,100
ジオリーブグループ	2,800	1,273.00	3,564,400
大光	5,200	670.00	3,484,000
OCHIホールディングス	2,800	1,412.00	3,953,600
TOKAIホールディングス	100,300	945.00	94,783,500
黒谷	3,400	583.00	1,982,200
Cominix	2,400	778.00	1,867,200
三洋貿易	20,900	1,200.00	25,080,000
ビューティガレージ	5,800	2,037.00	11,814,600
ウイン・パートナーズ	13,300	1,130.00	15,029,000
ミタチ産業	3,100	1,100.00	3,410,000
シップヘルスケアホールディングス	66,400	2,222.00	147,540,800
明治電機工業	6,900	1,389.00	9,584,100
デリカフーズホールディングス	4,800	582.00	2,793,600
スターティアホールディングス	2,700	1,325.00	3,577,500
コメダホールディングス	45,300	2,690.00	121,857,000
ピーバンドットコム	1,800	360.00	648,000
アセンテック	7,100	501.00	3,557,100
富士興産	2,900	1,803.00	5,228,700
協栄産業	1,100	2,475.00	2,722,500
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,546.00	43,536,600
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,915.00	40,716,000
小野建	18,200	1,666.00	30,321,200
南陽	2,300	2,048.00	4,710,400
佐島電機	9,000	1,899.00	17,091,000
エコートレーディング	2,400	1,598.00	3,835,200
伯東	10,600	5,390.00	57,134,000
コンドーテック	14,200	1,140.00	16,188,000
中山福	6,600	360.00	2,376,000
ナガイレーベン	23,300	2,333.00	54,358,900



三菱食品	17,100	4,765.00	81,481,500
松田産業	14,100	2,385.00	33,628,500
第一興商	71,500	2,064.00	147,576,000
メディバルホールディングス	191,400	2,258.00	432,181,200
S P K	8,200	1,838.00	15,071,600
萩原電気ホールディングス	7,900	4,660.00	36,814,000
アズワン	28,900	5,373.00	155,279,700
スズデン	6,500	2,266.00	14,729,000
尾家産業	2,900	1,865.00	5,408,500
シモジマ	12,700	1,261.00	16,014,700
ドウシシャ	17,100	2,010.00	34,371,000
小津産業	2,700	1,566.00	4,228,200
高速	11,000	2,032.00	22,352,000
たけびし	7,100	1,846.00	13,106,600
リックス	3,300	3,260.00	10,758,000
丸文	16,500	1,561.00	25,756,500
ハピネット	15,700	2,640.00	41,448,000
橋本総業ホールディングス	7,300	1,279.00	9,336,700
日本ライフライン	54,200	1,208.00	65,473,600
タカショー	16,100	503.00	8,098,300
I D O M	48,900	938.00	45,868,200
進和	11,300	2,330.00	26,329,000
エスケイジャパン	3,000	804.00	2,412,000
ダイトロン	7,300	2,815.00	20,549,500
シークス	26,300	1,430.00	37,609,000
田中商事	3,500	742.00	2,597,000
オーハシテクニカ	9,800	1,792.00	17,561,600
白銅	5,200	2,231.00	11,601,200
ダイコー通産	1,300	1,192.00	1,549,600
伊藤忠商事	1,241,600	5,834.00	7,243,494,400
丸紅	1,540,000	2,249.50	3,464,230,000
高島	7,700	1,119.00	8,616,300
長瀬産業	84,700	2,247.00	190,320,900
蝶理	11,600	2,781.00	32,259,600
豊田通商	161,800	8,604.00	1,392,127,200
三共生興	25,600	715.00	18,304,000
兼松	77,200	2,054.00	158,568,800
ツカモトコーポレーション	1,700	1,163.00	1,977,100
三井物産	1,391,700	5,195.00	7,229,881,500
日本紙パルプ商事	8,800	4,930.00	43,384,000
カメイ	19,700	1,698.00	33,450,600
東都水産	600	7,350.00	4,410,000

OU Gホールディングス	1,800	2,396.00	4,312,800
スターゼン	12,800	2,465.00	31,552,000
山善	56,000	1,200.00	67,200,000
椿本興業	3,800	6,550.00	24,890,000
住友商事	1,117,900	3,061.00	3,421,891,900
内田洋行	7,500	6,900.00	51,750,000
三菱商事	1,220,000	6,713.00	8,189,860,000
第一実業	17,400	1,866.00	32,468,400
キャノンマーケティングジャパン	42,800	4,046.00	173,168,800
西華産業	7,300	2,848.00	20,790,400
佐藤商事	12,800	1,445.00	18,496,000
菱洋エレクトロ	17,500	3,590.00	62,825,000
東京産業	16,900	816.00	13,790,400
ユアサ商事	14,400	4,600.00	66,240,000
神鋼商事	4,600	5,800.00	26,680,000
トルク	6,600	259.00	1,709,400
阪和興業	33,200	4,795.00	159,194,000
正栄食品工業	12,300	4,830.00	59,409,000
カナデン	13,900	1,551.00	21,558,900
RYODEN	14,900	2,482.00	36,981,800
岩谷産業	42,100	6,363.00	267,882,300
ナイス	3,300	1,562.00	5,154,600
ニチモウ	1,600	3,910.00	6,256,000
極東貿易	11,000	1,877.00	20,647,000
アステナホールディングス	34,800	472.00	16,425,600
三愛オブリ	44,400	1,627.00	72,238,800
稲畑産業	36,500	3,085.00	112,602,500
G S Iクレオス	10,600	2,142.00	22,705,200
明和産業	24,400	633.00	15,445,200
クワザワホールディングス	4,000	686.00	2,744,000
ワキタ	30,600	1,593.00	48,745,800
東邦ホールディングス	51,100	3,260.00	166,586,000
サンゲツ	42,500	3,030.00	128,775,000
ミツウロコグループホールディングス	23,600	1,542.00	36,391,200
シナネンホールディングス	5,100	4,130.00	21,063,000
伊藤忠エネクス	45,800	1,568.00	71,814,400
サンリオ	52,400	5,600.00	293,440,000
サンワテクノス	9,400	2,180.00	20,492,000
リョーサン	13,100	4,880.00	63,928,000
新光商事	24,800	1,133.00	28,098,400
トーホー	7,800	2,694.00	21,013,200
三信電気	7,500	2,126.00	15,945,000

東陽テクニカ	18,800	1,335.00	25,098,000
モスフードサービス	27,200	3,225.00	87,720,000
加賀電子	16,900	6,270.00	105,963,000
ソーダニッカ	13,700	1,061.00	14,535,700
立花エレテック	12,300	2,764.00	33,997,200
フォーバル	7,300	1,393.00	10,168,900
PALTAC	24,900	4,485.00	111,676,500
三谷産業	32,400	324.00	10,497,600
西本Wismettacホールディングス	4,700	5,890.00	27,683,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,144.00	2,144,000
コア商事ホールディングス	10,400	708.00	7,363,200
KPPグループホールディングス	47,900	695.00	33,290,500
ヤマタネ	8,200	2,368.00	19,417,600
丸紅建材リース	1,100	2,563.00	2,819,300
泉州電業	9,300	3,525.00	32,782,500
トラスコ中山	38,800	2,421.00	93,934,800
オートバックスセブン	64,300	1,541.50	99,118,450
モリト	13,200	1,274.00	16,816,800
加藤産業	22,900	4,510.00	103,279,000
北恵	3,100	813.00	2,520,300
イエローハット	29,400	1,752.00	51,508,800
JKホールディングス	14,200	1,012.00	14,370,400
日伝	12,500	2,851.00	35,637,500
北沢産業	6,600	276.00	1,821,600
杉本商事	8,900	2,184.00	19,437,600
因幡電機産業	47,900	3,385.00	162,141,500
東テク	6,200	4,770.00	29,574,000
ミスミグループ本社	278,800	2,164.00	603,323,200
アルテック	6,600	230.00	1,518,000
タキヒヨー	3,000	981.00	2,943,000
蔵王産業	2,000	2,409.00	4,818,000
スズケン	70,300	4,830.00	339,549,000
ジェコス	11,100	1,032.00	11,455,200
グローセル	18,900	688.00	13,003,200
ローソン	39,300	7,121.00	279,855,300
サンエー	14,200	4,535.00	64,397,000
カワチ薬品	14,600	2,495.00	36,427,000
エービーシー・マート	81,000	2,534.50	205,294,500
ハードオフコーポレーション	6,000	1,571.00	9,426,000
アスクル	38,400	2,266.00	87,014,400
ゲオホールディングス	20,900	2,132.00	44,558,800
アダストリア	22,400	3,625.00	81,200,000

くら寿司	21,700	3,310.00	71,827,000
キャンドウ	6,700	2,617.00	17,533,900
I Kホールディングス	5,200	329.00	1,710,800
パルグループホールディングス	36,400	2,498.00	90,927,200
エディオン	73,400	1,504.00	110,393,600
サーラコーポレーション	39,400	711.00	28,013,400
ワッツ	6,800	588.00	3,998,400
ハローズ	8,500	4,045.00	34,382,500
あみやき亭	4,600	3,705.00	17,043,000
大黒天物産	5,700	7,150.00	40,755,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,784.00	26,403,200
ファーマライズホールディングス	3,400	636.00	2,162,400
アルペン	15,500	1,968.00	30,504,000
ハブ	4,600	712.00	3,275,200
クオールホールディングス	25,700	1,672.00	42,970,400
ジーンズホールディングス	11,100	4,660.00	51,726,000
ビックカメラ	98,600	1,319.00	130,053,400
D C Mホールディングス	98,000	1,330.00	130,340,000
MonotaRO	262,200	1,542.50	404,443,500
東京一番フーズ	3,800	505.00	1,919,000
きちりホールディングス	2,900	1,108.00	3,213,200
J . フロント リテイリング	212,300	1,306.00	277,263,800
ドトール・日レスホールディングス	33,000	2,131.00	70,323,000
マツキヨココカラ&カンパニー	336,200	2,466.00	829,069,200
ブロンコビリー	11,000	3,155.00	34,705,000
Z O Z O	122,200	3,181.00	388,718,200
トレジャー・ファクトリー	9,300	1,329.00	12,359,700
物語コーポレーション	31,000	4,355.00	135,005,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,300	1,520.50	473,331,650
H a m e e	6,900	894.00	6,168,600
マーケットエンタープライズ	1,600	1,026.00	1,641,600
ウエルシアホールディングス	96,000	2,325.50	223,248,000
クリエイトSDホールディングス	30,700	3,020.00	92,714,000
丸善C H Iホールディングス	15,800	328.00	5,182,400
ミサワ	3,000	657.00	1,971,000
ティーライフ	2,000	1,375.00	2,750,000
チムニー	3,800	1,424.00	5,411,200
シュッピン	17,000	1,173.00	19,941,000
オイシックス・ラ・大地	25,200	1,341.00	33,793,200
ネクステージ	42,400	2,550.00	108,120,000
ジョイフル本田	54,000	1,804.00	97,416,000
鳥貴族ホールディングス	7,000	3,230.00	22,610,000

ホットランド	14,400	1,929.00	27,777,600
すかいらーくホールディングス	252,700	2,057.50	519,930,250
SFPホールディングス	10,100	2,097.00	21,179,700
綿半ホールディングス	14,700	1,373.00	20,183,100
ヨシックスホールディングス	3,500	2,685.00	9,397,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,000	1,004.00	52,208,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	688.00	6,192,000
BEENOS	8,000	1,406.00	11,248,000
あさひ	17,500	1,282.00	22,435,000
日本調剤	12,900	1,333.00	17,195,700
コスモス薬品	18,300	15,665.00	286,669,500
トーエル	6,100	733.00	4,471,300
セブン&アイ・ホールディングス	636,600	5,490.00	3,494,934,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	125,000	1,057.00	132,125,000
ツルハホールディングス	38,800	12,470.00	483,836,000
サンマルクホールディングス	15,100	2,004.00	30,260,400
フェリシモ	3,200	923.00	2,953,600
トリドールホールディングス	51,800	4,099.00	212,328,200
TOKYO BASE	24,000	279.00	6,696,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	989.00	2,373,600
JMホールディングス	14,200	2,216.00	31,467,200
サツドラホールディングス	6,200	798.00	4,947,600
アレンザホールディングス	14,300	1,031.00	14,743,300
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,583.00	8,231,600
パロックジャパンリミテッド	14,900	818.00	12,188,200
クスリのアオキホールディングス	49,500	3,331.00	164,884,500
力の源ホールディングス	8,300	1,456.00	12,084,800
FOOD & LIFE COMPANIES	98,700	2,890.00	285,243,000
メディカルシステムネットワーク	20,900	649.00	13,564,100
はるやまホールディングス	6,100	590.00	3,599,000
ノジマ	53,900	1,711.00	92,222,900
カッパ・クリエイト	29,000	1,625.00	47,125,000
ライトオン	9,200	446.00	4,103,200
良品計画	201,800	2,341.00	472,413,800
パリティホールディングス	16,500	483.00	7,969,500
アドヴァングループ	18,000	1,055.00	18,990,000
アルビス	6,200	2,561.00	15,878,200
コナカ	13,300	392.00	5,213,600
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,600.00	2,880,000
G-7ホールディングス	20,500	1,154.00	23,657,000

イオン北海道	54,800	907.00	49,703,600
コジマ	31,200	751.00	23,431,200
ヒマラヤ	4,400	923.00	4,061,200
コーナン商事	22,800	3,860.00	88,008,000
エコス	7,100	2,320.00	16,472,000
ワタミ	19,500	1,024.00	19,968,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	373,000	3,356.00	1,251,788,000
西松屋チェーン	36,600	2,120.00	77,592,000
ゼンショーホールディングス	94,200	7,261.00	683,986,200
幸楽苑ホールディングス	13,700	1,186.00	16,248,200
ハークスレイ	5,000	834.00	4,170,000
サイゼリヤ	27,400	4,970.00	136,178,000
V Tホールディングス	71,000	507.00	35,997,000
魚力	6,600	2,261.00	14,922,600
フジ・コーポレーション	9,300	1,612.00	14,991,600
ユナイテッドアローズ	21,900	1,933.00	42,332,700
ハイデイ日高	27,600	2,732.00	75,403,200
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	10,200	151.00	1,540,200
コロワイド	79,400	2,170.00	172,298,000
壱番屋	14,700	5,170.00	75,999,000
P L A N T	3,500	1,382.00	4,837,000
スギホールディングス	37,300	6,128.00	228,574,400
薬王堂ホールディングス	9,200	2,646.00	24,343,200
スクロール	28,000	962.00	26,936,000
ヨンドシーホールディングス	17,700	1,990.00	35,223,000
木曽路	28,100	2,498.00	70,193,800
S R S ホールディングス	30,900	1,055.00	32,599,500
千趣会	34,900	394.00	13,750,600
リテールパートナーズ	27,700	1,610.00	44,597,000
上新電機	18,500	2,378.00	43,993,000
日本瓦斯	98,100	2,277.50	223,422,750
ロイヤルホールディングス	32,600	2,524.00	82,282,400
いなげや	18,000	1,218.00	21,924,000
チヨダ	18,200	840.00	15,288,000
ライフコーポレーション	19,400	3,350.00	64,990,000
リンガーハット	23,800	2,334.00	55,549,200
M r M a x H D	26,400	612.00	16,156,800
A O K Iホールディングス	40,000	1,131.00	45,240,000
オークワ	26,700	807.00	21,546,900
コメリ	28,600	3,100.00	88,660,000
青山商事	39,800	1,507.00	59,978,600

しまむら	21,700	15,950.00	346,115,000
はせがわ	7,300	358.00	2,613,400
高島屋	127,700	1,925.00	245,822,500
松屋	31,500	926.00	29,169,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,800	1,543.00	126,217,400
近鉄百貨店	8,100	2,647.00	21,440,700
丸井グループ	122,700	2,373.00	291,167,100
アクシアル リテイリング	12,700	4,135.00	52,514,500
イオン	626,200	3,143.00	1,968,146,600
イズミ	32,800	3,579.00	117,391,200
平和堂	30,900	2,201.00	68,010,900
フジ	28,400	1,887.00	53,590,800
ヤオコー	20,900	8,077.00	168,809,300
ゼビオホールディングス	25,500	941.00	23,995,500
ケーズホールディングス	130,900	1,317.00	172,395,300
Olympicグループ	5,500	521.00	2,865,500
日産東京販売ホールディングス	16,600	439.00	7,287,400
シルバーライフ	4,000	1,013.00	4,052,000
Genky DrugStores	8,200	5,140.00	42,148,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,144.00	2,745,600
ブックオフグループホールディングス	9,800	1,139.00	11,162,200
ギフトホールディングス	8,000	2,289.00	18,312,000
アインホールディングス	25,500	4,454.00	113,577,000
元気寿司	10,600	3,150.00	33,390,000
ヤマダホールディングス	569,200	428.10	243,674,520
アーケランズ	55,200	1,683.00	92,901,600
ニトリホールディングス	67,300	18,345.00	1,234,618,500
グルメ杵屋	15,400	1,050.00	16,170,000
愛眼	9,000	175.00	1,575,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,073.00	9,764,300
吉野家ホールディングス	68,200	3,134.00	213,738,800
松屋フーズホールディングス	8,800	5,120.00	45,056,000
サガミホールディングス	28,000	1,378.00	38,584,000
関西フードマーケット	12,800	1,373.00	17,574,400
王将フードサービス	13,700	7,910.00	108,367,000
ミニストップ	13,500	1,500.00	20,250,000
アークス	34,000	2,718.00	92,412,000
パローホールディングス	35,400	2,335.00	82,659,000
ベルク	9,300	6,180.00	57,474,000
大庄	8,100	1,199.00	9,711,900
ファーストリテイリング	83,100	37,340.00	3,102,954,000
サンドラッグ	62,400	4,341.00	270,878,400

サクスパー ホールディングス	17,900	812.00	14,534,800
ヤマザワ	2,600	1,250.00	3,250,000
やまや	2,700	3,030.00	8,181,000
ペルーナ	45,200	598.00	27,029,600
いよぎんホールディングス	204,600	903.70	184,897,020
しずおかフィナンシャルグループ	382,000	1,136.50	434,143,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	144,800	985.00	142,628,000
楽天銀行	59,800	2,057.00	123,008,600
京都フィナンシャルグループ	54,500	8,600.00	468,700,000
島根銀行	3,900	505.00	1,969,500
じもとホールディングス	10,000	554.00	5,540,000
めぶきフィナンシャルグループ	853,200	428.50	365,596,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,000	3,975.00	87,450,000
九州フィナンシャルグループ	332,800	765.10	254,625,280
ゆうちょ銀行	1,889,400	1,407.50	2,659,330,500
富山第一銀行	54,600	758.00	41,386,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	922,600	636.90	587,603,940
西日本フィナンシャルホールディングス	97,000	1,576.00	152,872,000
三十三フィナンシャルグループ	15,400	1,792.00	27,596,800
第四北越フィナンシャルグループ	27,000	3,865.00	104,355,000
ひろぎんホールディングス	244,700	886.40	216,902,080
おきなわフィナンシャルグループ	14,700	2,274.00	33,427,800
十六フィナンシャルグループ	22,300	3,670.00	81,841,000
北國フィナンシャルホールディングス	18,100	4,540.00	82,174,000
プロクレアホールディングス	19,600	1,811.00	35,495,600
あいちフィナンシャルグループ	26,500	2,250.00	59,625,000
あおぞら銀行	123,600	3,086.00	381,429,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,767,900	1,187.50	12,786,881,250
りそなホールディングス	2,004,900	708.40	1,420,271,160
三井住友トラスト・ホールディングス	309,100	5,256.00	1,624,629,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,222,500	6,703.00	8,194,417,500
千葉銀行	479,200	1,006.00	482,075,200
群馬銀行	333,600	682.40	227,648,640
武蔵野銀行	24,000	2,651.00	63,624,000
千葉興業銀行	28,400	773.00	21,953,200
筑波銀行	75,500	245.00	18,497,500
七十七銀行	50,000	3,360.00	168,000,000
秋田銀行	11,500	1,888.00	21,712,000
山形銀行	19,100	1,057.00	20,188,700
岩手銀行	10,900	2,363.00	25,756,700
東邦銀行	136,000	291.00	39,576,000
東北銀行	5,500	1,165.00	6,407,500



ふくおかフィナンシャルグループ	149,700	3,209.00	480,387,300
スルガ銀行	151,500	780.00	118,170,000
八十二銀行	368,900	769.60	283,905,440
山梨中央銀行	19,300	1,685.00	32,520,500
大垣共立銀行	32,800	1,812.00	59,433,600
福井銀行	15,400	1,572.00	24,208,800
清水銀行	6,800	1,476.00	10,036,800
富山銀行	1,700	1,696.00	2,883,200
滋賀銀行	28,600	3,390.00	96,954,000
南都銀行	25,900	2,399.00	62,134,100
百五銀行	161,800	527.00	85,268,600
紀陽銀行	61,500	1,510.00	92,865,000
ほくほくフィナンシャルグループ	106,400	1,521.00	161,834,400
山陰合同銀行	107,600	976.00	105,017,600
鳥取銀行	3,600	1,338.00	4,816,800
百十四銀行	16,900	2,330.00	39,377,000
四国銀行	27,100	941.00	25,501,100
阿波銀行	24,100	2,310.00	55,671,000
大分銀行	10,300	2,444.00	25,173,200
宮崎銀行	10,400	2,475.00	25,740,000
佐賀銀行	10,100	1,788.00	18,058,800
琉球銀行	36,600	1,077.00	39,418,200
セブン銀行	538,900	292.90	157,843,810
みずほフィナンシャルグループ	2,320,800	2,350.00	5,453,880,000
高知銀行	3,900	910.00	3,549,000
山口フィナンシャルグループ	168,600	1,242.50	209,485,500
名古屋銀行	11,200	5,520.00	61,824,000
北洋銀行	260,500	351.00	91,435,500
大光銀行	3,400	1,253.00	4,260,200
愛媛銀行	23,200	950.00	22,040,000
トマト銀行	3,700	1,131.00	4,184,700
京葉銀行	72,100	676.00	48,739,600
栃木銀行	85,900	303.00	26,027,700
北日本銀行	6,000	2,033.00	12,198,000
東和銀行	31,600	585.00	18,486,000
福島銀行	12,000	232.00	2,784,000
大東銀行	4,400	751.00	3,304,400
トモニホールディングス	139,000	386.00	53,654,000
フィデアホールディングス	17,800	1,462.00	26,023,600
池田泉州ホールディングス	238,500	317.00	75,604,500
F P G	58,200	1,675.00	97,485,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,100	1,530.00	21,573,000

マーキュリアホールディングス	6,000	736.00	4,416,000
S B Iホールディングス	251,700	3,066.00	771,712,200
ジャフコ グループ	51,300	1,678.50	86,107,050
大和証券グループ本社	1,332,000	966.80	1,287,777,600
野村ホールディングス	2,891,600	645.40	1,866,238,640
岡三証券グループ	151,100	706.00	106,676,600
丸三証券	57,300	834.00	47,788,200
東洋証券	46,000	295.00	13,570,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,400	525.00	107,310,000
光世証券	2,900	480.00	1,392,000
水戸証券	51,000	421.00	21,471,000
いちよし証券	32,400	700.00	22,680,000
松井証券	84,800	714.00	60,547,200
マネックスグループ	168,600	684.00	115,322,400
極東証券	23,700	954.00	22,609,800
岩井コスモホールディングス	19,700	1,769.00	34,849,300
アイザワ証券グループ	24,900	1,195.00	29,755,500
マネーパートナーズグループ	12,400	288.00	3,571,200
スパークス・グループ	19,200	1,550.00	29,760,000
かんぽ生命保険	175,100	2,437.00	426,718,700
F Pパートナー	3,400	5,310.00	18,054,000
S O M P Oホールディングス	272,400	6,831.00	1,860,764,400
アニコム ホールディングス	58,400	524.00	30,601,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	385,000	5,440.00	2,094,400,000
第一生命ホールディングス	840,100	2,939.50	2,469,473,950
東京海上ホールディングス	1,699,500	3,521.00	5,983,939,500
T & Dホールディングス	499,900	2,180.00	1,089,782,000
アドバンスクリエイト	9,900	975.00	9,652,500
全国保証	45,000	5,212.00	234,540,000
あんしん保証	6,600	243.00	1,603,800
イントラスト	4,700	799.00	3,755,300
日本モーゲージサービス	6,800	500.00	3,400,000
C a s a	4,700	871.00	4,093,700
アルヒ	16,900	800.00	13,520,000
プレミアグループ	29,100	1,735.00	50,488,500
ネットプロテクションズホールディングス	58,500	180.00	10,530,000
クレディセゾン	109,100	2,535.00	276,568,500
芙蓉総合リース	15,800	11,810.00	186,598,000
みずほリース	28,900	4,765.00	137,708,500
東京センチュリー	32,200	6,033.00	194,262,600
日本証券金融	63,400	1,487.00	94,275,800
アイフル	253,900	373.00	94,704,700

リコーリース	16,400	4,700.00	77,080,000
イオンフィナンシャルサービス	99,000	1,229.50	121,720,500
アコム	307,700	344.50	106,002,650
ジャックス	18,400	5,100.00	93,840,000
オリエントコーポレーション	56,400	1,056.00	59,558,400
オリックス	1,048,100	2,678.00	2,806,811,800
三菱HCキャピタル	766,400	937.20	718,270,080
九州リースサービス	5,600	1,070.00	5,992,000
日本取引所グループ	448,700	2,993.00	1,342,959,100
イー・ギャランティ	28,100	1,888.00	53,052,800
アサックス	5,600	696.00	3,897,600
NECキャピタルソリューション	8,500	3,255.00	27,667,500
Robot Home	51,400	172.00	8,840,800
大東建託	63,000	15,995.00	1,007,685,000
いちご	199,900	335.00	66,966,500
日本駐車場開発	185,300	196.00	36,318,800
スター・マイカ・ホールディングス	21,100	608.00	12,828,800
SREホールディングス	8,600	2,802.00	24,097,200
ADワークスグループ	28,600	231.00	6,606,600
ヒューリック	401,500	1,481.50	594,822,250
野村不動産ホールディングス	95,900	3,669.00	351,857,100
三重交通グループホールディングス	37,900	564.00	21,375,600
サムティ	27,600	2,372.00	65,467,200
ディア・ライフ	30,000	864.00	25,920,000
地主	13,400	2,235.00	29,949,000
プレサンスコーポレーション	27,700	1,570.00	43,489,000
ハウスコム	2,600	886.00	2,303,600
JPMC	10,500	1,131.00	11,875,500
サンセイランディック	4,100	1,029.00	4,218,900
フージャースホールディングス	26,500	1,029.00	27,268,500
オープンハウスグループ	63,100	4,178.00	263,631,800
東急不動産ホールディングス	517,600	908.90	470,446,640
飯田グループホールディングス	165,000	2,152.00	355,080,000
イーランド	2,200	1,479.00	3,253,800
ムゲンエステート	8,300	1,197.00	9,935,100
And Doホールディングス	10,400	1,013.00	10,535,200
シーアールイー	10,000	1,325.00	13,250,000
ケイアイスター不動産	8,500	3,135.00	26,647,500
グッドコムアセット	16,900	662.00	11,187,800
ジェイ・エス・ビー	8,800	2,567.00	22,589,600
ロードスターキャピタル	11,500	2,082.00	23,943,000
テンポイノベーション	4,100	1,041.00	4,268,100

フェイスネットワーク	3,600	1,369.00	4,928,400
霞ヶ関キャピタル	4,100	8,800.00	36,080,000
パーク24	112,000	1,871.00	209,552,000
パラカ	6,400	1,877.00	12,012,800
三井不動産	795,300	3,491.00	2,776,392,300
三菱地所	1,124,200	1,984.00	2,230,412,800
平和不動産	28,100	3,745.00	105,234,500
東京建物	150,500	2,065.50	310,857,750
京阪神ビルディング	32,600	1,400.00	45,640,000
住友不動産	248,800	4,341.00	1,080,040,800
テーオーシー	31,900	685.00	21,851,500
東京楽天地	3,000	6,780.00	20,340,000
レオパレス21	172,000	422.00	72,584,000
スターツコーポレーション	24,900	2,796.00	69,620,400
フジ住宅	24,900	692.00	17,230,800
空港施設	25,400	577.00	14,655,800
明和地所	9,100	1,219.00	11,092,900
ゴールドクレスト	14,300	2,147.00	30,702,100
エスリード	8,300	3,235.00	26,850,500
日神グループホールディングス	28,900	488.00	14,103,200
日本エスコン	32,200	923.00	29,720,600
MIRARTHホールディングス	79,000	451.00	35,629,000
AVANTIA	7,200	851.00	6,127,200
イオンモール	89,500	1,738.00	155,551,000
毎日コムネット	5,200	740.00	3,848,000
ファースト住建	5,200	1,017.00	5,288,400
カチタス	46,500	2,149.00	99,928,500
トーセイ	29,000	1,836.00	53,244,000
穴吹興産	2,600	1,992.00	5,179,200
サンフロンティア不動産	25,900	1,577.00	40,844,300
FJネクストホールディングス	18,700	1,085.00	20,289,500
インテリックス	2,800	473.00	1,324,400
ランドビジネス	4,200	269.00	1,129,800
サンネクスタグループ	4,100	955.00	3,915,500
グランディハウス	12,400	595.00	7,378,000
日本空港ビルデング	60,900	6,231.00	379,467,900
明豊ファシリティワークス	6,400	803.00	5,139,200
LIFULL	63,000	176.00	11,088,000
MIXI	38,600	2,330.00	89,938,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,300	2,674.00	43,586,200
日本M&Aセンターホールディングス	286,400	751.20	215,143,680
メンバーズ	6,400	917.00	5,868,800

中広	2,400	407.00	976,800
UTグループ	23,700	2,287.00	54,201,900
アイティメディア	7,200	936.00	6,739,200
E・Jホールディングス	10,700	1,571.00	16,809,700
オープンアップグループ	54,000	2,276.00	122,904,000
コシダカホールディングス	54,000	1,055.00	56,970,000
アルトナー	4,300	2,089.00	8,982,700
パソナグループ	21,900	2,643.00	57,881,700
CDS	3,100	1,717.00	5,322,700
リンクアンドモチベーション	51,700	566.00	29,262,200
エス・エム・エス	63,000	2,782.00	175,266,000
サニーサイドアップグループ	3,900	589.00	2,297,100
パーソルホールディングス	1,828,300	230.40	421,240,320
リニカル	7,200	507.00	3,650,400
クックパッド	51,700	117.00	6,048,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	636.00	4,006,800
学情	9,300	1,718.00	15,977,400
スタジオアリス	9,100	2,078.00	18,909,800
シミックホールディングス	8,800	2,646.00	23,284,800
エプロ	3,700	864.00	3,196,800
NJS	4,000	2,791.00	11,164,000
総合警備保障	300,100	800.30	240,170,030
カカクコム	118,700	1,701.00	201,908,700
アイロムグループ	7,400	1,976.00	14,622,400
セントケア・ホールディング	13,400	926.00	12,408,400
サイネックス	2,500	754.00	1,885,000
ルネサンス	14,300	854.00	12,212,200
ディップ	27,600	3,140.00	86,664,000
デジタルホールディングス	12,900	1,260.00	16,254,000
新日本科学	16,500	1,722.00	28,413,000
キャリアデザインセンター	2,600	2,068.00	5,376,800
ベネフィット・ワン	62,600	1,995.50	124,918,300
エムスリー	354,800	2,291.00	812,846,800
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	115,400	1,753.00	202,296,200
ウェルネット	9,600	552.00	5,299,200
ワールドホールディングス	8,200	2,769.00	22,705,800
ディー・エヌ・エー	64,000	1,379.00	88,256,000
博報堂DYホールディングス	229,200	1,068.00	244,785,600
ぐるなび	34,500	273.00	9,418,500
タカミヤ	25,000	498.00	12,450,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	999.00	8,891,100

ファンコミュニケーションズ	32,300	414.00	13,372,200
ライク	6,900	1,425.00	9,832,500
A o b a - B B T	5,200	406.00	2,111,200
エスプール	52,300	422.00	22,070,600
W D Bホールディングス	9,300	2,202.00	20,478,600
ティア	7,700	454.00	3,495,800
C D G	1,500	1,188.00	1,782,000
アドウェイズ	25,300	536.00	13,560,800
バリューコマース	16,000	1,436.00	22,976,000
インフォマート	187,000	435.00	81,345,000
J Pホールディングス	52,000	449.00	23,348,000
エコナックホールディングス	12,300	136.00	1,672,800
C Lホールディングス	5,100	849.00	4,329,900
プレステージ・インターナショナル	84,500	586.00	49,517,000
アミューズ	11,100	1,468.00	16,294,800
ドリームインキュベータ	6,300	2,885.00	18,175,500
クイック	12,600	2,412.00	30,391,200
T A C	7,300	199.00	1,452,700
電通グループ	176,500	3,684.00	650,226,000
イオンファンタジー	6,600	2,454.00	16,196,400
シーティーエス	23,100	632.00	14,599,200
ネクシィーズグループ	4,000	712.00	2,848,000
H . U . グループホールディングス	52,600	2,622.00	137,917,200
アルプス技研	17,200	2,730.00	46,956,000
日本空調サービス	19,700	788.00	15,523,600
オリエンタルランド	949,800	5,309.00	5,042,488,200
ダスキン	40,000	3,313.00	132,520,000
明光ネットワークジャパン	22,200	727.00	16,139,400
ファルコホールディングス	8,200	2,088.00	17,121,600
ラウンドワン	169,400	569.00	96,388,600
リゾートトラスト	78,100	2,407.50	188,025,750
ビー・エム・エル	22,200	2,962.00	65,756,400
リソー教育	93,100	215.00	20,016,500
早稲田アカデミー	10,100	1,817.00	18,351,700
ユー・エス・エス	201,400	2,796.50	563,215,100
東京個別指導学院	21,900	440.00	9,636,000
サイバーエージェント	396,900	864.50	343,120,050
楽天グループ	1,537,800	576.60	886,695,480
クリーク・アンド・リバー社	9,200	2,046.00	18,823,200
S B I グローバルアセットマネジメント	35,600	585.00	20,826,000
テー・オー・ダブリュー	36,100	324.00	11,696,400
山田コンサルティンググループ	9,200	1,776.00	16,339,200

セントラルスポーツ	6,900	2,417.00	16,677,300
フルキャストホールディングス	17,300	1,788.00	30,932,400
エン・ジャパン	29,300	2,588.00	75,828,400
リソルホールディングス	1,100	5,500.00	6,050,000
テクノプロ・ホールディングス	105,600	3,658.00	386,284,800
アトラグループ	3,600	197.00	709,200
アイ・アールジャパンホールディングス	9,500	1,499.00	14,240,500
K e e P e r 技研	11,100	7,020.00	77,922,000
ファーストロジック	3,400	502.00	1,706,800
三機サービス	2,100	1,137.00	2,387,700
G u n o s y	14,700	715.00	10,510,500
デザインワン・ジャパン	4,800	132.00	633,600
イー・ガーディアン	7,000	1,580.00	11,060,000
リブセンス	6,500	262.00	1,703,000
ジャパンマテリアル	55,000	2,430.00	133,650,000
ベクトル	22,300	1,098.00	24,485,400
ウチヤマホールディングス	5,900	365.00	2,153,500
チャーム・ケア・コーポレーション	15,200	1,189.00	18,072,800
キャリアリンク	6,700	2,258.00	15,128,600
I B J	14,100	713.00	10,053,300
アサンテ	9,100	1,636.00	14,887,600
バリューHR	15,900	1,563.00	24,851,700
M & A キャピタルパートナーズ	14,700	2,371.00	34,853,700
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,014.00	7,503,600
E R I ホールディングス	3,200	1,642.00	5,254,400
アビスト	1,900	2,971.00	5,644,900
シグマクシス・ホールディングス	24,400	1,366.00	33,330,400
ウィルグループ	15,300	1,105.00	16,906,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	138.00	2,028,600
メドピア	16,200	723.00	11,712,600
レアジョブ	2,600	884.00	2,298,400
リクルートホールディングス	1,328,700	5,919.00	7,864,575,300
エラン	24,000	1,112.00	26,688,000
土木管理総合試験所	6,400	326.00	2,086,400
日本郵政	2,109,100	1,256.50	2,650,084,150
ベルシステム24ホールディングス	19,400	1,685.00	32,689,000
鎌倉新書	15,900	536.00	8,522,400
S M N	3,600	275.00	990,000
グローバルキッズCOMPANY	2,700	631.00	1,703,700
エアトリ	13,300	1,783.00	23,713,900
アトラエ	11,100	640.00	7,104,000
ストライク	7,700	4,375.00	33,687,500

ソラスト	50,000	575.00	28,750,000
セラク	5,700	1,251.00	7,130,700
インソース	39,300	860.00	33,798,000
ペイカレント・コンサルティング	132,000	4,941.00	652,212,000
Orchestra Holdings	4,100	1,023.00	4,194,300
アイモバイル	24,600	445.00	10,947,000
キャリアインデックス	5,100	207.00	1,055,700
MS - Japan	6,000	1,103.00	6,618,000
船場	2,800	909.00	2,545,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	58,300	2,325.00	135,547,500
フルテック	1,900	1,226.00	2,329,400
GameWith	4,500	299.00	1,345,500
MS&Consulting	1,900	672.00	1,276,800
ウェルビー	13,500	795.00	10,732,500
エル・ティー・エス	2,200	2,901.00	6,382,200
ミダックホールディングス	11,100	1,945.00	21,589,500
キュービーネットホールディングス	8,800	1,448.00	12,742,400
RPAホールディングス	25,400	269.00	6,832,600
スプリックス	3,800	814.00	3,093,200
マネジメントソリューションズ	7,800	3,215.00	25,077,000
プロレド・パートナーズ	5,200	355.00	1,846,000
テノ・ホールディングス	2,000	523.00	1,046,000
フロンティア・マネジメント	5,200	1,598.00	8,309,600
コプロ・ホールディングス	4,200	1,503.00	6,312,600
ギークス	2,000	481.00	962,000
アンビスホールディングス	19,300	3,170.00	61,181,000
カーブスホールディングス	49,500	624.00	30,888,000
フォーラムエンジニアリング	24,800	843.00	20,906,400
Fast Fitness Japan	6,400	1,057.00	6,764,800
ダイレクトマーケティングミックス	19,200	426.00	8,179,200
ポピンズ	2,900	1,112.00	3,224,800
LITALICO	14,100	2,048.00	28,876,800
コンフィデンス・インターワークス	1,100	1,530.00	1,683,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	499.00	3,043,900
リログループ	90,100	1,571.50	141,592,150
東祥	12,900	780.00	10,062,000
ID&Eホールディングス	10,900	3,275.00	35,697,500
ビーウィズ	4,700	2,104.00	9,888,800
TREホールディングス	34,600	1,040.00	35,984,000
人・夢・技術グループ	6,900	1,700.00	11,730,000
NISSOホールディングス	16,000	761.00	12,176,000
大栄環境	32,700	2,318.00	75,798,600



日本管財ホールディングス	18,900	2,497.00	47,193,300	
M & A 総研ホールディングス	8,700	4,400.00	38,280,000	
エイチ・アイ・エス	52,300	1,896.00	99,160,800	
ラックランド	8,300	2,565.00	21,289,500	
共立メンテナンス	28,200	5,565.00	156,933,000	
イチネンホールディングス	19,200	1,538.00	29,529,600	
建設技術研究所	9,300	5,070.00	47,151,000	
スペース	12,300	969.00	11,918,700	
燦ホールディングス	17,100	1,096.00	18,741,600	
スバル興業	1,000	13,270.00	13,270,000	
東京テアトル	4,400	1,087.00	4,782,800	
タナベコンサルティンググループ	5,700	1,000.00	5,700,000	
ナガワ	5,700	6,890.00	39,273,000	
東京都競馬	15,100	4,435.00	66,968,500	
カナモト	27,900	2,808.00	78,343,200	
ニシオホールディングス	16,800	3,790.00	63,672,000	
トランス・コスモス	22,400	2,988.00	66,931,200	
乃村工藝社	78,600	842.00	66,181,200	
藤田観光	7,200	4,895.00	35,244,000	
KNT - CTホールディングス	10,700	1,284.00	13,738,800	
トーカイ	16,000	2,053.00	32,848,000	
セコム	182,800	10,190.00	1,862,732,000	
セントラル警備保障	9,800	2,465.00	24,157,000	
丹青社	35,100	830.00	29,133,000	
メイテックグループホールディングス	64,700	2,829.50	183,068,650	
応用地質	16,900	2,007.00	33,918,300	
船井総研ホールディングス	37,500	2,533.00	94,987,500	
進学会ホールディングス	4,900	251.00	1,229,900	
オオバ	7,700	895.00	6,891,500	
いであ	3,400	1,744.00	5,929,600	
学究社	7,300	1,959.00	14,300,700	
ベネッセホールディングス	60,400	2,630.00	158,852,000	
イオンディライト	19,800	3,565.00	70,587,000	
ナック	7,900	977.00	7,718,300	
ダイセキ	36,700	3,900.00	143,130,000	
ステップ	6,700	1,864.00	12,488,800	
合 計	263,272,500		583,070,348,420	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

## 貸借対照表

	2023年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	85,669,774
株式	12,446,616,540
投資証券	106,798,600
派生商品評価勘定	349,268
未収配当金	1,160,063
差入委託証拠金	4,624,275
流動資産合計	12,645,218,520
資産合計	12,645,218,520
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,764
前受金	327,000
未払解約金	54,018
未払利息	30
流動負債合計	404,812
負債合計	404,812
純資産の部	
元本等	
元本	9,690,665,416
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,954,148,292
元本等合計	12,644,813,708
純資産合計	12,644,813,708
負債純資産合計	12,645,218,520

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

2023年12月20日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,690,665,416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)
	1.3048円 (13,048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12月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年12月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年12月21日
期首元本額	9,461,648,258円
期中追加設定元本額	1,738,721,000円
期中一部解約元本額	1,509,703,842円
期末元本額	9,690,665,416円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	206,252,795円
コア投資戦略ファンド（成長型）	443,646,163円
コア投資戦略ファンド（切替型）	208,669,921円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,328,087,546円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	98,618,905円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,178,136円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,051,753,939円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	49,376,099円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	86,146,669円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,735,372,994	
投資証券	3,094,911	
合計	1,738,467,905	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	88,802,000	-	89,129,000	327,000
合計		88,802,000	-	89,129,000	327,000

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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)	
INPEX	36,200	1,945.50	70,427,100	
大林組	24,200	1,187.50	28,737,500	

清水建設	19,400	912.90	17,710,260
大和ハウス工業	22,100	4,150.00	91,715,000
積水ハウス	22,300	2,997.00	66,833,100
高砂熱学工業	1,600	3,210.00	5,136,000
大気社	900	4,140.00	3,726,000
明治ホールディングス	8,800	3,308.00	29,110,400
サッポロホールディングス	2,400	6,015.00	14,436,000
アサヒグループホールディングス	18,000	5,378.00	96,804,000
キリンホールディングス	29,000	2,066.00	59,914,000
サントリー食品インターナショナル	5,200	4,707.00	24,476,400
伊藤園	2,000	4,138.00	8,276,000
キッコーマン	5,100	8,806.00	44,910,600
味の素	16,500	5,466.00	90,189,000
カゴメ	2,800	3,082.00	8,629,600
ニチレイ	4,000	3,466.00	13,864,000
日清食品ホールディングス	2,500	14,340.00	35,850,000
東洋紡	3,000	1,037.00	3,111,000
帝人	6,600	1,306.00	8,619,600
東レ	51,800	737.60	38,207,680
クラレ	10,600	1,450.00	15,370,000
旭化成	46,800	1,023.00	47,876,400
住友化学	52,500	334.10	17,540,250
東ソー	9,700	1,793.50	17,396,950
デンカ	3,000	2,428.00	7,284,000
カネカ	1,800	3,510.00	6,318,000
三井化学	6,400	4,310.00	27,584,000
J S R	6,600	4,019.00	26,525,400
東京応化工業	1,200	9,205.00	11,046,000
三菱ケミカルグループ	47,800	938.50	44,860,300
ダイセル	8,600	1,338.00	11,506,800
積水化学工業	14,400	2,024.50	29,152,800
U B E	3,400	2,241.50	7,621,100
日本化薬	4,800	1,353.50	6,496,800
花王	17,400	5,852.00	101,824,800
日本ペイントホールディングス	35,400	1,111.00	39,329,400
関西ペイント	6,700	2,360.00	15,812,000
D I C	2,800	2,554.00	7,151,200
富士フイルムホールディングス	13,900	8,705.00	120,999,500
資生堂	14,900	4,073.00	60,687,700
ライオン	8,700	1,317.50	11,462,250
日東電工	5,400	10,610.00	57,294,000
信越ポリマー	1,500	1,572.00	2,358,000

ニフコ	2,800	3,524.00	9,867,200
ユニ・チャーム	15,100	4,938.00	74,563,800
協和キリン	10,100	2,384.00	24,078,400
アステラス製薬	67,500	1,672.00	112,860,000
塩野義製薬	9,800	6,955.00	68,159,000
エーザイ	9,400	7,070.00	66,458,000
小野薬品工業	14,500	2,503.50	36,300,750
第一三共	69,000	3,911.00	269,859,000
E N E O Sホールディングス	107,500	562.30	60,447,250
ブリヂストン	21,300	5,940.00	126,522,000
住友理工	1,400	1,031.00	1,443,400
太平洋セメント	4,300	2,699.00	11,605,700
東海カーボン	7,600	1,033.00	7,850,800
T O T O	5,000	3,689.00	18,445,000
日本特殊陶業	5,700	3,293.00	18,770,100
日本製鉄	31,900	3,199.00	102,048,100
神戸製鋼所	13,300	1,722.00	22,902,600
J F Eホールディングス	21,500	2,166.00	46,569,000
日本軽金属ホールディングス	2,100	1,691.00	3,551,100
三井金属鉱業	2,000	4,340.00	8,680,000
三菱マテリアル	4,700	2,438.50	11,460,950
住友金属鉱山	9,200	4,279.00	39,366,800
D O W Aホールディングス	2,000	5,078.00	10,156,000
U A C J	1,300	3,780.00	4,914,000
L I X I L	10,700	1,726.00	18,468,200
三浦工業	3,300	2,808.00	9,266,400
アマダ	12,700	1,482.50	18,827,750
ナブテスコ	4,100	2,831.00	11,607,100
小松製作所	34,500	3,756.00	129,582,000
日立建機	4,000	3,756.00	15,024,000
クボタ	37,500	2,125.50	79,706,250
荏原製作所	3,400	8,609.00	29,270,600
ダイキン工業	9,800	22,930.00	224,714,000
栗田工業	3,900	5,472.00	21,340,800
ダイフク	11,300	2,892.50	32,685,250
グローリー	1,500	2,811.50	4,217,250
セガサミーホールディングス	5,900	1,954.50	11,531,550
N T N	14,900	263.10	3,920,190
日立造船	6,000	913.00	5,478,000
三菱重工業	12,000	7,881.00	94,572,000
I H I	5,200	2,617.00	13,608,400
イビデン	4,200	7,820.00	32,844,000

コニカミノルタ	16,900	415.30	7,018,570
ブラザー工業	8,700	2,356.00	20,497,200
日立製作所	34,600	9,933.00	343,681,800
富士電機	4,700	6,126.00	28,792,200
安川電機	9,000	5,860.00	52,740,000
オムロン	6,500	6,392.00	41,548,000
日本電気	9,200	8,183.00	75,283,600
富士通	6,600	20,680.00	136,488,000
ルネサスエレクトロニクス	54,800	2,579.50	141,356,600
セイコーエプソン	10,800	2,072.00	22,377,600
アルバック	1,700	6,746.00	11,468,200
パナソニック ホールディングス	82,400	1,390.50	114,577,200
シャープ	9,700	1,011.50	9,811,550
アンリツ	5,100	1,301.00	6,635,100
ソニーグループ	47,100	13,155.00	619,600,500
T D K	14,500	6,805.00	98,672,500
アルプスアルパイン	7,000	1,231.50	8,620,500
横河電機	8,500	2,764.00	23,494,000
アズビル	4,300	4,707.00	20,240,100
アドバンテスト	28,600	4,986.00	142,599,600
シスメックス	6,300	7,931.00	49,965,300
スタンレー電気	4,800	2,641.50	12,679,200
ファナック	35,600	4,187.00	149,057,200
太陽誘電	4,400	3,662.00	16,112,800
村田製作所	64,300	2,833.00	182,161,900
リコー	20,500	1,069.50	21,924,750
東京エレクトロン	17,600	25,255.00	444,488,000
川崎重工業	5,600	3,064.00	17,158,400
トヨタ自動車	395,800	2,644.00	1,046,495,200
ヤマハ発動機	11,100	3,906.00	43,356,600
島津製作所	8,800	3,956.00	34,812,800
ニコン	11,100	1,396.00	15,495,600
H O Y A	13,200	17,255.00	227,766,000
ノーリツ鋼機	700	2,959.00	2,071,300
前田工織	700	3,030.00	2,121,000
大日本印刷	7,600	4,270.00	32,452,000
N I S S H A	1,400	1,455.00	2,037,000
アシックス	6,000	4,861.00	29,166,000
ヤマハ	4,900	3,261.00	15,978,900
リンテック	1,400	2,709.00	3,792,600
任天堂	38,800	6,965.00	270,242,000
コクヨ	2,900	2,277.50	6,604,750

美津濃	600	3,910.00	2,346,000
東北電力	16,900	931.80	15,747,420
九州電力	15,000	985.60	14,784,000
電源開発	5,500	2,237.50	12,306,250
レノバ	1,500	1,079.00	1,618,500
東京瓦斯	13,800	3,346.00	46,174,800
大阪瓦斯	14,000	2,921.00	40,894,000
東邦瓦斯	2,700	2,699.50	7,288,650
西部ガスホールディングス	900	1,885.00	1,696,500
東武鉄道	7,000	3,719.00	26,033,000
相鉄ホールディングス	2,900	2,696.50	7,819,850
東急	18,700	1,680.00	31,416,000
京王電鉄	3,800	4,263.00	16,199,400
西日本旅客鉄道	8,200	5,746.00	47,117,200
西武ホールディングス	9,100	1,910.00	17,381,000
西日本鉄道	2,200	2,368.00	5,209,600
阪急阪神ホールディングス	8,500	4,454.00	37,859,000
南海電気鉄道	3,800	2,808.00	10,670,400
京阪ホールディングス	3,800	3,641.00	13,835,800
名古屋鉄道	7,000	2,194.50	15,361,500
ヤマトホールディングス	9,900	2,649.00	26,225,100
山九	1,800	5,061.00	9,109,800
センコーグループホールディングス	4,100	1,099.00	4,505,900
九州旅客鉄道	5,000	3,081.00	15,405,000
S Gホールディングス	12,000	2,018.50	24,222,000
日本郵船	18,100	4,333.00	78,427,300
A N Aホールディングス	6,000	3,054.00	18,324,000
トランコム	300	7,340.00	2,202,000
T I S	8,200	3,036.00	24,895,200
S H I F T	500	35,280.00	17,640,000
ティーガイア	600	1,871.00	1,122,600
マネーフォワード	1,600	4,181.00	6,689,600
野村総合研究所	14,400	4,068.00	58,579,200
メルカリ	4,300	2,659.50	11,435,850
フリー	1,600	2,973.00	4,756,800
L I N Eヤフー	99,700	478.30	47,686,510
ネットワンシステムズ	3,100	2,367.50	7,339,250
B I P R O G Y	2,900	4,234.00	12,278,600
K D D I	55,900	4,434.00	247,860,600
ソフトバンク	107,300	1,715.50	184,073,150
S C S K	5,800	2,736.50	15,871,700
双日	8,400	3,211.00	26,972,400



ＴＯＫＡＩホールディングス	3,600	945.00	3,402,000
アズワン	1,100	5,373.00	5,910,300
伊藤忠商事	44,400	5,834.00	259,029,600
丸紅	53,500	2,249.50	120,348,250
キヤノンマーケティングジャパン	1,700	4,046.00	6,878,200
伊藤忠エネクス	2,000	1,568.00	3,136,000
ローソン	1,700	7,121.00	12,105,700
ゲオホールディングス	900	2,132.00	1,918,800
アダストリア	900	3,625.00	3,262,500
ジーンズホールディングス	500	4,660.00	2,330,000
J．フロント リテイリング	9,100	1,306.00	11,884,600
マツキヨココカラ&カンパニー	12,800	2,466.00	31,564,800
Z O Z O	5,200	3,181.00	16,541,200
三越伊勢丹ホールディングス	12,600	1,520.50	19,158,300
オイシックス・ラ・大地	1,000	1,341.00	1,341,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,000	1,004.00	2,008,000
イオン北海道	1,600	907.00	1,451,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	14,200	3,356.00	47,655,200
スギホールディングス	1,300	6,128.00	7,966,400
日本瓦斯	3,900	2,277.50	8,882,250
マックスバリュ東海	400	2,910.00	1,164,000
丸井グループ	6,600	2,373.00	15,661,800
イオン	24,400	3,143.00	76,689,200
ヤオコー	700	8,077.00	5,653,900
ケーズホールディングス	5,200	1,317.00	6,848,400
ヤマダホールディングス	21,700	428.10	9,289,770
ファーストリテイリング	6,500	37,340.00	242,710,000
りそなホールディングス	79,300	708.40	56,176,120
三井住友トラスト・ホールディングス	12,200	5,256.00	64,123,200
三井住友フィナンシャルグループ	47,400	6,703.00	317,722,200
みずほフィナンシャルグループ	90,000	2,350.00	211,500,000
大和証券グループ本社	49,800	966.80	48,146,640
野村ホールディングス	112,200	645.40	72,413,880
S O M P Oホールディングス	11,000	6,831.00	75,141,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	16,000	5,440.00	87,040,000
東京海上ホールディングス	67,300	3,521.00	236,963,300
T & Dホールディングス	18,700	2,180.00	40,766,000
東京センチュリー	1,400	6,033.00	8,446,200
オリックス	43,800	2,678.00	117,296,400
ヒューリック	14,300	1,481.50	21,185,450

野村不動産ホールディングス	4,100	3,669.00	15,042,900	
東急不動産ホールディングス	22,800	908.90	20,722,920	
三井不動産	33,200	3,491.00	115,901,200	
三菱地所	42,000	1,984.00	83,328,000	
東京建物	7,000	2,065.50	14,458,500	
住友不動産	10,700	4,341.00	46,448,700	
パーソルホールディングス	69,600	230.40	16,035,840	
H・U・グループホールディングス	2,000	2,622.00	5,244,000	
オリエンタルランド	40,700	5,309.00	216,076,300	
ダスキン	1,500	3,313.00	4,969,500	
リゾートトラスト	2,800	2,407.50	6,741,000	
ビー・エム・エル	800	2,962.00	2,369,600	
ユー・エス・エス	7,700	2,796.50	21,533,050	
楽天グループ	55,900	576.60	32,231,940	
テクノプロ・ホールディングス	4,000	3,658.00	14,632,000	
リクルートホールディングス	53,800	5,919.00	318,442,200	
エラン	1,100	1,112.00	1,223,200	
インソース	1,900	860.00	1,634,000	
カーブスホールディングス	1,900	624.00	1,185,600	
LITALICO	800	2,048.00	1,638,400	
乃村工藝社	2,900	842.00	2,441,800	
セコム	7,800	10,190.00	79,482,000	
ベネッセホールディングス	2,500	2,630.00	6,575,000	
合計	3,964,600		12,446,616,540	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	57	7,888,800	
	積水ハウス・リート投資法人	155	12,477,500	
	日本ビルファンド投資法人	57	34,770,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	48	27,648,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	104	14,830,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	33	9,183,900	
合計		454	106,798,600	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## マネープールマザーファンド

## 貸借対照表

	2023年12月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	222,217,176,499
流動資産合計	222,217,176,499
資産合計	222,217,176,499
負債の部	
流動負債	
未払解約金	930
未払利息	79,145
その他未払費用	15
流動負債合計	80,090
負債合計	80,090
純資産の部	
元本等	
元本	222,083,264,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	133,831,642
元本等合計	222,217,096,409
純資産合計	222,217,096,409
負債純資産合計	222,217,176,499

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	222,083,264,767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 1.0006円 (1万口当たり純資産額) (10,006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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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	2023年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年12月21日
期首元本額	331,700,391,948円
期中追加設定元本額	206,013,794,562円
期中一部解約元本額	315,630,921,743円
期末元本額	222,083,264,767円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9,963円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,992,033円
バンクローン・オープン（円コース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（豪ドルコース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（米ドルコース）（SMA専用）	9,961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	9,961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	9,961円
MLP関連証券ファンド（為替ヘッジあり）	49,791円
MLP関連証券ファンド（為替ヘッジなし）	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド（SMA専用）	9,957円
バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	19,911円
バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	696,865円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,952円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジーノSMARS（SMA専用）	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,990円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円

区分	2023年12月20日現在
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド(SMA専用)	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(年2回決算型)	9,990円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(奇数月決算型)	9,994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(奇数月決算型)	9,994円
オーストラリア公社債ファンド(奇数月決算型)	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(奇数月決算型)	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(奇数月決算型)	9,995円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド(適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
225ベアファンド6(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	298,332,775円
225ベアファンド7(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	1,790,923,699円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド(適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
TOPIXベアファンド2(建玉比率非調整型)(適格機関投資家専用)	1,564,762,066円
TOPIXベアファンドR(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	6,076,003,660円
225ベアファンド8(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	4,111,843,915円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド(適格機関投資家専用)	7,042,915,026円
225ベアファンド10(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	2,196,843,214円
TOPIXベアファンドR2(建玉比率非調整型/リセット型)(適格機関投資家専用)	22,126,405,859円
TOPIXベアファンドF2(建玉数量固定型/リセットあり)(適格機関投資家専用)	29,984,348,102円
TOPIXベアファンドF3(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	13,350,760,490円
リスクプレミア ファンド(適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
TOPIXベアファンドF4(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	19,193,884,540円
TOPIXベアファンドF5(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	15,283,093,910円
TOPIXベアファンドF6(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	14,207,510,680円
TOPIXベアファンドF7(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	11,569,885,014円
TOPIXベアファンドF8(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	14,267,456,713円
TOPIXベアファンドF9(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	20,952,134,762円
TOPIXベアファンドF10(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	19,600,709,531円
TOPIXベアファンドF11(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,790円
TOPIXベアファンドF12(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF13(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF14(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
私募マネープールファンドAL(適格機関投資家専用)	161,010,775円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【中間財務諸表】**

- (1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2023年12月21日から2024年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2023年12月20日現在）	第10期中間計算期間 （2024年 6月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,795,849,990	3,726,435,184
投資信託受益証券	123,913,255,193	156,653,394,134
親投資信託受益証券	67,127,123,773	66,916,699,171
未収利息	-	6,761
流動資産合計	193,836,228,956	227,296,535,250
資産合計		
	193,836,228,956	227,296,535,250
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	179,715,401	183,465,024
未払受託者報酬	30,283,666	35,605,007
未払委託者報酬	524,916,896	617,153,295
未払利息	995	-
その他未払費用	1,249,134	1,335,825
流動負債合計	736,166,092	837,559,151
負債合計		
	736,166,092	837,559,151
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	99,538,421,680	97,825,857,311
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	93,561,641,184	128,633,118,788
（分配準備積立金）	49,461,251,446	41,532,345,263
元本等合計	193,100,062,864	226,458,976,099
純資産合計		
	193,100,062,864	226,458,976,099
負債純資産合計		
	193,836,228,956	227,296,535,250



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第9期中間計算期間 自 2022年12月21日 至 2023年 6月20日	第10期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年 6月20日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	143,226,384	229,982,802
受取利息	4,772	719,577
有価証券売買等損益	31,815,352,515	37,685,760,992
<b>営業収益合計</b>	<b>31,958,583,671</b>	<b>37,916,463,371</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	432,712	100,750
受託者報酬	27,231,500	35,605,007
委託者報酬	472,012,597	617,153,295
その他費用	1,194,194	1,335,825
<b>営業費用合計</b>	<b>500,871,003</b>	<b>654,194,877</b>
営業利益又は営業損失（ ）	31,457,712,668	37,262,268,494
経常利益又は経常損失（ ）	31,457,712,668	37,262,268,494
中間純利益又は中間純損失（ ）	31,457,712,668	37,262,268,494
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,055,689,417	4,636,597,673
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	54,893,611,371	93,561,641,184
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,811,898,617	18,766,543,080
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,811,898,617	18,766,543,080
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,974,881,061	16,320,736,297
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,974,881,061	16,320,736,297
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	86,132,652,178	128,633,118,788

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （中間貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2023年12月20日現在)	第10期中間計算期間 (2024年 6月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,538,421,680口	97,825,857,311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) 1.9400円 (19,400円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3149円 (23,149円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	第10期中間計算期間 (2024年 6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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。

## （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9期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日	第10期中間計算期間 自 2023年12月21日 至 2024年 6月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	99,862,852,287円	99,538,421,680円
期中追加設定元本額	26,608,308,961円	15,397,226,633円
期中一部解約元本額	26,932,739,568円	17,109,791,002円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 6月20日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	6,861,780,475
株式	651,065,029,140
派生商品評価勘定	5,697,350
未収配当金	3,828,590,472
未収利息	12,450
前払金	193,493,500
差入委託証拠金	462,122,652
流動資産合計	662,416,726,039
資産合計	662,416,726,039
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	199,397,650
未払解約金	857,821,334
流動負債合計	1,057,218,984
負債合計	1,057,218,984
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	233,720,763,388
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	427,638,743,667
元本等合計	661,359,507,055
純資産合計	661,359,507,055
負債純資産合計	662,416,726,039

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6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）

		2024年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		233,720,763,388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)	2.8297円 (28,297円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 6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。	

## (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	2024年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	243,831,636,576円
期中追加設定元本額	12,796,534,761円
期中一部解約元本額	22,907,407,949円
期末元本額	233,720,763,388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)	251,364,114円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,263,004,514円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,595,712円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,423,693,130円
世界経済インデックスファンド	6,162,859,290円
日本株式インデックス・オープン	2,799,039,803円
DCマイセクション25	4,617,157,036円
DCマイセクション50	15,497,385,338円
DCマイセクション75	17,876,737,371円
DC日本株式インデックス・オープン	5,989,218,276円
DCマイセクションS25	2,879,530,523円
DCマイセクションS50	9,174,836,830円
DCマイセクションS75	8,638,248,601円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,541,910,118円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,638,309円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	553,121,942円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	453,367,896円
DC世界経済インデックスファンド	4,008,193,586円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	397,803,858円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,269,905円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,300,182円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,243,691円

区分	2024年 6月20日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	88,465,678円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	11,956,624円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	58,961,720円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,994,838円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,851,120円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	395,788,974円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	287,247,671円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,952,428,645円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,917,567円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,406,067円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	284,731,975円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	159,845,482円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	202,759,080円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,798,344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）	359,027,908円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,364,121,693円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,895,367,505円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,366,846円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	666,473,174円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	415,678,113円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	187,624,955円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,639,242円
SMT インデックスバランス・オープン	50,062,346円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,796,901,083円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	194,507,065円
SMT 世界経済インデックス・オープン	53,306,262円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	245,844,252円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,067,616円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,128,254円
グローバル経済コア	290,106,138円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,713,087円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,321,729,623円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,978,045円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,281,238円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	125,410,997円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	64,871,223円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	63,782,926円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	27,932,983円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	35,333,019円
10資産分散投資ファンド	113,723,354円
グローバル10資産バランスファンド	36,895,176円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	240,951円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	31,734円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	34,978円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	37,585円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	37,585円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	34,970円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,495円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	17,859円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,076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）	41,802,449,381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）	239,440,438円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	294,580,696円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	24,462,088円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	101,811,260円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	48,854,620,824円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,013,646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）	206,731,546円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 6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	10,439,493,500	-	10,246,000,000	193,493,500
合計		10,439,493,500	-	10,246,000,000	193,493,500

## （注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 6月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	146,809,010
株式	14,345,491,570
投資証券	67,320,400
派生商品評価勘定	172,180
未収配当金	65,357,428
未収利息	266
前払金	2,203,350
差入委託証拠金	10,584,987
流動資産合計	14,637,939,191
資産合計	14,637,939,191
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,380,458
未払金	1,461,024
未払解約金	3,217
流動負債合計	3,844,699
負債合計	3,844,699
純資産の部	
元本等	
元本	9,400,722,569
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,233,371,923
元本等合計	14,634,094,492
純資産合計	14,634,094,492
負債純資産合計	14,637,939,191

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

2024年 6月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 6月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,400,722,569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 1.5567円 (1万口当たり純資産額) (15,567円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年 6月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2023年12月21日

区分	2024年 6月20日現在
期首元本額	9,690,665,416円
期中追加設定元本額	849,097,537円
期中一部解約元本額	1,139,040,384円
期末元本額	9,400,722,569円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	170,318,012円
コア投資戦略ファンド（成長型）	402,453,080円
コア投資戦略ファンド（切替型）	174,495,740円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	7,033,816,504円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	91,891,240円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	148,948,821円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	38,162,596円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,222,775,423円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	49,607,196円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	68,253,957円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 6月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	154,803,350	-	152,600,000	2,203,350
合計		154,803,350	-	152,600,000	2,203,350

## （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。

## 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2024年 6月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	302,938,378
株式	45,540,455,500
未収配当金	162,674,250
未収利息	549
流動資産合計	46,006,068,677
資産合計	46,006,068,677
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,651,889
流動負債合計	20,651,889
負債合計	20,651,889
純資産の部	
元本等	
元本	7,475,586,260
剰余金	



2024年 6月20日現在	
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	38,509,830,528
元本等合計	45,985,416,788
純資産合計	45,985,416,788
負債純資産合計	46,006,068,677

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 6月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 6月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,475,586,260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 6.1514円 (1万口当たり純資産額) (61,514円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2024年 6月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （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	2024年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	5,363,180,694円
期中追加設定元本額	2,339,957,283円
期中一部解約元本額	227,551,717円
期末元本額	7,475,586,260円
期末元本額の内訳	
DC日本株式エクセレント・フォーカス	5,227,652,122円
コア投資戦略ファンド（安定型）	42,840,268円
コア投資戦略ファンド（成長型）	102,221,317円
コア投資戦略ファンド（切替型）	44,672,869円

区分	2024年 6月20日現在
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,831,559,656円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	22,831,938円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	38,560,441円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	9,815,095円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	139,506,904円
F O F s 用 日本株式エクセレント・フォーカスS（適格機関投資家専用）	15,731,509円
日本株式エクセレント・フォーカスVA（適格機関投資家専用）	194,141円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## マネープールマザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	74,326,285,383
国債証券	84,928,060,000
未収利息	134,866
流動資産合計	159,254,480,249
資産合計	159,254,480,249
負債の部	
流動負債	
未払解約金	485
流動負債合計	485
負債合計	485
純資産の部	
元本等	
元本	159,138,028,299
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	116,451,465
元本等合計	159,254,479,764
純資産合計	159,254,479,764
負債純資産合計	159,254,480,249

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 6月20日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	159,138,028,299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 1.0007円 (1万口当たり純資産額) (10,007円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6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。

2024年 6月20日現在	
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。

## (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	2024年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	222,083,264,767円
期中追加設定元本額	32,076,782,640円
期中一部解約元本額	95,022,019,108円
期末元本額	159,138,028,299円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコー ス)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコー ス)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)	105,486円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SUMI TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円

区分	2024年 6月20日現在
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(年1回決算型)	9,970円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド(SMA専用)	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(資産成長型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド(年2回決算型)	9,990円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(奇数月決算型)	9,994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(奇数月決算型)	9,994円
オーストラリア公社債ファンド(奇数月決算型)	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり(奇数月決算型)	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし(奇数月決算型)	9,995円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド(予想分配金提示型・奇数月決算型)	9,995円
スマート・コントロール 世界株式戦略ファンド	9,996円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド(適格機関投資家専用)	24,620,823,586円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド(適格機関投資家専用)	2,972,540,925円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド(適格機関投資家専用)	14,046,281,498円
TOPIXベアファンドF3(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	11,190,342,042円
リスクプレミア ファンド(適格機関投資家専用)	2,995,805,872円
TOPIXベアファンドF4(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	16,409,584,935円
TOPIXベアファンドF5(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	12,283,806,498円
TOPIXベアファンドF6(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	11,816,962,633円
TOPIXベアファンドF7(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	9,661,941,606円
TOPIXベアファンドF8(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	12,211,261,001円
TOPIXベアファンドF9(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	17,881,774,675円
TOPIXベアファンドF10(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	16,782,484,602円
TOPIXベアファンドF11(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	5,988,905,090円
TOPIXベアファンドF12(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF13(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
TOPIXベアファンドF14(建玉数量固定型/リセットありZ)(適格機関投資家専用)	299,821円
米国国債ベアファンド(建玉比率非調整型Z)(適格機関投資家専用)	299,821円
私募マネーボールファンドAL(適格機関投資家専用)	249,529,898円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

## 【純資産額計算書】

（2024年 7月31日現在）

資産総額	230,297,004,251円
負債総額	415,325,893円
純資産総額（ - ）	229,881,678,358円
発行済口数	98,183,386,700口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3414円
（1万口当たり純資産額）	（23,414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

（2024年 7月31日現在）

資産総額	684,311,213,582円
負債総額	4,393,229,624円
純資産総額（ - ）	679,917,983,958円
発行済口数	234,096,075,039口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9044円
（1万口当たり純資産額）	（29,044円）

## 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 7月31日現在）

資産総額	15,082,369,915円
負債総額	6,724,472円
純資産総額（ - ）	15,075,645,443円
発行済口数	9,445,186,783口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5961円
（1万口当たり純資産額）	（15,961円）

## 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 7月31日現在）

資産総額	46,836,295,219円
負債総額	27,502,677円
純資産総額（ - ）	46,808,792,542円
発行済口数	7,456,246,309口

1口当たり純資産額（ / ）	6.2778円
（1万口当たり純資産額）	（62,778円）

## マネープールマザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 7月31日現在）

資産総額	176,306,674,085円
負債総額	2,057円
純資産総額（ - ）	176,306,672,028円
発行済口数	176,234,717,624口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0004円
（1万口当たり純資産額）	（10,004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、

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ます。）に支払います。

### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年 7月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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 9月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	531	15,325,601
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	212,279
単体型公社債投資信託	52	172,995
合計	645	15,710,875

## 3【委託会社等の経理状況】

- 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。  
なお、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。
- 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、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 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。

## (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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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  
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

## (リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8・ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

## 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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（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)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024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)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(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(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)
店頭	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。

当事業年度(2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	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) 株式関連

前事業年度(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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(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（2023年3月31日）

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		1,729	-	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

当事業年度（2024年3月31日）

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		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

### (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券届出書（内国投資信託受益証券）	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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、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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	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9月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024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） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2) 販売会社

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

## 3 【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2024年3月末日現在）

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

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

## 第3 【その他】

(1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
- ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
- 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
- ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月3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**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2024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

2024年2月29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 中島紀子

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2022年12月21日から2023年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2023年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年9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 中島紀子

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2023年12月21日から2024年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2024年6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中間計算期間（2023年12月21日から2024年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。