【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10月11日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	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】	ＳＭＴ　ＥＴＦカーボン・エフィシェント日本株
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町２番１号

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＳＭＴ　ＥＴＦカーボン・エフィシェント日本株

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。

②当初元本は、1口当たり25,088円とします。

③三井住友トラスト・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。

④当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

販売会社が定める申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を取得申込者から徴収できるものとします。

申込手数料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「（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。

（6）【申込単位】

1ユニット以上1ユニット単位

※「ユニット」とは、S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数（配当込み）（以下「対象株価指数」ということがあります。）を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象株価指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオをいいます。委託会社は、取得申込日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用されるユニットの銘柄及び株数を決定し、販売会社に提示します。取得申込みに係る口数は、委託会社が定めるものとし、1口の整数倍とします。

（７）【申込期間】

2024年10月12日から2025年 4月11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】

販売会社においてお申込みを取り扱います。

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、原則としてその保有する株式等を販売会社に引き渡すものとします。継続申込みに係る発行価額の総額に相当する株式等は、追加信託が行われる日に、販売会社（金融商品取引清算機関（金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下「清算機関」※といいます。）の業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる株式及び金銭の委託会社への受渡し又は支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、清算機関。以下本項において同じ。）により、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移管されます。株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社により、追加設定が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

※「清算機関」とは、株式会社日本証券クリアリング機構とします（以下同じ）。

（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したが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、償還金の支払い及び交換の請求は、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行われます。

＜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。

＜受付不可日＞

委託会社は、以下の各号に定める日には、受益権の取得申込みを受け付けないものとします。ただし、委託会社は、以下の各号に定める日における受益権の取得申込みであっても、投資信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、投資信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日及び期間における受益権の取得申込みについては、当該取得申込みの受付を行うことができます。

1. **対象株価指数の構成銘柄の配当落日及び権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間**
2. **対象株価指数の銘柄変更実施日及び銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間**
3. **計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間（ただし、計算期間終了日が休日（営業日でない日をいいます。）の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内）**
4. **当ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間**
5. **前各号のほか、委託会社が、投資信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき**

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場をいいます。以下同じ。）における取引の停止、決済機能の停止、投資信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると認めたとき、又はその他やむを得ない事情があるときは、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、S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数（配当込み）に採用されている銘柄（採用が決定された銘柄を含みます。以下同じ。）の株式に投資し、基準価額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目的として運用を行います。

＜信託の限度額＞

2兆円相当の有価証券及び金銭を上限とします。

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

■株式 ■一般 ■大型株 ■中小型株 ■債券 ■一般 ■公債 ■社債 ■その他債券 ■クレジット属性 （　　） ■不動産投信 ■その他資産 （　　） ■資産複合 （　　） ■資産配分固定型 ■資産配分変更型	■年1回 ■年2回 ■年4回 ■年6回（隔月） ■年12回（毎月） ■日々 ■その他（　　）	■グローバル ■日本 ■北米 ■欧州 ■アジア ■オセアニア ■中南米 ■アフリカ ■中近東（中東） ■エマージング	■ファミリーファンド ■ファンド・オブ・ファンズ	■あり（　　） ■なし	■日経225 ■ＴＯＰＩＸ ■その他（　S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数（配当込み）） ■	■ブル・ベア型 ■条件付運用型 ■ロング・ショート型/絶対収益追求型 ■その他（　　）

（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

①一般…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。

②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②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、為替のヘッジを行な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、仕組債への投資又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投信です。

＜ファンドの特色＞

1. 対象株価指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

●対象株価指数は、構成銘柄やウエイト決定にあたりESG*を主要な要素としています。
*ESG:「Environment(環境)」「Social(社会)」「Governance(企業統治)」の頭文字をとったもの。

●株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。また対象株価指数に含まれない銘柄には原則として投資しません。

●投資信託財産の1口当たりの純資産総額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目的として、対象株価指数に採用されている銘柄の株式に投資します。

●投資信託財産に占める個別銘柄の株数の比率は、対象株価指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

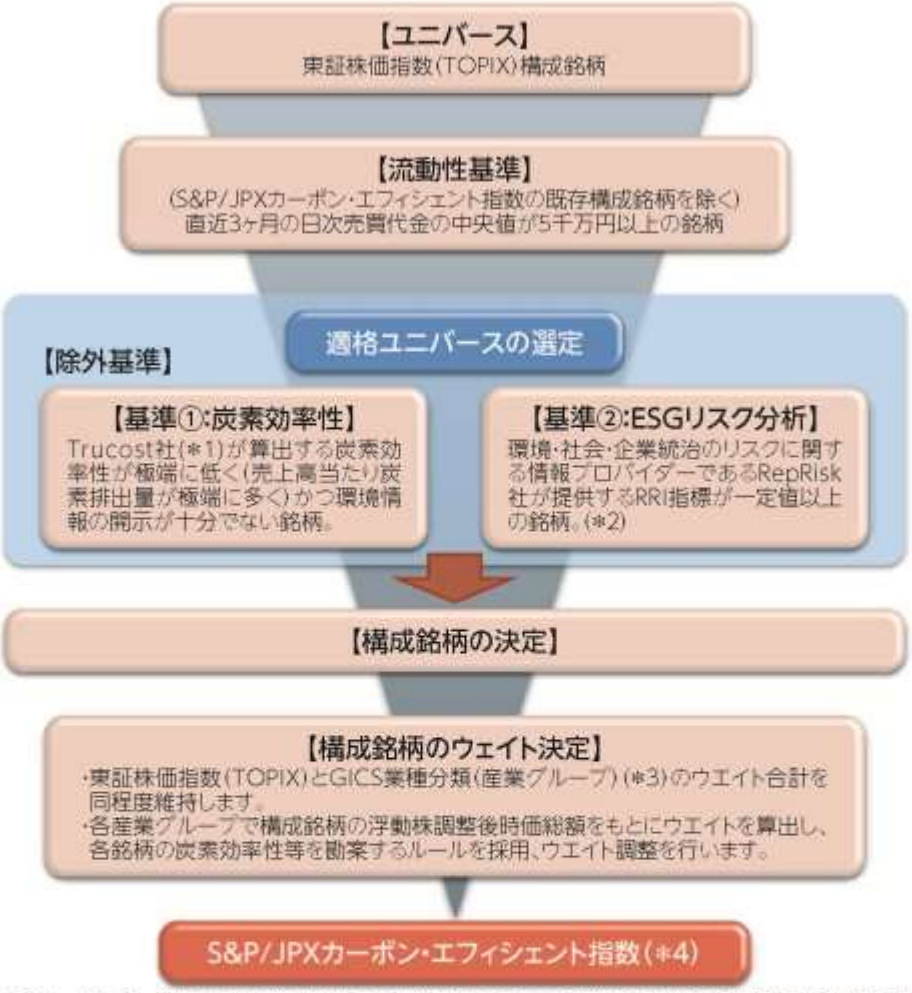
●対象株価指数に連動する投資成果を目指すため、対象株価指数に採用されている銘柄の株式に投資を行った場合と同様の損益を実現する目的で、補完的に対象株価指数又はその他のわが国の株価指数を対象とした先物取引の買建を行うことがあります。

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

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

「S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数」について

【指数構築プロセス】



※1 TrucostはS&Pグローバルの一部門であり、炭素排出量や環境に関するデータ提供や気候変動や天然資源の制約、広範なESG要因に関連するリスクを評価している大手調査会社です。
※2 ESGリスクに関するビジネス情報の大手プロバイダーであるRepRiskが、経済的な犯罪、汚職、詐欺、違法な商慣行、人権問題、労働争議、職場の安全性、大惨事の事故、環境災害など論争の的になる問題に関して企業を分析し、指標化したものです。この指標が一定数値以上となった場合、その企業はリスクがあるとされます。
※3 「GICS」は「Global Industry Classification Standard」の略で、S&P社とMSCI社が共同開発した産業分類です。世界の産業を「セクター」、「産業グループ」、「産業」、「産業サブグループ」の4階層で分類しており、S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数では「産業グループ」が用いられています。
※4 環境情報の開示を十分に行っている企業や炭素効率性の高い(売上高当たり炭素排出量が少ない)企業のウエイトを引き上げるなどのルールを採用することで、市場全体の環境に関する取り組み、情報開示を促し、株式市場の活性化を目指しています。

ベンチマークとして選定した理由

・東証株価指数(TOPIX)と非常に近いリスク・リターン特性を持ち、全世界の重要共通課題である気候変動の要因となる炭素排出量という関心・認知度の高い指標を対象とし環境改善が確認できる指数であること。炭素効率性に着目して、気候変動リスクを抑えながら企業の成長を後押しすることが期待できることで、投資家の潜在ニーズを捉えた指数であること。
・本指数の指数プロバイダーやESG調査会社の商品は、グローバルな機関投資家をはじめとして多くの投資家で利用されていること。

※S&P社、JPX社の資料に基づき、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が作成
※上記の内容については今後変更される可能性があります。

【指数構成銘柄のウエイト調整プロセス】

構成銘柄のウエイトを決定する際には、環境情報に関する情報開示が十分か、同業他社比での炭素効率性ランキング、産業グループの影響度等を考慮します。

①環境情報に関する開示状況 ・環境情報に関する開示が十分かどうか ・気候関連財務情報開示タスクフォース（TCFD）（*1）に準拠した開示が行われているか	・開示が十分な場合には企業はウエイトを引き上げる ・TCFDに準拠した開示が行われていると認められた場合にはさらにウエイトを引き上げる。
②炭素効率性 ・同一産業グループ内で炭素効率性に基づき十分位に分類（*2）	・炭素効率性が低い銘柄のウエイトを効率性が高い銘柄に移転させる
③産業グループの影響度 ・産業グループの中で、炭素効率性のばらつき度合いに応じて各産業のウエイトを3つのグループ（低・中・高）に分ける	・炭素効率性のばらつきの大きい産業はウエイトを引き上げる

本指数と東証株価指数（TOPIX）の産業グループごとのウエイト合計は同程度維持

*1 「TCFD」は「Task Force on Climate-related Financial Disclosures」の略で、G20財務大臣・中央銀行総裁会議の要請を受け、2015年に金融安定理事会（FSB）により、気候関連の情報開示及び気候変動への金融機関の対応を検討するために設立されました。企業が気候変動のリスク・機会を認識し経営戦略に織り込むことは、ESG投融資を行う機関投資家・金融機関が重視しており、TCFDの報告書においても、その重要性が言及されています。

*2 S&Pグローバル炭素基準により分類されます。この基準ではGICS産業グループの同業他社に対する各企業の売上高当たり炭素排出量や、GICS産業グループの同業他社内における売上高当たり炭素排出量の範囲を考慮します。また、企業の温室効果ガス排出量開示のクオリティも考慮します。

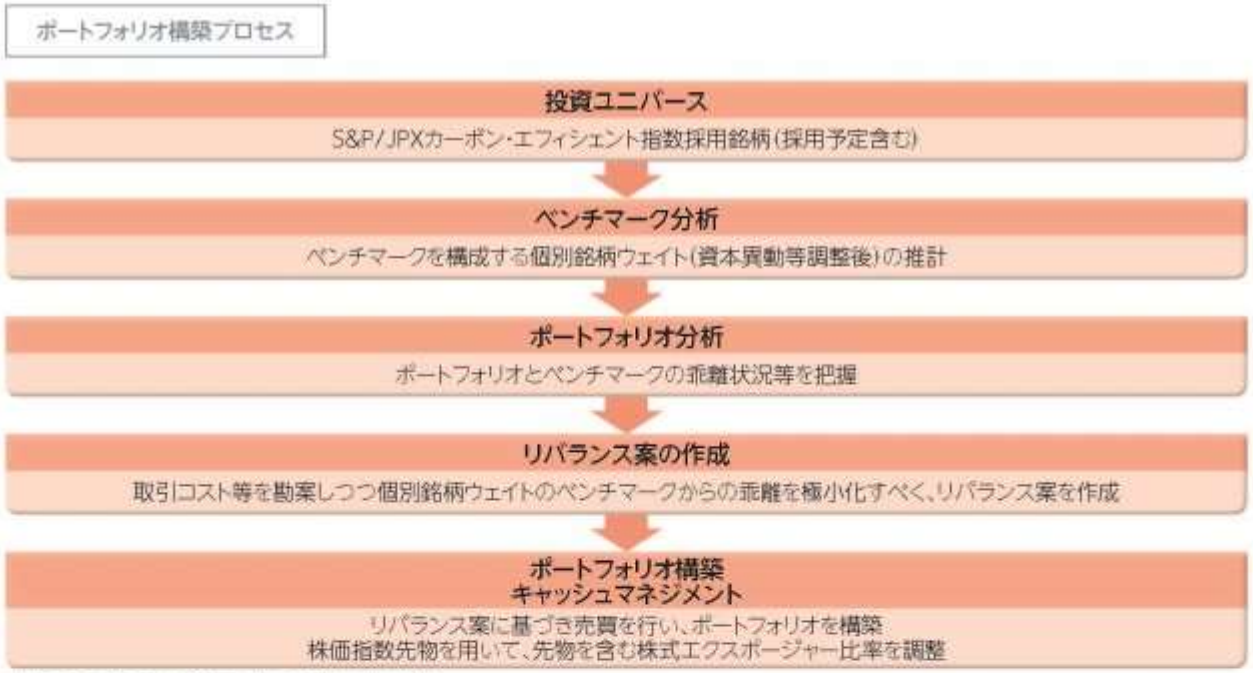
※S&P社、JPX社の資料に基づき、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が作成
※上記の内容については今後変更される可能性があります。

2. 上場投資信託（ETF）であり、通常の投資信託とは仕組みが異なります。

●受益権は、東京証券取引所に上場しており、株式と同様に売買可能です。
・売買単位は、1口単位です。
・取引方法は、原則として株式と同様です。

●追加設定は、株式により行います。
・追加設定に係る受益権の取得申込者は、ユニット（対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象株価指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ）単位で、株式による取得申込みを行うことができます。
・委託会社は、取得申込受付日に適用されるユニットの銘柄及び株数を決定し、販売会社に提示します。
・原則として、金銭による取得申込みはできません。

●受益権を株式と交換することができます。
・一定口数以上の受益権を保有する受益者は、当該受益権を当該受益権に相当する投資信託財産に属する株式と交換することができます。
・解約申込みにより、受益権を換金することはできません。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

「S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数」の著作権等について

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

分配方針

●年2回、毎決算時に分配方針に基づき分配を行います。
●経費等控除後の配当等収益の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
●売買益(評価益を含みます。)が生じても、分配は行いません。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

「S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数」（以下「当指数」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC又はその関連会社（以下「SPDJI」）ならびに株式会社ＪＰＸ総研（以下「ＪＰＸ総研」）及び株式会社日本取引所グループ（以下「ＪＰＸ」）の商品であり、これを利用するライセンスが三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「当社」）に付与されています。Standard & Poor's ®及びS&P ®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones ®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標です。また、JPXはＪＰＸ、TOPIXはＪＰＸ総研の商標です。これらの商標を利用するライセン

スがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。指数に直接投資することはできません。

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

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

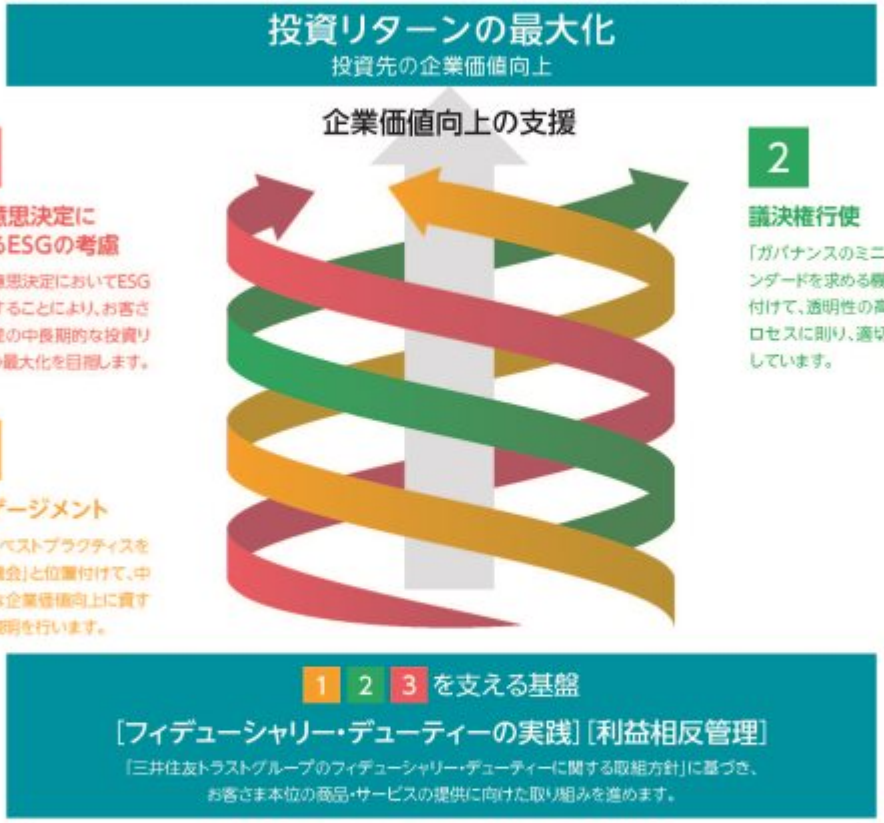
S&P Dow Jones Indices及びＪＰＸ総研は、これに含まれる過誤、遺漏又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indices及びＪＰＸ総研は、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的又は使用への適合性、もしくは当指数を使用することによって、又はそれに関連するデータに関して、当社、当社の商品の所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indices又はＪＰＸ総研は、利益の逸失、営業損失、時間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

<ご参考情報>

当社のスチュワードシップ活動

責任ある機関投資家として、投資リターンの最大化を目指します。スチュワードシップ活動は当ファンドのみならず当社の取り組みです。

当社は「責任ある機関投資家」として、エンゲージメント、議決権行使、投資の意思決定におけるESGの考慮を3つの柱としてスチュワードシップ活動を推進しています。投資先企業の企業価値向上に資するスチュワードシップ活動を行うことを通じ、お客さまからお預かりしている資産の中長期的な投資リターンの最大化を目指します。そして、その全ての基盤がフィデューシャリー・デューティーの実践です。当社は、スチュワードシップ活動に関する利益相反の適切な管理がフィデューシャリー・デューティーの向上につながると考え、利益相反管理を適切に行っております。



当社の責任ある機関投資家としての取り組みは
スマートフォンで左記コードを読み取るかアドレスを入力することで
ご確認いただけます。
https://www.smtam.jp/institutional/stewardship_initiatives/

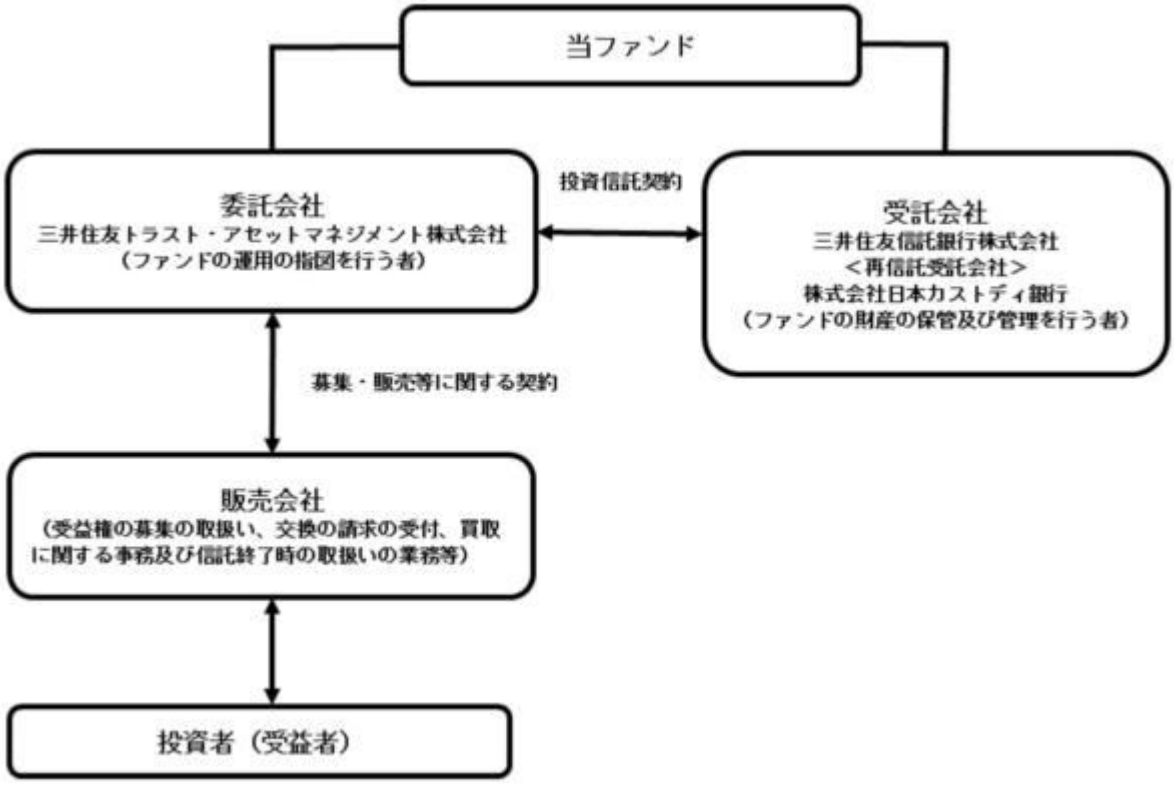
※上記内容は、今後変更になる場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2021年6月22日	**当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始**
2021年6月23日	**受益権を東京証券取引所に上場**

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2024年10月1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
三井住友トラストグループ株式会社	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】

①基本方針

当ファンドは、対象株価指数に採用されている銘柄の株式に投資し、基準価額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目的として運用を行います。

②投資対象

わが国の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）している株式のうち、対象株価指数に採用

されている銘柄の株式を投資対象とします。

③投資態度

イ．対象株価指数に採用されている銘柄の株式に投資し、基準価額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目指します。

ロ．次の場合等において、基準価額の変動率と対象株価指数の変動率の連動性を維持するために必要であると認めたときには、投資信託財産の構成を調整します。

・対象株価指数の計算方法が変更された場合もしくは当該変更が公表された場合

・対象株価指数における、その採用銘柄の変更又は資本異動等対象株価指数における個別銘柄の構成比率の修正が行われた場合もしくは当該修正が公表された場合

・追加信託又は交換が行われた場合

ハ．投資する株式は、金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）している銘柄のうち、対象株価指数に採用されている銘柄の株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。なお、対象株価指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案のうえ速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。

ニ．上記イ．にかかわらず、対象株価指数に連動する投資成果を目指すため、対象株価指数に採用されている銘柄の株式に投資を行った場合と同様の損益を実現する目的で、補完的に対象株価指数又はその他のわが国の株価指数を対象とした先物取引の買建を行うことがあります。

ホ．投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式を投資信託約款第24条の範囲内で貸付の指図を行うことがあります。

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

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

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

1.有価証券

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

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、投資信託財産を、株式に対する投資として運用することを指図します。

③金融商品の指図範囲

委託会社は、投資信託財産を、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

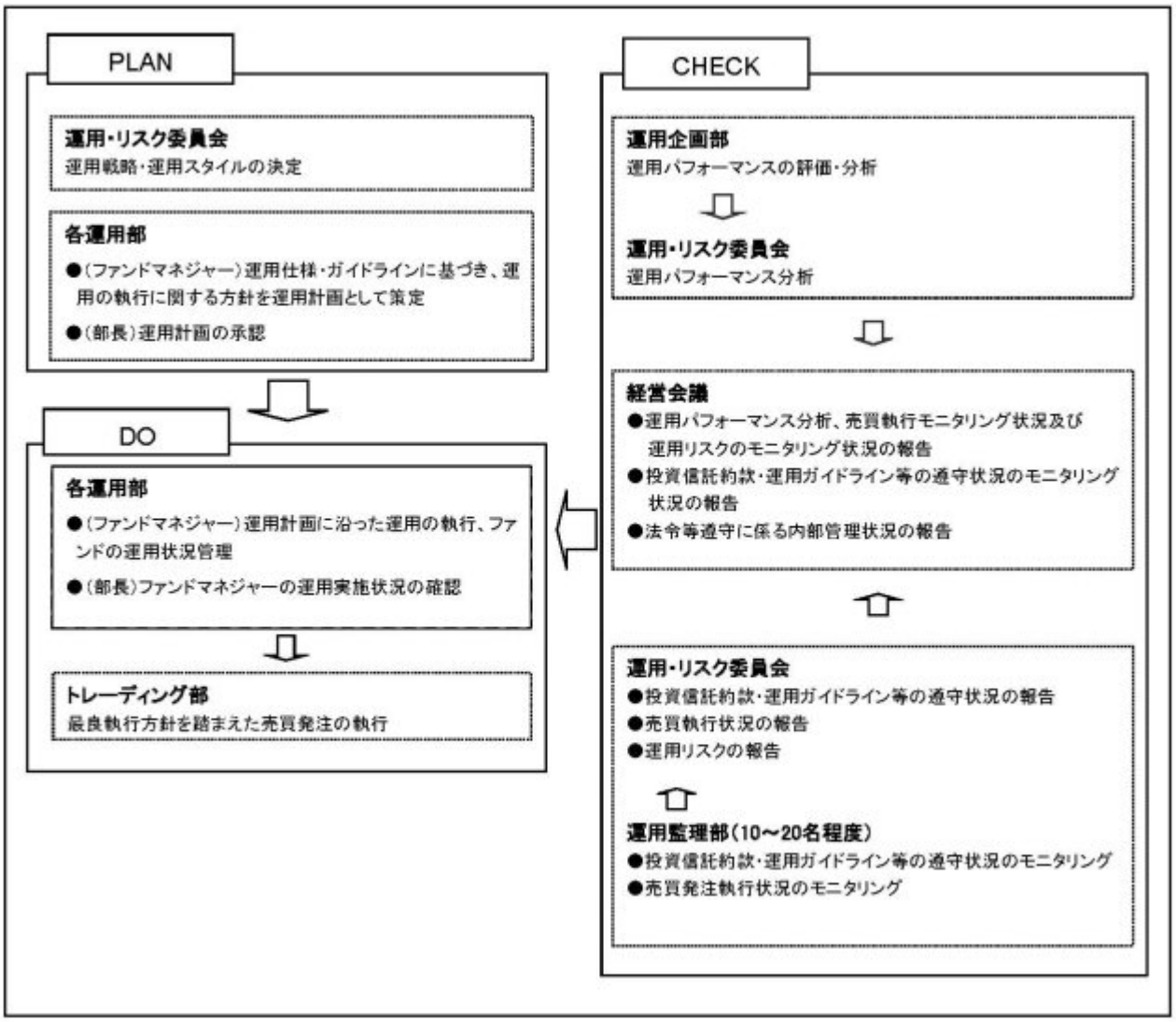
2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

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

（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2回、毎決算時に委託会社が経費等控除後の配当等収益（配当金、貸付株式に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

・売買益（評価益を含みます。）からの分配は行いません。
・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】

＜投資信託約款に定める投資制限＞

イ．株式への投資割合

株式への投資割合には制限を設けません。

ロ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

ハ．投資する株式の範囲

1.委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

2.上記1.の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ニ．先物取引等の運用指図

委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所における株価指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるもののうち、株価指数に係るものをいいます。）及び株価指数オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるもののうち、株価指数に係るものをいいます。）並びに外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定するものをいい、当該市場を開設するものを含みます。）におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします。

ホ．株式の貸付の指図、目的及び範囲

1.委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式を、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸付の指図をすることができます。

2.上記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3.委託会社は、株式の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヘ．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。

ト．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。

＜関連法令に基づく投資制限＞

同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託に

つき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の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。

①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。

②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。

③有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、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ます。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

④ESGの投資リスク

ファンドは、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。

⑤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＞

①対象株価指数と基準価額の乖離について

ファンドは、基準価額の変動率を対象株価指数の変動率に一致させることを目的として運用を行いますが、主として次のような要因から、それぞれの変動率は完全に一致するものではありません。

・対象株価指数構成銘柄の全てを構成比率通りに組入れられない場合があること
・対象株価指数構成銘柄の異動等によってポートフォリオの調整を行う場合、売買コストを負担すること
・個別銘柄の売買を行った際、約定価格と評価価格に価格差が生じる場合があること
・運用管理費用（信託報酬）を負担すること

・一部金銭による追加設定、組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

・株価指数先物取引を行った場合、株価指数先物と対象株価指数の変動率に差異が生じる場合があること

②市場価格と基準価額の乖離について

ファンドの市場価格は、金融商品取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額と必ずしも一致するものではありません。

③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。

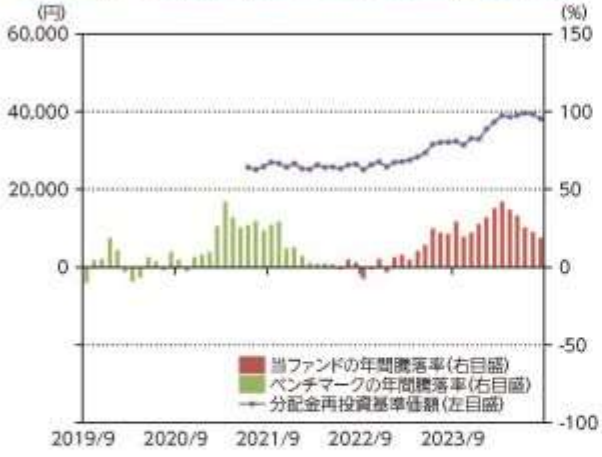
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*2019年9月～2024年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
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一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①販売会社が定める申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等に相当する金額を取得申込者から徴収できるものとします。申込手数料は、募集及び販売の取扱い事務に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

②上記①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、下記に記載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）手数料】

＜交換（買取り）手数料＞

販売会社は、受益権の交換又は買取りに際して、当該販売会社が定める手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を受益者から徴収できるものとします。交換（買取り）手数料は、当ファンドの受益権の交換又は買取りの取扱い事務等の対価として、販売会社に支払われます。
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、下記に記載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。）

＜信託財産留保額＞

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

運用管理費用（信託報酬）の総額は、以下の①及び②を合計した額とします。

①当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.1265%（税抜0.115%）（※1）以内の率を乗じて得た額

2024年10月11日現在、①の率、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。

合計		年率　0.1265% （税抜　0.115%）	主な役務
配分	委託会社	年率　0.0957% （税抜　0.087%）	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
	受託会社	年率　0.0308% （税抜　0.028%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

②株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に55%（税抜50%）以内を乗じて得た額

※2024年10月11日現在、②の率は合計で55%（税抜50%）以内とし、その配分は委託会社27.5%（税抜25%）、受託会社27.5%（税抜25%）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。）

③信託報酬は、毎日計上され、当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。

④信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

①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。

②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（※1）、先物取引・オプション取引に要する費用（※1）、組入資産の保管に要する費用（※1）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。

③投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※1）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

④対象株価指数の商標（これに類するものを含みます。）の使用料（※2）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁することができるものとします。

⑤受益権の上場に係る費用（※3）及びその消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁することができるものとします。

⑥対象株価指数の構成銘柄の配当落日及び権利落日に該当する日において、委託会社の判断により取得申込を受け付けるときには、配当落又は権利落対象銘柄の株式を投資信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が別に定める金額（※4）を徴することができるものとします。

⑦取得申込者がユニットに含まれる株式の発行会社又はその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。）である場合には、原則として当該株式の時価総額に相当する金額について金銭をもって取得申込を行いますが、この場合において、当該株式を取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が別に定める金額（※4）を徴することができるものとします。

⑧上記①から③までの手数料等は、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。

※1：上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

※2：2024年10月11日現在、当ファンドの純資産総額に年率0.015%以内の率を乗じた額です。

※3：2024年10月11日現在、追加上場料は追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時及び新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額、年間上場料は毎年末のファンドの純資産総額に最大0.00825%（税抜0.0075%）を乗じた額です。

※4：2024年10月11日現在、当該株式の個別銘柄時価総額の0.15%に相当する金額です。

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】

課税上は特定株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ.受益権の売却時の課税

売却時の差益（譲渡益）については譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、以下の税率で源泉徴収され、原則として、確定申告は不要です。

	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.収益分配金に対する課税

収益分配金は配当所得として、上記イ.の税率による源泉徴収が行われます。
なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

ハ.受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記イ.の受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

ニ.償還金に対する課税

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。

ホ.損益通算について

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

ヘ.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。なお、特定株式投資信託の分配金の受取方法については、販売会社の口座で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

イ.受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

ロ.収益分配金に対する課税

収益分配金は配当所得として、以下の税率で源泉徴収され、他の法人所得と合算して課税されます。
なお、益金不算入制度の適用が可能であり、株式の配当金と同様の取扱いとなります。

	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。）

ハ.受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記イ.の受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

ニ.償還金に対する課税

償還時の個別元本超過額については、上記ロ.の税率で源泉徴収されます。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2024年 8月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は、2024年8月30日現在の状況について記載してあります。

【ＳＭＴ　ＥＴＦカーボン・エフィシェント日本株】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	2,331,159,320	99.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	18,085,274	0.77
合計(純資産総額)		2,349,244,594	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	16,293,000	0.69

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（2）【投資資産】

①【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	48,600	3,284.00	159,602,400	2,759.50	134,111,700	5.71
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	4,700	15,380.00	72,286,000	14,200.00	66,740,000	2.84
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	37,800	1,792.00	67,737,600	1,528.00	57,758,400	2.46
日本	株式	日立製作所	電気機器	15,000	3,779.00	56,685,000	3,572.00	53,580,000	2.28
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	5,600	9,441.00	52,869,600	9,047.00	50,663,200	2.16
日本	株式	キーエンス	電気機器	600	76,750.00	46,050,000	69,610.00	41,766,000	1.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,600	38,050.00	60,880,000	25,805.00	41,288,000	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	4,000	11,065.00	44,260,000	9,550.00	38,200,000	1.63
日本	株式	信越化学工業	化学	5,400	6,715.00	36,261,000	6,422.00	34,678,800	1.48

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	6,200	6,476.00	40,151,200	5,506.00	34,137,200	1.45
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	196,000	159.50	31,262,000	155.70	30,517,200	1.30
日本	株式	第一三共	医薬品	4,800	6,027.00	28,929,600	6,108.00	29,318,400	1.25
日本	株式	三菱商事	卸売業	9,400	3,369.00	31,668,600	3,013.00	28,322,200	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	17,000	1,723.50	29,299,500	1,588.00	26,996,000	1.15
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	3,500	8,100.00	28,350,000	7,706.00	26,971,000	1.15
日本	株式	三井物産	卸売業	8,000	3,765.00	30,120,000	3,123.00	24,984,000	1.06
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	5,700	4,439.00	25,302,300	4,203.00	23,957,100	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	5,500	4,312.00	23,716,000	4,333.00	23,831,500	1.01
日本	株式	任天堂	その他製品	2,900	9,100.00	26,390,000	7,902.00	22,915,800	0.98
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	1,100	20,770.00	22,847,000	20,595.00	22,654,500	0.96
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	4,600	4,541.00	20,888,600	4,911.00	22,590,600	0.96
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,600	11,920.00	30,992,000	8,405.00	21,853,000	0.93
日本	株式	三菱重工業	機械	10,900	1,834.50	19,996,050	1,942.50	21,173,250	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	10,100	2,068.00	20,886,800	2,038.00	20,583,800	0.88
日本	株式	三菱電機	電気機器	8,000	2,839.50	22,716,000	2,441.00	19,528,000	0.83
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	45,200.00	18,080,000	46,650.00	18,660,000	0.79
日本	株式	丸紅	卸売業	7,100	3,039.00	21,576,900	2,487.00	17,657,700	0.75
日本	株式	住友商事	卸売業	5,000	4,061.00	20,305,000	3,446.00	17,230,000	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	4,200	4,576.00	19,219,200	3,988.00	16,749,600	0.71
日本	株式	キヤノン	電気機器	3,300	4,560.00	15,048,000	5,017.00	16,556,100	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.05
		鉱業	0.30
		建設業	2.56
		食料品	3.12
		繊維製品	0.32
		パルプ・紙	0.14
		化学	6.03
		医薬品	4.97
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.15
		ガラス・土石製品	0.34
		鉄鋼	0.29
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.30
		機械	5.37
		電気機器	17.93

	輸送用機器	8.71
	精密機器	2.29
	その他製品	1.89
	電気・ガス業	1.32
	陸運業	3.49
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	7.65
	卸売業	6.84
	小売業	4.27
	銀行業	7.26
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	3.05
	その他金融業	1.21
	不動産業	2.03
	サービス業	5.09
	小計	99.23
合計		99.23

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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	6	円	17,574,000	16,293,000	0.69

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

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）		東京証券取引所取引価格（円）
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1期計算期間末 (2022年 1月11日)	1,102,639,028	1,113,876,536	26,297	26,565	26,360
第2期計算期間末 (2022年 7月11日)	1,061,694,152	1,075,237,865	25,320	25,643	25,350
第3期計算期間末 (2023年 1月11日)	1,051,845,208	1,063,963,267	25,085	25,374	24,970
第4期計算期間末 (2023年 7月11日)	1,235,836,793	1,250,135,264	29,473	29,814	29,560
第5期計算期間末 (2024年 1月11日)	1,373,979,240	1,387,103,643	32,768	33,081	32,800
第6期計算期間末 (2024年 7月11日)	2,540,061,182	2,561,595,038	38,690	39,018	38,770
2023年 8月末日	1,287,184,402	—	30,698	—	30,650
9月末日	1,295,310,150	—	30,891	—	31,100
10月末日	1,258,159,357	—	30,005	—	29,865

11月末日	1,323,639,111	—	31,567	—	31,500
12月末日	1,318,023,883	—	31,433	—	31,450
2024年 1月末日	1,410,325,874	—	33,634	—	33,570
2月末日	1,480,887,028	—	35,317	—	35,210
3月末日	1,985,019,589	—	36,894	—	36,890
4月末日	2,402,045,023	—	36,588	—	36,590
5月末日	2,425,016,050	—	36,937	—	36,890
6月末日	2,460,652,279	—	37,480	—	37,480
7月末日	2,419,941,109	—	36,860	—	36,740
8月末日	2,349,244,594	—	35,783	—	35,750

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

②【分配の推移】

	期　間	1口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2021年 6月22日～2022年 1月11日	268
第2期計算期間	2022年 1月12日～2022年 7月11日	323
第3期計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	289
第4期計算期間	2023年 1月12日～2023年 7月11日	341
第5期計算期間	2023年 7月12日～2024年 1月11日	313
第6期計算期間	2024年 1月12日～2024年 7月11日	328

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2021年 6月22日～2022年 1月11日	5.9
第2期計算期間	2022年 1月12日～2022年 7月11日	△2.5
第3期計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	0.2
第4期計算期間	2023年 1月12日～2023年 7月11日	18.9
第5期計算期間	2023年 7月12日～2024年 1月11日	12.2
第6期計算期間	2024年 1月12日～2024年 7月11日	19.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2021年 6月22日～2022年 1月11日	41,931	—	41,931
第2期計算期間	2022年 1月12日～2022年 7月11日	—	—	41,931
第3期計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	—	—	41,931
第4期計算期間	2023年 1月12日～2023年 7月11日	—	—	41,931
第5期計算期間	2023年 7月12日～2024年 1月11日	—	—	41,931
第6期計算期間	2024年 1月12日～2024年 7月11日	23,721	—	65,652

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2021年6月22日
作成基準日：2024年8月30日

基準価額・純資産の推移

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

基準価額	35,783円
純資産総額	23.49億円

分配の推移

(1口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年7月	323円
2023年1月	289円
2023年7月	341円
2024年1月	313円
2024年7月	328円
設定来分配金合計額	1,862円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国／地域	種類	業種	投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5.7%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.8%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.5%
日立製作所	日本	株式	電気機器	2.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	2.2%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.6%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.5%
東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	1.5%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2021年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。
※2015年～2020年は、ファンドのベンチマークである「S&P/JPXカーボン・エフィシェント指数(配当込み)」の年間収益率です。
※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

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

第２【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

＜申込方法＞

1.受益権の取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
受益権の取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する株式をもって取得の申込みを行うものとします。当該株式は、対象株価指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象株価指数に連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ（ユニット）とします。
なお、当該ユニットの評価額が、取得する受益権口数の評価額（取得申込受益権口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額）に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭をもって支払うものとします。

2.受益権の取得申込者が、営業日の午後3時までに取得申込みを行い、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その申込日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受け付けます。
※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。

3.受益権の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、当該取得申込みに係る株式及び金銭の受渡し又は支払いと引換えに、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。
また、清算機関の業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる株式及び金銭の委託会社への受渡し又は支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載又は記録が行われ、取得申込者が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における口数の増加の記載又は記録は、当該清算機関と販売会社との間で振替機関等を介して行われます。

4.受益権の取得申込者が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、取得申込みに係るユニットのうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に取得申込みに係るユニットに含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を投資信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額（当該株式の個別銘柄時価総額に委託会社が別に定める率を乗じて得た額）を徴収することができるものとします。

5.取得申込受付日が以下に定める日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みを受け付けません。
イ．対象株価指数の構成銘柄の配当落日及び権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間
ロ．対象株価指数の銘柄変更実施日及び銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間
ハ．計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間（ただし、計算期間終了日が休日（営業日でない日をいいます。）の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内）
ニ．当ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
ホ．上記イ．～ニ．のほか、委託会社が運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

ただし、委託会社は、上記に定める日における受益権の取得申込みであっても、投資信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、投資信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日及び期間における受益権の取得申込みについては、当該取得申込みの受付けを行うことができます。

6.上記5.イ.に該当する日（対象株価指数の構成銘柄の配当落日及び権利落日の各々の前営業日を除きます。）において、当ファンドの取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みに係るユニットのうち、配当落又は権利落対象銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付ける場合があります。この場合の個別銘柄時価総額は、基準価額の計算日における当該銘柄の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に取得申込みに係るユニットに含まれる当該銘柄の株数を乗じて得た金額とします。この場合において、委託会社は、当該銘柄を投資信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額（当該株式の個別銘柄時価総額に委託会社が別に定める率を乗じて得た額）を徴収することができるものとします。

7.受益権の取得申込者が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社（販売会社が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等に該当する場合に、当該販売会社が自己勘定で取得申込みを行うときを含むものとします。）は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとします。また、当該の通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって投資信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

8.上記にかかわらず、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、投資信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると認めたとき、又はその他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付けを中止させていただく場合及びすでに受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

＜申込単位＞

1ユニット以上1ユニット単位とします。

委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用されるユニットの銘柄及び株数を決定し、販売会社に提示します。取得申込みに係る口数は、委託会社が定めるものとし、1口の整数倍とします。

＜申込価額＞

取得申込受付日の基準価額とします。

＜申込手数料＞

前記「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (1) 申込手数料」をご覧ください。

＜払込期日＞

取得申込者は販売会社の指定する日までに、原則としてその保有する株式等を販売会社に引き渡すものとします。

振替受益権に係る各取得申込受付日の発行価額の総額に相当する株式等は、販売会社（清算機関の業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる株式及び金銭の委託会社への受渡し又は支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、清算機関。以下本項において同じ。）によって、追加信託が行われる日に、受託会社の指定する当ファンド口座に移管されます。株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

＜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。）

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、信託期間中において解約（投資信託契約の一部解約の実行）の請求をすることはできません。

＜交換請求＞

1.受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に、当該受益権と投資信託財産に属する株式との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。

委託会社は、営業日の午後3時までに交換請求が行われ、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その請求日を交換請求受付日として、当該交換請求を受け付けます。

※2024年11月5日受付分からは、交換請求の受付は、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。

受益者は、交換請求に係る一定口数（当該口数に交換請求受付日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求受付日において委託会社が対象株価指数に連動すると想定する、対象株価指数における各構成銘柄の評価額の合計に相当するものとして、委託会社が定める口数をいい、「交換請求口数」といいます。）の整数倍の受益権をもって交換請求を行うことができます。

受益者が交換請求を行うときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

2.販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消に係る手続きを行うものとします（なお、当該販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消に係る手続きを行います）。当該抹消に係る手続き及び交換株式に係る振替の請求が行われた後に、振替機関は、当該交換に係る受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定に従い振替機関等の口座に交換請求を行った受益者に係る当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

3.委託会社は、受益者から提示された口数の振替受益権から受益者が取得できる個別銘柄の株式の株数と、交換に要する受益権の口数（1口未満の端数があるときは、1口に切り上げます。）を計算します。

交換に係る受益権の価額は交換請求受付日の基準価額とします。この場合において、受益者が交換によって取得する個別銘柄の株式の株数は、交換請求受付日における当該株式の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位（金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。以下同じ。）の整数倍とします。

4.委託会社は、受託会社に対し、上記3.により計算された口数の受益権と投資信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。ただし、交換の請求を行った受益者が、対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、上記3.の交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、上記3.の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に上記3.に基づき計算された株数を乗じて得た金額

します。

5.交換の請求を行った受益者が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社（販売会社が対象株価指数の構成銘柄である株式の発行会社等に該当する場合に、当該販売会社が自己勘定で交換を請求するときを含むものとします。）は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとします。また、当該通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって投資信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

6.受託会社は、交換のための振替受益権の抹消に係る手続きが行われたことを確認した場合に、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により投資信託財産に属する交換株式に係る振替の請求を行うものとします（ただし、交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託会社は、上記2.に掲げる手続きにかかわらず、委託会社の指図に従い、振替機関の定める方法により投資信託財産に属する交換株式に係る振替請求を行うものとします）。受益者への交換株式の交付に際しては、原則として交換請求の受付日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行った受益者に係る株式の増加の記載又は記録が行われ、金銭の交付については委託会社の指定する販売会社の営業所等において行われます。

7.委託会社は、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取り扱うこととし、受託会社は、当該受益権に係る振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

8.受託会社は、委託会社の交換の指図に基づいて、交換に係る振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続き及び上記7.の抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したものとして取り扱います。

9.交換請求受付日が以下に定める日に当たる場合には、交換請求の受付けは行いません。

イ．対象株価指数の構成銘柄の配当落日及び権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間

ロ．対象株価指数の銘柄変更実施日及び銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間

ハ．計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間（ただし、計算期間終了日が休日（営業日でない日をいいます。）の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内）

ニ．当ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間

ホ．上記イ．～ニ．のほか、委託会社が運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めたとき

ただし、委託会社は、上記に定める日における交換請求であっても、投資信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、投資信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日及び期間における交換請求については、当該交換請求の受付けを行うことができます。

10.上記9．イ.に該当する日において、交換請求を受け付けるときには、交換請求口数と投資信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。なお、当該株式のうち、配当落又は権利落対象銘柄については、当該銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金銭により交換する場合があります。この場合の個別銘柄時価総額は、上記3.の基準価額の計算日における当該銘柄の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に上記3.に基づき計算された数を乗じて得た金額とします。

11.上記にかかわらず、委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、投資信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると認めたとき、又はその他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受付けを中止すること、及びすでに受け付けた交換請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できます。受益者がその交換請求を撤回しない場合には、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交換請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

＜交換価額＞
交換請求受付日の基準価額とします。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。

＜交換手数料＞
前記「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (2)換金（解約）手数料」をご覧ください。

＜交換単位＞
委託会社が定める一定口数（交換請求口数）（※）の整数倍とします。
※当該口数に交換請求受付日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求受付日において委託会社が対象株価指数に連動すると想定する、対象株価指数における各構成銘柄の評価額の合計に相当するものとして、委託会社が定める口数をいいます。

＜受益権の買取請求＞
販売会社は、以下1.、2.に該当する場合で受益者の請求があるときは、その請求日を買取請求受付日として、買取請求受付日の基準価額で受益権を買い取ります。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。
1.交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
2.受益権を上場した全ての金融商品取引所において上場廃止になったとき
受益権の買取価額は、買取請求受付日の基準価額とします。
販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止すること及びすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。
この場合、受益者は当該買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。
＜買取り手数料＞
前記「第1ファンドの状況 4 手数料等及び税金 (2) 換金（解約）手数料」をご覧ください。

＜問い合わせ先＞
上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞
基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則にしたが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。

＜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＞

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2021年6月22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1月12日から7月11日まで及び7月12日から翌年1月11日までとします。
ただし、第1計算期間は2021年6月22日から2022年1月11日までとし、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（当ファンドの繰上償還）

①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したがい、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。

・投資信託財産の一部を受益権と交換することにより、受益権の口数が15万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

②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、その命令にしたがい、この投資信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させます。

③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、この投資信託契約を解約し、信託を終了（繰上償還）させます。

④委託会社は、信託期間中において次の各号に該当することとなった場合には、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）させます。

1. 受益権を上場した全ての金融商品取引所において上場廃止となった場合
2. 対象株価指数が廃止された場合
3. 対象株価指数の計算方法の変更等に伴って委託会社又は受託会社が必要と認めたこの投資信

託約款の変更が、書面決議により否決された場合

なお、上記1.に掲げる事由によりこの投資信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。

⑤委託会社は、上記の場合において投資信託契約を解約し、信託を終了（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（当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）①により当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。

①委託会社は、当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当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れ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します。

②受益者（委託会社等を除きます。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、知れ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。

③上記①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。

④上記①から③までの規定は、委託会社が当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①から③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したがい、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当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、本手続きにしたがいます。

(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

委託会社は当ファンドの投資信託約款の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。

①委託会社は、当ファンドの重大な約款変更又は当ファンドの併合（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当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れ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します。

②受益者（委託会社等を除きます。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、知れ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。

③上記①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。

④書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又は当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。

⑥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。

＜反対者の買取請求権＞

当ファンドの繰上償還、重大な約款変更又は併合を行う場合に、書面決議において当該議案に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞にしたがい、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。

②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＞

運用報告書の作成及び交付は行いません。

＜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。

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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。

＜金融商品取引所への上場＞

①委託会社及び受託会社は、当ファンドの受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとします。

②委託会社及び受託会社は、当ファンドの受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止又は売買取引の停止その他の措置にしたがうものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権及び名義登録

①受益者（計算期間終了日において受益者名簿に名義登録※されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

※受託会社は、当ファンドに係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名又は名称、住所及び個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。以下同じ。）又は法人番号（同条に規定する法人番号をいいます。以下同じ。）（個人番号又は法人番号を有しない者にあっては、氏名又は名称及び住所とします。以下同じ。）その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載又は記録された受益権に係る受益者として、その氏名又は名称、住所及び個人番号又は法人番号（個人番号又は法人番号を有しない者又は収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第１項に規定する支払いの取扱者を通じて交付を受ける者にあっては、氏名又は名称及び住所とします。）その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成及び受益者名簿への名義登録を委託することができます。

②収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式により行うものとします。

なお、受益者は当ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限ります。）を経由して受益者名簿に名義を登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴収することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社（受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。

③受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

④受益者が、支払開始日から5年間、収益分配金の支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

①償還は、信託終了日現在において受益者名簿に名義登録されている者を信託終了日現在における受益者（以下「信託終了時受益者」といいます。）として、当該信託終了時受益者に、信託終了時の投資信託財産の純資産総額に相当する金銭を支払うことにより行います。なお、当該信託終了時受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社が当ファンドの償還をす

るのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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。

②信託終了時受益者に交付する金銭の額は、信託終了時の基準価額（信託終了時の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。）に、当該信託終了時受益者に属する受益権の口数を乗じた額とします。なお、この場合における税法上の受益権1口当たり元本の額は、信託終了時において信託されている金額を受益権総口数で除した金額とします。

③償還金の支払いは、原則として受託会社が、信託終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日から行うものとし、信託終了時受益者は、受託会社から送付される領収書をゆうちょ銀行に持ち込む方式や受託会社から振り込まれる預金口座等をあらかじめ指定する方式などにより償還金を受領できます。

④受託会社は、支払開始日から10年経過した後に、信託終了による償還金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとします。

⑤受益者が、信託終了による償還金について、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

(3)交換請求権及び買取請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、交換又は買取りを請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

(4)書面決議における議決権及び受益権の買取請求権

①委託会社が、当ファンドの繰上償還、重大な約款変更又は併合を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、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。

②当該書面決議の結果、当ファンドの繰上償還、重大な約款変更又は併合が行われる場合は、当該書面決議において当該議案に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

(5)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2024年1月12日から2024年7月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＳＭＴ　ＥＴＦカーボン・エフィシェント日本株】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2024年 1月11日現在）	第6期 （2024年 7月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,690,465	37,135,594
株式	1,349,191,370	2,521,050,200
派生商品評価勘定	1,377,858	844,222
未収入金	868,494	1,016,618
未収配当金	1,782,775	2,897,459
未収利息	-	69
差入委託証拠金	1,762,285	1,773,877
流動資産合計	1,389,673,247	2,564,718,039
資産合計	1,389,673,247	2,564,718,039
負債の部		
流動負債		
前受金	1,615,950	1,670,600
未払収益分配金	13,124,403	21,533,856
未払受託者報酬	199,849	304,347
未払委託者報酬	620,895	945,605
未払利息	20	-
その他未払費用	132,890	202,449
流動負債合計	15,694,007	24,656,857
負債合計	15,694,007	24,656,857
純資産の部		
元本等		
元本	1,051,964,928	1,647,077,376
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	322,014,312	892,983,806
（分配準備積立金）	5,593	18,098
元本等合計	1,373,979,240	2,540,061,182
純資産合計	1,373,979,240	2,540,061,182
負債純資産合計	1,389,673,247	2,564,718,039

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2023年 7月12日 至　2024年 1月11日	第6期 自　2024年 1月12日 至　2024年 7月11日
営業収益		
受取配当金	14,089,585	23,063,304
受取利息	56	4,220
有価証券売買等損益	135,043,178	321,465,634
派生商品取引等損益	3,133,384	4,002,878
その他収益	3,040	2,489
営業収益合計	152,269,243	348,538,525
営業費用		
支払利息	5,199	411
受託者報酬	199,849	304,347
委託者報酬	620,895	945,605
その他費用	176,450	273,289
営業費用合計	1,002,393	1,523,652
営業利益又は営業損失（△）	151,266,850	347,014,873
経常利益又は経常損失（△）	151,266,850	347,014,873
当期純利益又は当期純損失（△）	151,266,850	347,014,873
期首剰余金又は期首欠損金（△）	183,871,865	322,014,312
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	245,488,477
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	245,488,477
分配金	13,124,403	21,533,856
期末剰余金又は期末欠損金（△）	322,014,312	892,983,806

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第5期 (2024年 1月11日現在)		第6期 (2024年 7月11日現在)
１.	計算期間の末日における受益権の総数	41,931口		65,652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	32,768円	1口当たり純資産額 38,690円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期
自 2023年 7月12日
至 2024年 1月11日

分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	14,087,482円
分配準備積立金	B	39,708円
配当等収益合計額	C=A+B	14,127,190円
経費	D	997,194円
収益分配可能額	E=C-D	13,129,996円
収益分配金金額	F	13,124,403円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,593円
口数	H	41,931口
1口当たり分配金額	I=F/H	313円

第6期
自 2024年 1月12日
至 2024年 7月11日

分配金の計算過程

項目		
当期配当等収益額	A	23,069,602円
分配準備積立金	B	5,593円
配当等収益合計額	C=A+B	23,075,195円
経費	D	1,523,241円
収益分配可能額	E=C-D	21,551,954円
収益分配金金額	F	21,533,856円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,098円
口数	H	65,652口
1口当たり分配金額	I=F/H	328円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2024年 1月12日 至 2024年 7月11日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及びそのリスク	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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
３.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (2024年 7月11日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2023年 7月12日 至 2024年 1月11日	第6期 自 2024年 1月12日 至 2024年 7月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,051,964,928円	1,051,964,928円
期中追加設定元本額	－円	595,112,448円
期中一部交換元本額	－円	－円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 (2024年 1月11日現在)	第6期 (2024年 7月11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)
株式	134,774,809	294,062,724
合計	134,774,809	294,062,724

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

第5期（2024年 1月11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	21,062,850	－	22,441,500	1,378,650
合計		21,062,850	－	22,441,500	1,378,650

第6期（2024年 7月11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	16,729,250	－	17,574,000	844,750
合計		16,729,250	－	17,574,000	844,750

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ニッスイ	1,200	847.90	1,017,480	
住石ホールディングス	100	1,309.00	130,900	
ＩＮＰＥＸ	2,900	2,478.00	7,186,200	
石油資源開発	100	6,420.00	642,000	
ショーボンドホールディングス	100	5,715.00	571,500	
ミライト・ワン	300	2,094.00	628,200	
タマホーム	100	3,865.00	386,500	
安藤・間	700	1,189.00	832,300	
東急建設	400	780.00	312,000	
コムシスホールディングス	400	3,244.00	1,297,600	
ビーアールホールディングス	100	361.00	36,100	
高松コンストラクショングループ	100	3,030.00	303,000	
ヤマウラ	100	1,326.00	132,600	
オリエンタル白石	400	352.00	140,800	
大成建設	600	6,250.00	3,750,000	
大林組	2,800	1,998.00	5,594,400	
清水建設	2,700	934.30	2,522,610	
飛島建設	100	1,533.00	153,300	
長谷工コーポレーション	600	1,793.00	1,075,800	
鹿島建設	1,700	2,856.50	4,856,050	
鉄建建設	100	2,575.00	257,500	
西松建設	100	4,758.00	475,800	
三井住友建設	500	392.00	196,000	
ナカノフドー建設	100	525.00	52,500	
奥村組	100	5,110.00	511,000	
東鉄工業	100	3,200.00	320,000	
淺沼組	100	3,860.00	386,000	
戸田建設	1,000	1,060.00	1,060,000	
熊谷組	100	3,605.00	360,500	
矢作建設工業	100	1,654.00	165,400	
ピーエス・コンストラクション	100	1,008.00	100,800	
日本ハウスホールディングス	100	346.00	34,600	

新日本建設	100	1,642.00	164,200	
東亜道路工業	100	1,300.00	130,000	
日本道路	100	1,831.00	183,100	
東亜建設工業	200	1,019.00	203,800	
日本国土開発	200	471.00	94,200	
東洋建設	200	1,480.00	296,000	
五洋建設	900	663.40	597,060	
世紀東急工業	100	1,762.00	176,200	
大和ハウス工業	2,500	4,165.00	10,412,500	
ライト工業	200	2,155.00	431,000	
積水ハウス	2,300	3,679.00	8,461,700	
日特建設	100	1,143.00	114,300	
ユアテック	100	1,479.00	147,900	
日本リーテック	100	1,255.00	125,500	
中電工	100	3,280.00	328,000	
関電工	600	1,720.00	1,032,000	
きんでん	400	3,264.00	1,305,600	
東京エネシス	100	1,342.00	134,200	
住友電設	100	4,025.00	402,500	
日本電設工業	100	1,967.00	196,700	
エクシオグループ	900	1,621.50	1,459,350	
新日本空調	100	4,095.00	409,500	
九電工	200	5,712.00	1,142,400	
三機工業	200	2,169.00	433,800	
日揮ホールディングス	700	1,269.00	888,300	
高砂熱学工業	200	5,810.00	1,162,000	
朝日工業社	100	1,362.00	136,200	
明星工業	100	1,315.00	131,500	
大氣社	100	5,250.00	525,000	
ダイダン	100	3,250.00	325,000	
日比谷総合設備	100	3,315.00	331,500	
テスホールディングス	200	410.00	82,000	
インフロニア・ホールディングス	700	1,285.00	899,500	
東洋エンジニアリング	100	838.00	83,800	
レイズネクスト	100	1,890.00	189,000	
日清製粉グループ本社	100	1,841.00	184,100	
森永製菓	300	2,618.50	785,550	
山崎製パン	600	3,347.00	2,008,200	
亀田製菓	100	4,230.00	423,000	
寿スピリッツ	500	1,948.50	974,250	
カルビー	100	3,092.00	309,200	
ヤクルト本社	100	2,914.50	291,450	

明治ホールディングス	100	3,638.00	363,800	
サッポロホールディングス	300	6,100.00	1,830,000	
アサヒグループホールディングス	2,200	5,776.00	12,707,200	
キリンホールディングス	4,200	2,159.50	9,069,900	
宝ホールディングス	700	1,120.00	784,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	1,000	2,180.50	2,180,500	
サントリー食品インターナショナル	800	5,612.00	4,489,600	
キッコーマン	2,600	1,975.00	5,135,000	
味の素	400	6,177.00	2,470,800	
キユーピー	100	3,729.00	372,900	
ハウス食品グループ本社	200	2,899.00	579,800	
カゴメ	100	3,437.00	343,700	
アリアケジャパン	100	5,270.00	527,000	
ニチレイ	100	3,474.00	347,400	
東洋水産	100	9,978.00	997,800	
日清食品ホールディングス	900	4,283.00	3,854,700	
日本たばこ産業	5,700	4,439.00	25,302,300	
ケンコーマヨネーズ	100	2,045.00	204,500	
ファーマフーズ	100	1,041.00	104,100	
ユーグレナ	300	523.00	156,900	
紀文食品	100	1,245.00	124,500	
理研ビタミン	100	2,740.00	274,000	
片倉工業	100	2,038.00	203,800	
東洋紡	300	1,045.00	313,500	
ダイトウボウ	100	105.00	10,500	
ダイドーリミテッド	100	1,023.00	102,300	
帝人	900	1,336.50	1,202,850	
東レ	3,800	774.10	2,941,580	
アツギ	100	589.00	58,900	
ワコールホールディングス	100	4,500.00	450,000	
ホギメディカル	100	4,185.00	418,500	
ＴＳＩホールディングス	200	925.00	185,000	
ワールド	100	2,337.00	233,700	
オンワードホールディングス	300	573.00	171,900	
ゴールドウイン	100	9,000.00	900,000	
デサント	100	3,840.00	384,000	
王子ホールディングス	1,900	625.80	1,189,020	
日本製紙	400	959.00	383,600	
三菱製紙	100	745.00	74,500	
北越コーポレーション	300	1,068.00	320,400	
大王製紙	400	900.70	360,280	
レンゴー	700	1,012.00	708,400	

トーモク	100	2,732.00	273,200	
北の達人コーポレーション	300	182.00	54,600	
クラレ	900	1,890.00	1,701,000	
旭化成	6,800	1,071.50	7,286,200	
レゾナック・ホールディングス	600	3,870.00	2,322,000	
住友化学	4,800	375.10	1,800,480	
日産化学	400	5,040.00	2,016,000	
クレハ	100	2,870.00	287,000	
テイカ	100	1,623.00	162,300	
石原産業	100	1,633.00	163,300	
日本曹達	100	5,380.00	538,000	
東ソー	900	2,076.50	1,868,850	
トクヤマ	100	3,014.00	301,400	
東亞合成	300	1,544.00	463,200	
関東電化工業	100	981.00	98,100	
デンカ	200	2,167.00	433,400	
信越化学工業	5,400	6,715.00	36,261,000	
第一稀元素化学工業	100	869.00	86,900	
エア・ウォーター	600	2,188.50	1,313,100	
日本酸素ホールディングス	600	5,069.00	3,041,400	
日本パーカライジング	300	1,309.00	392,700	
四国化成ホールディングス	100	2,261.00	226,100	
日本触媒	300	1,636.50	490,950	
大日精化工業	100	3,270.00	327,000	
カネカ	200	4,354.00	870,800	
三菱瓦斯化学	500	3,132.00	1,566,000	
三井化学	500	4,424.00	2,212,000	
東京応化工業	500	4,563.00	2,281,500	
大阪有機化学工業	100	4,055.00	405,500	
三菱ケミカルグループ	4,900	924.20	4,528,580	
ＫＨネオケム	100	2,268.00	226,800	
ダイセル	800	1,540.00	1,232,000	
住友ベークライト	300	4,635.00	1,390,500	
積水化学工業	100	2,250.00	225,000	
日本ゼオン	400	1,407.50	563,000	
アイカ工業	300	3,543.00	1,062,900	
ＵＢＥ	100	2,819.00	281,900	
積水樹脂	100	2,520.00	252,000	
タキロンシーアイ	300	765.00	229,500	
旭有機材	100	5,240.00	524,000	
リケンテクノス	200	1,023.00	204,600	
積水化成品工業	100	459.00	45,900	

日本化薬	900	1,278.50	1,150,650	
カーリット	100	1,476.00	147,600	
扶桑化学工業	100	4,045.00	404,500	
ＡＤＥＫＡ	300	3,278.00	983,400	
日油	800	2,291.50	1,833,200	
新日本理化	100	213.00	21,300	
ハリマ化成グループ	100	956.00	95,600	
花王	1,200	6,772.00	8,126,400	
大日本塗料	100	1,291.00	129,100	
日本ペイントホールディングス	5,500	1,027.00	5,648,500	
関西ペイント	700	2,562.00	1,793,400	
中国塗料	200	2,136.00	427,200	
藤倉化成	100	538.00	53,800	
太陽ホールディングス	100	3,395.00	339,500	
ＤＩＣ	300	3,025.00	907,500	
サカタインクス	200	1,819.00	363,800	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	200	3,330.00	666,000	
富士フイルムホールディングス	3,700	3,909.00	14,463,300	
資生堂	1,500	4,603.00	6,904,500	
ライオン	900	1,290.50	1,161,450	
高砂香料工業	100	3,795.00	379,500	
マンダム	200	1,226.00	245,200	
ミルボン	100	3,387.00	338,700	
ファンケル	300	2,720.00	816,000	
コーセー	200	10,350.00	2,070,000	
コタ	100	1,634.00	163,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	500	1,365.00	682,500	
ノエビアホールディングス	100	5,870.00	587,000	
新日本製薬	100	1,738.00	173,800	
エステー	100	1,579.00	157,900	
コニシ	300	1,260.00	378,000	
長谷川香料	200	3,255.00	651,000	
荒川化学工業	100	1,241.00	124,100	
タカラバイオ	200	1,152.00	230,400	
ＪＣＵ	100	4,015.00	401,500	
新田ゼラチン	100	767.00	76,700	
デクセリアルズ	100	8,054.00	805,400	
アース製薬	100	4,945.00	494,500	
北興化学工業	100	1,579.00	157,900	
クミアイ化学工業	400	804.00	321,600	
日本農薬	200	741.00	148,200	
アキレス	100	1,577.00	157,700	

有沢製作所	100	1,689.00	168,900	
日東電工	600	13,575.00	8,145,000	
三光合成	100	689.00	68,900	
きもと	100	214.00	21,400	
ＪＳＰ	100	2,316.00	231,600	
エフピコ	200	2,427.50	485,500	
信越ポリマー	200	1,575.00	315,000	
東リ	100	408.00	40,800	
ニフコ	100	3,962.00	396,200	
バルカー	100	3,715.00	371,500	
ユニ・チャーム	1,000	5,275.00	5,275,000	
協和キリン	800	3,101.00	2,480,800	
武田薬品工業	5,500	4,312.00	23,716,000	
アステラス製薬	5,400	1,662.00	8,974,800	
住友ファーマ	400	408.00	163,200	
塩野義製薬	800	6,690.00	5,352,000	
日本新薬	200	3,544.00	708,800	
中外製薬	2,200	6,354.00	13,978,800	
科研製薬	100	4,012.00	401,200	
エーザイ	800	6,926.00	5,540,800	
ロート製薬	700	3,415.00	2,390,500	
小野薬品工業	1,500	2,231.50	3,347,250	
久光製薬	100	3,931.00	393,100	
持田製薬	100	3,325.00	332,500	
参天製薬	1,100	1,792.00	1,971,200	
ツムラ	200	4,192.00	838,400	
キッセイ薬品工業	100	3,250.00	325,000	
生化学工業	100	898.00	89,800	
栄研化学	100	2,333.00	233,300	
ＪＣＲファーマ	300	621.00	186,300	
東和薬品	100	3,085.00	308,500	
ゼリア新薬工業	100	2,145.00	214,500	
ネクセラファーマ	200	1,655.00	331,000	
第一三共	4,800	6,027.00	28,929,600	
杏林製薬	100	1,714.00	171,400	
大幸薬品	100	458.00	45,800	
ダイト	100	2,288.00	228,800	
大塚ホールディングス	1,200	7,199.00	8,638,800	
ペプチドリーム	300	2,744.00	823,200	
あすか製薬ホールディングス	100	2,400.00	240,000	
サワイグループホールディングス	100	6,699.00	669,900	
日本コークス工業	800	118.00	94,400	

ニチレキ	100	2,338.00	233,800	
富士石油	200	481.00	96,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	12,800	829.30	10,615,040	
コスモエネルギーホールディングス	100	8,012.00	801,200	
横浜ゴム	100	3,386.00	338,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	100	2,577.00	257,700	
ブリヂストン	400	6,322.00	2,528,800	
住友ゴム工業	100	1,611.00	161,100	
三ツ星ベルト	100	4,555.00	455,500	
バンドー化学	100	1,989.00	198,900	
ＡＧＣ	400	5,300.00	2,120,000	
日本板硝子	200	420.00	84,000	
日本電気硝子	200	3,716.00	743,200	
太平洋セメント	100	4,070.00	407,000	
日本コンクリート工業	100	394.00	39,400	
アジアパイルホールディングス	100	996.00	99,600	
東海カーボン	600	948.50	569,100	
ＴＯＴＯ	300	4,060.00	1,218,000	
日本碍子	500	2,126.00	1,063,000	
日本特殊陶業	100	4,890.00	489,000	
品川リフラクトリーズ	100	1,950.00	195,000	
東京窯業	100	440.00	44,000	
フジミインコーポレーテッド	300	3,155.00	946,500	
ニチアス	100	4,825.00	482,500	
神戸製鋼所	1,200	1,989.50	2,387,400	
ＪＦＥホールディングス	1,400	2,351.00	3,291,400	
東京製鐵	200	1,588.00	317,600	
丸一鋼管	200	3,791.00	758,200	
大同特殊鋼	400	1,453.50	581,400	
山陽特殊製鋼	100	2,098.00	209,800	
新日本電工	200	295.00	59,000	
大紀アルミニウム工業所	100	1,259.00	125,900	
日本軽金属ホールディングス	200	1,802.00	360,400	
三井金属鉱業	200	5,411.00	1,082,200	
東邦亜鉛	100	826.00	82,600	
三菱マテリアル	500	3,048.00	1,524,000	
住友金属鉱山	1,100	5,263.00	5,789,300	
ＤＯＷＡホールディングス	200	5,854.00	1,170,800	
古河機械金属	100	1,849.00	184,900	
エス・サイエンス	300	23.00	6,900	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	2,713.00	271,300	
東邦チタニウム	100	1,486.00	148,600	

ＵＡＣＪ	100	3,890.00	389,000	
古河電気工業	100	4,252.00	425,200	
住友電気工業	600	2,524.00	1,514,400	
フジクラ	700	3,397.00	2,377,900	
ＳＷＣＣ	100	4,655.00	465,500	
タツタ電線	100	728.00	72,800	
リョービ	100	2,247.00	224,700	
ＡＲＥホールディングス	300	2,078.00	623,400	
トーカロ	100	2,033.00	203,300	
ＳＵＭＣＯ	900	2,643.50	2,379,150	
東洋製罐グループホールディングス	400	2,474.00	989,600	
横河ブリッジホールディングス	100	2,793.00	279,300	
三和ホールディングス	500	3,102.00	1,551,000	
文化シヤッター	100	1,760.00	176,000	
三協立山	100	813.00	81,300	
ＬＩＸＩＬ	800	1,785.50	1,428,400	
ノーリツ	100	1,829.00	182,900	
長府製作所	100	2,200.00	220,000	
日東精工	100	689.00	68,900	
岡部	100	788.00	78,800	
高周波熱錬	100	1,132.00	113,200	
東京製綱	100	1,324.00	132,400	
サンコール	100	488.00	48,800	
モリテック　スチール	100	225.00	22,500	
日本発條	100	1,716.50	171,650	
日本製鋼所	100	4,438.00	443,800	
三浦工業	200	3,619.00	723,800	
タクマ	300	1,744.00	523,200	
ツガミ	100	1,555.00	155,500	
オークマ	100	7,854.00	785,400	
芝浦機械	100	3,825.00	382,500	
アマダ	1,100	1,863.50	2,049,850	
アイダエンジニアリング	100	889.00	88,900	
ＦＵＪＩ	300	2,682.50	804,750	
牧野フライス製作所	100	7,030.00	703,000	
オーエスジー	200	1,930.00	386,000	
旭ダイヤモンド工業	200	966.00	193,200	
ＤＭＧ森精機	500	4,191.00	2,095,500	
ソディック	200	741.00	148,200	
ディスコ	200	68,540.00	13,708,000	
東洋機械金属	100	739.00	73,900	
島精機製作所	100	1,726.00	172,600	

オプトラン	100	2,197.00	219,700	
フリュー	100	1,077.00	107,700	
ヤマシンフィルタ	200	422.00	84,400	
日阪製作所	100	1,061.00	106,100	
やまびこ	100	2,304.00	230,400	
野村マイクロ・サイエンス	100	4,165.00	416,500	
ＰＥＧＡＳＵＳ	100	592.00	59,200	
ナブテスコ	500	2,816.00	1,408,000	
三井海洋開発	100	2,886.00	288,600	
レオン自動機	100	1,659.00	165,900	
ＳＭＣ	200	82,560.00	16,512,000	
瑞光	100	1,064.00	106,400	
オイレス工業	100	2,349.00	234,900	
サトーホールディングス	100	2,209.00	220,900	
技研製作所	100	1,934.00	193,400	
日精樹脂工業	100	1,014.00	101,400	
小松製作所	3,300	4,836.00	15,958,800	
住友重機械工業	400	4,219.00	1,687,600	
日立建機	300	4,518.00	1,355,400	
日工	100	781.00	78,100	
井関農機	100	1,037.00	103,700	
ＴＯＷＡ	100	11,170.00	1,117,000	
クボタ	3,000	2,223.50	6,670,500	
月島ホールディングス	100	1,478.00	147,800	
新東工業	100	1,136.00	113,600	
澁谷工業	100	3,485.00	348,500	
アイチ　コーポレーション	100	1,245.00	124,500	
小森コーポレーション	200	1,354.00	270,800	
鶴見製作所	100	4,195.00	419,500	
荏原製作所	1,500	2,437.50	3,656,250	
北越工業	100	2,308.00	230,800	
ダイキン工業	800	23,285.00	18,628,000	
オルガノ	100	7,880.00	788,000	
栗田工業	400	7,000.00	2,800,000	
椿本チエイン	100	6,500.00	650,000	
木村化工機	100	727.00	72,700	
アネスト岩田	100	1,597.00	159,700	
ダイフク	1,400	2,985.50	4,179,700	
タダノ	500	1,165.50	582,750	
フジテック	100	4,441.00	444,100	
ＣＫＤ	200	3,325.00	665,000	
平和	200	2,090.00	418,000	

理想科学工業	100	3,145.00	314,500	
ＳＡＮＫＹＯ	600	1,810.00	1,086,000	
日本金銭機械	100	1,092.00	109,200	
竹内製作所	100	5,810.00	581,000	
アマノ	200	4,179.00	835,800	
ＪＵＫＩ	100	533.00	53,300	
マックス	100	3,760.00	376,000	
グローリー	200	2,771.50	554,300	
新晃工業	100	4,255.00	425,500	
大和冷機工業	100	1,562.00	156,200	
セガサミーホールディングス	600	2,501.50	1,500,900	
ツバキ・ナカシマ	100	836.00	83,600	
ホシザキ	300	4,880.00	1,464,000	
日本精工	1,000	820.20	820,200	
ＮＴＮ	1,000	334.90	334,900	
ジェイテクト	100	1,142.50	114,250	
日本トムソン	100	634.00	63,400	
ＴＨＫ	300	3,030.00	909,000	
イーグル工業	100	1,866.00	186,600	
ＰＩＬＬＡＲ	100	5,580.00	558,000	
キッツ	200	1,140.00	228,000	
マキタ	800	4,687.00	3,749,600	
三井Ｅ＆Ｓ	300	1,475.00	442,500	
日立造船	600	1,083.00	649,800	
三菱重工業	10,900	1,834.50	19,996,050	
ＩＨＩ	600	5,505.00	3,303,000	
サノヤスホールディングス	100	220.00	22,000	
スター精密	100	2,140.00	214,000	
日清紡ホールディングス	400	1,094.50	437,800	
イビデン	200	6,881.00	1,376,200	
コニカミノルタ	1,700	466.10	792,370	
ブラザー工業	900	3,064.00	2,757,600	
ミネベアミツミ	800	3,588.00	2,870,400	
日立製作所	15,000	3,779.00	56,685,000	
三菱電機	8,000	2,839.50	22,716,000	
富士電機	300	9,504.00	2,851,200	
安川電機	900	5,633.00	5,069,700	
シンフォニアテクノロジー	100	3,445.00	344,500	
明電舎	100	3,630.00	363,000	
ＰＨＣホールディングス	100	1,139.00	113,900	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	300	5,550.00	1,665,000	
ソシオネクスト	400	4,024.00	1,609,600	

東芝テック	100	3,600.00	360,000	
マブチモーター	200	2,372.50	474,500	
ニデック	1,400	7,047.00	9,865,800	
ダブル・スコープ	100	509.00	50,900	
ダイヘン	100	8,580.00	858,000	
ヤーマン	100	827.00	82,700	
ＪＶＣケンウッド	500	889.00	444,500	
ミマキエンジニアリング	100	2,123.00	212,300	
大崎電気工業	100	702.00	70,200	
オムロン	600	5,761.00	3,456,600	
日東工業	100	3,555.00	355,500	
ＩＤＥＣ	100	3,055.00	305,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	200	2,950.50	590,100	
日本電気	700	13,620.00	9,534,000	
富士通	5,200	2,667.50	13,871,000	
沖電気工業	400	1,063.00	425,200	
サンケン電気	100	7,703.00	770,300	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	3,382.00	10,146,000	
セイコーエプソン	900	2,688.00	2,419,200	
ワコム	500	815.00	407,500	
アルバック	100	10,885.00	1,088,500	
ＥＩＺＯ	100	4,925.00	492,500	
ジャパンディスプレイ	1,500	19.00	28,500	
日本信号	200	1,036.00	207,200	
京三製作所	100	684.00	68,400	
能美防災	100	2,417.00	241,700	
エレコム	100	1,674.00	167,400	
パナソニック　ホールディングス	8,000	1,354.00	10,832,000	
シャープ	1,000	975.60	975,600	
アンリツ	600	1,257.50	754,500	
富士通ゼネラル	200	2,104.50	420,900	
ソニーグループ	4,700	15,380.00	72,286,000	
ＴＤＫ	700	10,985.00	7,689,500	
タムラ製作所	200	728.00	145,600	
アルプスアルパイン	600	1,601.50	960,900	
日本電波工業	100	1,509.00	150,900	
ティアック	100	109.00	10,900	
ホシデン	200	2,162.00	432,400	
ヒロセ電機	100	19,235.00	1,923,500	
日本航空電子工業	200	2,692.00	538,400	
ＴＯＡ	100	1,068.00	106,800	
マクセル	100	1,881.00	188,100	

古野電気	100	2,403.00	240,300	
スミダコーポレーション	100	1,126.00	112,600	
横河電機	800	4,122.00	3,297,600	
アズビル	500	4,576.00	2,288,000	
日本光電工業	600	2,317.50	1,390,500	
堀場製作所	200	13,525.00	2,705,000	
アドバンテスト	2,000	6,841.00	13,682,000	
エスペック	100	3,070.00	307,000	
キーエンス	600	76,750.00	46,050,000	
シスメックス	2,100	2,565.00	5,386,500	
日本マイクロニクス	200	7,250.00	1,450,000	
イリソ電子工業	100	3,210.00	321,000	
オプテックスグループ	100	1,791.00	179,100	
レーザーテック	300	34,210.00	10,263,000	
スタンレー電気	100	2,922.50	292,250	
ウシオ電機	300	2,190.50	657,150	
日本セラミック	100	2,577.00	257,700	
図研	100	4,090.00	409,000	
日本電子	200	7,038.00	1,407,600	
カシオ計算機	500	1,223.00	611,500	
ファナック	3,600	4,599.00	16,556,400	
日本シイエムケイ	100	604.00	60,400	
大真空	100	787.00	78,700	
ローム	800	2,344.00	1,875,200	
浜松ホトニクス	600	4,400.00	2,640,000	
三井ハイテック	100	6,194.00	619,400	
新光電気工業	200	5,690.00	1,138,000	
京セラ	3,400	1,985.50	6,750,700	
太陽誘電	200	4,769.00	953,800	
村田製作所	4,500	3,697.00	16,636,500	
双葉電子工業	100	651.00	65,100	
ニチコン	200	1,211.00	242,200	
ＫＯＡ	100	1,556.00	155,600	
小糸製作所	100	2,304.00	230,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	300	16,295.00	4,888,500	
キヤノン電子	100	2,299.00	229,900	
キヤノン	3,300	4,560.00	15,048,000	
リコー	1,600	1,435.50	2,296,800	
東京エレクトロン	1,600	38,050.00	60,880,000	
トヨタ紡織	100	2,170.50	217,050	
豊田自動織機	500	13,755.00	6,877,500	
モリタホールディングス	100	1,792.00	179,200	

デンソー	1,400	2,593.50	3,630,900	
川崎重工業	600	5,943.00	3,565,800	
名村造船所	100	2,371.00	237,100	
三菱ロジスネクスト	100	1,479.00	147,900	
日産自動車	9,900	561.60	5,559,840	
いすゞ自動車	1,900	2,217.50	4,213,250	
トヨタ自動車	48,600	3,284.00	159,602,400	
日野自動車	1,300	430.10	559,130	
三菱自動車工業	3,300	510.00	1,683,000	
日産車体	100	989.00	98,900	
新明和工業	200	1,455.00	291,000	
極東開発工業	100	2,558.00	255,800	
曙ブレーキ工業	100	168.00	16,800	
ＮＯＫ	100	2,207.00	220,700	
プレス工業	100	649.00	64,900	
アイシン	100	5,503.00	550,300	
マツダ	2,900	1,570.50	4,554,450	
本田技研工業	17,000	1,723.50	29,299,500	
スズキ	4,800	1,954.00	9,379,200	
ＳＵＢＡＲＵ	2,300	3,529.00	8,116,700	
ヤマハ発動機	600	1,596.00	957,600	
エフ・シー・シー	100	2,387.00	238,700	
テイ・エス　テック	100	1,966.00	196,600	
テルモ	3,200	2,779.50	8,894,400	
日機装	200	1,195.00	239,000	
島津製作所	1,000	4,289.00	4,289,000	
ＪＭＳ	100	529.00	52,900	
オーバル	100	467.00	46,700	
東京精密	100	13,490.00	1,349,000	
マニー	200	2,052.00	410,400	
ニコン	1,000	1,708.00	1,708,000	
トプコン	300	1,850.00	555,000	
オリンパス	3,400	2,698.50	9,174,900	
理研計器	100	4,115.00	411,500	
ＨＯＹＡ	1,100	20,770.00	22,847,000	
ノーリツ鋼機	100	4,500.00	450,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	100	3,370.00	337,000	
朝日インテック	700	2,366.50	1,656,550	
シチズン時計	600	1,093.00	655,800	
大研医器	100	537.00	53,700	
メニコン	300	1,333.00	399,900	
セイコーグループ	100	4,905.00	490,500	

ニプロ	500	1,291.50	645,750	
パラマウントベッドホールディングス	100	2,702.00	270,200	
前田工繊	200	1,623.00	324,600	
アートネイチャー	100	818.00	81,800	
バンダイナムコホールディングス	2,000	3,218.00	6,436,000	
ＳＨＯＥＩ	200	2,030.00	406,000	
フランスベッドホールディングス	100	1,221.00	122,100	
フジシールインターナショナル	100	2,380.00	238,000	
タカラトミー	300	3,177.00	953,100	
広済堂ホールディングス	100	557.00	55,700	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	300	4,617.00	1,385,100	
大日本印刷	300	5,510.00	1,653,000	
ＮＩＳＳＨＡ	100	2,039.00	203,900	
アシックス	1,600	2,527.00	4,043,200	
ローランド	100	3,985.00	398,500	
ヤマハ	400	3,700.00	1,480,000	
ピジョン	400	1,484.50	593,800	
リンテック	200	3,575.00	715,000	
イトーキ	100	1,619.00	161,900	
任天堂	2,900	9,100.00	26,390,000	
タカラスタンダード	100	1,776.00	177,600	
コクヨ	200	2,639.50	527,900	
オカムラ	100	2,222.00	222,200	
美津濃	100	7,570.00	757,000	
東京電力ホールディングス	11,000	829.70	9,126,700	
中部電力	3,600	1,884.50	6,784,200	
関西電力	200	2,668.50	533,700	
中国電力	100	1,027.50	102,750	
東北電力	200	1,387.00	277,400	
四国電力	100	1,349.00	134,900	
九州電力	100	1,564.50	156,450	
レノバ	200	977.00	195,400	
東京瓦斯	1,900	3,435.00	6,526,500	
大阪瓦斯	1,600	3,408.00	5,452,800	
東邦瓦斯	500	3,882.00	1,941,000	
西部ガスホールディングス	200	1,955.00	391,000	
静岡ガス	100	932.00	93,200	
メタウォーター	100	1,921.00	192,100	
ＳＢＳホールディングス	100	2,590.00	259,000	
東武鉄道	1,200	2,680.00	3,216,000	
相鉄ホールディングス	500	2,383.50	1,191,750	
東急	3,400	1,735.00	5,899,000	

京浜急行電鉄	1,300	1,187.50	1,543,750	
小田急電鉄	1,800	1,557.00	2,802,600	
京王電鉄	400	3,750.00	1,500,000	
京成電鉄	500	5,235.00	2,617,500	
東日本旅客鉄道	4,600	2,710.50	12,468,300	
西日本旅客鉄道	1,900	2,931.50	5,569,850	
東海旅客鉄道	3,100	3,527.00	10,933,700	
西武ホールディングス	1,000	2,284.50	2,284,500	
鴻池運輸	200	2,404.00	480,800	
西日本鉄道	400	2,479.50	991,800	
ハマキョウレックス	100	4,595.00	459,500	
サカイ引越センター	100	2,632.00	263,200	
近鉄グループホールディングス	1,200	3,454.00	4,144,800	
阪急阪神ホールディングス	1,600	4,300.00	6,880,000	
南海電気鉄道	500	2,676.00	1,338,000	
京阪ホールディングス	400	2,877.00	1,150,800	
名古屋鉄道	1,000	1,778.00	1,778,000	
ヤマトホールディングス	1,500	1,838.00	2,757,000	
センコーグループホールディングス	600	1,113.00	667,800	
ニッコンホールディングス	300	3,618.00	1,085,400	
福山通運	100	3,955.00	395,500	
セイノーホールディングス	600	2,226.50	1,335,900	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	300	1,195.00	358,500	
九州旅客鉄道	600	3,565.00	2,139,000	
ＳＧホールディングス	1,400	1,444.50	2,022,300	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	400	7,366.00	2,946,400	
日新	100	4,635.00	463,500	
三菱倉庫	300	5,379.00	1,613,700	
三井倉庫ホールディングス	100	4,805.00	480,500	
住友倉庫	200	2,767.00	553,400	
安田倉庫	100	1,607.00	160,700	
上組	600	3,399.00	2,039,400	
エーアイテイー	100	1,880.00	188,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	300	2,466.00	739,800	
システナ	900	351.00	315,900	
日鉄ソリューションズ	200	2,893.00	578,600	
ラクーンホールディングス	100	576.00	57,600	
ＴＩＳ	700	3,145.00	2,201,500	
グリー	600	553.00	331,800	
コーエーテクモホールディングス	1,100	1,455.00	1,600,500	
ファインデックス	100	1,087.00	108,700	
ブレインパッド	100	1,023.00	102,300	

ＫＬａｂ	400	230.00	92,000	
ポールトゥウィンホールディングス	100	489.00	48,900	
ネクソン	1,300	3,320.00	4,316,000	
アイスタイル	200	463.00	92,600	
エムアップホールディングス	100	1,332.00	133,200	
エニグモ	100	341.00	34,100	
テクノスジャパン	100	761.00	76,100	
コロプラ	700	648.00	453,600	
ブロードリーフ	300	599.00	179,700	
じげん	200	573.00	114,600	
ブイキューブ	100	262.00	26,200	
フィックスターズ	100	1,884.00	188,400	
オプティム	100	668.00	66,800	
セレス	100	1,585.00	158,500	
ティーガイア	100	3,105.00	310,500	
テクマトリックス	100	1,997.00	199,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	400	2,921.00	1,168,400	
GMOペイメントゲートウェイ	200	8,948.00	1,789,600	
インターネットイニシアティブ	400	2,560.00	1,024,000	
さくらインターネット	100	4,010.00	401,000	
朝日ネット	100	684.00	68,400	
ｅＢＡＳＥ	100	714.00	71,400	
アバントグループ	100	1,413.00	141,300	
コムチュア	100	1,854.00	185,400	
アステリア	100	556.00	55,600	
メディカル・データ・ビジョン	100	568.00	56,800	
ｇｕｍｉ	300	340.00	102,000	
ラクス	300	1,902.50	570,750	
オープンドア	100	658.00	65,800	
マイネット	100	328.00	32,800	
アカツキ	100	2,552.00	255,200	
カナミックネットワーク	100	546.00	54,600	
チェンジホールディングス	100	1,240.00	124,000	
オークネット	100	2,758.00	275,800	
セグエグループ	100	627.00	62,700	
マクロミル	100	869.00	86,900	
ニーズウェル	100	382.00	38,200	
マネーフォワード	300	5,276.00	1,582,800	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	100	841.00	84,100	
プラスアルファ・コンサルティング	100	1,812.00	181,200	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	300	1,188.00	356,400	
ソルクシーズ	100	317.00	31,700	

プロトコーポレーション	100	1,435.00	143,500	
野村総合研究所	1,400	4,651.00	6,511,400	
日本システム技術	100	1,719.00	171,900	
インテージホールディングス	100	1,536.00	153,600	
ソースネクスト	300	212.00	63,600	
シンプレクス・ホールディングス	100	2,680.00	268,000	
ラクスル	100	973.00	97,300	
メルカリ	300	2,324.00	697,200	
ＦＩＧ	100	345.00	34,500	
ウイングアーク１ｓｔ	100	2,625.00	262,500	
Ｓａｎｓａｎ	200	1,730.00	346,000	
ギフティ	100	1,023.00	102,300	
メドレー	100	3,890.00	389,000	
ＪＭＤＣ	100	3,370.00	337,000	
フジ・メディア・ホールディングス	600	1,868.00	1,120,800	
オービック	200	21,375.00	4,275,000	
ジャストシステム	100	3,130.00	313,000	
ＴＤＣソフト	200	1,255.00	251,000	
ＬＩＮＥヤフー	8,500	404.00	3,434,000	
トレンドマイクロ	300	7,141.00	2,142,300	
日本オラクル	100	11,630.00	1,163,000	
フューチャー	100	1,536.00	153,600	
オービックビジネスコンサルタント	100	7,101.00	710,100	
アイティフォー	100	1,493.00	149,300	
大塚商会	1,000	3,272.00	3,272,000	
サイボウズ	100	1,844.00	184,400	
電通総研	100	5,040.00	504,000	
ＡＣＣＥＳＳ	100	1,317.00	131,700	
デジタルガレージ	200	2,576.00	515,200	
ＥＭシステムズ	100	610.00	61,000	
ＣＩＪ	200	486.00	97,200	
日本エンタープライズ	100	137.00	13,700	
ＷＯＷＯＷ	100	1,115.00	111,500	
スカラ	100	669.00	66,900	
インテリジェント　ウェイブ	100	1,120.00	112,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	100	2,482.00	248,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	100	550.00	55,000	
ネットワンシステムズ	300	3,002.00	900,600	
システムソフト	200	71.00	14,200	
アルゴグラフィックス	100	4,785.00	478,500	
マーベラス	100	651.00	65,100	
エイベックス	100	1,453.00	145,300	

ＢＩＰＲＯＧＹ	200	4,537.00	907,400	
ＴＢＳホールディングス	300	4,397.00	1,319,100	
日本テレビホールディングス	600	2,458.00	1,474,800	
テレビ朝日ホールディングス	500	2,156.00	1,078,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	500	886.00	443,000	
テレビ東京ホールディングス	100	3,750.00	375,000	
ビジョン	100	1,289.00	128,900	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	100	4,300.00	430,000	
日本通信	700	197.00	137,900	
日本電信電話	196,000	159.50	31,262,000	
ＫＤＤＩ	4,600	4,541.00	20,888,600	
ソフトバンク	10,100	2,068.00	20,886,800	
光通信	100	30,070.00	3,007,000	
GMOインターネットグループ	200	2,551.00	510,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	300	2,826.00	847,800	
学研ホールディングス	100	1,036.00	103,600	
ゼンリン	300	924.00	277,200	
東宝	300	4,526.00	1,357,800	
東映	100	3,835.00	383,500	
ＮＴＴデータグループ	1,700	2,382.00	4,049,400	
ＤＴＳ	100	4,260.00	426,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	4,928.00	1,971,200	
シーイーシー	100	2,051.00	205,100	
カプコン	1,000	3,297.00	3,297,000	
ＳＣＳＫ	400	3,183.00	1,273,200	
アイネス	100	1,802.00	180,200	
ＴＫＣ	100	3,485.00	348,500	
富士ソフト	100	7,270.00	727,000	
ＮＳＤ	300	3,025.00	907,500	
コナミグループ	200	12,165.00	2,433,000	
ＪＢＣＣホールディングス	100	3,700.00	370,000	
ミロク情報サービス	100	1,955.00	195,500	
ソフトバンクグループ	2,600	11,920.00	30,992,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	100	3,090.00	309,000	
エレマテック	100	2,107.00	210,700	
あらた	100	3,515.00	351,500	
東京エレクトロン　デバイス	100	4,310.00	431,000	
円谷フィールズホールディングス	100	1,729.00	172,900	
双日	900	3,896.00	3,506,400	
アルフレッサ　ホールディングス	700	2,268.00	1,587,600	
横浜冷凍	100	1,032.00	103,200	
アルコニックス	100	1,538.00	153,800	

神戸物産	500	3,612.00	1,806,000	
あい　ホールディングス	100	2,383.00	238,300	
ダイワボウホールディングス	300	2,950.00	885,000	
マクニカホールディングス	200	6,680.00	1,336,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,309.00	261,800	
レスター	100	3,185.00	318,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	300	982.00	294,600	
三洋貿易	100	1,571.00	157,100	
シップヘルスケアホールディングス	200	2,259.50	451,900	
コメダホールディングス	200	2,588.00	517,600	
フルサト・マルカホールディングス	100	2,266.00	226,600	
ヤマエグループホールディングス	100	2,442.00	244,200	
小野建	100	1,642.00	164,200	
ナガイレーベン	100	2,539.00	253,900	
三菱食品	100	5,510.00	551,000	
第一興商	300	1,690.50	507,150	
メディパルホールディングス	700	2,606.50	1,824,550	
アズワン	200	3,119.00	623,800	
丸文	100	1,251.00	125,100	
ハピネット	100	3,315.00	331,500	
日本ライフライン	200	1,169.00	233,800	
ＩＤＯＭ	100	1,457.00	145,700	
シークス	100	1,297.00	129,700	
伊藤忠商事	3,500	8,100.00	28,350,000	
丸紅	7,100	3,039.00	21,576,900	
高島	100	1,011.00	101,100	
長瀬産業	200	3,259.00	651,800	
蝶理	100	3,640.00	364,000	
豊田通商	2,100	3,249.00	6,822,900	
兼松	400	2,675.00	1,070,000	
三井物産	8,000	3,765.00	30,120,000	
カメイ	100	2,288.00	228,800	
山善	300	1,469.00	440,700	
住友商事	5,000	4,061.00	20,305,000	
三菱商事	9,400	3,369.00	31,668,600	
第一実業	100	2,423.00	242,300	
キヤノンマーケティングジャパン	200	4,610.00	922,000	
東京産業	100	731.00	73,100	
ユアサ商事	100	5,450.00	545,000	
阪和興業	200	5,960.00	1,192,000	
ＲＹＯＤＥＮ	100	2,860.00	286,000	
岩谷産業	100	10,315.00	1,031,500	

アステナホールディングス	100	542.00	54,200	
三愛オブリ	300	2,137.00	641,100	
稲畑産業	100	3,555.00	355,500	
明和産業	100	726.00	72,600	
ワキタ	100	1,708.00	170,800	
東邦ホールディングス	200	4,367.00	873,400	
ミツウロコグループホールディングス	200	1,738.00	347,600	
伊藤忠エネクス	300	1,513.00	453,900	
サンリオ	500	3,177.00	1,588,500	
新光商事	100	945.00	94,500	
東陽テクニカ	100	1,660.00	166,000	
モスフードサービス	100	3,520.00	352,000	
加賀電子	100	5,730.00	573,000	
ソーダニッカ	100	1,196.00	119,600	
立花エレテック	100	3,150.00	315,000	
ＰＡＬＴＡＣ	100	4,292.00	429,200	
三谷産業	100	364.00	36,400	
コーア商事ホールディングス	100	724.00	72,400	
ＫＰＰグループホールディングス	200	765.00	153,000	
泉州電業	100	5,110.00	511,000	
トラスコ中山	200	2,404.00	480,800	
オートバックスセブン	200	1,579.00	315,800	
モリト	100	1,475.00	147,500	
加藤産業	100	4,320.00	432,000	
イエローハット	100	2,306.00	230,600	
ＪＫホールディングス	100	1,079.00	107,900	
日伝	100	3,530.00	353,000	
北沢産業	100	346.00	34,600	
因幡電機産業	200	4,030.00	806,000	
東テク	100	2,405.00	240,500	
ミスミグループ本社	1,200	2,811.50	3,373,800	
スズケン	200	5,196.00	1,039,200	
サンエー	100	4,970.00	497,000	
カワチ薬品	100	2,883.00	288,300	
エービーシー・マート	200	2,790.50	558,100	
アスクル	200	2,122.00	424,400	
ゲオホールディングス	100	1,689.00	168,900	
アダストリア	100	3,150.00	315,000	
くら寿司	100	3,900.00	390,000	
パルグループホールディングス	100	1,663.00	166,300	
エディオン	300	1,666.00	499,800	
サーラコーポレーション	300	819.00	245,700	

フジオフードグループ本社	100	1,412.00	141,200	
クオールホールディングス	100	1,513.00	151,300	
ビックカメラ	300	1,556.00	466,800	
ＤＣＭホールディングス	300	1,409.00	422,700	
ペッパーフードサービス	100	141.00	14,100	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	1,200	2,092.50	2,511,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	600	2,012.50	1,207,500	
マツキヨココカラ＆カンパニー	1,300	2,384.50	3,099,850	
ＺＯＺＯ	400	4,394.00	1,757,600	
物語コーポレーション	100	3,610.00	361,000	
三越伊勢丹ホールディングス	600	3,624.00	2,174,400	
ウエルシアホールディングス	400	1,915.00	766,000	
クリエイトＳＤホールディングス	100	3,315.00	331,500	
シュッピン	100	1,519.00	151,900	
オイシックス・ラ・大地	100	1,272.00	127,200	
ネクステージ	100	2,157.00	215,700	
ジョイフル本田	200	2,166.00	433,200	
すかいらーくホールディングス	300	2,122.00	636,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	100	862.00	86,200	
日本調剤	100	1,497.00	149,700	
コスモス薬品	100	12,655.00	1,265,500	
セブン&アイ・ホールディングス	7,000	1,940.00	13,580,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	400	1,090.00	436,000	
ツルハホールディングス	200	9,120.00	1,824,000	
サンマルクホールディングス	100	2,156.00	215,600	
トリドールホールディングス	100	3,850.00	385,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	100	283.00	28,300	
バロックジャパンリミテッド	100	797.00	79,700	
クスリのアオキホールディングス	200	2,977.00	595,400	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	400	2,633.00	1,053,200	
メディカルシステムネットワーク	100	578.00	57,800	
ノジマ	200	1,617.00	323,400	
良品計画	800	2,712.00	2,169,600	
アドヴァングループ	100	951.00	95,100	
コナカ	100	274.00	27,400	
イオン北海道	200	896.00	179,200	
コジマ	100	973.00	97,300	
コーナン商事	100	4,125.00	412,500	
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	1,300	3,954.00	5,140,200	
西松屋チェーン	100	2,189.00	218,900	

ゼンショーホールディングス	300	6,133.00	1,839,900	
サイゼリヤ	100	5,620.00	562,000	
ＶＴホールディングス	300	509.00	152,700	
ユナイテッドアローズ	100	2,171.00	217,100	
ハイデイ日高	100	2,751.00	275,100	
コロワイド	100	2,025.50	202,550	
壱番屋	300	1,089.00	326,700	
スギホールディングス	400	2,311.00	924,400	
スクロール	100	1,045.00	104,500	
ヨンドシーホールディングス	100	1,930.00	193,000	
木曽路	100	2,603.00	260,300	
ＳＲＳホールディングス	100	1,330.00	133,000	
千趣会	100	308.00	30,800	
上新電機	100	2,651.00	265,100	
日本瓦斯	800	2,393.00	1,914,400	
いなげや	100	1,218.00	121,800	
チヨダ	100	1,006.00	100,600	
ライフコーポレーション	100	3,645.00	364,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	100	681.00	68,100	
ＡＯＫＩホールディングス	100	1,336.00	133,600	
コメリ	100	3,575.00	357,500	
青山商事	100	1,527.00	152,700	
しまむら	200	7,241.00	1,448,200	
高島屋	400	3,063.00	1,225,200	
松屋	100	1,181.00	118,100	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	100	2,666.00	266,600	
丸井グループ	400	2,367.00	946,800	
アクシアル　リテイリング	200	1,014.00	202,800	
イオン	2,200	3,325.00	7,315,000	
イズミ	100	3,392.00	339,200	
ヤオコー	100	9,180.00	918,000	
ゼビオホールディングス	100	1,161.00	116,100	
ケーズホールディングス	500	1,582.50	791,250	
日産東京販売ホールディングス	100	513.00	51,300	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	100	2,749.00	274,900	
アインホールディングス	100	5,423.00	542,300	
ヤマダホールディングス	2,100	443.30	930,930	
アークランズ	200	1,844.00	368,800	
ニトリホールディングス	300	16,580.00	4,974,000	
愛眼	100	181.00	18,100	
吉野家ホールディングス	300	2,854.00	856,200	
アークス	100	2,647.00	264,700	

バローホールディングス	100	2,427.00	242,700	
ファーストリテイリング	400	45,200.00	18,080,000	
サンドラッグ	200	3,995.00	799,000	
ベルーナ	100	812.00	81,200	
いよぎんホールディングス	700	1,528.00	1,069,600	
しずおかフィナンシャルグループ	1,400	1,490.50	2,086,700	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	400	1,642.50	657,000	
楽天銀行	300	3,025.00	907,500	
京都フィナンシャルグループ	900	2,898.00	2,608,200	
じもとホールディングス	100	340.00	34,000	
めぶきフィナンシャルグループ	2,800	608.80	1,704,640	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	4,600.00	460,000	
九州フィナンシャルグループ	1,300	938.70	1,220,310	
ゆうちょ銀行	7,900	1,532.50	12,106,750	
富山第一銀行	100	1,306.00	130,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	3,200	937.20	2,999,040	
西日本フィナンシャルホールディングス	400	2,026.00	810,400	
三十三フィナンシャルグループ	100	2,069.00	206,900	
第四北越フィナンシャルグループ	100	5,070.00	507,000	
ひろぎんホールディングス	800	1,211.00	968,800	
十六フィナンシャルグループ	100	4,630.00	463,000	
北國フィナンシャルホールディングス	100	5,240.00	524,000	
プロクレアホールディングス	100	1,868.00	186,800	
あいちフィナンシャルグループ	100	2,613.00	261,300	
あおぞら銀行	500	2,498.00	1,249,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	37,800	1,792.00	67,737,600	
りそなホールディングス	7,000	1,066.00	7,462,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,200	3,835.00	8,437,000	
三井住友フィナンシャルグループ	4,000	11,065.00	44,260,000	
千葉銀行	1,700	1,380.50	2,346,850	
群馬銀行	1,200	1,015.50	1,218,600	
武蔵野銀行	100	3,195.00	319,500	
千葉興業銀行	200	1,058.00	211,600	
筑波銀行	300	308.00	92,400	
七十七銀行	200	4,410.00	882,000	
山形銀行	100	1,144.00	114,400	
東邦銀行	400	315.00	126,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	500	4,278.00	2,139,000	
スルガ銀行	500	1,074.00	537,000	
八十二銀行	1,400	1,045.00	1,463,000	
山梨中央銀行	100	1,954.00	195,400	
大垣共立銀行	100	2,211.00	221,100	

滋賀銀行	100	4,080.00	408,000	
南都銀行	100	3,525.00	352,500	
百五銀行	800	669.00	535,200	
紀陽銀行	200	1,906.00	381,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	200	2,007.50	401,500	
山陰合同銀行	500	1,414.00	707,000	
百十四銀行	100	3,190.00	319,000	
四国銀行	100	1,162.00	116,200	
阿波銀行	100	2,703.00	270,300	
宮崎銀行	100	3,280.00	328,000	
琉球銀行	100	1,227.00	122,700	
セブン銀行	2,300	274.30	630,890	
みずほフィナンシャルグループ	5,400	3,484.00	18,813,600	
山口フィナンシャルグループ	400	1,801.00	720,400	
北洋銀行	900	520.00	468,000	
愛媛銀行	100	1,238.00	123,800	
京葉銀行	200	833.00	166,600	
栃木銀行	300	352.00	105,600	
東和銀行	100	692.00	69,200	
福島銀行	100	269.00	26,900	
トモニホールディングス	700	413.00	289,100	
池田泉州ホールディングス	600	387.00	232,200	
ＦＰＧ	200	2,384.00	476,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	100	1,647.00	164,700	
ＳＢＩホールディングス	900	4,083.00	3,674,700	
日本アジア投資	100	234.00	23,400	
ジャフコ　グループ	200	1,970.00	394,000	
大和証券グループ本社	4,400	1,290.50	5,678,200	
野村ホールディングス	10,400	965.20	10,038,080	
岡三証券グループ	500	777.00	388,500	
丸三証券	200	1,114.00	222,800	
東洋証券	200	411.00	82,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	700	577.00	403,900	
水戸証券	200	568.00	113,600	
いちよし証券	100	846.00	84,600	
松井証券	300	845.00	253,500	
マネックスグループ	700	701.00	490,700	
極東証券	100	1,496.00	149,600	
岩井コスモホールディングス	100	2,255.00	225,500	
アイザワ証券グループ	100	2,822.00	282,200	
マネーパートナーズグループ	100	246.00	24,600	
スパークス・グループ	100	1,749.00	174,900	

かんぽ生命保険	800	3,232.00	2,585,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	2,200	3,493.00	7,684,600	
アニコム　ホールディングス	200	684.00	136,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	3,900	3,862.00	15,061,800	
第一生命ホールディングス	2,700	4,735.00	12,784,500	
東京海上ホールディングス	6,200	6,476.00	40,151,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	1,400	3,023.00	4,232,200	
全国保証	200	5,995.00	1,199,000	
ジェイリース	100	1,342.00	134,200	
ＳＢＩアルヒ	100	904.00	90,400	
プレミアグループ	100	2,114.00	211,400	
ネットプロテクションズホールディングス	300	199.00	59,700	
クレディセゾン	400	3,386.00	1,354,400	
芙蓉総合リース	100	12,160.00	1,216,000	
みずほリース	500	1,131.00	565,500	
東京センチュリー	400	1,509.50	603,800	
日本証券金融	200	1,627.00	325,400	
アイフル	1,000	385.00	385,000	
リコーリース	100	5,300.00	530,000	
イオンフィナンシャルサービス	400	1,302.50	521,000	
アコム	1,200	425.80	510,960	
ジャックス	100	4,650.00	465,000	
オリエントコーポレーション	200	1,025.00	205,000	
オリックス	3,300	3,697.00	12,200,100	
三菱ＨＣキャピタル	2,800	1,080.00	3,024,000	
日本取引所グループ	1,500	3,906.00	5,859,000	
イー・ギャランティ	200	1,463.00	292,600	
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	200	179.00	35,800	
大東建託	300	16,960.00	5,088,000	
サムティホールディングス	100	2,597.00	259,700	
いちご	200	414.00	82,800	
日本駐車場開発	300	214.00	64,200	
スター・マイカ・ホールディングス	100	678.00	67,800	
ＡＤワークスグループ	200	229.00	45,800	
ヒューリック	1,400	1,452.50	2,033,500	
野村不動産ホールディングス	400	4,133.00	1,653,200	
三重交通グループホールディングス	200	558.00	111,600	
ディア・ライフ	100	989.00	98,900	
地主	100	2,737.00	273,700	
プレサンスコーポレーション	100	1,947.00	194,700	
ＪＰＭＣ	100	1,215.00	121,500	
フージャースホールディングス	100	1,135.00	113,500	

オープンハウスグループ	300	5,331.00	1,599,300	
東急不動産ホールディングス	2,400	1,082.50	2,598,000	
飯田グループホールディングス	600	2,119.50	1,271,700	
ムゲンエステート	100	1,334.00	133,400	
ビーロット	100	936.00	93,600	
グッドコムアセット	100	838.00	83,800	
ロードスターキャピタル	100	2,799.00	279,900	
パーク２４	200	1,602.00	320,400	
三井不動産	10,400	1,493.00	15,527,200	
三菱地所	1,200	2,613.00	3,135,600	
平和不動産	100	3,935.00	393,500	
東京建物	200	2,675.50	535,100	
京阪神ビルディング	200	1,764.00	352,800	
住友不動産	1,200	4,896.00	5,875,200	
レオパレス２１	600	521.00	312,600	
スターツコーポレーション	100	3,330.00	333,000	
フジ住宅	100	799.00	79,900	
ゴールドクレスト	100	2,674.00	267,400	
日神グループホールディングス	100	595.00	59,500	
日本エスコン	100	1,085.00	108,500	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	400	532.00	212,800	
イオンモール	100	1,877.50	187,750	
ランド	4,700	8.00	37,600	
カチタス	200	1,821.00	364,200	
トーセイ	100	2,487.00	248,700	
サンフロンティア不動産	100	2,044.00	204,400	
ＦＪネクストホールディングス	100	1,306.00	130,600	
グランディハウス	100	617.00	61,700	
日本空港ビルデング	300	5,579.00	1,673,700	
ＬＩＦＵＬＬ	200	156.00	31,200	
ＭＩＸＩ	300	3,040.00	912,000	
ジェイエイシーリクルートメント	400	702.00	280,800	
日本M&Aセンターホールディングス	1,000	876.50	876,500	
ＵＴグループ	100	3,255.00	325,500	
ケアネット	200	552.00	110,400	
オープンアップグループ	100	2,151.00	215,100	
コシダカホールディングス	300	886.00	265,800	
リンクアンドモチベーション	100	503.00	50,300	
エス・エム・エス	100	1,935.00	193,500	
パーソルホールディングス	8,800	256.90	2,260,720	
クックパッド	200	206.00	41,200	
綜合警備保障	800	951.00	760,800	

カカクコム	400	2,140.50	856,200	
ルネサンス	100	1,021.00	102,100	
ディップ	100	3,030.00	303,000	
新日本科学	100	1,324.00	132,400	
エムスリー	1,600	1,563.00	2,500,800	
ウェルネット	100	690.00	69,000	
ディー・エヌ・エー	200	1,604.50	320,900	
博報堂ＤＹホールディングス	1,000	1,203.50	1,203,500	
ぐるなび	100	315.00	31,500	
タカミヤ	100	472.00	47,200	
ファンコミュニケーションズ	100	414.00	41,400	
エスプール	200	323.00	64,600	
アドウェイズ	100	407.00	40,700	
バリューコマース	200	1,222.00	244,400	
インフォマート	400	326.00	130,400	
ＪＰホールディングス	100	562.00	56,200	
エコナックホールディングス	100	130.00	13,000	
プレステージ・インターナショナル	300	710.00	213,000	
電通グループ	600	4,095.00	2,457,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	200	2,420.50	484,100	
オリエンタルランド	4,200	4,576.00	19,219,200	
ダスキン	100	3,733.00	373,300	
明光ネットワークジャパン	100	764.00	76,400	
ラウンドワン	300	822.00	246,600	
リゾートトラスト	100	2,392.00	239,200	
ビー・エム・エル	100	2,998.00	299,800	
リソー教育	400	250.00	100,000	
ユー・エス・エス	1,600	1,376.50	2,202,400	
東京個別指導学院	100	410.00	41,000	
サイバーエージェント	1,400	950.90	1,331,260	
楽天グループ	5,500	909.60	5,002,800	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	100	667.00	66,700	
テー・オー・ダブリュー	100	356.00	35,600	
フルキャストホールディングス	100	1,523.00	152,300	
エン・ジャパン	100	2,609.00	260,900	
テクノプロ・ホールディングス	200	2,724.50	544,900	
ＫｅｅＰｅｒ技研	100	3,850.00	385,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	100	806.00	80,600	
ジャパンマテリアル	300	2,213.00	663,900	
ベクトル	100	1,177.00	117,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,538.00	153,800	
バリューＨＲ	100	1,491.00	149,100	

シグマクシス・ホールディングス	100	1,571.00	157,100	
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	145.00	14,500	
メドピア	100	601.00	60,100	
リクルートホールディングス	5,600	9,441.00	52,869,600	
エラン	100	926.00	92,600	
日本郵政	6,000	1,668.50	10,011,000	
鎌倉新書	100	437.00	43,700	
エアトリ	100	1,324.00	132,400	
ソラスト	200	476.00	95,200	
インソース	100	842.00	84,200	
ベイカレント・コンサルティング	300	3,623.00	1,086,900	
アイモバイル	200	504.00	100,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	2,636.00	263,600	
オープングループ	100	269.00	26,900	
アンビスホールディングス	100	2,123.00	212,300	
カーブスホールディングス	200	759.00	151,800	
フォーラムエンジニアリング	100	1,025.00	102,500	
ダイレクトマーケティングミックス	200	248.00	49,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	100	1,658.00	165,800	
リログループ	300	1,762.00	528,600	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	100	4,065.00	406,500	
ＴＲＥホールディングス	100	1,306.00	130,600	
ＮＩＳＳＯホールディングス	100	847.00	84,700	
大栄環境	100	2,666.00	266,600	
M&A総研ホールディングス	100	3,705.00	370,500	
共立メンテナンス	100	2,975.00	297,500	
イチネンホールディングス	100	1,709.00	170,900	
東京都競馬	100	4,205.00	420,500	
カナモト	100	2,903.00	290,300	
ニシオホールディングス	100	3,975.00	397,500	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	100	50.00	5,000	
乃村工藝社	100	882.00	88,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	100	1,375.00	137,500	
トーカイ	100	2,220.00	222,000	
セコム	600	9,603.00	5,761,800	
丹青社	100	977.00	97,700	
メイテックグループホールディングス	100	3,421.00	342,100	
船井総研ホールディングス	100	2,280.00	228,000	
ダイセキ	100	3,715.00	371,500	
合　計	1,037,700		2,521,050,200	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

２【ファンドの現況】

【ＳＭＴ　ＥＴＦカーボン・エフィシェント日本株】

【純資産額計算書】

（2024年 8月30日現在）

Ⅰ　資産総額	2,350,150,145円
Ⅱ　負債総額	905,551円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,349,244,594円
Ⅳ　発行済口数	65,652口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	35,783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。

①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。

②受益権の譲渡

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

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③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。

④受益権の再分割

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

⑤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、交換の請求の受付、交換株式の交付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したが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 8月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。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。

②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

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10月11日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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 8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	530	15,487,993
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	60	209,161
単位型公社債投資信託	52	173,949
合計	642	15,871,103

3【委託会社等の経理状況】

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

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。

①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。

②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。

③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)				
その他有価証券	－	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)				
その他有価証券	－	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 債券先物取引 売建	12,195 182	－ －	△9 △0	△9 △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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券 関係会社株式	 1,729 3,228 20 83 21	 － － － － －	 △6 △81 △0 △0 △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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ シンガポールドル	投資有価証券 関係会社株式	 2,126 4,586 28 83 63 448	 － － － － － －	 1 7 0 0 0 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㈱	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
① 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。
② 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㈱	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
① 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。
② 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おりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自 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10月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

③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
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
バークレイズ証券株式会社	38,945※	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,905	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

※資本金の額は2023年12月末日現在です。

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、交換の請求の受付け、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱い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

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2024年3月末日現在）
④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。
⑤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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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みます。）、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．ＸＢＲＬ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9月24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　　鶴見将史

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT ETFカーボン・エフィシェント日本株の2024年1月12日から2024年7月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT ETFカーボン・エフィシェント日本株の2024年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。