

日本株式インデックス・オープン (SMA専用)

追加型投信／国内／株式／インデックス型

投資信託説明書 (請求目論見書)

2024年3月27日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年3月26日に関東財務局長に提出しており、2024年3月27日にその届出の効力が生じております。

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

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
（1）【ファンドの名称】	1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】	1
（3）【発行（売出）価額の総額】	1
（4）【発行（売出）価格】	1
（5）【申込手数料】	1
（6）【申込単位】	1
（7）【申込期間】	1
（8）【申込取扱場所】	2
（9）【払込期日】	2
（10）【払込取扱場所】	2
（11）【振替機関に関する事項】	2
（12）【その他】	2
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	13
3【投資リスク】	19
4【手数料等及び税金】	22
5【運用状況】	25
第2【管理及び運営】	32
1【申込（販売）手続等】	32
2【換金（解約）手続等】	33
3【資産管理等の概要】	34
4【受益者の権利等】	38
第3【ファンドの経理状況】	39
1【財務諸表】	42
2【ファンドの現況】	119
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	120
第三部【委託会社等の情報】	121
第1【委託会社等の概況】	121
1【委託会社等の概況】	121
2【事業の内容及び営業の概況】	122
3【委託会社等の経理状況】	123
4【利害関係人との取引制限】	157
5【その他】	157
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

日本株式インデックス・オープン（SMA専用）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- 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。
- ③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（※）とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7)【申込期間】

2024年3月27日から2024年9月25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せん。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

<申込みコース>

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

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

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MR F	特殊型
	内外	不動産投信	E T F	
		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	年1回	グローバル	ファミリーフ アード	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			TOPIX	条件付運用型
	年4回	北米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ショ ート型/絶対 収益追求型
債券	年6回 (隔月)	欧州				その他 ()
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア				
	日々	中南米				
不動産投信	その他 ()	アフリカ				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		中近東 (中東) エマージン グ				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

- 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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<ファンドの特色>

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



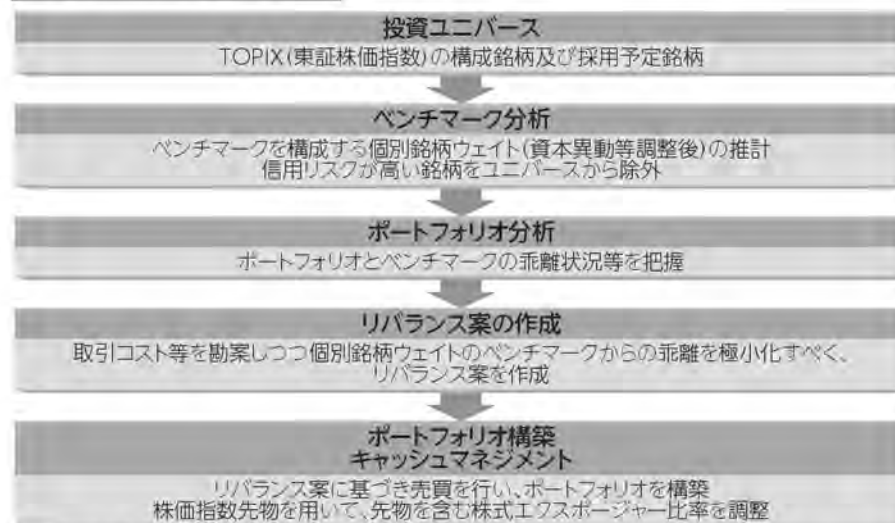
? ファミリーファンド方式とは

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

<マザーファンドの概要>

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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



TOPIX(東証株価指数)とは

インデックスの概要 (2024年1月末現在)		TOPIXの構成銘柄時価総額上位10銘柄		
構成国	1ヵ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,152銘柄	1	トヨタ自動車	220,252
時価総額	約484兆円	2	ソニーグループ	138,985
※上記時価総額は浮動株ベース		3	三菱UFJフィナンシャルグループ	111,872
		4	キーエンス	89,060
		5	東京エレクトロン	78,852
		6	日立製作所	75,773
		7	日本電信電話	74,312
		8	三井住友フィナンシャルグループ	72,093
		9	三菱商事	71,900
		10	信越化学工業	71,350
		※上記時価総額は浮動株ベース		

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

※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み) (以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

- ① TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。
- ② JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIXに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③ JPXは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ JPXは、配当込みTOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥ JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦ JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

分配方針

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

主な投資制限

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

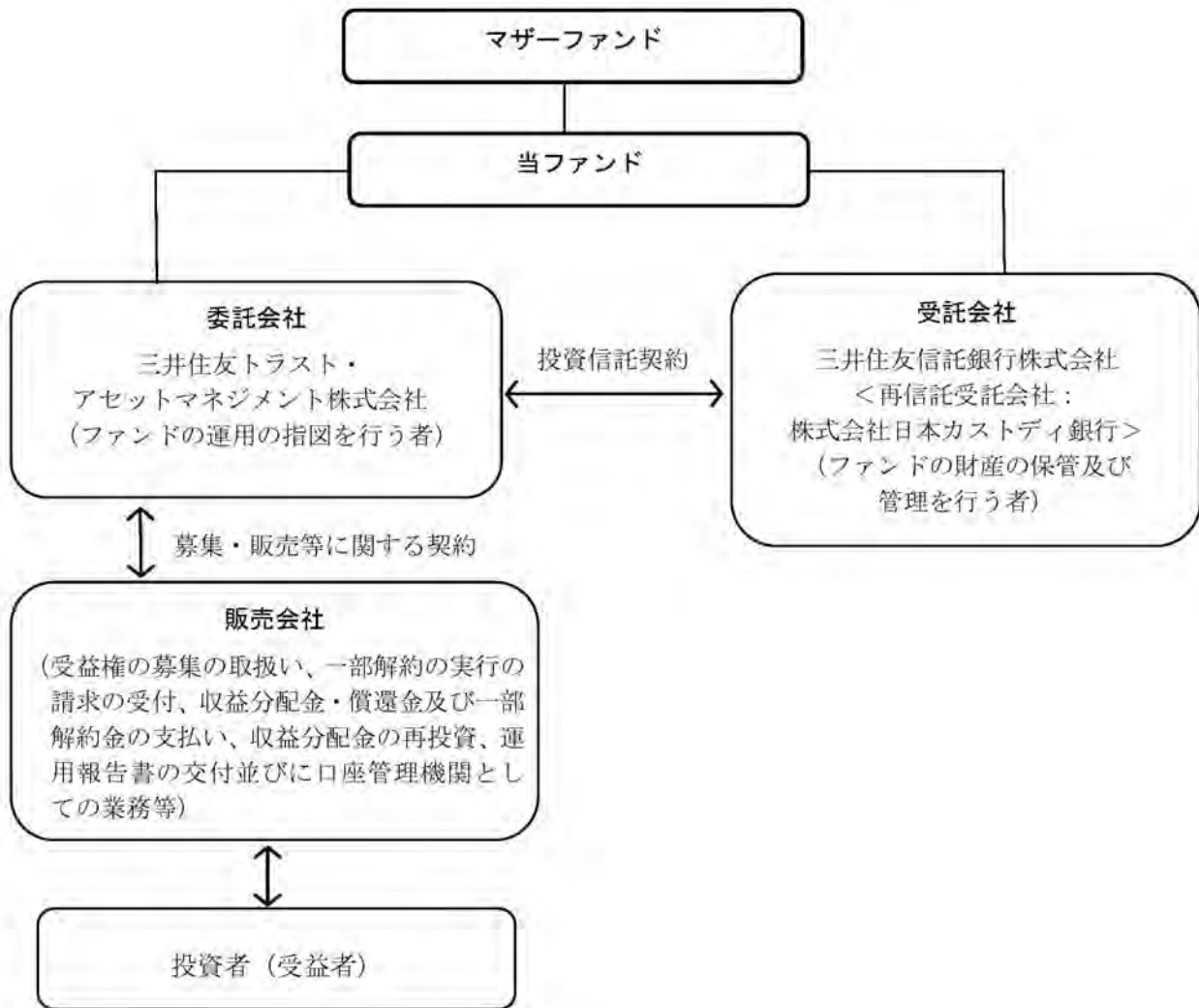
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

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1月31日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

(イ) 基本方針

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

(ロ) 運用方法

①投資対象

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

②投資態度

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

(2) 【投資対象】

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 1 号から第 11 号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で第 21 号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 1 号の証券または証書、第 12 号ならびに第 17 号の証券または証書のうち第 1 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 2 号から第 6 号までの証券および第 12 号ならびに第 17 号の証券または証書のうち第 2 号から第 6 号までの証券の性質を有するもの、および第 14 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 13 号および第 14 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- (ハ) 委託会社は、信託金を、前記 (ロ) に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(ハ)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

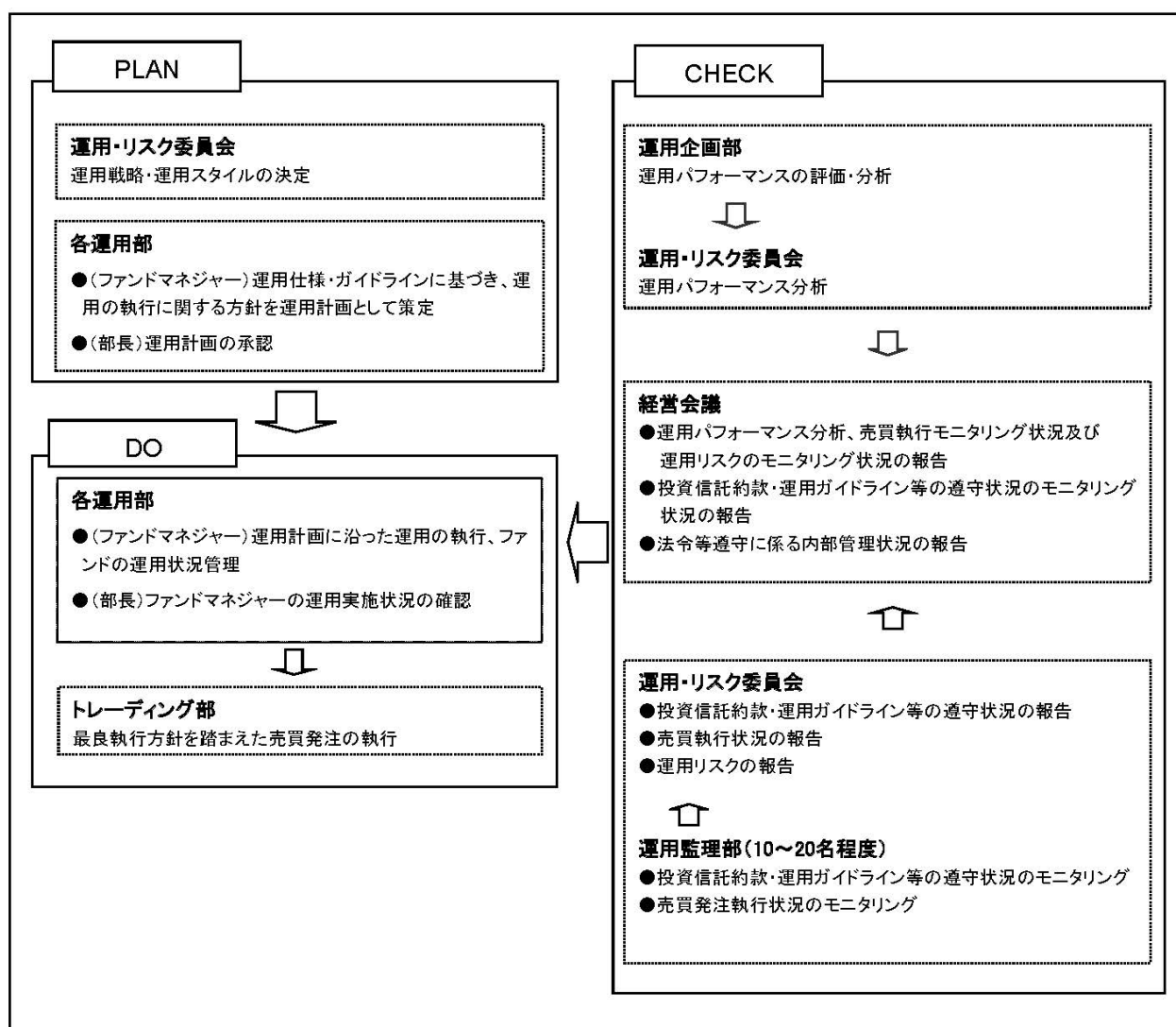
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 【運用体制】

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



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

務規則を定めています。

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

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5)【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ②外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ④同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑦投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑧委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）
- ⑨委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）
 1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ⑩委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとしません。（投資信託約款第 23 条）
- ⑪委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第 24 条）
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ⑫委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第 31 条）
- ⑬前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑭デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ※前記①および③から⑦における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①および③から⑦に掲げる当該各資産の時価総額とマザ

ーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<関連法令に基づく投資制限>

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

3 【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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 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 ファンドは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。
- ② 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
- ③ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払

われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

- ④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。
- ⑤ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

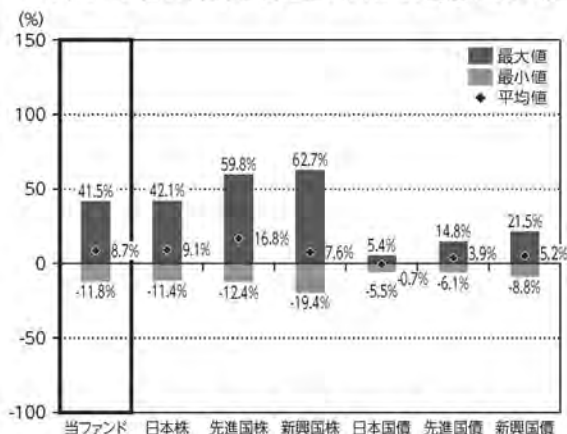
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年2月～2024年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の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差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公衆を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公衆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投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを算出します。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・サービスに關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、本ファンドの発売、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤差、遅延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 JPELボナンパメント・インド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバタズ・インデックス	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・配布することは認められていません。 Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時に、信託財産留保額（※）の控除はありません。

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

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.407%（税抜 0.37%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

- ②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ③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（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。
- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことが

できません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

③個別元本について

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

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

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

ニ、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

※上記は、2024年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率 ¹	その他費用の比率 ²
0.42%	0.41%	0.01%

※対象期間は2022年6月28日～2023年6月26日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

以下は、2024年1月31日現在の状況について記載してあります。

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,074,420,446	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,027,870	0.05
合計(純資産総額)		2,075,448,316	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

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	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	791,521,843	2.2943	1,815,988,565	2.6208	2,074,420,446	99.95

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

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】

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

① 【純資産の推移】

純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第8期計算期間末	(2014年6月25日)	421,829,003	421,829,003	7,970	7,970
第9期計算期間末	(2015年6月25日)	462,803,071	462,803,071	10,698	10,698
第10期計算期間末	(2016年6月27日)	399,546,072	399,546,072	7,968	7,968
第11期計算期間末	(2017年6月26日)	473,027,168	473,027,168	10,666	10,666
第12期計算期間末	(2018年6月25日)	600,485,748	600,485,748	11,635	11,635
第13期計算期間末	(2019年6月25日)	1,610,423,900	1,610,423,900	10,595	10,595
第14期計算期間末	(2020年6月25日)	1,570,256,552	1,570,256,552	10,957	10,957
第15期計算期間末	(2021年6月25日)	2,908,068,863	2,908,068,863	14,010	14,010
第16期計算期間末	(2022年6月27日)	3,222,783,216	3,222,783,216	13,733	13,733
第17期計算期間末	(2023年6月26日)	2,398,463,640	2,398,463,640	16,830	16,830
	2023年1月末日	2,612,519,330	—	14,547	—
	2月末日	2,605,945,539	—	14,680	—
	3月末日	2,554,649,206	—	14,925	—
	4月末日	2,490,214,598	—	15,322	—
	5月末日	2,500,748,927	—	15,870	—
	6月末日	2,348,428,366	—	17,062	—
	7月末日	2,210,163,045	—	17,311	—
	8月末日	2,175,092,398	—	17,379	—
	9月末日	2,174,919,422	—	17,464	—
	10月末日	2,041,157,717	—	16,936	—
	11月末日	2,138,522,429	—	17,845	—
	12月末日	2,073,370,198	—	17,801	—
	2024年1月末日	2,075,448,316	—	19,183	—

②【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第8期計算期間	2013年6月26日～2014年6月25日	0
第9期計算期間	2014年6月26日～2015年6月25日	0
第10期計算期間	2015年6月26日～2016年6月27日	0
第11期計算期間	2016年6月28日～2017年6月26日	0
第12期計算期間	2017年6月27日～2018年6月25日	0
第13期計算期間	2018年6月26日～2019年6月25日	0
第14期計算期間	2019年6月26日～2020年6月25日	0
第15期計算期間	2020年6月26日～2021年6月25日	0
第16期計算期間	2021年6月26日～2022年6月27日	0
第17期計算期間	2022年6月28日～2023年6月26日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 8 期計算期間	2013 年 6 月 26 日～2014 年 6 月 25 日	18.6
第 9 期計算期間	2014 年 6 月 26 日～2015 年 6 月 25 日	34.2
第 10 期計算期間	2015 年 6 月 26 日～2016 年 6 月 27 日	△25.5
第 11 期計算期間	2016 年 6 月 28 日～2017 年 6 月 26 日	33.9
第 12 期計算期間	2017 年 6 月 27 日～2018 年 6 月 25 日	9.1
第 13 期計算期間	2018 年 6 月 26 日～2019 年 6 月 25 日	△8.9
第 14 期計算期間	2019 年 6 月 26 日～2020 年 6 月 25 日	3.4
第 15 期計算期間	2020 年 6 月 26 日～2021 年 6 月 25 日	27.9
第 16 期計算期間	2021 年 6 月 26 日～2022 年 6 月 27 日	△2.0
第 17 期計算期間	2022 年 6 月 28 日～2023 年 6 月 26 日	22.6
第 18 期中間計算期間	2023 年 6 月 27 日～2023 年 12 月 26 日	4.4

(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 8 期計算期間	2013 年 6 月 26 日～2014 年 6 月 25 日	240,217,610	193,049,580	529,263,623
第 9 期計算期間	2014 年 6 月 26 日～2015 年 6 月 25 日	267,031,202	363,702,679	432,592,146
第 10 期計算期間	2015 年 6 月 26 日～2016 年 6 月 27 日	168,629,406	99,774,600	501,446,952
第 11 期計算期間	2016 年 6 月 28 日～2017 年 6 月 26 日	105,855,663	163,810,500	443,492,115
第 12 期計算期間	2017 年 6 月 27 日～2018 年 6 月 25 日	205,570,147	132,941,629	516,120,633
第 13 期計算期間	2018 年 6 月 26 日～2019 年 6 月 25 日	1,166,396,443	162,578,396	1,519,938,680
第 14 期計算期間	2019 年 6 月 26 日～2020 年 6 月 25 日	390,544,895	477,351,199	1,433,132,376
第 15 期計算期間	2020 年 6 月 26 日～2021 年 6 月 25 日	1,441,950,295	799,305,694	2,075,776,977
第 16 期計算期間	2021 年 6 月 26 日～2022 年 6 月 27 日	720,012,856	449,034,868	2,346,754,965
第 17 期計算期間	2022 年 6 月 28 日～2023 年 6 月 26 日	76,161,163	997,779,466	1,425,136,662
第 18 期中間計算期間	2023 年 6 月 27 日～2023 年 12 月 26 日	28,909,482	289,281,996	1,164,764,148

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	631,937,949,060	99.31
新株予約権証券	日本	7,416,600	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,363,866,236	0.69
合計(純資産総額)		636,309,231,896	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,983,460,000	0.63

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,591,500	1,949.30	18,696,777,691	3,000.00	28,774,500,000	4.52
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,235,600	13,269.36	16,395,625,672	14,695.00	18,157,142,000	2.85
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,477,000	937.25	9,819,586,911	1,395.00	14,615,415,000	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,800	68,425.93	11,960,852,811	66,580.00	11,638,184,000	1.83
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,700	19,788.63	7,315,860,127	27,865.00	10,301,690,500	1.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,900	8,178.23	6,934,324,874	11,675.00	9,899,232,500	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,111,700	163.02	8,495,732,000	186.30	9,708,409,710	1.53
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,223,200	5,692.47	6,963,034,634	7,700.00	9,418,640,000	1.48
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,662,100	2,005.56	7,344,564,183	2,565.00	9,393,286,500	1.48
日本	株式	信越化学工業	化学	1,586,600	4,422.30	7,016,436,431	5,875.00	9,321,275,000	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,800	5,934.04	6,544,066,304	8,310.00	9,164,268,000	1.44
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,500	4,709.00	6,557,290,389	6,031.00	8,398,167,500	1.32
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,242,300	5,002.25	6,214,307,124	6,752.00	8,388,009,600	1.32
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,329,400	4,457.15	5,925,346,796	5,927.00	7,879,353,800	1.24
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,259,700	1,347.78	5,741,177,085	1,675.50	7,137,127,350	1.12
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,550,500	4,530.99	7,025,314,811	4,362.00	6,763,281,000	1.06
日本	株式	第一三共	医薬品	1,526,200	4,532.60	6,917,654,880	4,423.00	6,750,382,600	1.06
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,700,500	3,122.76	5,310,259,360	3,930.00	6,682,965,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,800	4,361.40	5,904,468,686	4,897.00	6,629,558,600	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,139.04	5,894,116,380	18,945.00	6,515,185,500	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,322,200	2,087.53	4,847,672,632	2,702.00	6,274,584,400	0.99
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	864,200	5,568.12	4,811,970,587	6,460.00	5,582,732,000	0.88

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,819,400	1,517.14	4,277,444,429	1,963.50	5,535,891,900	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	950,300	5,369.65	5,102,787,574	5,502.00	5,228,550,600	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,600	26,672.84	5,617,302,040	23,885.00	5,030,181,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,589,300	2,752.52	4,374,587,204	3,015.00	4,791,739,500	0.75
日本	株式	SMC	機械	52,800	74,502.90	3,933,753,244	82,910.00	4,377,648,000	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,963,600	1,826.03	3,585,600,132	2,203.00	4,325,810,800	0.68
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,045,100	3,094.89	3,234,478,926	3,895.00	4,070,664,500	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	1,540,900	2,119.48	3,265,916,628	2,541.50	3,916,197,350	0.62

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.29
		繊維製品	0.38
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.86
		医薬品	4.49
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.97
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	5.35
		電気機器	17.35
		輸送用機器	8.55
		精密機器	2.34
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.37
		陸運業	2.69
		海運業	0.90
		空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	7.58		
卸売業	7.22		
小売業	4.16		

		銀行業	7.10
		証券、商品先物取引業	0.86
		保険業	2.43
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.92
		サービス業	4.69
		小計	99.31
新株予約権証券	—	—	0.00
合計			99.31

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	156円		3,926,284,700	3,983,460,000	0.63

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

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

《参考情報》

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

 運用実績

当初設定日：2007年2月16日
作成基準日：2024年1月31日

基準価額・純資産の推移



基準価額	19,183円
純資産総額	20.75億円
分配の推移 (1万口当たり、税引前)	
決算期	分配金
2019年6月	0円
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
2023年6月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

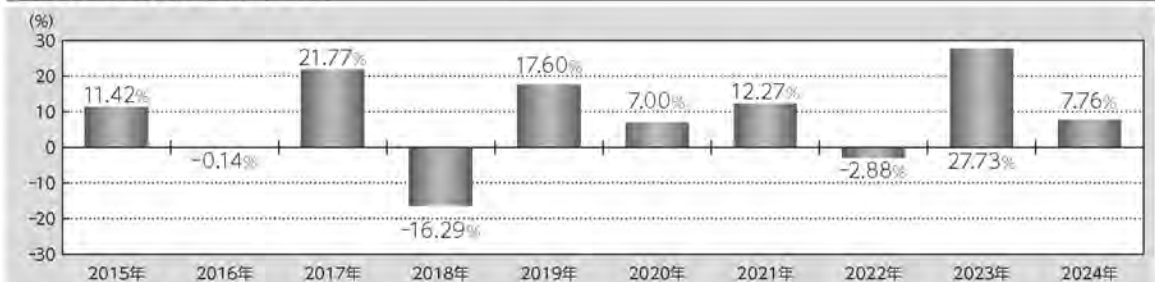
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.5%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.3%
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	1.6%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.5%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.5%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.5%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

1円以上1円単位とします。

<申込価額>

取得申込受付日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

ありません。

<申込受付の中止等>

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

<その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当

該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口単位とします。

<解約価額>

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

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

<一部解約代金の支払い>

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

<受付不可日>

ありません。

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①マザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における最終相場で評価します。

<基準価額の照会方法>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。(2007年2月16日設定)

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

(4)【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

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

(5)【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

- 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従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。
 - ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
 - ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
 - ・やむを得ない事情が発生した場合
- 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、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
- 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、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、ファンドの繰上償還を行いません。

④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、当該約款変更を行いません。

④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- 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。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>に従い、新受託会社を選任します。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

<反対者の買取請求権>

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

<運用報告書>

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

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

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

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- 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。

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

- ①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- ④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑤受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

- ①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2022年6月28日から2023年6月26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。

独立監査人の監査報告書

2023年9月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2022年6月28日から2023年6月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2023年6月26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。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 16 期 (2022 年 6 月 27 日現在)	第 17 期 (2023 年 6 月 26 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,398,951	6,390,943
親投資信託受益証券	3,221,189,390	2,397,262,024
未収入金	-	22,831,263
流動資産合計	3,229,588,341	2,426,484,230
資産合計	3,229,588,341	2,426,484,230
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	22,749,243
未払受託者報酬	1,254,317	968,463
未払委託者報酬	5,375,577	4,150,506
未払利息	13	15
その他未払費用	175,218	152,363
流動負債合計	6,805,125	28,020,590
負債合計	6,805,125	28,020,590
純資産の部		
元本等		
元本	2,346,754,965	1,425,136,662
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	876,028,251	973,326,978
(分配準備積立金)	526,240,014	675,865,190
元本等合計	3,222,783,216	2,398,463,640
純資産合計	3,222,783,216	2,398,463,640
負債純資産合計	3,229,588,341	2,426,484,230

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期		第17期	
	自 2021年6月26日	至 2022年6月27日	自 2022年6月28日	至 2023年6月26日
営業収益				
受取利息		22		8
有価証券売買等損益		△41,573,015		544,757,768
営業収益合計		△41,572,993		544,757,776
営業費用				
支払利息		2,313		2,438
受託者報酬		2,454,751		2,134,829
委託者報酬		10,520,246		9,149,170
その他費用		175,218		152,363
営業費用合計		13,152,528		11,438,800
営業利益又は営業損失(△)		△54,725,521		533,318,976
経常利益又は経常損失(△)		△54,725,521		533,318,976
当期純利益又は当期純損失(△)		△54,725,521		533,318,976
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		2,217,845		94,765,448
期首剰余金又は期首欠損金(△)		832,291,886		876,028,251
剰余金増加額又は欠損金減少額		281,300,940		31,928,058
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		281,300,940		31,928,058
剰余金減少額又は欠損金増加額		180,621,209		373,182,859
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		180,621,209		373,182,859
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		876,028,251		973,326,978

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2022年6月28日から2023年6月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2022年6月27日現在)	第17期 (2023年6月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,346,754,965 口	1,425,136,662 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,3733 円 (13,733 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,6830 円 (16,830 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自2021年6月26日 至2022年6月27日			第17期 自2022年6月28日 至2023年6月26日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	63,561,236 円	費用控除後の配当等収益額	A	53,744,922 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	314,326,346 円
収益調整金額	C	1,630,766,104 円	収益調整金額	C	1,002,160,425 円
分配準備積立金額	D	462,678,778 円	分配準備積立金額	D	307,793,922 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,157,006,118 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,678,025,615 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,346,754,965 口	当ファンドの期末残存口数	F	1,425,136,662 口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,191 円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	11,774 円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自2022年6月28日 至2023年6月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 17 期 (2023 年 6 月 26 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第 16 期 自 2021 年 6 月 26 日 至 2022 年 6 月 27 日	第 17 期 自 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	2,075,776,977 円	2,346,754,965 円
期中追加設定元本額	720,012,856 円	76,161,163 円
期中一部解約元本額	449,034,868 円	997,779,466 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 16 期 (2022 年 6 月 27 日現在)	第 17 期 (2023 年 6 月 26 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	△39,553,765	449,035,868
合計	△39,553,765	449,035,868

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,045,241,781	2,397,262,024	
合計		1,045,241,781	2,397,262,024	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年6月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,213,299,209
株式	571,379,621,920
派生商品評価勘定	85,108,150
未収入金	113,960,000
未収配当金	2,292,372,227
差入委託証拠金	197,090,000
流動資産合計	577,281,451,506
資産合計	577,281,451,506
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,108,250
前受金	75,012,000
未払金	320,550
未払解約金	524,458,316
未払利息	7,879
流動負債合計	609,906,995

負債合計	609,906,995
純資産の部	
元本等	
元本	251,438,322,235
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	325,233,222,276
元本等合計	576,671,544,511
純資産合計	576,671,544,511
負債純資産合計	577,281,451,506

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,438,322,235 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2935円 (1万口当たり純資産額) (22,935円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月26日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p> <p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年6月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月28日
期首元本額	262,695,780,133円
期中追加設定元本額	20,162,210,054円
期中一部解約元本額	31,419,667,952円
期末元本額	251,438,322,235円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	335,281,949円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,922,089,703円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,163,739円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,422,634,437円

世界経済インデックスファンド	4,662,576,857円
日本株式インデックス・オープン	3,086,025,430円
DCマイセクション25	5,474,423,843円
DCマイセクション50	17,642,059,037円
DCマイセクション75	18,332,627,495円
DC日本株式インデックス・オープン	6,031,646,863円
DCマイセクションS25	3,273,007,536円
DCマイセクションS50	9,324,487,872円
DCマイセクションS75	7,899,661,173円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,848,562,315円
DCターゲット・イヤーフンド2025	129,876,654円
DCターゲット・イヤーフンド2035	667,222,664円
DCターゲット・イヤーフンド2045	511,143,520円
DC世界経済インデックスファンド	3,656,681,920円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,045,241,781円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,668,401円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	10,113,328円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	159,213,431円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,122,651円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	20,383,179円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	77,307,106円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	17,546,507円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	51,173,986円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	630,548,168円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	337,646,784円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,277,049,096円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	32,469,844円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	14,821,567円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	356,734,823円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	204,634,551円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	261,938,690円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	25,080,339円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	464,139,723円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,776,858,806円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,800,047,258円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,468,595,038円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,453,282,078円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	552,839,628円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	393,798,589円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,664,270,729円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,214,962円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,593,598円
SMTインデックスバランス・オープン	50,652,756円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	27,349,601,915円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	399,116,467円
SMT世界経済インデックス・オープン	48,858,407円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	194,875,951円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	33,521,348円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	11,221,613円
グローバル経済コア	210,611,244円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	32,774,562円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	701,216,974円
DCターゲット・イヤーフンド2055	27,710,942円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,199,057,997円

コア投資戦略ファンド（積極成長型）	260,308,230 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	47,965,651 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	41,927,482 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	16,486,117 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	18,795,735 円
10資産分散投資ファンド	93,062,081 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,141,006,427 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	652,413,838 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	296,957,179 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,967,849 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	690,518,488 円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,195,698,568 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,034,095 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	215,370,769 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月26日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	25,146,252,330	
合計	25,146,252,330	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年6月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,043,838,000	—	5,118,850,000	75,012,000
合計		5,043,838,000	—	5,118,850,000	75,012,000

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,400	3,605.00	33,887,000	
ニッセイ	247,900	659.00	163,366,100	

マルハニチロ	36,800	2,450.00	90,160,000
雪国まいたけ	21,100	989.00	20,867,900
カネコ種苗	7,600	1,465.00	11,134,000
サカタのタネ	28,200	4,150.00	117,030,000
ホクト	22,100	1,838.00	40,619,800
ホクリョウ	2,700	857.00	2,313,900
住石ホールディングス	30,000	351.00	10,530,000
日鉄鉱業	9,900	4,185.00	41,431,500
三井松島ホールディングス	11,200	2,555.00	28,616,000
I N P E X	916,800	1,606.00	1,472,380,800
石油資源開発	28,700	4,265.00	122,405,500
K&Oエナジーグループ	11,200	2,295.00	25,704,000
ショーボンドホールディングス	33,800	5,722.00	193,403,600
ミライト・ワン	82,000	1,808.00	148,256,000
タマホーム	15,600	3,280.00	51,168,000
サンヨーホームズ	2,300	724.00	1,665,200
日本アクア	8,000	851.00	6,808,000
ファーストコーポレーション	4,900	770.00	3,773,000
ベステラ	4,200	1,132.00	4,754,400
R o b o t Home	42,200	195.00	8,229,000
キャンディル	3,500	579.00	2,026,500
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,030.00	4,017,000
第一カッター興業	6,300	1,419.00	8,939,700
安藤・間	143,600	1,043.00	149,774,800
東急建設	70,600	729.00	51,467,400
コムシスホールディングス	83,900	2,790.50	234,122,950
ビーアールホールディングス	39,400	394.00	15,523,600
高松コンストラクショングループ	16,100	2,489.00	40,072,900
東建コーポレーション	7,100	7,450.00	52,895,000
ソネック	2,100	968.00	2,032,800
ヤマウラ	12,600	1,161.00	14,628,600
オリエンタル白石	89,100	312.00	27,799,200
大成建設	162,300	4,891.00	793,809,300
大林組	620,200	1,206.00	747,961,200
清水建設	521,300	893.20	465,625,160
飛島建設	19,200	1,226.00	23,539,200

長谷工コーポレーション	179,000	1,729.50	309,580,500
松井建設	16,200	683.00	11,064,600
銭高組	1,700	3,100.00	5,270,000
鹿島建設	384,500	2,095.50	805,719,750
不動テトラ	12,000	1,808.00	21,696,000
大末建設	4,900	1,327.00	6,502,300
鉄建建設	12,400	2,032.00	25,196,800
西松建設	29,400	3,487.00	102,517,800
三井住友建設	139,800	365.00	51,027,000
大豊建設	7,200	3,870.00	27,864,000
佐田建設	8,600	453.00	3,895,800
ナカノフドー建設	9,600	377.00	3,619,200
奥村組	28,100	4,035.00	113,383,500
東鉄工業	23,900	2,647.00	63,263,300
イチケン	3,000	1,924.00	5,772,000
富士ピー・エス	6,000	446.00	2,676,000
浅沼組	13,900	3,200.00	44,480,000
戸田建設	213,300	798.90	170,405,370
熊谷組	29,000	3,070.00	89,030,000
北野建設	2,500	3,020.00	7,550,000
植木組	3,800	1,384.00	5,259,200
矢作建設工業	23,600	1,204.00	28,414,400
ピーエス三菱	22,000	751.00	16,522,000
日本ハウスホールディングス	34,400	373.00	12,831,200
新日本建設	24,300	1,224.00	29,743,200
東亜道路工業	6,900	4,500.00	31,050,000
日本道路	3,500	9,070.00	31,745,000
東亜建設工業	14,900	3,055.00	45,519,500
日本国土開発	52,000	574.00	29,848,000
若築建設	7,700	3,225.00	24,832,500
東洋建設	56,200	1,061.00	59,628,200
五洋建設	245,800	765.00	188,037,000
世紀東急工業	22,300	1,377.00	30,707,100
福田組	6,500	4,795.00	31,167,500
住友林業	133,000	3,452.00	459,116,000
日本基礎技術	8,100	498.00	4,033,800

巴コーポレーション	15,100	476.00	7,187,600
大和ハウス工業	484,600	3,800.00	1,841,480,000
ライト工業	32,100	1,938.00	62,209,800
積水ハウス	525,700	2,842.00	1,494,039,400
日特建設	16,500	1,017.00	16,780,500
北陸電気工事	11,900	936.00	11,138,400
ユアテック	38,200	842.00	32,164,400
日本リーテック	15,200	1,385.00	21,052,000
四電工	7,300	2,130.00	15,549,000
中電工	26,900	2,276.00	61,224,400
関電工	95,000	1,123.00	106,685,000
きんでん	122,100	1,936.00	236,385,600
東京エネシス	17,200	971.00	16,701,200
トーエネック	5,800	3,590.00	20,822,000
住友電設	16,500	3,015.00	49,747,500
日本電設工業	28,500	1,944.00	55,404,000
エクシオグループ	79,900	2,820.00	225,318,000
新日本空調	9,600	2,242.00	21,523,200
九電工	42,200	3,837.00	161,921,400
三機工業	38,500	1,511.00	58,173,500
日揮ホールディングス	171,500	1,802.50	309,128,750
中外炉工業	5,700	2,043.00	11,645,100
ヤマト	11,200	939.00	10,516,800
太平電業	10,800	4,255.00	45,954,000
高砂熱学工業	41,800	2,428.00	101,490,400
三晃金属工業	1,600	4,220.00	6,752,000
朝日工業社	7,200	2,316.00	16,675,200
明星工業	29,800	947.00	28,220,600
大気社	20,000	3,935.00	78,700,000
ダイダン	11,400	2,675.00	30,495,000
日比谷総合設備	14,900	2,173.00	32,377,700
フィル・カンパニー	3,100	933.00	2,892,300
テスホールディングス	18,700	1,143.00	21,374,100
インフロニア・ホールディングス	181,700	1,329.00	241,479,300
東洋エンジニアリング	22,900	574.00	13,144,600
レイズネクスト	25,100	1,440.00	36,144,000

ニッポン	46,900	1,838.00	86,202,200
日清製粉グループ本社	161,000	1,825.00	293,825,000
日東富士製粉	3,100	4,700.00	14,570,000
昭和産業	15,200	2,665.00	40,508,000
鳥越製粉	10,800	611.00	6,598,800
中部飼料	24,100	1,060.00	25,546,000
フィード・ワン	25,400	722.00	18,338,800
東洋精糖	2,500	1,576.00	3,940,000
日本甜菜製糖	10,100	1,828.00	18,462,800
DM三井製糖ホールディングス	17,300	2,687.00	46,485,100
塩水港精糖	16,200	207.00	3,353,400
ウェルネオシュガー	9,000	1,987.00	17,883,000
森永製菓	31,800	4,536.00	144,244,800
中村屋	4,300	3,070.00	13,201,000
江崎グリコ	49,800	3,863.00	192,377,400
名糖産業	6,800	1,628.00	11,070,400
井村屋グループ	9,500	2,238.00	21,261,000
不二家	11,900	2,456.00	29,226,400
山崎製パン	116,500	1,993.00	232,184,500
第一屋製パン	2,600	389.00	1,011,400
モロゾフ	5,600	3,635.00	20,356,000
亀田製菓	11,100	4,245.00	47,119,500
寿スピリッツ	18,500	10,660.00	197,210,000
カルビー	79,700	2,712.50	216,186,250
森永乳業	31,600	4,803.00	151,774,800
六甲バター	12,800	1,305.00	16,704,000
ヤクルト本社	124,400	9,287.00	1,155,302,800
明治ホールディングス	213,400	3,254.00	694,403,600
雪印メグミルク	42,100	1,908.00	80,326,800
プリマハム	23,400	2,166.00	50,684,400
日本ハム	68,100	3,899.00	265,521,900
林兼産業	4,100	484.00	1,984,400
丸大食品	17,500	1,469.00	25,707,500
S Foods	19,200	3,160.00	60,672,000
柿安本店	6,800	2,316.00	15,748,800
伊藤ハム米久ホールディングス	133,000	721.00	95,893,000

サッポロホールディングス	57,300	3,763.00	215,619,900
アサヒグループホールディングス	402,300	5,641.00	2,269,374,300
麒麟ホールディングス	785,600	2,179.00	1,711,822,400
宝ホールディングス	118,800	1,114.00	132,343,200
オエノンホールディングス	52,000	341.00	17,732,000
養命酒製造	5,700	1,837.00	10,470,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	136,400	1,559.00	212,647,600
サントリー食品インターナショナル	122,600	5,321.00	652,354,600
ダイドーグループホールディングス	9,900	5,030.00	49,797,000
伊藤園	59,000	4,039.00	238,301,000
キーコーヒー	19,500	2,057.00	40,111,500
ユニカフェ	4,500	909.00	4,090,500
ジャパンフーズ	2,100	1,086.00	2,280,600
日清オイリオグループ	24,500	3,425.00	83,912,500
不二製油グループ本社	40,500	2,010.00	81,405,000
かどや製油	1,600	3,470.00	5,552,000
J-オイルミルズ	17,700	1,584.00	28,036,800
キッコーマン	115,400	8,404.00	969,821,600
味の素	420,300	5,774.00	2,426,812,200
ブルドックソース	9,200	1,991.00	18,317,200
キューピー	93,600	2,363.50	221,223,600
ハウス食品グループ本社	53,300	3,188.00	169,920,400
カゴメ	81,100	3,238.00	262,601,800
焼津水産化学工業	5,300	832.00	4,409,600
アリアケジャパン	15,200	5,285.00	80,332,000
ピエトロ	2,000	1,816.00	3,632,000
エバラ食品工業	4,700	2,931.00	13,775,700
やまみ	1,300	1,338.00	1,739,400
ニチレイ	79,800	3,126.00	249,454,800
東洋水産	88,000	6,565.00	577,720,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,186.00	16,176,400
大冷	1,700	1,974.00	3,355,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,000	899.00	9,889,000
日清食品ホールディングス	61,200	12,065.00	738,378,000
永谷園ホールディングス	8,500	2,115.00	17,977,500

一正蒲鉾	5,800	785.00	4,553,000
フジッコ	17,900	1,893.00	33,884,700
ロック・フィールド	19,500	1,482.00	28,899,000
日本たばこ産業	1,146,000	3,239.00	3,711,894,000
ケンコーマヨネーズ	12,000	1,338.00	16,056,000
わらべや日洋ホールディングス	12,800	2,193.00	28,070,400
なとり	10,900	1,945.00	21,200,500
イフジ産業	2,300	1,081.00	2,486,300
ファーマフーズ	25,000	2,212.00	55,300,000
ユーグレナ	112,500	888.00	99,900,000
紀文食品	13,600	1,004.00	13,654,400
ピクルスホールディングス	10,200	1,227.00	12,515,400
ミヨシ油脂	4,800	1,027.00	4,929,600
理研ビタミン	15,000	2,156.00	32,340,000
片倉工業	16,600	1,640.00	27,224,000
グンゼ	12,700	4,430.00	56,261,000
東洋紡	77,100	1,015.50	78,295,050
ユニチカ	55,800	230.00	12,834,000
富士紡ホールディングス	7,200	3,130.00	22,536,000
倉敷紡績	13,500	2,237.00	30,199,500
シキボウ	7,700	996.00	7,669,200
日本毛織	47,300	1,024.00	48,435,200
トーア紡コーポレーション	5,400	410.00	2,214,000
帝国繊維	20,300	1,628.00	33,048,400
帝人	170,600	1,382.00	235,769,200
東レ	1,187,300	789.10	936,898,430
住江織物	2,900	2,140.00	6,206,000
日本フェルト	9,000	418.00	3,762,000
イチカワ	2,100	1,359.00	2,853,900
日東製網	1,400	1,397.00	1,955,800
アツギ	8,600	416.00	3,577,600
ダイニック	3,500	727.00	2,544,500
セーレン	34,400	2,443.00	84,039,200
ソトー	4,600	792.00	3,643,200
東海染工	1,500	1,108.00	1,662,000
小松マテーレ	26,000	670.00	17,420,000

ワコールホールディングス	34,200	2,824.00	96,580,800
ホギメディカル	23,800	3,200.00	76,160,000
T S I ホールディングス	59,900	744.00	44,565,600
マツオカコーポレーション	3,900	1,142.00	4,453,800
ワールド	22,900	1,566.00	35,861,400
三陽商会	5,300	1,735.00	9,195,500
ナイガイ	5,400	302.00	1,630,800
オンワードホールディングス	115,500	385.00	44,467,500
ルックホールディングス	4,000	2,344.00	9,376,000
ゴールドウイン	31,400	12,125.00	380,725,000
デサント	30,600	4,015.00	122,859,000
キング	6,400	644.00	4,121,600
ヤマトインターナショナル	11,700	284.00	3,322,800
特種東海製紙	7,900	3,245.00	25,635,500
王子ホールディングス	737,800	556.30	410,438,140
日本製紙	92,200	1,205.00	111,101,000
三菱製紙	16,600	558.00	9,262,800
北越コーポレーション	111,900	906.00	101,381,400
中越パルプ工業	5,600	1,324.00	7,414,400
巴川製紙所	4,300	673.00	2,893,900
大王製紙	78,200	1,101.50	86,137,300
阿波製紙	3,300	568.00	1,874,400
レンゴー	161,300	866.80	139,814,840
トーモク	10,200	2,029.00	20,695,800
ザ・パック	13,200	3,060.00	40,392,000
北の達人コーポレーション	74,600	288.00	21,484,800
クラレ	281,600	1,392.00	391,987,200
旭化成	1,106,000	957.90	1,059,437,400
共和レザー	7,900	550.00	4,345,000
レゾナック・ホールディングス	171,200	2,287.00	391,534,400
住友化学	1,313,800	440.10	578,203,380
住友精化	7,400	4,320.00	31,968,000
日産化学	84,100	6,092.00	512,337,200
ラサ工業	6,800	2,114.00	14,375,200
クレハ	15,100	8,330.00	125,783,000
多木化学	6,900	4,310.00	29,739,000

テイカ	11,900	1,363.00	16,219,700
石原産業	32,000	1,284.00	41,088,000
片倉コープアグリ	2,800	1,255.00	3,514,000
日本曹達	19,000	5,020.00	95,380,000
東ソー	236,400	1,703.50	402,707,400
トクヤマ	57,200	2,340.50	133,876,600
セントラル硝子	28,400	3,125.00	88,750,000
東亜合成	88,800	1,297.00	115,173,600
大阪ソーダ	10,600	5,310.00	56,286,000
関東電化工業	34,200	970.00	33,174,000
デンカ	64,400	2,636.50	169,790,600
信越化学工業	1,472,100	4,636.00	6,824,655,600
日本カーバイド工業	5,200	1,344.00	6,988,800
堺化学工業	13,500	1,838.00	24,813,000
第一稀元素化学工業	16,100	969.00	15,600,900
エア・ウォーター	167,100	1,939.00	324,006,900
日本酸素ホールディングス	171,800	3,108.00	533,954,400
日本化学工業	5,900	1,869.00	11,027,100
東邦アセチレン	2,900	1,399.00	4,057,100
日本パーカライジング	87,700	1,062.00	93,137,400
高压ガス工業	25,700	749.00	19,249,300
チタン工業	1,700	1,399.00	2,378,300
四国化成ホールディングス	21,000	1,473.00	30,933,000
戸田工業	4,000	2,347.00	9,388,000
ステラ ケミファ	10,500	3,080.00	32,340,000
保土谷化学工業	5,000	3,505.00	17,525,000
日本触媒	27,000	5,340.00	144,180,000
大日精化工業	12,300	2,057.00	25,301,100
カネカ	40,500	3,928.00	159,084,000
三菱瓦斯化学	132,200	2,100.50	277,686,100
三井化学	146,000	4,164.00	607,944,000
J S R	165,300	3,934.00	650,290,200
東京応化工業	31,000	8,761.00	271,591,000
大阪有機化学工業	13,300	2,573.00	34,220,900
三菱ケミカルグループ	1,195,100	847.00	1,012,249,700
KHネオケム	29,500	2,385.00	70,357,500

ダイセル	260,400	1,290.00	335,916,000	
住友ベークライト	26,200	5,775.00	151,305,000	
積水化学工業	362,200	2,052.50	743,415,500	
日本ゼオン	106,200	1,375.50	146,078,100	
アイカ工業	44,700	3,138.00	140,268,600	
UBE	91,300	2,441.00	222,863,300	
積水樹脂	25,800	2,255.00	58,179,000	
タキロンシーアイ	38,700	557.00	21,555,900	
旭有機材	11,800	4,130.00	48,734,000	
ニチバン	11,000	1,906.00	20,966,000	
リケンテクノス	38,200	639.00	24,409,800	
大倉工業	8,200	2,163.00	17,736,600	
積水化成成品工業	24,900	429.00	10,682,100	
群栄化学工業	4,200	2,722.00	11,432,400	
タイガースポリマー	6,300	578.00	3,641,400	
ミライアル	4,200	1,537.00	6,455,400	
ダイキアクシス	5,100	723.00	3,687,300	
ダイキョーニシカワ	39,100	771.00	30,146,100	
竹本容器	4,600	853.00	3,923,800	
森六ホールディングス	9,000	2,045.00	18,405,000	
恵和	11,500	1,122.00	12,903,000	
日本化薬	135,300	1,233.50	166,892,550	
カーリットホールディングス	15,900	827.00	13,149,300	
日本精化	10,100	2,836.00	28,643,600	
扶桑化学工業	16,400	4,375.00	71,750,000	
トリケミカル研究所	23,600	2,640.00	62,304,000	
ADEKA	61,700	2,631.00	162,332,700	
日油	54,800	6,039.00	330,937,200	
新日本理化	19,000	240.00	4,560,000	
ハリマ化成グループ	9,700	867.00	8,409,900	
花王	431,300	5,338.00	2,302,279,400	
第一工業製薬	6,400	1,766.00	11,302,400	
石原ケミカル	8,100	1,689.00	13,680,900	
日華化学	5,500	856.00	4,708,000	
ニイタカ	2,500	2,092.00	5,230,000	
三洋化成工業	10,900	4,225.00	46,052,500	

有機合成薬品工業	10,200	307.00	3,131,400	
大日本塗料	21,600	911.00	19,677,600	
日本ペイントホールディングス	783,700	1,181.00	925,549,700	
関西ペイント	162,200	2,162.50	350,757,500	
神東塗料	11,500	124.00	1,426,000	
中国塗料	29,100	1,188.00	34,570,800	
日本特殊塗料	8,700	1,046.00	9,100,200	
藤倉化成	23,800	456.00	10,852,800	
太陽ホールディングス	26,900	2,677.00	72,011,300	
D I C	69,200	2,633.00	182,203,600	
サカタインクス	39,400	1,236.00	48,698,400	
東洋インキS Cホールディングス	34,700	2,219.00	76,999,300	
T & K TOKA	15,700	1,179.00	18,510,300	
富士フイルムホールディングス	340,300	8,542.00	2,906,842,600	
資生堂	370,300	6,646.00	2,461,013,800	
ライオン	212,800	1,392.00	296,217,600	
高砂香料工業	12,000	2,605.00	31,260,000	
マンダム	38,300	1,463.00	56,032,900	
ミルボン	26,300	5,040.00	132,552,000	
ファンケル	77,600	2,406.00	186,705,600	
コーセー	36,100	14,620.00	527,782,000	
コタ	16,300	1,618.00	26,373,400	
シーボン	1,800	1,552.00	2,793,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	90,900	2,089.50	189,935,550	
ノエビアホールディングス	15,800	5,480.00	86,584,000	
アジュバンホールディングス	3,400	939.00	3,192,600	
新日本製薬	10,100	1,412.00	14,261,200	
アクシージア	9,000	1,353.00	12,177,000	
エステー	13,700	1,517.00	20,782,900	
アグロ カネショウ	7,100	1,684.00	11,956,400	
コニシ	29,600	2,300.00	68,080,000	
長谷川香料	33,900	3,435.00	116,446,500	
星光PMC	7,000	595.00	4,165,000	
小林製薬	51,600	8,009.00	413,264,400	
荒川化学工業	15,000	995.00	14,925,000	
メック	14,600	3,340.00	48,764,000	

日本高純度化学	4,400	2,605.00	11,462,000	
タカラバイオ	47,800	1,631.00	77,961,800	
JCU	19,800	3,425.00	67,815,000	
新田ゼラチン	8,500	725.00	6,162,500	
OATアグリオ	5,600	2,024.00	11,334,400	
デクセリアルズ	51,200	2,920.00	149,504,000	
アース製薬	16,100	5,060.00	81,466,000	
北興化学工業	17,800	976.00	17,372,800	
大成ラミック	5,600	2,885.00	16,156,000	
クミアイ化学工業	70,400	1,107.00	77,932,800	
日本農薬	32,500	702.00	22,815,000	
アキレス	11,200	1,440.00	16,128,000	
有沢製作所	28,800	1,100.00	31,680,000	
日東電工	128,700	10,535.00	1,355,854,500	
レック	25,200	850.00	21,420,000	
三光合成	22,300	621.00	13,848,300	
きもと	20,300	196.00	3,978,800	
藤森工業	14,000	3,430.00	48,020,000	
前澤化成工業	11,400	1,612.00	18,376,800	
未来工業	6,300	2,629.00	16,562,700	
ウェーブロックホールディングス	4,100	586.00	2,402,600	
JSP	12,500	1,830.00	22,875,000	
エフピコ	33,500	2,973.00	99,595,500	
天馬	15,100	2,541.00	38,369,100	
信越ポリマー	32,800	1,455.00	47,724,000	
東リ	30,900	330.00	10,197,000	
ニフコ	64,000	3,888.00	248,832,000	
バルカー	14,800	3,760.00	55,648,000	
ユニ・チャーム	369,400	5,388.00	1,990,327,200	
ショーエイコーポレーション	4,000	589.00	2,356,000	
協和キリン	214,200	2,731.50	585,087,300	
武田薬品工業	1,569,300	4,548.00	7,137,176,400	
アステラス製薬	1,675,100	2,189.00	3,666,793,900	
住友ファーマ	131,500	656.60	86,342,900	
塩野義製薬	223,600	6,224.00	1,391,686,400	
わかもと製薬	12,900	228.00	2,941,200	

日本新薬	41,800	6,208.00	259,494,400
中外製薬	555,100	4,200.00	2,331,420,000
科研製薬	30,400	3,646.00	110,838,400
エーザイ	215,700	9,550.00	2,059,935,000
ロート製薬	171,800	3,316.00	569,688,800
小野薬品工業	342,100	2,700.00	923,670,000
久光製薬	39,400	3,738.00	147,277,200
持田製薬	20,400	3,275.00	66,810,000
参天製薬	323,100	1,239.50	400,482,450
扶桑薬品工業	5,600	1,995.00	11,172,000
日本ケミファ	1,400	1,899.00	2,658,600
ツムラ	55,800	2,687.00	149,934,600
キッセイ薬品工業	27,400	2,911.00	79,761,400
生化学工業	33,800	750.00	25,350,000
栄研化学	28,800	1,510.00	43,488,000
鳥居薬品	9,500	3,670.00	34,865,000
JCRファーマ	60,000	1,257.00	75,420,000
東和薬品	27,200	1,829.00	49,748,800
富士製薬工業	13,100	1,153.00	15,104,300
ゼリア新薬工業	24,600	2,466.00	60,663,600
そーせいグループ	60,900	3,160.00	192,444,000
第一三共	1,544,800	4,595.00	7,098,356,000
杏林製薬	38,400	1,768.00	67,891,200
大幸薬品	34,100	338.00	11,525,800
ダイト	12,400	2,319.00	28,755,600
大塚ホールディングス	405,700	5,381.00	2,183,071,700
大正製薬ホールディングス	39,400	5,440.00	214,336,000
ペプチドリーム	86,000	2,203.00	189,458,000
あすか製薬ホールディングス	18,200	1,400.00	25,480,000
サワイグループホールディングス	40,500	3,650.00	147,825,000
日本コークス工業	159,900	107.00	17,109,300
ニチレキ	20,900	1,769.00	36,972,100
ユシロ化学工業	9,200	1,088.00	10,009,600
ビーピー・カストロール	5,300	888.00	4,706,400
富士石油	36,200	265.00	9,593,000
MORESCO	4,500	1,167.00	5,251,500

出光興産	196,900	2,857.00	562,543,300
E N E O Sホールディングス	3,007,900	485.30	1,459,733,870
コスモエネルギーホールディングス	70,100	3,839.00	269,113,900
横浜ゴム	100,900	3,116.00	314,404,400
TOYO TIRE	101,900	1,881.00	191,673,900
ブリヂストン	566,300	5,931.00	3,358,725,300
住友ゴム工業	173,900	1,350.50	234,851,950
藤倉コンポジット	9,800	930.00	9,114,000
オカモト	9,800	3,895.00	38,171,000
フコク	9,300	1,329.00	12,359,700
ニッタ	18,000	3,080.00	55,440,000
住友理工	34,400	834.00	28,689,600
三ツ星ベルト	25,900	4,330.00	112,147,000
バンドー化学	28,100	1,425.00	40,042,500
日東紡績	20,000	2,397.00	47,940,000
A G C	180,500	5,234.00	944,737,000
日本板硝子	90,400	630.00	56,952,000
石塚硝子	2,300	1,559.00	3,585,700
日本山村硝子	5,400	1,090.00	5,886,000
日本電気硝子	72,500	2,573.00	186,542,500
オハラ	8,600	1,498.00	12,882,800
住友大阪セメント	25,000	3,607.00	90,175,000
太平洋セメント	113,000	2,751.50	310,919,500
日本ヒューム	15,800	783.00	12,371,400
日本コンクリート工業	35,100	330.00	11,583,000
三谷セキサン	7,500	4,925.00	36,937,500
アジアパイルホールディングス	28,100	607.00	17,056,700
東海カーボン	148,900	1,279.00	190,443,100
日本カーボン	10,200	4,490.00	45,798,000
東洋炭素	11,100	5,130.00	56,943,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,900	5,400.00	48,060,000
TOTO	117,100	4,332.00	507,277,200
日本碍子	206,300	1,754.00	361,850,200
日本特殊陶業	135,100	2,803.50	378,752,850
MARUWA	6,600	20,710.00	136,686,000
品川リフラクトリーズ	5,000	5,240.00	26,200,000

黒崎播磨	3,600	8,460.00	30,456,000
ヨータイ	9,700	1,412.00	13,696,400
東京窯業	13,300	334.00	4,442,200
ニッカトー	6,500	657.00	4,270,500
フジミインコーポレーテッド	14,100	10,010.00	141,141,000
クニミネ工業	4,300	973.00	4,183,900
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,061.00	2,864,700
ニチアス	44,900	2,913.00	130,793,700
ニチハ	22,300	3,085.00	68,795,500
日本製鉄	816,800	2,923.50	2,387,914,800
神戸製鋼所	366,900	1,295.50	475,318,950
中山製鋼所	37,600	809.00	30,418,400
合同製鐵	9,100	3,535.00	32,168,500
JFEホールディングス	487,500	1,985.50	967,931,250
東京製鐵	51,300	1,368.00	70,178,400
共英製鋼	20,800	2,006.00	41,724,800
大和工業	30,100	5,906.00	177,770,600
東京鐵鋼	8,700	3,070.00	26,709,000
大阪製鐵	8,400	1,380.00	11,592,000
淀川製鋼所	20,700	3,365.00	69,655,500
中部鋼板	15,000	1,889.00	28,335,000
丸一鋼管	55,600	3,244.00	180,366,400
モリ工業	3,200	3,355.00	10,736,000
大同特殊鋼	23,000	5,881.00	135,263,000
日本高周波鋼業	4,900	340.00	1,666,000
日本冶金工業	13,300	4,045.00	53,798,500
山陽特殊製鋼	18,000	2,768.00	49,824,000
愛知製鋼	10,500	2,844.00	29,862,000
日本金属	3,100	914.00	2,833,400
大平洋金属	13,000	1,514.00	19,682,000
新日本電工	109,000	279.00	30,411,000
栗本鐵工所	8,700	2,116.00	18,409,200
虹技	1,800	1,260.00	2,268,000
三菱製鋼	11,500	1,315.00	15,122,500
日亜鋼業	14,500	303.00	4,393,500
日本精線	2,500	4,910.00	12,275,000

エンビプロ・ホールディングス	9,800	554.00	5,429,200
シンニッタン	15,500	245.00	3,797,500
新家工業	3,100	2,303.00	7,139,300
大紀アルミニウム工業所	26,000	1,352.00	35,152,000
日本軽金属ホールディングス	49,300	1,422.00	70,104,600
三井金属鉱業	53,100	3,297.00	175,070,700
東邦亜鉛	10,800	1,663.00	17,960,400
三菱マテリアル	121,800	2,599.00	316,558,200
住友金属鉱山	211,500	4,571.00	966,766,500
DOWAホールディングス	41,000	4,415.00	181,015,000
古河機械金属	26,800	1,520.00	40,736,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,800	2,813.00	75,388,400
東邦チタニウム	33,000	1,750.00	57,750,000
UACJ	25,600	2,662.00	68,147,200
CKサンエツ	4,400	4,270.00	18,788,000
古河電気工業	60,800	2,488.00	151,270,400
住友電気工業	630,000	1,704.50	1,073,835,000
フジクラ	195,700	1,191.50	233,176,550
SWCC	20,400	1,843.00	37,597,200
タツタ電線	37,200	714.00	26,560,800
カナレ電気	2,300	1,367.00	3,144,100
平河ヒューテック	10,600	1,520.00	16,112,000
リョービ	19,500	1,958.00	38,181,000
アーレスティ	15,800	661.00	10,443,800
アサヒホールディングス	73,800	1,927.00	142,212,600
稲葉製作所	9,500	1,592.00	15,124,000
宮地エンジニアリンググループ	5,000	3,950.00	19,750,000
トーカロ	50,100	1,443.00	72,294,300
アルファC o	5,200	1,202.00	6,250,400
SUMCO	347,300	2,095.00	727,593,500
川田テクノロジーズ	4,300	5,320.00	22,876,000
RS Technologies	12,200	3,175.00	38,735,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,301.00	4,371,900
信和	7,800	743.00	5,795,400
東洋製罐グループホールディングス	108,800	2,078.50	226,140,800
ホッカンホールディングス	9,800	1,366.00	13,386,800

コロナ	10,200	907.00	9,251,400	
横河ブリッジホールディングス	22,800	2,468.00	56,270,400	
駒井ハルテック	2,300	1,862.00	4,282,600	
高田機工	1,100	2,902.00	3,192,200	
三和ホールディングス	168,000	1,800.00	302,400,000	
文化シャッター	52,500	1,092.00	57,330,000	
三協立山	20,900	688.00	14,379,200	
アルインコ	13,900	991.00	13,774,900	
東洋シャッター	3,300	608.00	2,006,400	
L I X I L	265,800	1,851.00	491,995,800	
日本ファイルコン	9,200	472.00	4,342,400	
ノーリツ	26,900	1,805.00	48,554,500	
長府製作所	18,400	2,481.00	45,650,400	
リンナイ	99,200	3,012.00	298,790,400	
ダイニチ工業	7,100	737.00	5,232,700	
日東精工	26,400	578.00	15,259,200	
三洋工業	1,600	1,952.00	3,123,200	
岡部	29,300	762.00	22,326,600	
ジーテクト	20,300	1,654.00	33,576,200	
東プレ	32,100	1,518.00	48,727,800	
高周波熱錬	28,100	972.00	27,313,200	
東京製綱	10,800	1,137.00	12,279,600	
サンコール	12,600	524.00	6,602,400	
モリテック スチール	10,400	275.00	2,860,000	
パイオラックス	25,200	2,081.00	52,441,200	
エイチワン	18,800	715.00	13,442,000	
日本発條	161,400	1,025.50	165,515,700	
中央発條	13,500	702.00	9,477,000	
アドバネクス	1,700	981.00	1,667,700	
立川ブラインド工業	8,200	1,268.00	10,397,600	
三益半導体工業	14,100	2,981.00	42,032,100	
日本ドライケミカル	3,400	1,721.00	5,851,400	
日本製鋼所	49,200	3,080.00	151,536,000	
三浦工業	74,600	3,706.00	276,467,600	
タクマ	55,000	1,474.00	81,070,000	
ツガミ	39,800	1,373.00	54,645,400	

オークマ	17,900	7,389.00	132,263,100
芝浦機械	17,900	4,670.00	83,593,000
アマダ	285,000	1,391.50	396,577,500
アイダエンジニアリング	36,900	928.00	34,243,200
TAKISAWA	3,700	1,216.00	4,499,200
FUJI	77,600	2,528.00	196,172,800
牧野フライス製作所	19,800	5,480.00	108,504,000
オーエスジー	85,300	1,982.50	169,107,250
ダイジェット工業	1,600	868.00	1,388,800
旭ダイヤモンド工業	50,100	813.00	40,731,300
DMG森精機	108,300	2,485.00	269,125,500
ソディック	49,400	714.00	35,271,600
ディスコ	85,900	21,830.00	1,875,197,000
日東工器	8,700	1,940.00	16,878,000
日進工具	15,000	1,128.00	16,920,000
パンチ工業	12,700	510.00	6,477,000
富士ダイス	6,600	648.00	4,276,800
豊和工業	7,700	817.00	6,290,900
東洋機械金属	9,700	667.00	6,469,900
エンシュウ	3,100	768.00	2,380,800
島精機製作所	28,500	1,866.00	53,181,000
オプトラン	26,400	2,399.00	63,333,600
NCホールディングス	2,900	2,200.00	6,380,000
イワキポンプ	11,900	1,372.00	16,326,800
フリュー	18,800	1,103.00	20,736,400
ヤマシンフィルタ	42,800	295.00	12,626,000
日阪製作所	17,400	894.00	15,555,600
やまびこ	29,200	1,545.00	45,114,000
野村マイクロ・サイエンス	6,100	6,440.00	39,284,000
平田機工	8,500	8,250.00	70,125,000
PEGASUS	19,800	567.00	11,226,600
マルマエ	7,800	1,676.00	13,072,800
タツモ	9,800	2,397.00	23,490,600
ナブテスコ	112,100	3,193.00	357,935,300
三井海洋開発	22,400	1,395.00	31,248,000
レオン自動機	18,800	1,418.00	26,658,400

SMC	57,900	79,210.00	4,586,259,000
ホソカワミクロン	12,600	3,250.00	40,950,000
ユニオンツール	7,900	3,275.00	25,872,500
オイレス工業	25,000	1,959.00	48,975,000
日精エー・エス・ビー機械	7,100	4,060.00	28,826,000
サトーホールディングス	25,400	1,982.00	50,342,800
技研製作所	16,800	2,011.00	33,784,800
日本エアテック	9,100	1,214.00	11,047,400
カワタ	4,100	1,121.00	4,596,100
日精樹脂工業	13,400	990.00	13,266,000
オカダアイヨン	4,300	2,326.00	10,001,800
ワイエイシイホールディングス	5,900	3,130.00	18,467,000
小松製作所	836,700	3,787.00	3,168,582,900
住友重機械工業	105,700	3,405.00	359,908,500
日立建機	71,200	3,916.00	278,819,200
日工	26,700	650.00	17,355,000
巴工業	7,700	2,902.00	22,345,400
井関農機	16,800	1,252.00	21,033,600
TOWA	18,200	2,477.00	45,081,400
丸山製作所	2,400	1,845.00	4,428,000
北川鉄工所	7,100	1,159.00	8,228,900
ローツェ	9,300	11,230.00	104,439,000
タカキタ	4,100	448.00	1,836,800
クボタ	945,000	2,108.00	1,992,060,000
荏原実業	8,600	3,040.00	26,144,000
三菱化工機	5,800	2,768.00	16,054,400
月島ホールディングス	24,300	1,189.00	28,892,700
帝国電機製作所	12,600	2,617.00	32,974,200
新東工業	36,200	1,052.00	38,082,400
澁谷工業	16,800	2,677.00	44,973,600
アイチ コーポレーション	25,000	863.00	21,575,000
小森コーポレーション	41,500	933.00	38,719,500
鶴見製作所	13,700	2,513.00	34,428,100
日本ギア工業	4,800	371.00	1,780,800
酒井重工業	2,300	5,100.00	11,730,000
荏原製作所	73,100	6,881.00	503,001,100

石井鐵工所	1,600	2,442.00	3,907,200
西島製作所	15,500	1,742.00	27,001,000
北越工業	18,000	1,394.00	25,092,000
ダイキン工業	213,200	28,565.00	6,090,058,000
オルガノ	24,600	4,060.00	99,876,000
トーヨーカネツ	6,800	3,300.00	22,440,000
栗田工業	99,900	5,504.00	549,849,600
椿本チエイン	25,400	3,650.00	92,710,000
大同工業	5,800	733.00	4,251,400
木村化工機	13,800	725.00	10,005,000
アネスト岩田	30,400	1,137.00	34,564,800
ダイフク	276,300	2,915.00	805,414,500
サムコ	4,800	5,960.00	28,608,000
加藤製作所	6,600	1,158.00	7,642,800
油研工業	2,200	2,020.00	4,444,000
タダノ	94,300	1,124.50	106,040,350
フジテック	62,600	3,650.00	228,490,000
CKD	49,400	2,335.00	115,349,000
平和	59,400	2,498.00	148,381,200
理想科学工業	15,900	2,285.00	36,331,500
SANKYO	35,100	5,860.00	205,686,000
日本金銭機械	19,700	1,141.00	22,477,700
マースグループホールディングス	10,500	2,657.00	27,898,500
フクシマガリレイ	13,100	5,250.00	68,775,000
オーイズミ	5,400	486.00	2,624,400
ダイコク電機	9,800	3,630.00	35,574,000
竹内製作所	32,400	4,350.00	140,940,000
アマノ	50,700	2,981.00	151,136,700
JUKI	27,800	583.00	16,207,400
ジャノメ	18,200	606.00	11,029,200
マックス	22,000	2,571.00	56,562,000
グローリー	42,900	2,798.50	120,055,650
新晃工業	18,000	2,090.00	37,620,000
大和冷機工業	27,400	1,370.00	37,538,000
セガサミーホールディングス	143,600	3,001.00	430,943,600
日本ピストンリング	4,700	1,515.00	7,120,500

リケン	7,100	3,000.00	21,300,000
T P R	20,500	1,591.00	32,615,500
ツバキ・ナカシマ	44,100	811.00	35,765,100
ホシザキ	115,000	5,142.00	591,330,000
大豊工業	15,500	838.00	12,989,000
日本精工	328,100	881.90	289,351,390
NTN	352,100	296.90	104,538,490
ジェイテクト	158,900	1,276.50	202,835,850
不二越	13,200	4,055.00	53,526,000
日本トムソン	43,900	594.00	26,076,600
THK	103,100	2,958.00	304,969,800
ユーシン精機	14,200	702.00	9,968,400
前澤給装工業	12,600	1,098.00	13,834,800
イーグル工業	19,800	1,720.00	34,056,000
前澤工業	8,000	813.00	6,504,000
日本ピラー工業	16,600	4,500.00	74,700,000
キッツ	65,800	1,078.00	70,932,400
マキタ	222,200	3,953.00	878,356,600
三井E & S	83,700	479.00	40,092,300
日立造船	146,500	912.00	133,608,000
三菱重工業	312,300	6,667.00	2,082,104,100
I H I	112,500	3,819.00	429,637,500
スター精密	33,700	1,788.00	60,255,600
日清紡ホールディングス	145,400	1,122.00	163,138,800
イビデン	102,500	7,760.00	795,400,000
コニカミノルタ	399,600	480.50	192,007,800
ブラザー工業	238,800	2,173.50	519,031,800
ミネベアミツミ	310,700	2,675.00	831,122,500
日立製作所	868,400	8,692.00	7,548,132,800
東芝	343,700	4,535.00	1,558,679,500
三菱電機	1,845,600	1,972.50	3,640,446,000
富士電機	108,600	6,251.00	678,858,600
東洋電機製造	4,500	957.00	4,306,500
安川電機	211,600	6,564.00	1,388,942,400
シンフォニアテクノロジー	19,700	1,697.00	33,430,900
明電舎	27,100	1,996.00	54,091,600

オリジン	3,100	1,254.00	3,887,400
山洋電気	7,800	7,740.00	60,372,000
デンヨー	13,600	2,051.00	27,893,600
PHCホールディングス	25,200	1,527.00	38,480,400
ソシオネクスト	24,500	20,190.00	494,655,000
東芝テック	26,700	4,075.00	108,802,500
芝浦メカトロニクス	3,400	21,410.00	72,794,000
マブチモーター	44,400	3,971.00	176,312,400
ニデック	434,500	7,672.00	3,333,484,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,700	563.00	7,713,100
トレックス・セミコンダクター	8,600	2,211.00	19,014,600
東光高岳	10,900	2,156.00	23,500,400
ダブル・スコープ	58,400	1,209.00	70,605,600
ダイヘン	16,100	5,360.00	86,296,000
ヤーマン	31,200	1,008.00	31,449,600
JVCケンウッド	163,400	494.00	80,719,600
ミマキエンジニアリング	17,400	818.00	14,233,200
IPEX	10,200	1,354.00	13,810,800
大崎電気工業	42,300	545.00	23,053,500
オムロン	163,600	8,588.00	1,404,996,800
日東工業	24,100	3,480.00	83,868,000
IDEC	26,400	3,235.00	85,404,000
正興電機製作所	5,600	1,019.00	5,706,400
不二電機工業	3,100	1,142.00	3,540,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	58,700	2,747.50	161,278,250
サクサホールディングス	2,900	2,080.00	6,032,000
メルコホールディングス	4,600	3,135.00	14,421,000
テクノメディカ	4,500	1,862.00	8,379,000
日本電気	252,600	6,748.00	1,704,544,800
富士通	177,900	18,285.00	3,252,901,500
沖電気工業	80,700	880.00	71,016,000
岩崎通信機	6,100	827.00	5,044,700
電気興業	7,200	2,218.00	15,969,600
サンケン電気	16,600	11,480.00	190,568,000
ナカヨ	2,200	1,146.00	2,521,200
アイホン	10,800	2,378.00	25,682,400

ルネサスエレクトロニクス	1,165,300	2,512.50	2,927,816,250	
セイコーエプソン	229,100	2,214.50	507,341,950	
ワコム	136,400	585.00	79,794,000	
アルバック	42,400	5,921.00	251,050,400	
アクセル	5,400	1,561.00	8,429,400	
E I Z O	13,100	4,695.00	61,504,500	
日本信号	40,700	1,058.00	43,060,600	
京三製作所	37,400	475.00	17,765,000	
能美防災	24,300	1,817.00	44,153,100	
ホーチキ	13,500	1,761.00	23,773,500	
星和電機	6,300	505.00	3,181,500	
エレコム	42,900	1,476.00	63,320,400	
パナソニック ホールディングス	2,109,300	1,689.00	3,562,607,700	
シャープ	215,000	784.80	168,732,000	
アンリツ	125,800	1,205.50	151,651,900	
富士通ゼネラル	50,600	3,114.00	157,568,400	
ソニーグループ	1,250,700	12,990.00	16,246,593,000	
TDK	282,800	5,385.00	1,522,878,000	
帝国通信工業	8,300	1,648.00	13,678,400	
タムラ製作所	76,600	661.00	50,632,600	
アルプスアルパイン	159,800	1,224.00	195,595,200	
池上通信機	4,400	643.00	2,829,200	
日本電波工業	21,700	1,250.00	27,125,000	
鈴木	9,900	1,004.00	9,939,600	
メイコー	19,600	2,585.00	50,666,000	
日本トリム	4,100	2,977.00	12,205,700	
ローランド ディー. ジー.	9,900	3,600.00	35,640,000	
フォスター電機	16,500	891.00	14,701,500	
SMK	4,300	2,361.00	10,152,300	
ヨコオ	14,400	1,720.00	24,768,000	
ホシデン	41,900	1,784.00	74,749,600	
ヒロセ電機	29,500	19,035.00	561,532,500	
日本航空電子工業	36,600	2,999.00	109,763,400	
TOA	20,300	905.00	18,371,500	
マクセル	36,400	1,568.00	57,075,200	
古野電気	23,500	1,047.00	24,604,500	

スミダコーポレーション	19,400	1,405.00	27,257,000	
アイコム	6,900	2,977.00	20,541,300	
リオン	7,500	1,948.00	14,610,000	
横河電機	195,400	2,664.50	520,643,300	
新電元工業	6,800	3,305.00	22,474,000	
アズビル	123,500	4,445.00	548,957,500	
東亜ディーケーケー	6,900	848.00	5,851,200	
日本光電工業	81,800	3,858.00	315,584,400	
チノー	7,300	2,341.00	17,089,300	
共和電業	12,900	358.00	4,618,200	
日本電子材料	11,700	1,631.00	19,082,700	
堀場製作所	39,400	8,016.00	315,830,400	
アドバンテスト	139,300	18,285.00	2,547,100,500	
小野測器	5,900	442.00	2,607,800	
エスペック	14,300	2,282.00	32,632,600	
キーエンス	176,900	67,860.00	12,004,434,000	
日置電機	9,300	8,900.00	82,770,000	
シスメックス	152,500	10,000.00	1,525,000,000	
日本マイクロニクス	29,300	1,892.00	55,435,600	
メガチップス	14,600	3,660.00	53,436,000	
OBARA GROUP	9,700	4,180.00	40,546,000	
澤藤電機	1,900	1,328.00	2,523,200	
原田工業	6,500	802.00	5,213,000	
コーセル	21,500	1,292.00	27,778,000	
イリソ電子工業	16,300	4,055.00	66,096,500	
オブテックスグループ	32,600	1,996.00	65,069,600	
千代田インテグレ	6,300	2,388.00	15,044,400	
レーザーテック	81,100	20,775.00	1,684,852,500	
スタンレー電気	125,900	2,873.00	361,710,700	
ウシオ電機	90,000	1,905.50	171,495,000	
岡谷電機産業	12,000	271.00	3,252,000	
ハリオス テクノ ホールディング	13,200	1,100.00	14,520,000	
エノモト	3,700	1,659.00	6,138,300	
日本セラミック	18,100	2,638.00	47,747,800	
遠藤照明	6,500	1,242.00	8,073,000	
古河電池	13,300	1,037.00	13,792,100	

双信電機	6,600	370.00	2,442,000
山一電機	15,600	2,299.00	35,864,400
図研	15,500	4,015.00	62,232,500
日本電子	44,400	5,099.00	226,395,600
カシオ計算機	131,700	1,165.00	153,430,500
ファナック	867,700	5,016.00	4,352,383,200
日本シイエムケイ	38,200	517.00	19,749,400
エンプラス	5,200	5,580.00	29,016,000
大真空	22,100	638.00	14,099,800
ローム	81,700	13,165.00	1,075,580,500
浜松ホトニクス	141,900	6,957.00	987,198,300
三井ハイテック	18,300	9,430.00	172,569,000
新光電気工業	62,600	5,546.00	347,179,600
京セラ	274,700	7,809.00	2,145,132,300
太陽誘電	86,200	4,115.00	354,713,000
村田製作所	536,200	8,091.00	4,338,394,200
双葉電子工業	34,400	478.00	16,443,200
北陸電気工業	5,400	1,193.00	6,442,200
ニチコン	36,300	1,473.00	53,469,900
日本ケミコン	17,700	1,270.00	22,479,000
KOA	27,000	1,757.00	47,439,000
市光工業	26,100	562.00	14,668,200
小糸製作所	212,700	2,645.50	562,697,850
ミツバ	33,200	794.00	26,360,800
SCREENホールディングス	30,200	15,465.00	467,043,000
キヤノン電子	19,700	1,991.00	39,222,700
キヤノン	970,000	3,807.00	3,692,790,000
リコー	443,300	1,210.50	536,614,650
象印マホービン	53,000	1,758.00	93,174,000
MUTOHホールディングス	2,100	1,715.00	3,601,500
東京エレクトロン	374,200	19,610.00	7,338,062,000
イノテック	12,000	1,579.00	18,948,000
トヨタ紡織	74,500	2,465.00	183,642,500
芦森工業	2,600	1,885.00	4,901,000
ユニプレス	31,800	1,083.00	34,439,400
豊田自動織機	129,300	10,010.00	1,294,293,000

モリタホールディングス	31,100	1,545.00	48,049,500	
三櫻工業	27,100	823.00	22,303,300	
デンソー	364,700	9,264.00	3,378,580,800	
東海理化電機製作所	49,900	2,070.00	103,293,000	
川崎重工業	133,200	3,531.00	470,329,200	
名村造船所	35,300	573.00	20,226,900	
日本車輛製造	6,800	2,006.00	13,640,800	
三菱ロジスネクスト	28,200	1,256.00	35,419,200	
近畿車輛	1,900	1,660.00	3,154,000	
日産自動車	2,511,600	535.70	1,345,464,120	
いすゞ自動車	514,000	1,720.00	884,080,000	
トヨタ自動車	9,708,300	2,221.00	21,562,134,300	
日野自動車	227,900	608.30	138,631,570	
三菱自動車工業	689,700	475.90	328,228,230	
エフテック	9,600	916.00	8,793,600	
レシップホールディングス	5,400	511.00	2,759,400	
GMB	2,700	1,950.00	5,265,000	
ファルテック	2,300	607.00	1,396,100	
武蔵精密工業	43,200	1,739.00	75,124,800	
日産車体	31,200	832.00	25,958,400	
新明和工業	55,500	1,350.00	74,925,000	
極東開発工業	29,200	1,722.00	50,282,400	
トピー工業	14,400	2,190.00	31,536,000	
ティラド	4,500	1,821.00	8,194,500	
曙ブレーキ工業	107,900	138.00	14,890,200	
タチエス	28,000	1,486.00	41,608,000	
NOK	68,700	2,048.00	140,697,600	
フタバ産業	47,500	503.00	23,892,500	
KYB	17,000	4,945.00	84,065,000	
大同メタル工業	34,700	483.00	16,760,100	
プレス工業	79,100	596.00	47,143,600	
ミクニ	15,900	436.00	6,932,400	
太平洋工業	40,600	1,298.00	52,698,800	
アイシン	136,400	4,266.00	581,882,400	
マツダ	584,800	1,351.00	790,064,800	
今仙電機製作所	8,800	623.00	5,482,400	

本田技研工業	1,437,200	4,302.00	6,182,834,400	
スズキ	324,700	4,941.00	1,604,342,700	
S U B A R U	559,400	2,650.50	1,482,689,700	
安永	6,100	916.00	5,587,600	
ヤマハ発動機	277,900	3,991.00	1,109,098,900	
T B K	13,800	385.00	5,313,000	
エクセディ	28,900	2,325.00	67,192,500	
豊田合成	51,600	2,554.00	131,786,400	
愛三工業	29,300	1,124.00	32,933,200	
盟和産業	2,000	1,000.00	2,000,000	
日本プラスト	11,000	444.00	4,884,000	
ヨロズ	16,700	897.00	14,979,900	
エフ・シー・シー	31,400	1,837.00	57,681,800	
シマノ	72,300	22,660.00	1,638,318,000	
テイ・エス テック	81,000	1,814.50	146,974,500	
ジャムコ	7,500	1,474.00	11,055,000	
テルモ	543,800	4,549.00	2,473,746,200	
クリエートメディック	4,500	909.00	4,090,500	
日機装	41,200	911.00	37,533,200	
日本エム・ディ・エム	10,500	1,000.00	10,500,000	
島津製作所	215,300	4,399.00	947,104,700	
J M S	16,400	579.00	9,495,600	
長野計器	12,900	2,122.00	27,373,800	
ブイ・テクノロジー	8,700	2,425.00	21,097,500	
東京計器	13,600	1,289.00	17,530,400	
愛知時計電機	6,900	1,482.00	10,225,800	
インターアクション	8,400	1,360.00	11,424,000	
オーバル	12,200	402.00	4,904,400	
東京精密	38,800	7,460.00	289,448,000	
マニー	70,700	1,711.00	120,967,700	
ニコン	255,600	1,847.00	472,093,200	
トプコン	93,100	2,046.00	190,482,600	
オリンパス	1,088,300	2,247.00	2,445,410,100	
理研計器	11,000	5,420.00	59,620,000	
タムロン	13,200	3,960.00	52,272,000	
HOYA	377,600	16,715.00	6,311,584,000	

シード	7,000	573.00	4,011,000
ノーリツ鋼機	16,800	2,279.00	38,287,200
A&Dホロンホールディングス	25,800	1,651.00	42,595,800
朝日インテック	197,600	2,779.50	549,229,200
シチズン時計	194,400	876.00	170,294,400
リズム	4,300	1,634.00	7,026,200
大研医器	10,400	515.00	5,356,000
メニコン	60,700	2,511.00	152,417,700
シンシア	1,300	611.00	794,300
松風	8,000	2,336.00	18,688,000
セイコーグループ	27,400	2,560.00	70,144,000
ニプロ	147,400	1,028.00	151,527,200
KYORITSU	20,400	151.00	3,080,400
中本ボックス	4,200	1,688.00	7,089,600
スノーピーク	30,300	1,922.00	58,236,600
パラマウントベッドホールディングス	40,800	2,404.00	98,083,200
トランザクション	11,700	1,765.00	20,650,500
粧美堂	3,700	439.00	1,624,300
ニホンフラッシュ	16,600	965.00	16,019,000
前田工織	14,900	3,095.00	46,115,500
永大産業	14,600	215.00	3,139,000
アートネイチャー	18,200	742.00	13,504,400
バンダイナムコホールディングス	484,400	3,267.00	1,582,534,800
アイフィスジャパン	3,800	621.00	2,359,800
SHOEI	40,000	2,590.00	103,600,000
フランスベッドホールディングス	21,900	1,103.00	24,155,700
パイロットコーポレーション	27,600	4,620.00	127,512,000
萩原工業	11,800	1,407.00	16,602,600
フジシールインターナショナル	35,800	1,531.00	54,809,800
タカラトミー	81,300	1,762.00	143,250,600
広済堂ホールディングス	9,200	2,136.00	19,651,200
エステールホールディングス	3,200	621.00	1,987,200
タカノ	5,100	815.00	4,156,500
プロネクサス	14,700	979.00	14,391,300
ホクシン	10,500	133.00	1,396,500
ウッドワン	4,600	1,177.00	5,414,200

大建工業	10,700	2,315.00	24,770,500
凸版印刷	231,200	3,043.00	703,541,600
大日本印刷	193,200	4,102.00	792,506,400
共同印刷	5,000	3,080.00	15,400,000
N I S S H A	33,600	1,670.00	56,112,000
光村印刷	1,100	1,216.00	1,337,600
TAKARA & COMPANY	11,300	2,331.00	26,340,300
アシックス	163,200	4,284.00	699,148,800
ツツミ	3,100	2,272.00	7,043,200
ローランド	13,000	4,225.00	54,925,000
小松ウオール工業	6,500	2,614.00	16,991,000
ヤマハ	111,500	5,480.00	611,020,000
河合楽器製作所	4,800	3,280.00	15,744,000
クリナップ	19,800	712.00	14,097,600
ピジョン	112,600	2,046.50	230,435,900
キングジム	15,600	880.00	13,728,000
リンテック	35,500	2,275.50	80,780,250
イトーキ	36,200	969.00	35,077,800
任天堂	1,116,300	6,289.00	7,020,410,700
三菱鉛筆	25,100	1,703.00	42,745,300
タカラスタンダード	32,600	1,781.00	58,060,600
コクヨ	85,100	1,988.50	169,221,350
ナカバヤシ	19,000	505.00	9,595,000
グローブライド	14,300	2,200.00	31,460,000
オカムラ	53,200	1,892.00	100,654,400
美津濃	17,600	3,765.00	66,264,000
東京電力ホールディングス	1,593,800	527.20	840,251,360
中部電力	651,500	1,719.00	1,119,928,500
関西電力	682,700	1,774.00	1,211,109,800
中国電力	281,600	966.30	272,110,080
北陸電力	166,900	758.00	126,510,200
東北電力	432,200	881.80	381,113,960
四国電力	150,900	964.20	145,497,780
九州電力	407,600	906.70	369,570,920
北海道電力	170,800	594.90	101,608,920
沖縄電力	41,400	1,143.00	47,320,200

電源開発	133,100	2,109.50	280,774,450
エフオン	11,400	569.00	6,486,600
イーレックス	31,400	1,142.00	35,858,800
レノバ	47,100	1,632.00	76,867,200
東京瓦斯	373,800	3,147.00	1,176,348,600
大阪瓦斯	358,100	2,238.50	801,606,850
東邦瓦斯	69,600	2,535.00	176,436,000
北海道瓦斯	10,600	2,324.00	24,634,400
広島ガス	37,300	371.00	13,838,300
西部ガスホールディングス	16,600	2,043.00	33,913,800
静岡ガス	40,300	1,183.00	47,674,900
メタウォーター	22,100	1,806.00	39,912,600
SBSホールディングス	15,800	3,235.00	51,113,000
東武鉄道	194,200	3,845.00	746,699,000
相鉄ホールディングス	58,400	2,552.00	149,036,800
東急	495,800	1,767.00	876,078,600
京浜急行電鉄	200,600	1,287.00	258,172,200
小田急電鉄	268,000	1,990.00	533,320,000
京王電鉄	93,500	4,659.00	435,616,500
京成電鉄	114,000	5,756.00	656,184,000
富士急行	21,800	5,380.00	117,284,000
東日本旅客鉄道	299,900	7,927.00	2,377,307,300
西日本旅客鉄道	225,900	5,989.00	1,352,915,100
東海旅客鉄道	136,200	17,905.00	2,438,661,000
西武ホールディングス	213,900	1,518.00	324,700,200
鴻池運輸	30,100	1,626.00	48,942,600
西日本鉄道	47,200	2,433.50	114,861,200
ハマキョウレックス	13,800	3,785.00	52,233,000
サカイ引越センター	8,400	4,975.00	41,790,000
近鉄グループホールディングス	176,500	5,020.00	886,030,000
阪急阪神ホールディングス	235,400	4,715.00	1,109,911,000
南海電気鉄道	84,400	3,235.00	273,034,000
京阪ホールディングス	97,300	3,790.00	368,767,000
神戸電鉄	4,800	2,964.00	14,227,200
名古屋鉄道	195,100	2,323.50	453,314,850
山陽電気鉄道	13,300	2,210.00	29,393,000

アルプス物流	14,100	1,526.00	21,516,600
ヤマトホールディングス	226,000	2,617.00	591,442,000
山九	44,900	4,691.00	210,625,900
丸運	6,700	237.00	1,587,900
丸全昭和運輸	10,900	3,795.00	41,365,500
センコーグループホールディングス	93,500	972.00	90,882,000
トナミホールディングス	3,900	4,415.00	17,218,500
ニッコンホールディングス	56,500	2,793.00	157,804,500
日本石油輸送	1,400	2,790.00	3,906,000
福山通運	13,400	3,745.00	50,183,000
セイノーホールディングス	109,900	1,990.00	218,701,000
エスライン	3,900	807.00	3,147,300
神奈川中央交通	5,000	3,120.00	15,600,000
AZ-COM丸和ホールディングス	42,600	1,960.00	83,496,000
C&Fロジホールディングス	17,000	1,244.00	21,148,000
九州旅客鉄道	124,800	3,113.00	388,502,400
SGホールディングス	338,700	2,079.00	704,157,300
NIPPON EXPRESSホールディングス	65,900	8,312.00	547,760,800
日本郵船	472,600	3,108.00	1,468,840,800
商船三井	311,500	3,405.00	1,060,657,500
川崎汽船	132,900	3,358.00	446,278,200
NSユナイテッド海運	9,800	3,385.00	33,173,000
飯野海運	66,100	830.00	54,863,000
共栄タンカー	3,700	844.00	3,122,800
乾汽船	23,200	1,293.00	29,997,600
日本航空	433,500	3,035.00	1,315,672,500
ANAホールディングス	480,300	3,338.00	1,603,241,400
パスコ	2,700	1,810.00	4,887,000
トランコム	5,100	6,450.00	32,895,000
日新	13,400	2,457.00	32,923,800
三菱倉庫	37,900	3,599.00	136,402,100
三井倉庫ホールディングス	16,500	3,490.00	57,585,000
住友倉庫	47,600	2,376.00	113,097,600
澁澤倉庫	7,000	2,704.00	18,928,000
東陽倉庫	18,200	270.00	4,914,000

日本トランスシティ	35,500	616.00	21,868,000	
ケイヒン	2,400	1,801.00	4,322,400	
中央倉庫	8,500	1,074.00	9,129,000	
川西倉庫	2,300	1,023.00	2,352,900	
安田倉庫	12,000	976.00	11,712,000	
ファイズホールディングス	2,500	1,336.00	3,340,000	
東洋埠頭	3,900	1,368.00	5,335,200	
上組	84,600	3,306.00	279,687,600	
サンリツ	3,100	723.00	2,241,300	
キムラユニティー	6,500	1,247.00	8,105,500	
キューソー流通システム	8,200	948.00	7,773,600	
東海運	8,000	284.00	2,272,000	
エーアイテイー	11,100	1,863.00	20,679,300	
内外トランスライン	6,400	2,494.00	15,961,600	
日本コンセプト	5,500	1,760.00	9,680,000	
NEC ネットエスアイ	59,300	1,935.00	114,745,500	
クロスキャット	10,200	1,111.00	11,332,200	
システナ	298,300	298.00	88,893,400	
デジタルアーツ	11,200	6,000.00	67,200,000	
日鉄ソリューションズ	30,300	4,005.00	121,351,500	
キューブシステム	10,600	1,230.00	13,038,000	
コア	7,900	1,754.00	13,856,600	
手間いらず	3,000	4,035.00	12,105,000	
ラクーンホールディングス	14,800	712.00	10,537,600	
ソリトンシステムズ	9,200	1,294.00	11,904,800	
ソフトクリエイトホールディングス	14,600	1,730.00	25,258,000	
T I S	194,000	3,585.00	695,490,000	
J N Sホールディングス	6,400	623.00	3,987,200	
グリー	47,600	640.00	30,464,000	
GMOペパボ	2,600	1,828.00	4,752,800	
コーエーテクモホールディングス	111,100	2,428.50	269,806,350	
三菱総合研究所	8,700	5,360.00	46,632,000	
電算	1,700	1,610.00	2,737,000	
A G S	5,900	757.00	4,466,300	
ファインデックス	14,200	616.00	8,747,200	
ブレインパッド	13,300	938.00	12,475,400	

K L a b	35,300	340.00	12,002,000
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	791.00	24,046,400
ネクソン	459,300	2,771.50	1,272,949,950
アイスタイル	51,600	612.00	31,579,200
エムアップホールディングス	21,800	1,182.00	25,767,600
エイチーム	10,600	668.00	7,080,800
エニグモ	22,700	399.00	9,057,300
テクノスジャパン	11,400	660.00	7,524,000
コロプラ	68,900	657.00	45,267,300
ブロードリーフ	103,700	440.00	45,628,000
クロス・マーケティンググループ	8,400	823.00	6,913,200
デジタルハーツホールディングス	11,100	1,258.00	13,963,800
システム情報	14,200	758.00	10,763,600
メディアドゥ	7,200	1,447.00	10,418,400
じげん	51,800	744.00	38,539,200
ブイキューブ	21,400	486.00	10,400,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,300	514.00	1,696,200
サイバーリンクス	4,500	714.00	3,213,000
フィックスターズ	20,100	1,403.00	28,200,300
CARTA HOLDINGS	8,400	1,277.00	10,726,800
オブティム	14,600	1,021.00	14,906,600
セレス	7,200	1,028.00	7,401,600
SHIFT	11,800	25,410.00	299,838,000
ティーガイア	18,600	1,700.00	31,620,000
セック	1,900	3,315.00	6,298,500
テクマトリックス	32,400	1,806.00	58,514,400
プロシップ	7,800	1,409.00	10,990,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,900	2,856.00	148,226,400
GMOペイメントゲートウェイ	35,400	11,235.00	397,719,000
ザップラス	4,000	350.00	1,400,000
システムリサーチ	5,600	2,647.00	14,823,200
インターネットイニシアティブ	99,000	2,684.00	265,716,000
さくらインターネット	20,000	1,184.00	23,680,000
ヴェンクス	4,100	1,448.00	5,936,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	3,195.00	17,253,000
SRAホールディングス	9,100	3,205.00	29,165,500

システムインテグレータ	4,200	441.00	1,852,200
朝日ネット	19,200	636.00	12,211,200
eBASE	25,000	770.00	19,250,000
アバントグループ	22,400	1,523.00	34,115,200
アドソル日進	7,500	1,703.00	12,772,500
ODKソリューションズ	3,200	567.00	1,814,400
フリービット	9,300	1,472.00	13,689,600
コムチュア	23,500	2,015.00	47,352,500
サイバーコム	2,300	1,475.00	3,392,500
アステリア	14,000	778.00	10,892,000
アイル	8,300	2,875.00	23,862,500
マークライnz	9,600	2,468.00	23,692,800
メディカル・データ・ビジョン	26,600	739.00	19,657,400
gumi	26,200	652.00	17,082,400
ショーケース	3,300	352.00	1,161,600
モバイルファクトリー	3,000	857.00	2,571,000
テラスカイ	7,700	2,850.00	21,945,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,300	1,586.00	16,335,800
PCIホールディングス	5,300	1,132.00	5,999,600
アイビーシー	2,200	599.00	1,317,800
ネオジャパン	6,000	1,109.00	6,654,000
PR TIMES	4,500	1,409.00	6,340,500
ラクス	83,900	2,378.50	199,556,150
ランドコンピュータ	3,400	1,361.00	4,627,400
ダブルスタンダード	7,200	2,560.00	18,432,000
オープンドア	12,500	1,290.00	16,125,000
アカツキ	8,400	2,012.00	16,900,800
ベネフィットジャパン	900	1,192.00	1,072,800
Ubicomホールディングス	5,500	1,688.00	9,284,000
カナミックネットワーク	19,200	463.00	8,889,600
ノムラシステムコーポレーション	13,500	117.00	1,579,500
チェンジホールディングス	43,500	2,188.00	95,178,000
シンクロ・フード	8,800	718.00	6,318,400
オークネット	8,800	1,734.00	15,259,200
キャピタル・アセット・プランニング	2,700	815.00	2,200,500
セグエグループ	3,900	1,086.00	4,235,400

エイトレッド	2,100	1,414.00	2,969,400
マクロミル	34,900	827.00	28,862,300
ビーグリー	2,400	1,153.00	2,767,200
オロ	5,400	2,093.00	11,302,200
ユーザーローカル	6,400	2,594.00	16,601,600
テモナ	3,400	292.00	992,800
ニーズウェル	7,600	808.00	6,140,800
マネーフォワード	42,800	5,541.00	237,154,800
サインポスト	5,300	507.00	2,687,100
Sun Asterisk	12,600	1,163.00	14,653,800
電算システムホールディングス	8,600	3,280.00	28,208,000
Appier Group	67,200	1,712.00	115,046,400
ソルクシーズ	11,300	445.00	5,028,500
フェイス	4,000	512.00	2,048,000
プロトコーポレーション	22,200	1,133.00	25,152,600
ハイマックス	5,600	1,412.00	7,907,200
野村総合研究所	353,300	3,951.00	1,395,888,300
サイバネットシステム	14,900	857.00	12,769,300
CEホールディングス	7,200	647.00	4,658,400
日本システム技術	5,800	2,417.00	14,018,600
インテージホールディングス	20,100	1,652.00	33,205,200
東邦システムサイエンス	3,900	1,165.00	4,543,500
ソースネクスト	90,500	198.00	17,919,000
インフォコム	22,900	2,250.00	51,525,000
シンプレクス・ホールディングス	30,300	2,510.00	76,053,000
HEROZ	6,000	2,101.00	12,606,000
ラクスル	42,600	1,363.00	58,063,800
メルカリ	106,800	3,337.00	356,391,600
I P S	5,800	2,317.00	13,438,600
F I G	16,200	277.00	4,487,400
システムサポート	6,900	2,058.00	14,200,200
イーソル	11,400	942.00	10,738,800
アルテリア・ネットワークス	16,600	1,968.00	32,668,800
東海ソフト	2,100	1,108.00	2,326,800
ウイングアーク1st	18,300	2,478.00	45,347,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,800	1,505.00	7,224,000

ス				
サーバーワークス	3,600	2,924.00	10,526,400	
東名	1,000	3,025.00	3,025,000	
ヴィッツ	1,400	1,482.00	2,074,800	
トピラシステムズ	3,500	977.00	3,419,500	
S a n s a n	58,100	1,685.50	97,927,550	
L i n k-U	3,300	1,132.00	3,735,600	
ギフトィ	19,300	1,807.00	34,875,100	
メドレー	23,800	5,200.00	123,760,000	
ベース	6,000	5,560.00	33,360,000	
J M D C	29,100	5,697.00	165,782,700	
フォーカスシステムズ	13,000	1,054.00	13,702,000	
クレスコ	13,700	2,037.00	27,906,900	
フジ・メディア・ホールディングス	170,400	1,425.00	242,820,000	
オービック	59,300	22,675.00	1,344,627,500	
ジャストシステム	25,500	4,090.00	104,295,000	
T D C ソフト	15,000	1,656.00	24,840,000	
Zホールディングス	2,523,700	352.70	890,108,990	
トレンドマイクロ	102,400	6,847.00	701,132,800	
I Dホールディングス	12,000	1,253.00	15,036,000	
日本オラクル	33,900	10,800.00	366,120,000	
アルファシステムズ	5,600	3,510.00	19,656,000	
フューチャー	44,200	1,733.00	76,598,600	
C A C H o l d i n g s	10,900	1,745.00	19,020,500	
S Bテクノロジー	7,500	2,563.00	19,222,500	
トーセ	4,000	769.00	3,076,000	
オービックビジネスコンサルタント	34,900	5,270.00	183,923,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	95,200	3,542.00	337,198,400	
アイティフォー	23,400	1,056.00	24,710,400	
東計電算	2,500	6,120.00	15,300,000	
エクスネット	2,000	1,029.00	2,058,000	
大塚商会	100,500	5,490.00	551,745,000	
サイボウズ	24,400	2,501.00	61,024,400	
電通国際情報サービス	21,600	5,050.00	109,080,000	
A C C E S S	21,000	986.00	20,706,000	
デジタルガレージ	31,500	3,705.00	116,707,500	

EMシステムズ	29,600	783.00	23,176,800
ウェザーニューズ	5,500	6,560.00	36,080,000
C I J	29,500	637.00	18,791,500
ビジネスエンジニアリング	2,900	3,355.00	9,729,500
日本エンタープライズ	14,700	132.00	1,940,400
WOWOW	13,400	1,145.00	15,343,000
スカラ	16,500	779.00	12,853,500
インテリジェント ウェイブ	7,400	795.00	5,883,000
IMAGICA GROUP	14,900	605.00	9,014,500
ネットワンシステムズ	66,100	3,137.00	207,355,700
システムソフト	62,500	78.00	4,875,000
アルゴグラフィックス	16,300	3,870.00	63,081,000
マーベラス	28,900	671.00	19,391,900
エイベックス	30,200	1,496.00	45,179,200
B I P R O G Y	65,300	3,540.00	231,162,000
都築電気	9,400	1,996.00	18,762,400
T B S ホールディングス	90,800	2,555.00	231,994,000
日本テレビホールディングス	157,000	1,344.00	211,008,000
朝日放送グループホールディングス	16,700	652.00	10,888,400
テレビ朝日ホールディングス	43,100	1,581.00	68,141,100
スカパー J S A T ホールディングス	157,400	556.00	87,514,400
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,215.00	41,152,000
日本BS放送	5,000	918.00	4,590,000
ビジョン	23,400	1,789.00	41,862,600
スマートバリュー	3,500	393.00	1,375,500
USEN-NEXT HOLDINGS	19,900	3,225.00	64,177,500
ワイヤレスゲート	6,300	230.00	1,449,000
日本通信	163,900	250.00	40,975,000
クロップス	2,300	1,050.00	2,415,000
日本電信電話	2,272,200	4,132.00	9,388,730,400
K D D I	1,370,300	4,428.00	6,067,688,400
ソフトバンク	2,849,300	1,523.50	4,340,908,550
光通信	20,900	20,490.00	428,241,000
エムティーアイ	12,300	600.00	7,380,000
GMOインターネットグループ	65,500	2,788.00	182,614,000
ファイバーゲート	9,600	1,417.00	13,603,200

アイドママーケティングコミュニケーション	3,400	277.00	941,800	
KADOKAWA	93,800	3,353.00	314,511,400	
学研ホールディングス	29,600	865.00	25,604,000	
ゼンリン	30,400	910.00	27,664,000	
昭文社ホールディングス	6,100	302.00	1,842,200	
インプレスホールディングス	12,400	210.00	2,604,000	
アイネット	10,800	1,626.00	17,560,800	
松竹	10,100	10,755.00	108,625,500	
東宝	111,000	5,398.00	599,178,000	
東映	4,900	17,730.00	86,877,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	556,400	1,977.50	1,100,281,000	
ピー・シー・エー	10,200	1,320.00	13,464,000	
ビジネスブレイン太田昭和	7,600	2,338.00	17,768,800	
D T S	37,800	3,395.00	128,331,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,100	6,893.00	614,166,300	
シーイーシー	24,900	1,723.00	42,902,700	
カプコン	176,200	5,436.00	957,823,200	
アイ・エス・ビー	9,100	1,671.00	15,206,100	
ジャステック	10,900	1,328.00	14,475,200	
S C S K	144,700	2,259.50	326,949,650	
N S W	6,900	2,391.00	16,497,900	
アイネス	12,500	1,470.00	18,375,000	
T K C	28,300	3,810.00	107,823,000	
富士ソフト	20,100	9,120.00	183,312,000	
N S D	63,300	2,867.00	181,481,100	
コナミグループ	75,900	7,355.00	558,244,500	
福井コンピュータホールディングス	12,300	2,771.00	34,083,300	
J B C Cホールディングス	13,000	2,532.00	32,916,000	
ミロク情報サービス	16,200	1,526.00	24,721,200	
ソフトバンクグループ	874,700	6,622.00	5,792,263,400	
高千穂交易	5,200	3,080.00	16,016,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,200	2,000.00	4,400,000	
伊藤忠食品	4,200	5,170.00	21,714,000	
エレマテック	16,800	1,776.00	29,836,800	
あらた	14,300	4,695.00	67,138,500	
トーメンデバイス	2,700	5,010.00	13,527,000	

東京エレクトロン デバイス	6,900	10,330.00	71,277,000	
円谷フィールズホールディングス	32,100	2,778.00	89,173,800	
双日	186,500	3,190.00	594,935,000	
アルフレッサ ホールディングス	187,800	2,167.00	406,962,600	
横浜冷凍	51,000	1,172.00	59,772,000	
ラサ商事	6,700	1,444.00	9,674,800	
アルコニックス	24,600	1,368.00	33,652,800	
神戸物産	144,700	3,765.00	544,795,500	
ハイパー	2,800	448.00	1,254,400	
あい ホールディングス	29,900	2,346.00	70,145,400	
ディーブイエックス	4,000	909.00	3,636,000	
ダイワボウホールディングス	76,500	2,728.50	208,730,250	
マクニカホールディングス	44,300	5,690.00	252,067,000	
ラクト・ジャパン	7,200	2,032.00	14,630,400	
グリムス	7,800	2,890.00	22,542,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,400	895.00	24,523,000	
八洲電機	15,100	1,380.00	20,838,000	
メディアスホールディングス	12,000	899.00	10,788,000	
レスターホールディングス	17,900	2,433.00	43,550,700	
ジュテックホールディングス	3,400	1,163.00	3,954,200	
大光	6,200	570.00	3,534,000	
OCHIホールディングス	3,300	1,259.00	4,154,700	
TOKAIホールディングス	92,400	887.00	81,958,800	
黒谷	4,000	599.00	2,396,000	
C o m i n i x	2,900	864.00	2,505,600	
三洋貿易	21,100	1,411.00	29,772,100	
ビューティガレージ	3,000	4,475.00	13,425,000	
ウイン・パートナーズ	13,600	1,024.00	13,926,400	
ミタチ産業	3,700	1,401.00	5,183,700	
シップヘルスケアホールディングス	67,200	2,379.50	159,902,400	
明治電機工業	7,000	1,415.00	9,905,000	
デリカフーズホールディングス	5,700	589.00	3,357,300	
スターティアホールディングス	2,900	1,342.00	3,891,800	
コメダホールディングス	45,800	2,670.00	122,286,000	
ピーバンドットコム	2,100	461.00	968,100	
アセンテック	6,300	629.00	3,962,700	

富士興産	3,300	1,516.00	5,002,800
協栄産業	1,300	2,045.00	2,658,500
フルサト・マルカホールディングス	18,600	2,296.00	42,705,600
ヤマエグループホールディングス	10,600	3,015.00	31,959,000
小野建	18,400	1,597.00	29,384,800
南陽	2,800	2,142.00	5,997,600
佐島電機	9,200	1,658.00	15,253,600
エコートレーディング	2,800	789.00	2,209,200
伯東	10,700	5,210.00	55,747,000
コンドーテック	14,400	1,135.00	16,344,000
中山福	7,800	341.00	2,659,800
ナガイレーベン	23,600	2,267.00	53,501,200
三菱食品	17,300	3,615.00	62,539,500
松田産業	14,200	2,241.00	31,822,200
第一興商	72,400	2,512.00	181,868,800
メディパルホールディングス	178,900	2,385.50	426,765,950
S P K	8,300	1,782.00	14,790,600
萩原電気ホールディングス	7,200	3,145.00	22,644,000
アズワン	26,600	5,686.00	151,247,600
スズデン	6,600	2,196.00	14,493,600
尾家産業	3,500	1,251.00	4,378,500
シモジマ	12,900	1,092.00	14,086,800
ドウシシャ	19,800	2,284.00	45,223,200
小津産業	3,200	1,599.00	5,116,800
高速	9,700	2,011.00	19,506,700
たけびし	7,100	1,711.00	12,148,100
リックス	3,000	3,085.00	9,255,000
丸文	16,700	1,278.00	21,342,600
ハピネット	15,900	2,109.00	33,533,100
橋本総業ホールディングス	7,400	1,261.00	9,331,400
日本ライフライン	54,900	1,043.00	57,260,700
タカショー	16,300	673.00	10,969,900
I D O M	56,600	875.00	49,525,000
進和	11,500	2,253.00	25,909,500
エスケイジャパン	3,600	552.00	1,987,200
ダイトロン	7,400	3,010.00	22,274,000

シークス	26,700	1,546.00	41,278,200
田中商事	4,100	652.00	2,673,200
オーハシテクニカ	9,100	1,569.00	14,277,900
白銅	6,800	2,338.00	15,898,400
ダイコー通産	1,500	1,120.00	1,680,000
伊藤忠商事	1,152,700	5,645.00	6,506,991,500
丸紅	1,459,800	2,488.50	3,632,712,300
高島	2,300	3,550.00	8,165,000
長瀬産業	85,800	2,372.50	203,560,500
蝶理	10,100	2,854.00	28,825,400
豊田通商	163,900	7,016.00	1,149,922,400
三共生興	26,900	553.00	14,875,700
兼松	72,600	1,977.00	143,530,200
ツカモトコーポレーション	2,100	1,351.00	2,837,100
三井物産	1,327,600	5,460.00	7,248,696,000
日本紙パルプ商事	9,900	5,060.00	50,094,000
カメイ	19,900	1,435.00	28,556,500
東都水産	800	6,480.00	5,184,000
OUGホールディングス	2,100	2,454.00	5,153,400
スターゼン	14,200	2,322.00	32,972,400
山善	50,400	1,115.00	56,196,000
椿本興業	3,000	4,075.00	12,225,000
住友商事	1,158,500	3,042.00	3,524,157,000
内田洋行	7,600	5,520.00	41,952,000
三菱商事	1,157,000	6,924.00	8,011,068,000
第一実業	6,600	5,730.00	37,818,000
キヤノンマーケティングジャパン	43,300	3,534.00	153,022,200
西華産業	7,300	1,992.00	14,541,600
佐藤商事	13,000	1,433.00	18,629,000
菱洋エレクトロ	16,000	3,420.00	54,720,000
東京産業	17,100	896.00	15,321,600
ユアサ商事	16,800	4,330.00	72,744,000
神鋼商事	4,700	5,740.00	26,978,000
トルク	7,900	258.00	2,038,200
阪和興業	33,600	4,560.00	153,216,000
正栄食品工業	12,400	4,275.00	53,010,000

カナデン	12,500	1,282.00	16,025,000
RYODEN	15,100	2,128.00	32,132,800
岩谷産業	42,600	7,512.00	320,011,200
ナイス	4,000	1,463.00	5,852,000
ニチモウ	1,800	3,775.00	6,795,000
極東貿易	11,200	1,672.00	18,726,400
アステナホールディングス	32,400	446.00	14,450,400
三愛オブリ	49,500	1,499.00	74,200,500
稲畑産業	37,800	3,200.00	120,960,000
G S I クレオス	10,900	2,038.00	22,214,200
明和産業	24,900	670.00	16,683,000
クワザワホールディングス	4,700	550.00	2,585,000
ワキタ	34,400	1,302.00	44,788,800
東邦ホールディングス	46,600	2,598.00	121,066,800
サンゲツ	47,000	2,472.00	116,184,000
ミツウロコグループホールディングス	23,900	1,389.00	33,197,100
シナネンホールディングス	6,000	3,820.00	22,920,000
伊藤忠エネクス	46,400	1,237.00	57,396,800
サンリオ	53,000	5,566.00	294,998,000
サンワテクノス	9,600	2,335.00	22,416,000
リョーサン	19,800	4,205.00	83,259,000
新光商事	25,200	1,165.00	29,358,000
トーヨー	8,000	2,976.00	23,808,000
三信電気	7,600	2,112.00	16,051,200
東陽テクニカ	19,000	1,425.00	27,075,000
モスフードサービス	27,500	3,215.00	88,412,500
加賀電子	15,200	6,150.00	93,480,000
ソーダニッカ	10,700	808.00	8,645,600
立花エレテック	13,700	3,080.00	42,196,000
フォーバル	7,400	1,052.00	7,784,800
PALTAC	29,400	4,823.00	141,796,200
三谷産業	32,800	319.00	10,463,200
西本Wismettacホールディングス	4,800	4,615.00	22,152,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,050.00	2,460,000
コーア商事ホールディングス	10,500	706.00	7,413,000
KPPグループホールディングス	43,600	624.00	27,206,400

ヤマタネ	8,300	1,686.00	13,993,800
丸紅建材リース	1,300	2,380.00	3,094,000
泉州電業	9,400	3,585.00	33,699,000
トラスコ中山	39,300	2,291.00	90,036,300
オートボックスセブン	65,100	1,528.50	99,505,350
モリト	13,400	1,030.00	13,802,000
加藤産業	23,200	3,915.00	90,828,000
北恵	3,300	753.00	2,484,900
イエローハット	33,000	1,850.00	61,050,000
J Kホールディングス	14,400	969.00	13,953,600
日伝	11,100	2,371.00	26,318,100
北沢産業	7,800	438.00	3,416,400
杉本商事	8,300	2,166.00	17,977,800
因幡電機産業	48,500	3,285.00	159,322,500
東テク	6,300	4,300.00	27,090,000
ミスミグループ本社	282,300	2,907.00	820,646,100
アルテック	8,200	271.00	2,222,200
タキヒヨー	3,600	916.00	3,297,600
蔵王産業	2,400	2,279.00	5,469,600
スズケン	54,800	3,823.00	209,500,400
ジェコス	11,200	853.00	9,553,600
グローセル	17,600	405.00	7,128,000
ローソン	46,500	6,392.00	297,228,000
サンエー	14,400	4,595.00	66,168,000
カワチ薬品	14,900	2,189.00	32,616,100
エービーシー・マート	27,400	7,679.00	210,404,600
ハードオフコーポレーション	6,200	1,404.00	8,704,800
アスクル	39,000	1,993.00	77,727,000
ゲオホールディングス	18,600	1,719.00	31,973,400
アダストリア	22,800	2,989.00	68,149,200
くら寿司	22,100	3,075.00	67,957,500
キャンドゥ	6,900	2,430.00	16,767,000
I Kホールディングス	6,000	368.00	2,208,000
パルグループホールディングス	18,500	3,775.00	69,837,500
エディオン	74,400	1,427.00	106,168,800
サーラコーポレーション	40,000	778.00	31,120,000

ワッツ	7,800	712.00	5,553,600
ハローズ	8,600	3,555.00	30,573,000
あみやき亭	4,700	3,510.00	16,497,000
大黒天物産	5,800	5,290.00	30,682,000
ハニーズホールディングス	15,100	1,559.00	23,540,900
ファーマライズホールディングス	4,000	617.00	2,468,000
アルペン	15,700	2,034.00	31,933,800
ハブ	5,400	808.00	4,363,200
クオールホールディングス	26,000	1,725.00	44,850,000
ジンズホールディングス	11,300	2,998.00	33,877,400
ビックカメラ	100,000	1,071.00	107,100,000
DCMホールディングス	109,200	1,219.00	133,114,800
M o n o t a R O	265,500	1,833.50	486,794,250
東京一番フーズ	4,400	502.00	2,208,800
きちりホールディングス	3,400	896.00	3,046,400
アークランドサービスホールディングス	15,500	2,929.00	45,399,500
J. フロント リテイリング	232,900	1,391.50	324,080,350
ドトール・日レスホールディングス	33,400	2,056.00	68,670,400
マツキヨココカラ&カンパニー	113,500	8,093.00	918,555,500
ブロンコビリー	10,100	2,935.00	29,643,500
Z O Z O	123,800	3,066.00	379,570,800
トレジャー・ファクトリー	9,300	1,606.00	14,935,800
物語コーポレーション	31,400	3,435.00	107,859,000
三越伊勢丹ホールディングス	315,300	1,443.00	454,977,900
H a m e e	6,900	1,065.00	7,348,500
マーケットエンタープライズ	1,800	1,518.00	2,732,400
ウエルシアホールディングス	97,200	2,978.50	289,510,200
クリエイトSDホールディングス	31,100	3,525.00	109,627,500
丸善C H I ホールディングス	18,600	351.00	6,528,600
ミサワ	3,500	612.00	2,142,000
ティーライフ	2,300	1,479.00	3,401,700
チムニー	4,500	1,289.00	5,800,500
シュッピン	14,400	1,125.00	16,200,000
オイシックス・ラ・大地	25,400	2,470.00	62,738,000
ネクステージ	42,900	2,735.00	117,331,500
ジョイフル本田	55,800	1,706.00	95,194,800

鳥貴族ホールディングス	7,100	2,558.00	18,161,800
ホットランド	14,600	1,726.00	25,199,600
すかいらーくホールディングス	256,000	1,883.00	482,048,000
SFPホールディングス	10,200	2,089.00	21,307,800
綿半ホールディングス	14,900	1,360.00	20,264,000
ヨシックスホールディングス	3,100	2,410.00	7,471,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	61,400	1,113.00	68,338,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	794.00	7,225,400
B E E N O S	8,200	2,027.00	16,621,400
あさひ	16,000	1,281.00	20,496,000
日本調剤	13,200	1,162.00	15,338,400
コスモス薬品	18,600	14,375.00	267,375,000
トーエル	7,100	753.00	5,346,300
セブン&アイ・ホールディングス	644,700	6,085.00	3,922,999,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	140,700	977.00	137,463,900
ツルハホールディングス	39,300	10,895.00	428,173,500
サンマルクホールディングス	15,300	1,877.00	28,718,100
フェリシモ	3,800	1,016.00	3,860,800
トリドールホールディングス	46,700	3,045.00	142,201,500
TOKYO BASE	20,400	358.00	7,303,200
ウイルプラスホールディングス	2,800	1,313.00	3,676,400
JMホールディングス	14,400	1,990.00	28,656,000
サツドラホールディングス	7,200	765.00	5,508,000
アレンザホールディングス	14,500	987.00	14,311,500
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,686.00	8,935,800
バロックジャパンリミテッド	12,700	854.00	10,845,800
クスリのアオキホールディングス	16,700	8,077.00	134,885,900
力の源ホールディングス	8,400	2,014.00	16,917,600
FOOD & LIFE COMPANIES	99,900	2,892.50	288,960,750
メディカルシステムネットワーク	17,600	377.00	6,635,200
はるやまホールディングス	7,200	497.00	3,578,400
ノジマ	61,400	1,377.00	84,547,800
カッパ・クリエイト	29,400	1,529.00	44,952,600
ライトオン	11,000	582.00	6,402,000
良品計画	204,600	1,391.50	284,700,900

パリミキホールディングス	19,800	325.00	6,435,000	
アドヴァングループ	18,300	925.00	16,927,500	
アルビス	6,300	2,399.00	15,113,700	
コナカ	15,900	377.00	5,994,300	
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,616.00	3,393,600	
G-7ホールディングス	23,700	1,311.00	31,070,700	
イオン北海道	27,900	879.00	24,524,100	
コジマ	31,800	576.00	18,316,800	
ヒマラヤ	5,100	949.00	4,839,900	
コーナン商事	25,400	3,490.00	88,646,000	
エコス	7,200	1,863.00	13,413,600	
ワタミ	22,600	896.00	20,249,600	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	377,700	2,475.50	934,996,350	
西松屋チェーン	41,700	1,686.00	70,306,200	
ゼンショーホールディングス	102,500	6,218.00	637,345,000	
幸楽苑ホールディングス	12,200	1,010.00	12,322,000	
ハークスレイ	6,000	620.00	3,720,000	
サイゼリヤ	27,800	3,665.00	101,887,000	
V Tホールディングス	72,000	540.00	38,880,000	
魚力	6,000	2,180.00	13,080,000	
フジ・コーポレーション	10,900	1,669.00	18,192,100	
ユナイテッドアローズ	20,200	2,434.00	49,166,800	
ハイデイ日高	28,000	2,337.00	65,436,000	
YU-WA Creation Holdings	11,400	195.00	2,223,000	
コロワイド	86,200	2,022.00	174,296,400	
ピーシーデポコーポレーション	22,000	479.00	10,538,000	
老番屋	14,900	5,460.00	81,354,000	
P L A N T	4,100	704.00	2,886,400	
スギホールディングス	37,800	6,198.00	234,284,400	
薬王堂ホールディングス	10,600	2,502.00	26,521,200	
スクロール	28,300	958.00	27,111,400	
ヨンドシーホールディングス	16,400	1,778.00	29,159,200	
木曾路	28,500	2,383.00	67,915,500	
S R Sホールディングス	31,400	935.00	29,359,000	
千趣会	35,700	411.00	14,672,700	

リテールパートナーズ	28,100	1,610.00	45,241,000
ケーヨー	30,400	806.00	24,502,400
上新電機	16,900	1,923.00	32,498,700
日本瓦斯	100,500	1,980.00	198,990,000
ロイヤルホールディングス	36,300	2,769.00	100,514,700
いなげや	18,300	1,514.00	27,706,200
チヨダ	18,500	878.00	16,243,000
ライフコーポレーション	16,400	3,055.00	50,102,000
リンガーハット	24,100	2,473.00	59,599,300
MrMaxHD	27,000	621.00	16,767,000
AOKIホールディングス	35,400	862.00	30,514,800
オークワ	30,100	875.00	26,337,500
コメリ	29,000	2,974.00	86,246,000
青山商事	40,400	1,288.00	52,035,200
しまむら	22,000	14,045.00	308,990,000
はせがわ	8,400	351.00	2,948,400
高島屋	141,100	1,876.00	264,703,600
松屋	31,900	1,121.00	35,759,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	91,200	1,470.00	134,064,000
近鉄百貨店	8,200	2,523.00	20,688,600
丸井グループ	138,000	2,398.00	330,924,000
アクシアル リテイリング	12,900	3,615.00	46,633,500
イオン	634,200	2,942.50	1,866,133,500
イズミ	28,500	3,400.00	96,900,000
平和堂	31,400	2,156.00	67,698,400
フジ	28,800	1,825.00	52,560,000
ヤオコー	21,200	7,226.00	153,191,200
ゼビオホールディングス	25,800	1,088.00	28,070,400
ケーズホールディングス	132,700	1,253.00	166,273,100
Olympicグループ	6,400	552.00	3,532,800
日産東京販売ホールディングス	20,000	348.00	6,960,000
シルバーライフ	4,000	1,320.00	5,280,000
Genky DrugStores	8,300	4,430.00	36,769,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	964.00	2,795,600
ブックオフグループホールディングス	9,900	1,252.00	12,394,800
ギフトホールディングス	4,100	4,990.00	20,459,000

アインホールディングス	25,900	5,162.00	133,695,800
元気寿司	5,400	3,270.00	17,658,000
ヤマダホールディングス	768,300	422.50	324,606,750
アーケランズ	27,700	1,572.00	43,544,400
ニトリホールディングス	75,700	16,140.00	1,221,798,000
グルメ杵屋	15,600	1,036.00	16,161,600
愛眼	10,700	182.00	1,947,400
ケーユーホールディングス	11,400	1,259.00	14,352,600
吉野家ホールディングス	73,400	2,574.50	188,968,300
松屋フーズホールディングス	9,000	4,095.00	36,855,000
サガミホールディングス	30,500	1,250.00	38,125,000
関西フードマーケット	17,200	1,529.00	26,298,800
王将フードサービス	12,400	6,630.00	82,212,000
ミニストップ	13,700	1,443.00	19,769,100
アークス	34,500	2,447.00	84,421,500
バローホールディングス	36,000	1,975.00	71,100,000
ベルク	9,400	6,390.00	60,066,000
大庄	8,300	1,128.00	9,362,400
ファーストリテイリング	84,200	35,790.00	3,013,518,000
サンドラッグ	71,100	4,256.00	302,601,600
サックスパー ホールディングス	18,300	1,035.00	18,940,500
ヤマザワ	3,100	1,260.00	3,906,000
やまや	3,200	2,689.00	8,604,800
ベルーナ	45,800	716.00	32,792,800
いよぎんホールディングス	207,200	787.60	163,190,720
しずおかフィナンシャルグループ	393,500	1,032.00	406,092,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	146,600	860.80	126,193,280
楽天銀行	60,600	1,935.00	117,261,000
島根銀行	4,700	480.00	2,256,000
じもとホールディングス	12,000	381.00	4,572,000
めぶきフィナンシャルグループ	864,100	330.90	285,930,690
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,300	3,070.00	68,461,000
九州フィナンシャルグループ	306,400	583.10	178,661,840
ゆうちょ銀行	487,900	1,124.50	548,643,550
富山第一銀行	57,900	725.00	41,977,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	934,300	551.60	515,359,880

西日本フィナンシャルホールディングス	108,100	1,237.00	133,719,700
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,564.00	24,398,400
第四北越フィナンシャルグループ	27,300	3,035.00	82,855,500
ひろぎんホールディングス	227,200	789.30	179,328,960
おきなわフィナンシャルグループ	16,600	2,078.00	34,494,800
十六フィナンシャルグループ	22,600	3,035.00	68,591,000
北國フィナンシャルホールディングス	19,600	4,090.00	80,164,000
プロクレアホールディングス	21,300	2,034.00	43,324,200
あいちフィナンシャルグループ	24,400	2,257.00	55,070,800
あおぞら銀行	109,500	2,660.00	291,270,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,905,400	1,006.50	10,976,285,100
りそなホールディングス	2,200,900	669.50	1,473,502,550
三井住友トラスト・ホールディングス	316,500	4,963.00	1,570,789,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,272,500	5,924.00	7,538,290,000
千葉銀行	485,300	864.00	419,299,200
群馬銀行	337,900	516.50	174,525,350
武蔵野銀行	22,400	2,099.00	47,017,600
千葉興業銀行	31,700	578.00	18,322,600
筑波銀行	76,400	200.00	15,280,000
七十七銀行	55,800	2,448.00	136,598,400
秋田銀行	11,700	1,667.00	19,503,900
山形銀行	19,300	1,019.00	19,666,700
岩手銀行	11,900	2,014.00	23,966,600
東邦銀行	137,700	222.00	30,569,400
東北銀行	6,600	1,010.00	6,666,000
ふくおかフィナンシャルグループ	139,000	2,801.00	389,339,000
スルガ銀行	153,500	570.00	87,495,000
八十二銀行	367,800	610.60	224,578,680
山梨中央銀行	17,900	1,207.00	21,605,300
大垣共立銀行	33,200	1,812.00	60,158,400
福井銀行	15,600	1,420.00	22,152,000
清水銀行	6,900	1,434.00	9,894,600
富山銀行	2,100	1,648.00	3,460,800
滋賀銀行	29,000	2,648.00	76,792,000
南都銀行	26,200	2,397.00	62,801,400
百五銀行	163,800	404.00	66,175,200

京都銀行	55,200	7,069.00	390,208,800	
紀陽銀行	62,300	1,451.00	90,397,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	110,700	1,134.00	125,533,800	
山陰合同銀行	109,000	791.00	86,219,000	
鳥取銀行	4,300	1,140.00	4,902,000	
百十四銀行	15,900	1,823.00	28,985,700	
四国銀行	27,700	846.00	23,434,200	
阿波銀行	24,400	1,960.00	47,824,000	
大分銀行	10,500	2,125.00	22,312,500	
宮崎銀行	11,400	2,270.00	25,878,000	
佐賀銀行	10,200	1,646.00	16,789,200	
琉球銀行	39,900	906.00	36,149,400	
セブン銀行	623,800	282.20	176,036,360	
みずほフィナンシャルグループ	2,518,300	2,131.00	5,366,497,300	
高知銀行	4,600	697.00	3,206,200	
山口フィナンシャルグループ	192,300	934.20	179,646,660	
名古屋銀行	11,500	3,235.00	37,202,500	
北洋銀行	263,800	275.00	72,545,000	
大光銀行	4,000	1,050.00	4,200,000	
愛媛銀行	23,500	792.00	18,612,000	
トマト銀行	4,500	1,024.00	4,608,000	
京葉銀行	79,700	522.00	41,603,400	
栃木銀行	79,700	246.00	19,606,200	
北日本銀行	6,100	2,028.00	12,370,800	
東和銀行	32,000	520.00	16,640,000	
福島銀行	14,300	210.00	3,003,000	
大東銀行	5,300	623.00	3,301,900	
トモニホールディングス	140,700	357.00	50,229,900	
フィデアホールディングス	18,000	1,344.00	24,192,000	
池田泉州ホールディングス	223,000	230.00	51,290,000	
F P G	59,000	1,237.00	72,983,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,400	1,122.00	16,156,800	
マーキュリアホールディングス	8,200	743.00	6,092,600	
S B I ホールディングス	252,200	2,759.00	695,819,800	
ジャフコ グループ	58,200	1,776.50	103,392,300	
大和証券グループ本社	1,245,400	721.60	898,680,640	

野村ホールディングス	3,207,300	541.00	1,735,149,300	
岡三証券グループ	153,300	461.00	70,671,300	
丸三証券	58,300	433.00	25,243,900	
東洋証券	58,300	314.00	18,306,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	190,000	376.00	71,440,000	
光世証券	3,400	552.00	1,876,800	
水戸証券	47,300	329.00	15,561,700	
いちよし証券	32,400	595.00	19,278,000	
松井証券	103,100	791.00	81,552,100	
マネックスグループ	188,000	543.00	102,084,000	
極東証券	22,000	635.00	13,970,000	
岩井コスモホールディングス	20,000	1,417.00	28,340,000	
アイザワ証券グループ	25,400	797.00	20,243,800	
マネーパートナーズグループ	14,800	267.00	3,951,600	
スパークス・グループ	19,500	1,501.00	29,269,500	
かんぽ生命保険	211,400	2,131.50	450,599,100	
SOMPOホールディングス	298,900	6,465.00	1,932,388,500	
アニコムホールディングス	59,100	636.00	37,587,600	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	354,400	5,109.00	1,810,629,600	
第一生命ホールディングス	850,700	2,720.00	2,313,904,000	
東京海上ホールディングス	1,721,200	3,285.00	5,654,142,000	
T&Dホールディングス	467,300	2,088.00	975,722,400	
アドバンスクリエイト	10,100	1,191.00	12,029,100	
全国保証	45,600	5,043.00	229,960,800	
あんしん保証	7,900	301.00	2,377,900	
イントラスト	5,600	950.00	5,320,000	
日本モーゲージサービス	8,200	556.00	4,559,200	
C a s a	5,700	892.00	5,084,400	
アルヒ	21,900	985.00	21,571,500	
プレミアグループ	29,600	1,762.00	52,155,200	
ネットプロテクションズホールディングス	58,700	326.00	19,136,200	
クレディセゾン	110,500	2,110.00	233,155,000	
芙蓉総合リース	16,100	11,050.00	177,905,000	
みずほリース	26,000	4,550.00	118,300,000	
東京センチュリー	32,600	5,151.00	167,922,600	

日本証券金融	64,300	1,090.00	70,087,000
アイフル	289,500	336.00	97,272,000
リコーリース	16,600	4,100.00	68,060,000
イオンフィナンシャルサービス	100,300	1,248.50	125,224,550
アコム	311,900	346.50	108,073,350
ジャックス	18,600	4,985.00	92,721,000
オリエントコーポレーション	45,800	1,124.00	51,479,200
オリックス	1,143,200	2,548.00	2,912,873,600
三菱HCキャピタル	679,400	839.20	570,152,480
九州リースサービス	6,800	866.00	5,888,800
日本取引所グループ	489,400	2,573.00	1,259,226,200
イー・ギャランティ	28,500	1,916.00	54,606,000
アサックス	6,700	651.00	4,361,700
NECキャピタルソリューション	8,700	3,105.00	27,013,500
大東建託	63,800	14,340.00	914,892,000
いちご	203,100	271.00	55,040,100
日本駐車場開発	187,300	224.00	41,955,200
スター・マイカ・ホールディングス	16,800	650.00	10,920,000
SREホールディングス	8,700	3,790.00	32,973,000
ADワークスグループ	34,100	206.00	7,024,600
ヒューリック	406,700	1,250.50	508,578,350
三栄建築設計	8,900	1,366.00	12,157,400
野村不動産ホールディングス	109,100	3,519.00	383,922,900
三重交通グループホールディングス	38,500	569.00	21,906,500
サムティ	28,000	2,214.00	61,992,000
ディア・ライフ	30,600	775.00	23,715,000
地主	13,700	1,946.00	26,660,200
プレサンスコーポレーション	27,800	2,037.00	56,628,600
ハウスコム	2,900	932.00	2,702,800
JPMC	9,400	1,134.00	10,659,600
サンセイランディック	4,800	916.00	4,396,800
フージャースホールディングス	26,800	985.00	26,398,000
オープンハウスグループ	63,900	5,414.00	345,954,600
東急不動産ホールディングス	524,300	838.00	439,363,400
飯田グループホールディングス	152,800	2,370.00	362,136,000
イーランド	2,500	1,499.00	3,747,500

ムゲンエステート	10,000	715.00	7,150,000
And Doホールディングス	10,300	1,253.00	12,905,900
シーアールイー	10,200	1,377.00	14,045,400
ケイアイスター不動産	8,500	4,805.00	40,842,500
グッドコムアセット	17,000	832.00	14,144,000
ジェイ・エス・ビー	4,400	4,860.00	21,384,000
ロードスターキャピタル	10,400	1,673.00	17,399,200
テンポイノベーション	4,700	1,085.00	5,099,500
フェイスネットワーク	4,200	1,568.00	6,585,600
パーク24	136,000	2,042.50	277,780,000
パラカ	6,500	1,914.00	12,441,000
三井不動産	752,800	2,901.50	2,184,249,200
三菱地所	1,051,100	1,739.00	1,827,862,900
平和不動産	28,400	3,855.00	109,482,000
東京建物	166,300	1,924.50	320,044,350
京阪神ビルディング	29,900	1,166.00	34,863,400
住友不動産	315,000	3,618.00	1,139,670,000
テーオーシー	32,600	626.00	20,407,600
東京楽天地	3,000	4,110.00	12,330,000
レオパレス21	196,000	276.00	54,096,000
スターツコーポレーション	25,200	2,948.00	74,289,600
フジ住宅	25,400	676.00	17,170,400
空港施設	22,300	541.00	12,064,300
明和地所	7,300	1,006.00	7,343,800
ゴールドクレスト	17,000	1,802.00	30,634,000
エスリード	8,500	2,547.00	21,649,500
日神グループホールディングス	29,300	513.00	15,030,900
日本エスコン	39,100	822.00	32,140,200
MIRARTHホールディングス	88,000	441.00	38,808,000
AVANTIA	8,400	846.00	7,106,400
イオンモール	90,700	1,817.50	164,847,250
毎日コムネット	5,900	741.00	4,371,900
ファースト住建	6,100	1,097.00	6,691,700
カチタス	47,100	2,461.00	115,913,100
トーセイ	29,400	1,794.00	52,743,600
穴吹興産	3,000	2,295.00	6,885,000

サンフロンティア不動産	29,500	1,428.00	42,126,000
F J ネクストホールディングス	19,000	1,007.00	19,133,000
インテリックス	3,300	541.00	1,785,300
ランドビジネス	5,000	258.00	1,290,000
サンネクスタグループ	4,700	1,022.00	4,803,400
グランディハウス	12,600	576.00	7,257,600
日本空港ビルデング	61,700	6,564.00	404,998,800
明豊ファシリティワークス	7,500	742.00	5,565,000
日本工営	11,000	3,755.00	41,305,000
L I F U L L	63,200	288.00	18,201,600
M I X I	41,500	2,717.00	112,755,500
ジェイエシーリクルートメント	16,500	2,508.00	41,382,000
日本M&Aセンターホールディングス	312,200	1,094.50	341,702,900
メンバーズ	5,500	1,714.00	9,427,000
中広	2,800	413.00	1,156,400
U T グループ	26,800	2,941.00	78,818,800
アイティメディア	7,100	1,315.00	9,336,500
E・Jホールディングス	10,800	1,571.00	16,966,800
オープンアップグループ	54,600	2,075.00	113,295,000
コシダカホールディングス	54,700	1,214.00	66,405,800
アルトナー	3,600	1,707.00	6,145,200
パソナグループ	22,200	1,662.00	36,896,400
C D S	3,700	1,825.00	6,752,500
リンクアンドモチベーション	52,300	423.00	22,122,900
エス・エム・エス	69,300	2,974.50	206,132,850
サニーサイドアップグループ	4,700	675.00	3,172,500
パーソルホールディングス	200,600	2,631.00	527,778,600
リニカル	8,400	826.00	6,938,400
クックパッド	51,500	173.00	8,909,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	601.00	4,507,500
学情	8,400	1,880.00	15,792,000
スタジオアリス	9,200	2,185.00	20,102,000
シミックホールディングス	8,900	1,987.00	17,684,300
エプコ	3,500	760.00	2,660,000
N J S	4,100	2,665.00	10,926,500
総合警備保障	67,500	4,035.00	272,362,500

カカクコム	133,600	2,130.00	284,568,000
アイロムグループ	6,700	1,979.00	13,259,300
セントケア・ホールディング	12,000	776.00	9,312,000
サイネックス	2,900	674.00	1,954,600
ルネサンス	13,100	886.00	11,606,600
ディップ	31,900	3,505.00	111,809,500
デジタルホールディングス	14,500	1,041.00	15,094,500
新日本科学	19,400	2,124.00	41,205,600
キャリアデザインセンター	3,200	1,543.00	4,937,600
ベネフィット・ワン	84,400	1,520.50	128,330,200
エムスリー	359,200	3,127.00	1,123,218,400
ツカダ・グローバルホールディング	9,100	474.00	4,313,400
アウトソーシング	108,500	1,353.50	146,854,750
ウェルネット	11,300	614.00	6,938,200
ワールドホールディングス	8,300	2,709.00	22,484,700
ディー・エヌ・エー	72,900	1,900.00	138,510,000
博報堂DYホールディングス	232,000	1,528.00	354,496,000
ぐるなび	34,300	346.00	11,867,800
タカミヤ	25,300	532.00	13,459,600
ジャパンベストレスキューシステム	9,000	677.00	6,093,000
ファンコミュニケーションズ	36,400	396.00	14,414,400
ライク	7,000	1,687.00	11,809,000
ビジネス・ブレークスルー	6,000	463.00	2,778,000
エスプール	52,900	528.00	27,931,200
WDBホールディングス	9,400	2,110.00	19,834,000
ティア	9,100	447.00	4,067,700
CDG	1,800	1,404.00	2,527,200
アドウェイズ	25,500	675.00	17,212,500
バリューコマース	13,900	1,397.00	19,418,300
インフォマート	189,800	312.00	59,217,600
J Pホールディングス	53,200	340.00	18,088,000
エコナックホールディングス	28,000	95.00	2,660,000
CLホールディングス	5,400	912.00	4,924,800
プレステージ・インターナショナル	77,000	603.00	46,431,000
アミューズ	10,000	1,780.00	17,800,000
ドリームインキュベータ	5,600	2,823.00	15,808,800

クイック	14,000	2,176.00	30,464,000
TAC	8,500	200.00	1,700,000
電通グループ	178,700	4,726.00	844,536,200
イオンファンタジー	7,900	3,245.00	25,635,500
シーティーエス	20,500	736.00	15,088,000
ネクシィーズグループ	4,900	649.00	3,180,100
H. U. グループホールディングス	53,300	2,732.00	145,615,600
アルプス技研	15,900	3,065.00	48,733,500
日本空調サービス	20,000	749.00	14,980,000
オリエンタルランド	961,900	5,343.00	5,139,431,700
ダスキン	40,600	3,218.00	130,650,800
明光ネットワークジャパン	22,600	640.00	14,464,000
ファルコホールディングス	8,400	1,838.00	15,439,200
ラウンドワン	152,600	573.00	87,439,800
リゾートトラスト	71,900	2,144.00	154,153,600
ビー・エム・エル	22,600	2,963.00	66,963,800
りらいあコミュニケーションズ	30,200	1,463.00	44,182,600
リソー教育	83,800	266.00	22,290,800
早稲田アカデミー	10,300	1,331.00	13,709,300
ユー・エス・エス	187,100	2,412.00	451,285,200
東京個別指導学院	22,200	517.00	11,477,400
サイバーエージェント	401,800	1,114.50	447,806,100
楽天グループ	1,090,800	477.10	520,420,680
クリーク・アンド・リバー社	10,800	1,949.00	21,049,200
SBIグローバルアセットマネジメント	30,300	505.00	15,301,500
テー・オー・ダブリュー	36,600	323.00	11,821,800
山田コンサルティンググループ	9,400	1,617.00	15,199,800
セントラルスポーツ	7,000	2,383.00	16,681,000
フルキャストホールディングス	17,500	2,266.00	39,655,000
エン・ジャパン	33,000	2,465.00	81,345,000
リソルホールディングス	1,400	4,735.00	6,629,000
テクノプロ・ホールディングス	107,600	3,146.00	338,509,600
アトラグループ	3,200	182.00	582,400
インターワークス	4,600	340.00	1,564,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,600	1,617.00	15,523,200
Keepers 技研	11,300	4,795.00	54,183,500

ファーストロジック	2,000	1,002.00	2,004,000
三機サービス	2,400	1,178.00	2,827,200
G u n o s y	14,900	605.00	9,014,500
デザインワン・ジャパン	5,400	178.00	961,200
イー・ガーディアン	7,000	1,998.00	13,986,000
リブセンス	7,800	295.00	2,301,000
ジャパンマテリアル	55,800	2,283.00	127,391,400
ベクトル	28,800	1,324.00	38,131,200
ウチヤマホールディングス	7,000	328.00	2,296,000
チャーム・ケア・コーポレーション	15,400	1,298.00	19,989,200
キャリアリンク	6,800	3,040.00	20,672,000
I B J	11,600	679.00	7,876,400
アサンテ	9,200	1,669.00	15,354,800
バリューHR	16,100	1,361.00	21,912,100
M&Aキャピタルパートナーズ	14,800	3,335.00	49,358,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,051.00	7,146,800
E R I ホールディングス	3,900	1,378.00	5,374,200
アビスト	2,300	3,225.00	7,417,500
シグマクシス・ホールディングス	27,800	1,264.00	35,139,200
ウィルグループ	15,500	1,081.00	16,755,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,100	147.00	2,513,700
メドピア	16,300	1,016.00	16,560,800
レアジョブ	3,100	1,074.00	3,329,400
リクルートホールディングス	1,345,700	4,530.00	6,096,021,000
エラン	24,400	855.00	20,862,000
土木管理総合試験所	6,900	345.00	2,380,500
日本郵政	2,187,300	1,032.00	2,257,293,600
ベルシステム24ホールディングス	24,600	1,356.00	33,357,600
鎌倉新書	21,100	739.00	15,592,900
SMN	4,100	449.00	1,840,900
グローバルキッズCOMPANY	3,100	690.00	2,139,000
エアトリ	13,300	2,795.00	37,173,500
アトラエ	11,100	731.00	8,114,100
ストライク	7,800	3,460.00	26,988,000
ソラスト	50,500	654.00	33,027,000
セラク	5,800	1,599.00	9,274,200

インソース	39,700	1,192.00	47,322,400
ベイカレント・コンサルティング	143,900	5,388.00	775,333,200
Orchestra Holdings	4,100	1,263.00	5,178,300
アイモバイル	8,400	1,165.00	9,786,000
キャリアインデックス	5,900	298.00	1,758,200
MS-Japan	4,900	1,047.00	5,130,300
船場	2,800	742.00	2,077,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,000	1,824.00	118,560,000
フルテック	2,300	1,121.00	2,578,300
GameWith	5,100	363.00	1,851,300
MS&Consulting	2,200	616.00	1,355,200
ウェルビー	14,000	460.00	6,440,000
エル・ティー・エス	2,400	3,505.00	8,412,000
ミダックホールディングス	11,200	1,546.00	17,315,200
日総工産	14,000	909.00	12,726,000
キュービーネットホールディングス	8,800	1,464.00	12,883,200
RPAホールディングス	25,400	424.00	10,769,600
スプリックス	4,500	785.00	3,532,500
マネジメントソリューションズ	10,100	4,100.00	41,410,000
プロレド・パートナーズ	5,100	526.00	2,682,600
テノ.ホールディングス	2,200	663.00	1,458,600
フロンティア・マネジメント	6,300	1,235.00	7,780,500
ピアラ	2,900	508.00	1,473,200
コプロ・ホールディングス	2,500	2,206.00	5,515,000
ギークス	2,400	765.00	1,836,000
アンビスホールディングス	19,500	3,165.00	61,717,500
カーブスホールディングス	50,100	749.00	37,524,900
フォーラムエンジニアリング	10,900	1,182.00	12,883,800
Fast Fitness Japan	6,500	1,309.00	8,508,500
ダイレクトマーケティングミックス	22,100	869.00	19,204,900
ポピンズ	2,900	1,591.00	4,613,900
LITALICO	14,300	2,302.00	32,918,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,900	603.00	4,160,700
リログループ	101,300	1,952.00	197,737,600
東祥	12,900	1,215.00	15,673,500

ビーウィズ	4,700	2,267.00	10,654,900
TREホールディングス	38,500	1,200.00	46,200,000
人・夢・技術グループ	7,100	1,478.00	10,493,800
大栄環境	46,400	2,572.00	119,340,800
日本管財ホールディングス	19,200	2,587.00	49,670,400
エイチ・アイ・エス	47,700	2,026.00	96,640,200
ラックランド	7,600	3,460.00	26,296,000
共立メンテナンス	31,200	5,495.00	171,444,000
イチネンホールディングス	19,500	1,331.00	25,954,500
建設技術研究所	9,500	3,550.00	33,725,000
スペース	13,500	1,032.00	13,932,000
燦ホールディングス	7,900	2,097.00	16,566,300
スバル興業	900	9,720.00	8,748,000
東京テアトル	5,200	1,130.00	5,876,000
タナベコンサルティンググループ	5,800	904.00	5,243,200
ナガワ	4,900	6,890.00	33,761,000
東京都競馬	15,300	3,905.00	59,746,500
カナモト	33,500	2,198.00	73,633,000
ニシオホールディングス	17,000	3,325.00	56,525,000
トランス・コスモス	22,700	3,525.00	80,017,500
乃村工藝社	79,600	972.00	77,371,200
藤田観光	8,100	3,435.00	27,823,500
KNT-CTホールディングス	10,800	1,428.00	15,422,400
トーカイ	16,300	1,835.00	29,910,500
セコム	185,100	9,712.00	1,797,691,200
セントラル警備保障	9,900	2,870.00	28,413,000
丹青社	35,600	776.00	27,625,600
メイテック	71,000	2,423.00	172,033,000
応用地質	17,100	2,036.00	34,815,600
船井総研ホールディングス	37,900	2,508.00	95,053,200
進学会ホールディングス	5,800	292.00	1,693,600
オオバ	9,200	778.00	7,157,600
いであ	3,300	1,683.00	5,553,900
学究社	7,400	2,097.00	15,517,800
ベネッセホールディングス	68,000	1,825.00	124,100,000
イオンディライト	20,200	3,050.00	61,610,000

ナック	8,400	962.00	8,080,800	
ダイセキ	37,200	3,990.00	148,428,000	
ステップ	6,800	1,794.00	12,199,200	
合 計	207,000,900		571,379,621,920	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2023年6月27日から2023年12月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年3月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2023年6月27日から2023年12月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2023年12月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月27日から2023年12月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 17 期 (2023 年 6 月 26 日現在)	第 18 期中間計算期間 (2023 年 12 月 26 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,390,943	5,381,922
親投資信託受益証券	2,397,262,024	2,045,478,852
未収入金	22,831,263	4,555,542
流動資産合計	2,426,484,230	2,055,416,316
資産合計	2,426,484,230	2,055,416,316
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,749,243	4,460,487
未払受託者報酬	968,463	831,511
未払委託者報酬	4,150,506	3,563,520
未払利息	15	2
その他未払費用	152,363	59,335
流動負債合計	28,020,590	8,914,855
負債合計	28,020,590	8,914,855
純資産の部		
元本等		
元本	1,425,136,662	1,164,764,148
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	973,326,978	881,737,313
（分配準備積立金）	675,865,190	539,663,736
元本等合計	2,398,463,640	2,046,501,461
純資産合計	2,398,463,640	2,046,501,461
負債純資産合計	2,426,484,230	2,055,416,316

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 17 期中間計算期間 自 2022 年 6 月 28 日 至 2022 年 12 月 27 日	第 18 期中間計算期間 自 2023 年 6 月 27 日 至 2023 年 12 月 26 日
営業収益		
受取利息	3	22
有価証券売買等損益	88,980,689	96,740,515
営業収益合計	88,980,692	96,740,537
営業費用		
支払利息	1,606	626
受託者報酬	1,166,366	831,511
委託者報酬	4,998,664	3,563,520
その他費用	83,249	59,335
営業費用合計	6,249,885	4,454,992
営業利益又は営業損失 (△)	82,730,807	92,285,545
経常利益又は経常損失 (△)	82,730,807	92,285,545
中間純利益又は中間純損失 (△)	82,730,807	92,285,545
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	25,811,052	7,473,082
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	876,028,251	973,326,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,124,932	21,276,764
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,124,932	21,276,764
剰余金減少額又は欠損金増加額	211,920,171	197,678,892
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	211,920,171	197,678,892
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	743,152,767	881,737,313

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第18期中間計算期間は2023年6月27日から2023年12月26日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2023年6月26日現在)	第18期中間計算期間 (2023年12月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,425,136,662口	1,164,764,148口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6830円 (16,830円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7570円 (17,570円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第18期中間計算期間 (2023年12月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第17期 自2022年6月28日 至2023年6月26日	第18期中間計算期間 自2023年6月27日 至2023年12月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,346,754,965円	1,425,136,662円
期中追加設定元本額	76,161,163円	28,909,482円
期中一部解約元本額	997,779,466円	289,281,996円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年12月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,593,482,866
株式	580,441,695,520
派生商品評価勘定	3,790,150
未収入金	24,496,000
未収配当金	46,579,325
前払金	7,516,000
差入委託証拠金	216,390,521
流動資産合計	585,333,950,382
資産合計	585,333,950,382
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,327,600
未払金	61,550
未払解約金	284,148,955
未払利息	2,066
流動負債合計	295,540,171
負債合計	295,540,171
純資産の部	
元本等	
元本	243,829,074,957
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	341,209,335,254
元本等合計	585,038,410,211
純資産合計	585,038,410,211
負債純資産合計	585,333,950,382

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月26日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,829,074,957 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3994 円 (1万口当たり純資産額) (23,994 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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つた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	251,438,322,235円
期中追加設定元本額	12,772,863,948円
期中一部解約元本額	20,382,111,226円
期末元本額	243,829,074,957円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	308,330,698円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,399,111,753円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,082,390円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,990,345,429円
世界経済インデックスファンド	5,202,331,704円
日本株式インデックス・オープン	2,953,732,695円
DCマイセレクション25	5,336,033,387円
DCマイセレクション50	17,229,414,173円
DCマイセレクション75	18,644,051,968円
DC日本株式インデックス・オープン	6,014,821,687円
DCマイセレクションS25	3,164,923,902円
DCマイセレクションS50	9,554,067,872円
DCマイセレクションS75	8,303,269,119円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,214,149,276円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	91,074,318円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	620,259,780円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	485,773,696円
DC世界経済インデックスファンド	3,805,658,552円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	852,495,979円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,504,090円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	10,124,653円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,704,323円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	145,990,200円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,043,492円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	14,945,647円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	67,375,820円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,046,582円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	42,929,946円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	499,002,943円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	318,699,512円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,133,315,490円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	30,004,333円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,227,818円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	330,056,309円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	181,936,971円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	247,354,264円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	19,486,404円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	419,983,074円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,526,183,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,922,114,684円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円

DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	604,359,463円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,114,521円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,206,404,459円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	197,542,212円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,665,885円
SMT インデックスバランス・オープン	47,604,109円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,888,144,852円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,466,702円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	217,437,416円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,582,703円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,168,637円
グローバル経済コア	218,114,058円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,597,171円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,382,152,743円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,304,571円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	964,175,269円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	53,028,566円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	50,818,000円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	22,246,692円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	26,488,262円
10資産分散投資ファンド	92,449,797円
グローバル10資産バランスファンド	4,999,953円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,969,724,535円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	493,196,863円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,124,352円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	20,815,303円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	346,365,787円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	47,160,716,551円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,677,590円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	213,389,052円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年12月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,558,816,000	—	4,551,300,000	△7,516,000
合計		4,558,816,000	—	4,551,300,000	△7,516,000

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2 【ファンドの現況】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

【純資産額計算書】

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	2,115,567,292円
II 負債総額	40,118,976円
III 純資産総額（I－II）	2,075,448,316円
IV 発行済口数	1,081,938,535口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9183円
（1万口当たり純資産額）	（19,183円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	639,904,925,624円
II 負債総額	3,595,693,728円
III 純資産総額（I－II）	636,309,231,896円
IV 発行済口数	242,788,974,268口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6208円
（1万口当たり純資産額）	（26,208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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

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 償還金

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

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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

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

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

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

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手續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 3 月 26 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 1 月 31 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	14,616,414
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	219,430
単位型公社債投資信託	51	176,359
合計	654	15,012,203

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 37 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第 38 期事業年度の中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 289	※1 255
器具備品	※1 687	※1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」という。)に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過措置に代って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

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

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

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

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

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 (2022年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1、*2)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*3)	—	196	—	196
資産計	—	196	—	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	—	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(71)	—	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	—	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
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)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 218 百万円) は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

(注 2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注 3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	—	—	—
未収委託者報酬	9,067	—	—	—
未収運用受託報酬	6,252	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	108	1,712	0

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	—	—	—
未収委託者報酬	9,147	—	—	—
未収運用受託報酬	5,815	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	594	2,144	38

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。
 なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	—	0	0
合計		6,915	—	△80	△80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建				
	米ドル	152	—	3	3
合計		7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度 (2022年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ		21	—	△0
合計			5,082	—	△88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 100 百万円、当事業年度 109 百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 7. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売 代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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（2022 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023 年 3 月 31 日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

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

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

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田中洋一

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601
固定資産		
有形固定資産	※1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045
負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	※2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		43,700
利益剰余金合計		46,300
株主資本合計		65,540
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		164
繰延ヘッジ損益		△906
評価・換算差額等合計		△741
純資産合計		64,798
負債・純資産合計		77,045

中間損益計算書

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間

(自 2023 年 4 月 1 日

至 2023 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	※1	6,965
営業利益		3,722
営業外収益	※2	1,680
営業外費用	※3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	—	—	△1,055	△1,055	△1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	114	△395	△280	△280
当中間期変動額合計	114	△395	△280	△1,335
当中間期末残高	164	△906	△741	64,798

注記事項

(重要な会計方針)

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

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づいて償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」という。)に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドの AUM に固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(表示方法の変更)

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

従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第 38 期中間会計期末
(2023 年 9 月 30 日)

- ※1 有形固定資産の減価償却累計額 957 百万円
- ※2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

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

- ※1 減価償却実施額
有形固定資産 91 百万円
無形固定資産 972 百万円
- ※2 営業外収益の主要項目
金銭の信託運用益 1,589 百万円
- ※3 営業外費用の主要項目
デリバティブ費用 1,269 百万円
為替差損 784 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

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

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) *2、*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	—	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,137	—	4,137
資産計	1,206	18,133	—	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	—	339
通貨関連取引	—	(134)	—	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	—	205

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額 1,041 百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は 16,243 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額 271 百万円）は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末(2023年9月30日)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位:百万円)

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額271百万円)は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)	
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	—	△76	△76
	英ポンド	267	—	△1	△1
	カナダドル	126	—	△1	△1
	スイスフラン	176	—	△0	△0
	香港ドル	214	—	△2	△2
	ユーロ	719	—	△3	△3
合計	7,449	—	△84	△84	

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	9,373	—	226	226
店頭				
トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	—	113	113
合計	13,239	—	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
1株当たり純資産額	21,599,648 円 64 銭
1株当たり中間純利益	770,782 円 86 銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
中間純利益	2,312 百万円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	2,312 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の見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

通常の見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3月26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。

追加型証券投資信託
日本株式インデックス・オープン（SMA 専用）
約款

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第 18 条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下「TOPIX」といいます。）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

(3) 運用制限

- ①株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純

資産総額の5%以下とします。

- ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないこともあります。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
日本株式インデックス・オープン（SMA 専用）
約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第26条第1項にもとづく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第1項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的、金額および限度額）

第3条 委託者は、金 207,300,000 円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金 3,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第44条第1項、第44条第2項、第45条第1項、第46条第1項および第48条第2項の規定による信託終了の日までとします。

（受益権の分割および再分割）

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権については 207,300,000 口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その申込口数に応じて取得申込者に帰属するものとします。

(追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じて得た金額とします。

- ②この投資信託約款において基準価額とは、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。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。

- ②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③委託者は、第5条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(受益権の申込単位、価額および手数料)

第12条 指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第5条の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、指定販売会社が委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、指定販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

- ②第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開

設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第3項または第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

- ③第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④第3項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。
- ⑤第1項から第4項の規定にかかわらず、指定販売会社は、受益者が別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、原則として、第34条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥第1項から第5項の規定にかかわらず、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第13条 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また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。

②第1項の申請のある場合には、第1項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第1項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または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第14条 受益権の譲渡は、第13条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 23 条に定めるものに限ります。）
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

（運用の指図範囲等）

第 16 条 委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 1 号から第 11 号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で第21号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ②委託者は、信託金を、第1項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
 - ③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第2項第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
 - ④委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
 - ⑤委託者は、取得時において、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
 - ⑥第4項および第5項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者お

よび受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第 25 条において同じ。）、第 25 条第 1 項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第 15 条および第 16 条第 1 項ならびに第 2 項に定める資産への投資を、信託財産を害するおそれがないと認められる取引として行うことができます。

②第 1 項に定める信託財産を害するおそれがないと認められる取引とは、次の各号のいずれかに該当する場合をいいます。

1. 取引所価格（気配値等を含みます。）等の適正な価格による取引であること。
2. 受託者の店頭に表示する利率等の公正な条件によること。
3. 第 1 号および第 2 号に該当しない場合で、委託者が適正な条件であると判断する場合であること。

③第 1 項および第 2 項の取扱いは、第 22 条から第 24 条までならびに第 29 条および第 30 条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第 18 条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第 19 条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第 1 項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、

（同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限）

第 20 条 委託者は、取得時において、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

②第 1 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第 21 条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることと

なる投資の指図をしません。

- ②第 1 項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第 22 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、

- ②第 1 項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第 5 号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図、目的および範囲)

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

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとし、
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとし、
- ②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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、
- ③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、

(信託業務の委託等)

第 25 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める

信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

④（削除）

（有価証券等の保管）

第 26 条 （削除）

（混蔵寄託）

第 27 条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（投資信託財産の登記等および記載等の留保等）

第 28 条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記また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また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また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、受託者が認める場合は、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。

(一部解約の請求および有価証券の売却等の指図)

第 29 条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 30 条 委託者は、第 29 条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

(資金の借入れ)

第 31 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 32 条 委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 33 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③第 1 項および第 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 34 条 この信託の計算期間は、毎年 6 月 26 日から翌年 6 月 25 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、平成 19 年 2 月 16 日から平成 19 年 6 月 25 日までとします。

②第 1 項の規定にかかわらず、第 1 項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第 4 条に定める信託

期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告)

第 35 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第 36 条 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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 34 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 37 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 34 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 37 の率を乗じて得た額とします。

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 38 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第 39 条 受託者は、収益分配金については、第 40 条第 1 項に規定する支払開始日および第 40 条第 2 項に規定する交付開始前までに、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第 40 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 40 条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第 40 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。

②第 1 項の規定にかかわらず、別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、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または記録が行われます。

④一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 4 営業日目から受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項および第 4 項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとしします。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとしします。

⑦第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとしします。また、第 6 項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとしします。

(収益分配金および償還金の時効)

第 41 条 受益者が、収益分配金については第 40 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第 40 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(投資信託契約の一部解約)

第 42 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

②投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対

し、振替受益権をもって行うものとします。

- ③委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に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または記録が行われます。
- ④第 1 項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑥第 5 項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第 43 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第 44 条 委託者は、第 4 条の規定による信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 5 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、第 1 項および第 2 項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ④第 3 項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ⑤第 4 項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項および第 2 項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑥委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑦第 4 項から第 6 項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第 4 項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うこと

が困難な場合には適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第 45 条 委託者は、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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第 49 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 46 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②第 1 項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 49 条第 4 項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者の間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 47 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 48 条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 49 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第 49 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、第 1 項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③第 2 項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④第 3 項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第 1 項の投資信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 50 条 第 44 条に規定する投資信託契約の解約または第 49 条に規定する投資信託約款の変更を行う場合において、第 44 条第 4 項または第 49 条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、指定販売会社を経由して、受託者に対し、自己に帰属する受益権を投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 50 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第 51 条 委託者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。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第 52 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第 1 条 第 42 条第 4 項の規定は、平成 24 年 3 月 6 日から適用されるものとし、平成 24 年 3 月 5 日までは平成 24 年 2 月 15 日における当該規定の改正前の条文によります。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 19 年 2 月 16 日

委託者 住信アセットマネジメント株式会社

受託者 住友信託銀行株式会社