

日本株式インデックス・オープン

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)

2025年3月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※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2025年2月28日に関東財務局長に提出しており、2025年3月1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】	2
(6)【申込単位】	2
(7)【申込期間】	2
(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】	3
(12)【その他】	3
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】	14
3【投資リスク】	22
4【手数料等及び税金】	25
5【運用状況】	29
第2【管理及び運営】	36
1【申込(販売)手続等】	36
2【換金(解約)手続等】	37
3【資産管理等の概要】	38
4【受益者の権利等】	42
第3【ファンドの経理状況】	43
1【財務諸表】	46
2【ファンドの現況】	124
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	125
第三部【委託会社等の情報】	126
第1【委託会社等の概況】	126
1【委託会社等の概況】	126
2【事業の内容及び営業の概況】	127
3【委託会社等の経理状況】	128
4【利害関係人との取引制限】	162
5【その他】	162
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

(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（※1）に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1%）（※2）を加えた価額（販売基準価額）とします。

※1「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。

※2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うことになります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

(5) 【申込手数料】

取得申込受付日の販売基準価額に、1.1%（税抜 1.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

※「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。

(6) 【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2025年3月1日から2025年8月29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、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜申込みコース＞

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

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場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及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーフ ァンド	あり ()	日経 225	ブル・ベア型
	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 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月)	欧州				その他 ()
	年12回 (毎月)	アジア				
	日々	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
ないファンドをいう。
- (2) 追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産と
ともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

- ① 一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ② 大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③ 中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- ① 一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ② 公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③ 社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④ その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤ 格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

- ① 資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ② 資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1) 年 1 回…目論見書又は投資信託約款において、年 1 回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年 2 回…目論見書又は投資信託約款において、年 2 回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年 4 回…目論見書又は投資信託約款において、年 4 回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年 6 回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年 6 回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年 12 回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年 12 回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7) その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1) グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

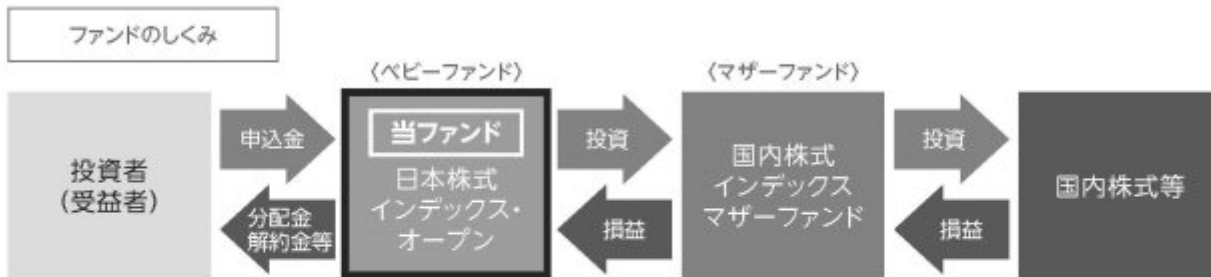
[特殊型]

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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

1. 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。



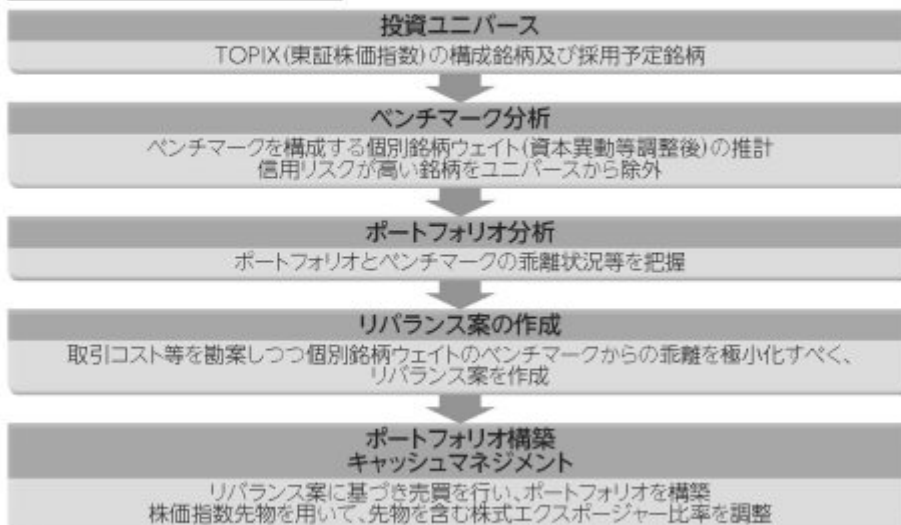
? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてペビーファンドとし、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12月末現在)		TOPIXの構成銘柄時価総額上位10銘柄		
構成国	1カ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,124銘柄	1	トヨタ自動車	223,610
時価総額	約532兆円	2	ソニーグループ	157,747
※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	155,939
		4	日立製作所	136,906
		5	リクルートホールディングス	119,519
		6	三井住友フィナンシャルグループ	103,404
		7	キーエンス	86,452
		8	任天堂	78,202
		9	伊藤忠商事	74,477
		10	東京海上ホールディングス	73,645
		※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もとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成				
<p>※「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。</p>				

- 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5月29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。

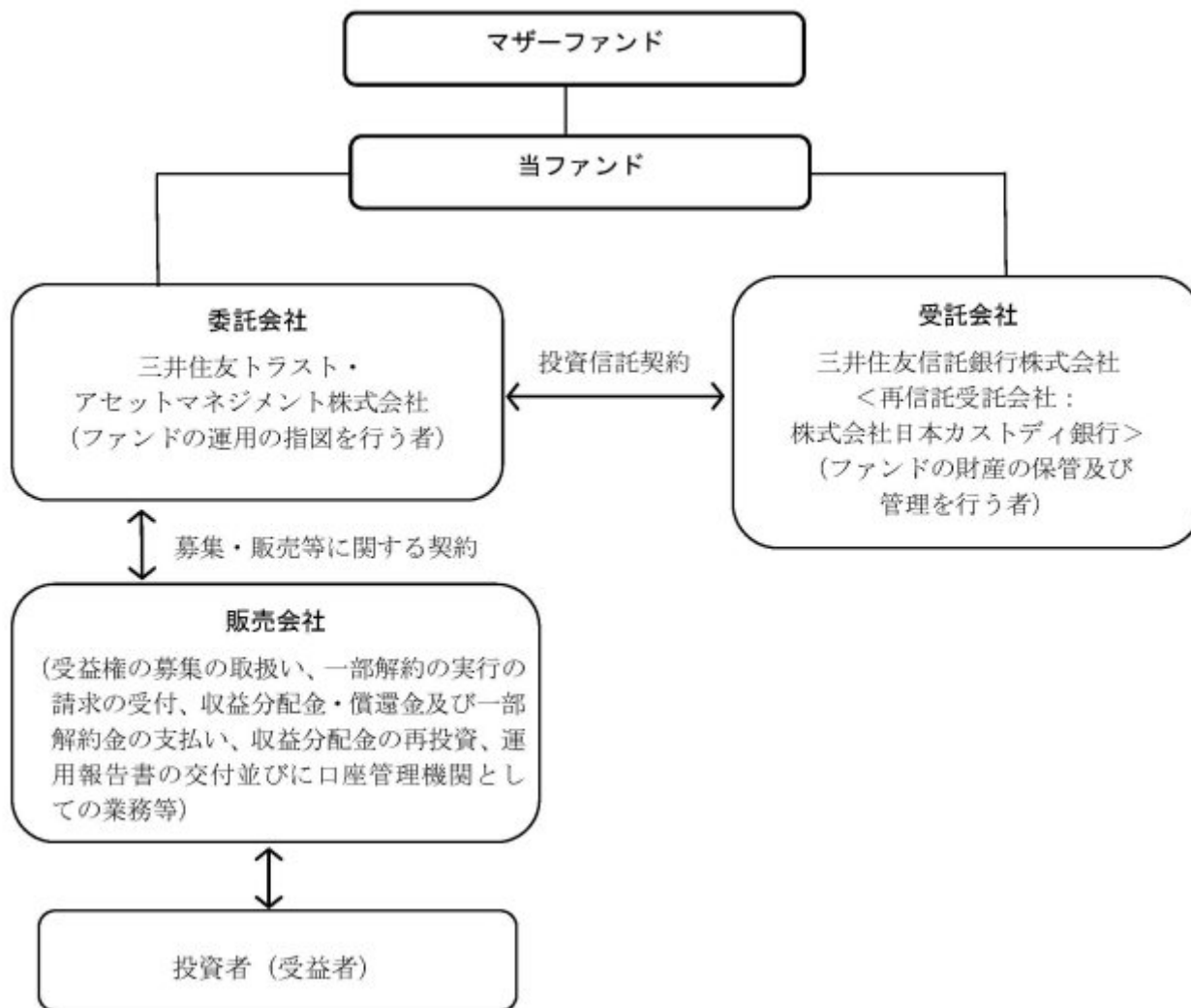
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2000年5月30日	当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	当ファンドの名称を「すみしん 日本株式インデックス・オープン」から「日本株式インデックス・オープン」に変更 当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12月30日現在)

イ. 資本金の額：20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、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。

③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) 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) 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。

(2) 【投資対象】

①有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された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す。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又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. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であつて金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
 なお、第1号の証券又は証書、第12号ならびに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号ならびに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

②金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、前記①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つて金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記①の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. 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、T O P I X (東証株価指数) (配当込み) と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場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及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場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、T O P I X (東証株価指数) (配当込み) の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 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

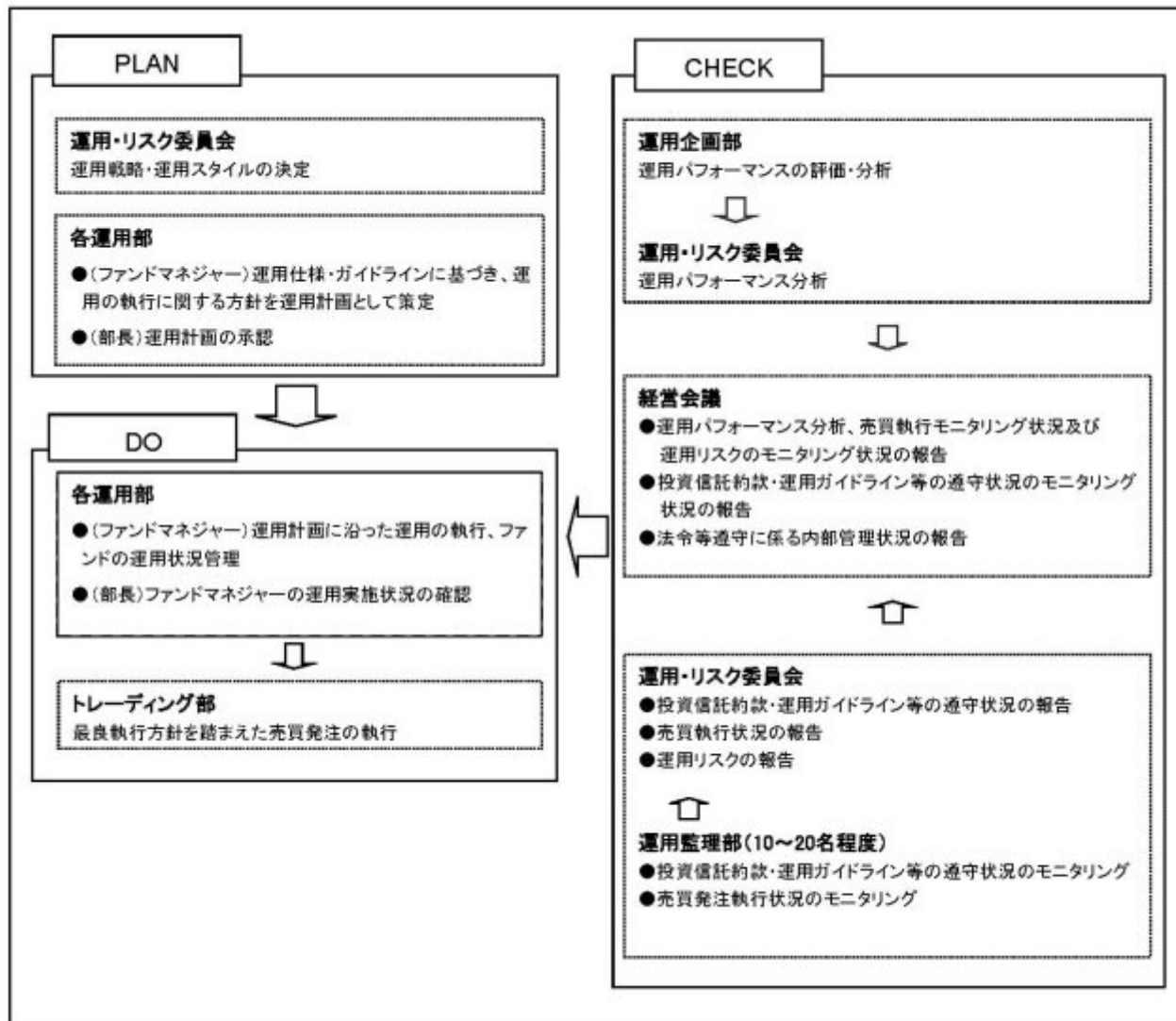
- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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及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及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることと

なった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

- 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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(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（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）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

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

- ・分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向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があります。

- ・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、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5)【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- 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新株引受権証券及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。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、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委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、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ます。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 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、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び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及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及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、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。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

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及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に資するため、ならびに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。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。当該資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 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%以内

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

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、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

<関連法令に基づく投資制限>

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 信用リスク

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

③ 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

④ 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。

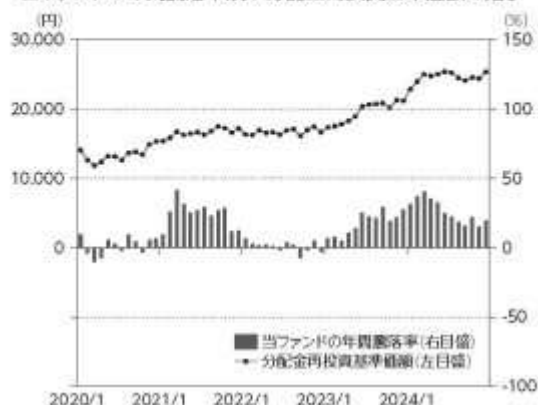
(2) リスクの管理体制

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】

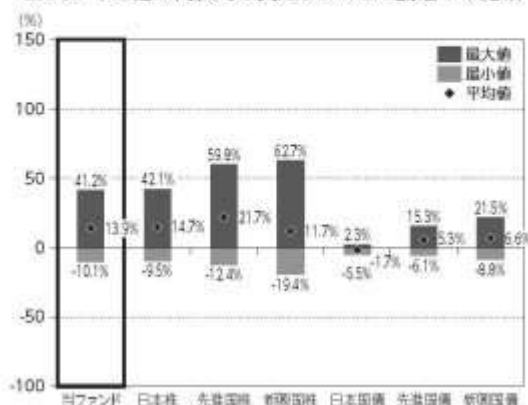
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2020年1月～2024年12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、投資対象としての優位性を有するマーケットベンチマークで、流動性ベースの特選銘柄追加方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は指標は、株式会社JPX(研究又は株式会社JPX(研究の関連会社(以下「JPX」という。))の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は指標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の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、保証又は提供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関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ワールドインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIワールドインデックスとは、MSCI Inc.が算出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、株式市場総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケットインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が算出した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式市場総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社(以下「野村」)が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社(以下「野村」)に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 PEAのグローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められません。Copyright © 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

①取得申込受付日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1%）（※1）を加えた価額（販売基準価額）に、1.1%（税抜 1.0%）（※2）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

※1：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

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

②「分配金再投資コース」（※3）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※3：収益分配金の受取方法により、「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。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。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

(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、以下のイ. 及びロ. を合計した額とします。

イ. 当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.407%（税抜 0.37%）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.154% （税抜 0.14%）	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 0.209% （税抜 0.19%）	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 0.044% (税抜 0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

※2025年2月28日現在、合計で49.5%(税抜45%)以内とし、その配分は委託会社29.7%(税抜27%)、受託会社19.8%(税抜18%)です。(品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。)

- 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。

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

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12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(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
0.67%	0.66%	0.01%

※対象期間は2023年5月30日～2024年5月29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12月30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】

(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	7,901,596,387	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,976,578	0.05
合計(純資産総額)		7,905,572,965	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	2,698,632,646	2.8456	7,679,229,058	2.9280	7,901,596,387	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 15 期計算期間末	(2015 年 5 月 29 日)	14,183,983,200	14,387,249,961	11,165	11,325
第 16 期計算期間末	(2016 年 5 月 30 日)	19,406,872,905	19,770,121,114	9,082	9,252
第 17 期計算期間末	(2017 年 5 月 29 日)	13,150,557,546	13,390,299,930	10,422	10,612
第 18 期計算期間末	(2018 年 5 月 29 日)	9,342,486,878	9,518,864,739	11,653	11,873
第 19 期計算期間末	(2019 年 5 月 29 日)	7,565,731,261	7,753,241,662	10,087	10,337
第 20 期計算期間末	(2020 年 5 月 29 日)	6,159,474,683	6,310,173,054	10,218	10,468
第 21 期計算期間末	(2021 年 5 月 31 日)	6,552,196,518	6,677,844,116	12,515	12,755
第 22 期計算期間末	(2022 年 5 月 30 日)	6,175,136,962	6,324,234,246	12,425	12,725
第 23 期計算期間末	(2023 年 5 月 29 日)	6,730,596,663	6,885,172,792	13,934	14,254
第 24 期計算期間末	(2024 年 5 月 29 日)	7,886,436,433	8,047,666,986	17,609	17,969
	2023 年 12 月末日	7,179,903,710	—	15,390	—
	2024 年 1 月末日	7,644,264,442	—	16,581	—
	2 月末日	7,957,093,953	—	17,388	—
	3 月末日	8,179,454,950	—	18,149	—
	4 月末日	8,072,467,518	—	17,977	—
	5 月末日	8,084,359,127	—	17,808	—
	6 月末日	8,168,558,389	—	18,057	—
	7 月末日	8,067,713,510	—	17,948	—
	8 月末日	7,804,346,096	—	17,418	—
	9 月末日	7,684,276,445	—	17,142	—
	10 月末日	7,798,690,230	—	17,455	—
	11 月末日	7,638,887,146	—	17,356	—
	12 月末日	7,905,572,965	—	18,045	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	160
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	170
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	190
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	220
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	250
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	250
第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	240
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	300

第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	320
第 24 期計算期間	2023 年 5 月 30 日～2024 年 5 月 29 日	360

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	41.4
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	△17.1
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	16.8
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	13.9
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	△11.3
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	3.8
第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	24.8
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	1.7
第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	14.7
第 24 期計算期間	2023 年 5 月 30 日～2024 年 5 月 29 日	29.0
第 25 期中間計算期間	2024 年 5 月 30 日～2024 年 11 月 29 日	△1.4

(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 15 期計算期間	2014 年 5 月 30 日～2015 年 5 月 29 日	16,329,909,593	25,353,508,387	12,704,172,616
第 16 期計算期間	2015 年 5 月 30 日～2016 年 5 月 30 日	17,645,482,093	8,982,112,982	21,367,541,727
第 17 期計算期間	2016 年 5 月 31 日～2017 年 5 月 29 日	4,557,255,174	13,306,776,663	12,618,020,238
第 18 期計算期間	2017 年 5 月 30 日～2018 年 5 月 29 日	163,236,204	4,764,080,905	8,017,175,537
第 19 期計算期間	2018 年 5 月 30 日～2019 年 5 月 29 日	115,634,723	632,394,206	7,500,416,054
第 20 期計算期間	2019 年 5 月 30 日～2020 年 5 月 29 日	148,606,297	1,621,087,474	6,027,934,877
第 21 期計算期間	2020 年 5 月 30 日～2021 年 5 月 31 日	113,236,909	905,855,186	5,235,316,600
第 22 期計算期間	2021 年 6 月 1 日～2022 年 5 月 30 日	78,739,623	344,146,734	4,969,909,489
第 23 期計算期間	2022 年 5 月 31 日～2023 年 5 月 29 日	92,792,126	232,197,554	4,830,504,061
第 24 期計算期間	2023 年 5 月 30 日～2024 年 5 月 29 日	97,895,504	449,773,066	4,478,626,499
第 25 期中間計算期間	2024 年 5 月 30 日～2024 年 11 月 29 日	82,236,923	159,688,734	4,401,174,688

(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	723,678,262,550	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,742,046,170	0.92
合計(純資産総額)		730,420,308,720	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	6,381,085,000	0.87

(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	9,659,200	3,318.65	32,055,533,124	3,146.00	30,387,843,200	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,363,100	2,526.94	16,079,190,807	3,369.00	21,437,283,900	2.93
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,481,800	1,633.10	18,750,927,580	1,846.00	21,195,402,800	2.90
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,725,700	3,254.54	15,379,990,909	3,937.00	18,605,080,900	2.55
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,457,400	7,985.40	11,637,927,429	11,145.00	16,242,723,000	2.22
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,733,300	3,343.32	12,481,639,978	3,764.00	14,052,141,200	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	181,800	69,474.72	12,630,505,748	64,630.00	11,749,734,000	1.61
日本	株式	任天堂	その他製品	1,147,200	8,270.23	9,487,615,471	9,264.00	10,627,660,800	1.46
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,292,300	7,275.04	9,401,544,509	7,832.00	10,121,293,600	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,747,200	5,359.90	9,364,822,061	5,728.00	10,007,961,600	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,415,500	3,141.64	7,588,631,435	3,873.00	9,355,231,500	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	2,824,600	3,954.33	11,169,401,952	3,311.00	9,352,250,600	1.28
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	384,600	34,477.18	13,259,924,167	24,185.00	9,301,551,000	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,553,100	3,312.28	11,768,881,307	2,604.00	9,252,272,400	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	1,632,100	5,879.00	9,595,132,098	5,296.00	8,643,601,600	1.18

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,206,900	151.95	8,236,784,307	158.00	8,564,690,200	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	899,000	8,918.18	8,017,444,452	9,185.00	8,257,315,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	1,719,900	5,396.98	9,282,271,404	4,352.00	7,485,004,800	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	3,209,300	1,367.58	4,388,991,076	2,223.00	7,134,273,900	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	355,000	18,682.95	6,632,447,518	19,815.00	7,034,325,000	0.96
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,621,500	4,110.18	6,664,660,204	4,181.00	6,779,491,500	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,340,400	4,312.78	5,780,861,453	5,042.00	6,758,296,800	0.93
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,305,200	1,708.06	7,353,541,337	1,535.00	6,608,482,000	0.90
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	108,100	40,832.94	4,414,041,846	53,820.00	5,817,942,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,161,100	187.76	5,475,335,313	198.90	5,800,142,790	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,123,700	2,047.12	4,347,479,669	2,487.00	5,281,641,900	0.72
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	572,600	6,009.08	3,440,799,498	9,198.00	5,266,774,800	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,866,600	2,666.49	4,977,271,851	2,687.00	5,015,554,200	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	1,688,700	2,286.05	3,860,467,723	2,799.50	4,727,515,650	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	906,300	4,502.93	4,081,013,337	5,161.00	4,677,414,300	0.64

(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	0.24
		建設業	2.13
		食料品	3.03
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.10
		医薬品	4.29
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.65
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.49
		機械	5.50
		電気機器	17.43
		輸送用機器	7.81
		精密機器	2.38
その他製品	2.63		

	電気・ガス業	1.24
	陸運業	2.22
	海運業	0.68
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.43
	卸売業	6.75
	小売業	4.56
	銀行業	8.47
	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	3.25
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.77
	サービス業	5.10
	小計	99.08
合計		99.08

(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	229円		6,310,874,750	6,381,085,000	0.87

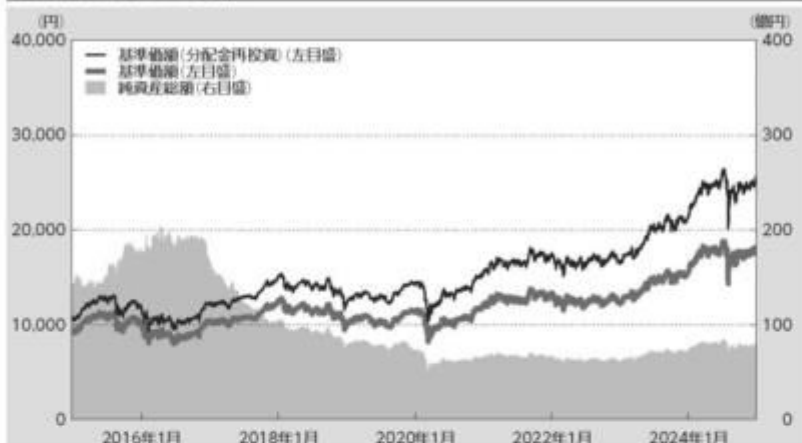
(注 1) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(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。

運用実績

当初設定日：2000年5月30日
作成基準日：2024年12月30日

基準価額・純資産の推移



※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※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。

基準価額 18,045円

純資産総額 79.06億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年5月	250円
2021年5月	240円
2022年5月	300円
2023年5月	320円
2024年5月	360円
設定来 分配金合計額	3,450円

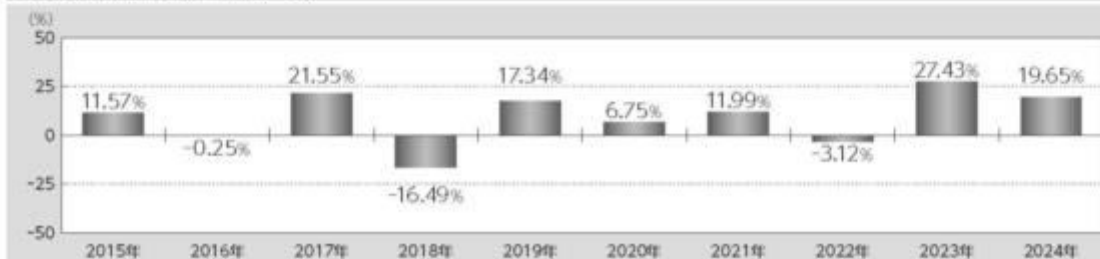
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.2%
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	2.9%
日立製作所	日本	株式	電気機器	2.5%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	2.2%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.9%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.6%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.5%
伊藤忠商事	日本	株式	卸売業	1.4%
東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	1.4%

※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)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<申込単位>

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

<申込価額>

取得申込受付日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

販売基準価額＝取得申込受付日の基準価額＋追加設定時信託財産留保額
＝取得申込受付日の基準価額＋（取得申込受付日の基準価額×0.1%）

（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販売基準価額とします。

<申込手数料>

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

<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、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、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、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額を控除した価額（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、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などにに基づき、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>

イ. マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ. マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

<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。(2000年5月30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5月30日から翌年5月29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づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更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て）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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て）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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24期計算期間(2023年5月30日から2024年5月29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

2024年8月9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 中島紀子
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（2023年5月30日から2024年5月29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（2024年5月29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】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)	第 24 期 (2024 年 5 月 29 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,264,983	30,662,722
親投資信託受益証券	6,881,753,959	8,043,603,675
未収入金	3,359,142	1,244,125
未収利息	-	57
流動資産合計	6,909,378,084	8,075,510,579
資産合計	6,909,378,084	8,075,510,579
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	154,576,129	161,230,553
未払解約金	2,962,707	2,081,426
未払受託者報酬	2,437,758	2,958,048
未払委託者報酬	18,457,266	22,396,597
未払利息	49	-
その他未払費用	347,512	407,522
流動負債合計	178,781,421	189,074,146
負債合計	178,781,421	189,074,146
純資産の部		
元本等		
元本	4,830,504,061	4,478,626,499
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,900,092,602	3,407,809,934
(分配準備積立金)	2,063,214,665	3,515,070,788
元本等合計	6,730,596,663	7,886,436,433
純資産合計	6,730,596,663	7,886,436,433
負債純資産合計	6,909,378,084	8,075,510,579

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 23 期		第 24 期	
	自 2022 年 5 月 31 日	至 2023 年 5 月 29 日	自 2023 年 5 月 30 日	至 2024 年 5 月 29 日
営業収益				
受取利息		35		3,212
有価証券売買等損益		939,904,128		1,938,360,456
営業収益合計		939,904,163		1,938,363,668
営業費用				
支払利息		6,331		4,132
受託者報酬		4,866,870		5,707,029
委託者報酬		36,849,032		43,210,214
その他費用		347,512		407,522
営業費用合計		42,069,745		49,328,897
営業利益又は営業損失 (△)		897,834,418		1,889,034,771
経常利益又は経常損失 (△)		897,834,418		1,889,034,771
当期純利益又は当期純損失 (△)		897,834,418		1,889,034,771
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 (△)		15,093,317		87,588,048
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		1,205,227,473		1,900,092,602
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,787,153		44,019,082
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,787,153		44,019,082
剰余金減少額又は欠損金増加額		56,086,996		176,517,920
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		56,086,996		176,517,920
分配金		154,576,129		161,230,553
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		1,900,092,602		3,407,809,934

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 23 期 (2023 年 5 月 29 日現在)	第 24 期 (2024 年 5 月 29 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,830,504,061 口	4,478,626,499 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) 1.3934 円 (13,934 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1.7609 円 (17,609 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 23 期 自 2022 年 5 月 31 日 至 2023 年 5 月 29 日			第 24 期 自 2023 年 5 月 30 日 至 2024 年 5 月 29 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	155,367,639 円	費用控除後の配当等収益額	A	162,022,477 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	722,886,262 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	1,639,424,246 円
収益調整金額	C	2,854,665,046 円	収益調整金額	C	2,685,336,634 円
分配準備積立金額	D	1,339,536,893 円	分配準備積立金額	D	1,874,854,618 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,072,455,840 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,361,637,975 円
当ファンドの期末残存口数	F	4,830,504,061 口	当ファンドの期末残存口数	F	4,478,626,499 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,500 円	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,204 円
1 万口当たり分配金額	H	320 円	1 万口当たり分配金額	H	360 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	154,576,129 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	161,230,553 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 24 期 自 2023 年 5 月 30 日 至 2024 年 5 月 29 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 24 期 (2024 年 5 月 29 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 23 期	第 24 期
	自 2022 年 5 月 31 日 至 2023 年 5 月 29 日	自 2023 年 5 月 30 日 至 2024 年 5 月 29 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,969,909,489 円	4,830,504,061 円
期中追加設定元本額	92,792,126 円	97,895,504 円
期中一部解約元本額	232,197,554 円	449,773,066 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 23 期	第 24 期
	(2023 年 5 月 29 日現在)	(2024 年 5 月 29 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	922,840,568	1,844,520,998
合計	922,840,568	1,844,520,998

(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	2,825,985,903	8,043,603,675	
合計		2,825,985,903	8,043,603,675	

(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

	2024年5月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,461,229,728
株式	652,736,925,880
派生商品評価勘定	78,583,850
未収入金	20,176,000
未収配当金	6,150,757,503
未収利息	10,175
差入委託証拠金	390,250,703
流動資産合計	664,837,933,839
資産合計	664,837,933,839
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,952,150
前受金	39,863,800
未払解約金	105,648,420
流動負債合計	184,464,370
負債合計	184,464,370
純資産の部	
元本等	
元本	233,518,775,755
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	431,134,693,714
元本等合計	664,653,469,469
純資産合計	664,653,469,469
負債純資産合計	664,837,933,839

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年5月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年5月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	233,518,775,755 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 2.8463 円 (1 万口当たり純資産額) (28,463 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

	2024年5月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年5月29日現在

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年5月30日
期首元本額	255,447,146,244円
期中追加設定元本額	24,993,586,662円
期中一部解約元本額	46,921,957,151円
期末元本額	233,518,775,755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)	268,612,952円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,258,378,877円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,767,408円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,481,131,615円
世界経済インデックスファンド	6,005,092,869円
日本株式インデックス・オープン	2,825,985,903円
DCマイセレクション25	4,666,264,841円
DCマイセレクション50	15,537,273,602円
DCマイセレクション75	17,871,476,401円
DC日本株式インデックス・オープン	6,012,945,920円
DCマイセレクションS25	2,895,825,312円
DCマイセレクションS50	9,178,172,690円
DCマイセレクションS75	8,607,822,388円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,561,540,230円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,974,905円

DCターゲット・イヤールファンド2035	552,947,571円
DCターゲット・イヤールファンド2045	451,060,171円
DC世界経済インデックスファンド	3,958,052,517円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	676,053,958円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,269,905円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,300,182円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,243,691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）	135,837,809円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,459,639円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	60,324,905円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,949,675円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,514,138円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	402,936,024円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	288,030,221円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,956,879,985円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,771,657円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,552,242円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	288,418,440円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	162,430,682円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	215,804,436円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,960,135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）	360,881,340円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,364,121,693円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,895,661,012円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,366,846円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	656,565,023円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	415,092,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	185,954,933円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,551,680円
SMT インデックスバランス・オープン	49,936,007円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,602,036,566円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	194,507,065円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,564,168円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	241,467,366円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	39,448,594円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,108,987円
グローバル経済コア	273,202,612円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,052,735円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,192,493,248円
DCターゲット・イヤールファンド2055	30,441,480円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,281,238円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	125,410,997円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2030	63,722,735円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2040	62,430,230円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2050	27,133,166円
DCターゲット・イヤールファンド（6資産・運用継続型）2060	33,957,540円
10資産分散投資ファンド	113,723,354円
グローバル10資産バランスファンド	33,224,772円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2035	32,694円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2040	35,914円
DCターゲット・イヤールファンド（ライフステージ対応型）2045	38,209円

DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2050	38,209 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2055	32,814 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2060	20,588 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型） 2065	18,210 円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,076 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,389,074,744 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）	243,803,589 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	289,307,233 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,271,837 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	156,681,751 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）	49,018,325,430 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,833,273 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）	204,191,612 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年5月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		135,734,949,938
合計		135,734,949,938

（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

（2024年5月29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	11,520,826,200	—	11,560,690,000	39,863,800
合計		11,520,826,200	—	11,560,690,000	39,863,800

（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	9,800	3,705.00	36,309,000	
ニッセイ	236,400	870.40	205,762,560	
マルハニチロ	35,100	3,174.00	111,407,400	

雪国まいたけ	20,100	965.00	19,396,500	
カネコ種苗	6,700	1,418.00	9,500,600	
サカタのタネ	26,900	3,345.00	89,980,500	
ホクト	18,900	1,822.00	34,435,800	
ホクリヨウ	1,300	992.00	1,289,600	
住石ホールディングス	30,100	1,380.00	41,538,000	
日鉄鉱業	9,500	5,160.00	49,020,000	
三井松島ホールディングス	14,000	4,600.00	64,400,000	
I N P E X	794,000	2,433.50	1,932,199,000	
石油資源開発	27,400	6,680.00	183,032,000	
K&Oエナジーグループ	10,700	3,765.00	40,285,500	
ショーボンドホールディングス	32,200	5,971.00	192,266,200	
ミライト・ワン	71,400	1,865.50	133,196,700	
タマホーム	14,900	4,520.00	67,348,000	
サンヨーホームズ	900	727.00	654,300	
日本アクア	3,300	867.00	2,861,100	
ファーストコーポレーション	2,300	781.00	1,796,300	
ベステラ	1,900	946.00	1,797,400	
キャンディル	1,400	598.00	837,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	991.00	1,585,600	
第一カッター興業	6,800	1,449.00	9,853,200	
安藤・間	137,000	1,126.00	154,262,000	
東急建設	74,100	761.00	56,390,100	
コムシスホールディングス	75,500	3,116.00	235,258,000	
ビーアールホールディングス	34,700	353.00	12,249,100	
高松コンストラクショングループ	17,600	2,834.00	49,878,400	
東建コーポレーション	5,900	10,650.00	62,835,000	
ソネック	800	925.00	740,000	
ヤマウラ	12,000	1,288.00	15,456,000	
オリエンタル白石	87,500	355.00	31,062,500	
大成建設	151,500	6,064.00	918,696,000	
大林組	591,400	1,837.50	1,086,697,500	
清水建設	468,900	872.90	409,302,810	
飛鳥建設	17,000	1,477.00	25,109,000	
長谷工コーポレーション	151,700	1,756.50	266,461,050	
松井建設	15,400	784.00	12,073,600	

錢高組	800	4,370.00	3,496,000	
鹿島建設	366,700	2,629.50	964,237,650	
不動テトラ	11,400	2,539.00	28,944,600	
大末建設	2,200	1,735.00	3,817,000	
鉄建建設	11,900	2,600.00	30,940,000	
西松建設	31,500	4,360.00	137,340,000	
三井住友建設	123,100	385.00	47,393,500	
大豊建設	5,700	3,400.00	19,380,000	
佐田建設	3,500	750.00	2,625,000	
ナカノフドー建設	3,900	505.00	1,969,500	
奥村組	26,800	4,860.00	130,248,000	
東鉄工業	20,500	3,040.00	62,320,000	
イチケン	1,400	2,550.00	3,570,000	
富士ピー・エス	2,400	441.00	1,058,400	
浅沼組	12,200	3,600.00	43,920,000	
戸田建設	223,800	1,077.50	241,144,500	
熊谷組	27,300	3,610.00	98,553,000	
北野建設	1,000	3,600.00	3,600,000	
植木組	1,600	1,638.00	2,620,800	
矢作建設工業	22,500	1,524.00	34,290,000	
ピーエス三菱	21,000	1,013.00	21,273,000	
日本ハウスホールディングス	35,300	308.00	10,872,400	
新日本建設	23,200	1,514.00	35,124,800	
東亜道路工業	32,900	1,196.00	39,348,400	
日本道路	19,400	1,745.00	33,853,000	
東亜建設工業	51,100	932.00	47,625,200	
日本国土開発	47,000	481.00	22,607,000	
若築建設	5,700	3,435.00	19,579,500	
東洋建設	41,700	1,386.00	57,796,200	
五洋建設	234,500	633.10	148,461,950	
世紀東急工業	21,200	1,667.00	35,340,400	
福田組	6,200	5,320.00	32,984,000	
住友林業	142,900	5,347.00	764,086,300	
日本基礎技術	3,300	559.00	1,844,700	
巴コーポレーション	6,900	800.00	5,520,000	
大和ハウス工業	457,300	4,064.00	1,858,467,200	

ライト工業	32,900	1,982.00	65,207,800	
積水ハウス	501,600	3,500.00	1,755,600,000	
日特建設	15,800	1,081.00	17,079,800	
北陸電気工事	11,300	1,178.00	13,311,400	
ユアテック	36,400	1,613.00	58,713,200	
日本リーテック	12,900	1,130.00	14,577,000	
四電工	6,900	3,545.00	24,460,500	
中電工	25,700	3,205.00	82,368,500	
関電工	103,600	1,760.00	182,336,000	
きんでん	115,000	3,235.00	372,025,000	
東京エネシス	15,400	1,343.00	20,682,200	
トーエネック	5,500	5,090.00	27,995,000	
住友電設	15,700	3,490.00	54,793,000	
日本電設工業	31,000	1,936.00	60,016,000	
エクシオグループ	161,600	1,591.00	257,105,600	
新日本空調	10,700	4,395.00	47,026,500	
九電工	35,700	6,520.00	232,764,000	
三機工業	35,700	2,155.00	76,933,500	
日揮ホールディングス	163,600	1,261.50	206,381,400	
中外炉工業	5,400	3,145.00	16,983,000	
ヤマト	4,600	1,110.00	5,106,000	
太平電業	10,300	4,995.00	51,448,500	
高砂熱学工業	44,300	6,460.00	286,178,000	
三晃金属工業	700	4,480.00	3,136,000	
朝日工業社	15,400	1,372.00	21,128,800	
明星工業	32,000	1,281.00	40,992,000	
大気社	19,100	5,170.00	98,747,000	
ダイダン	21,700	3,280.00	71,176,000	
日比谷総合設備	12,000	3,045.00	36,540,000	
フィル・カンパニー	2,600	612.00	1,591,200	
テスホールディングス	35,600	400.00	14,240,000	
インフロニア・ホールディングス	190,600	1,356.50	258,548,900	
東洋エンジニアリング	24,300	953.00	23,157,900	
レイズネクスト	23,900	1,760.00	42,064,000	
ニッポン	49,700	2,253.00	111,974,100	
日清製粉グループ本社	153,500	1,733.00	266,015,500	

日東富士製粉	3,000	6,220.00	18,660,000
昭和産業	16,100	3,115.00	50,151,500
鳥越製粉	4,900	670.00	3,283,000
中部飼料	23,000	1,496.00	34,408,000
フィード・ワン	24,300	895.00	21,748,500
東洋精糖	1,000	1,666.00	1,666,000
日本甜菜製糖	9,700	1,942.00	18,837,400
DM三井製糖ホールディングス	16,500	3,140.00	51,810,000
塩水港精糖	7,200	276.00	1,987,200
ウェルネオシュガー	8,300	2,310.00	19,173,000
森永製菓	70,700	2,444.00	172,790,800
中村屋	4,100	3,225.00	13,222,500
江崎グリコ	47,500	3,939.00	187,102,500
名糖産業	6,500	1,800.00	11,700,000
井村屋グループ	9,900	2,532.00	25,066,800
不二家	11,400	2,481.00	28,283,400
山崎製パン	111,100	3,344.00	371,518,400
第一屋製パン	1,000	583.00	583,000
モロゾフ	5,400	4,195.00	22,653,000
亀田製菓	9,500	3,920.00	37,240,000
寿スピリッツ	78,500	1,698.00	133,293,000
カルビー	76,000	3,040.00	231,040,000
森永乳業	58,000	3,126.00	181,308,000
六甲バター	12,200	1,403.00	17,116,600
ヤクルト本社	237,300	2,833.00	672,270,900
明治ホールディングス	203,500	3,449.00	701,871,500
雪印メグミルク	40,200	2,497.00	100,379,400
プリマハム	22,300	2,328.00	51,914,400
日本ハム	71,400	4,786.00	341,720,400
林兼産業	1,800	511.00	919,800
丸大食品	16,700	1,641.00	27,404,700
S Foods	18,300	2,835.00	51,880,500
柿安本店	6,500	2,529.00	16,438,500
伊藤ハム米久ホールディングス	25,400	4,115.00	104,521,000
サッポロホールディングス	54,700	5,172.00	282,908,400
アサヒグループホールディングス	383,600	5,693.00	2,183,834,800

キリンホールディングス	691,600	2,142.50	1,481,753,000	
宝ホールディングス	111,900	1,049.50	117,439,050	
オエノンホールディングス	49,600	355.00	17,608,000	
養命酒製造	5,500	2,242.00	12,331,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,100	1,777.00	231,187,700	
ライフドリンク カンパニー	3,300	5,300.00	17,490,000	
サントリー食品インターナショナル	116,900	5,685.00	664,576,500	
ダイドーグループホールディングス	18,800	2,540.00	47,752,000	
伊藤園	56,300	3,637.00	204,763,100	
キーコーヒー	18,600	2,025.00	37,665,000	
ユニカフェ	1,800	911.00	1,639,800	
ジャパンフーズ	900	1,989.00	1,790,100	
日清オイリオグループ	23,400	4,785.00	111,969,000	
不二製油グループ本社	38,700	2,426.50	93,905,550	
かどや製油	700	3,625.00	2,537,500	
J-オイルミルズ	19,000	1,903.00	36,157,000	
キッコーマン	550,100	1,784.50	981,653,450	
味の素	394,500	5,790.00	2,284,155,000	
ブルドックソース	8,800	1,932.00	17,001,600	
キューピー	89,200	3,045.00	271,614,000	
ハウス食品グループ本社	57,200	2,868.00	164,049,600	
カゴメ	71,400	3,561.00	254,255,400	
アリアケジャパン	16,600	5,110.00	84,826,000	
ピエトロ	800	1,786.00	1,428,800	
エバラ食品工業	4,000	2,830.00	11,320,000	
やまみ	800	3,005.00	2,404,000	
ニチレイ	76,100	3,509.00	267,034,900	
東洋水産	83,900	11,115.00	932,548,500	
イトアンドホールディングス	7,900	2,020.00	15,958,000	
大冷	800	1,910.00	1,528,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,600	1,480.00	11,248,000	
日清食品ホールディングス	175,100	3,955.00	692,520,500	
永谷園ホールディングス	8,100	2,190.00	17,739,000	
一正蒲鉾	2,400	761.00	1,826,400	
フジッコ	17,100	1,832.00	31,327,200	

ロック・フィールド	20,300	1,461.00	29,658,300	
日本たばこ産業	1,008,900	4,411.00	4,450,257,900	
ケンコーマヨネーズ	11,400	1,831.00	20,873,400	
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,305.00	25,585,500	
なとり	10,400	2,102.00	21,860,800	
イフジ産業	1,100	1,334.00	1,467,400	
ファーマフーズ	23,700	845.00	20,026,500	
ユウグレナ	103,300	545.00	56,298,500	
紀文食品	14,400	1,161.00	16,718,400	
ピクルスホールディングス	9,700	1,159.00	11,242,300	
ミヨシ油脂	2,100	1,330.00	2,793,000	
理研ビタミン	14,300	2,531.00	36,193,300	
片倉工業	15,800	1,977.00	31,236,600	
グンゼ	12,100	5,180.00	62,678,000	
東洋紡	73,300	1,092.00	80,043,600	
ユニチカ	57,200	226.00	12,927,200	
富士紡ホールディングス	7,500	4,565.00	34,237,500	
倉敷紡績	12,100	4,520.00	54,692,000	
シキボウ	10,100	1,076.00	10,867,600	
日本毛織	43,600	1,303.00	56,810,800	
トーア紡コーポレーション	2,200	433.00	952,600	
帝国繊維	19,200	2,324.00	44,620,800	
帝人	162,500	1,519.00	246,837,500	
東レ	1,132,200	786.00	889,909,200	
住江織物	1,200	2,509.00	3,010,800	
日本フェルト	4,000	462.00	1,848,000	
イチカワ	900	1,699.00	1,529,100	
日東製網	600	1,426.00	855,600	
アツギ	4,000	633.00	2,532,000	
ダイニック	1,800	816.00	1,468,800	
セーレン	32,800	2,412.00	79,113,600	
ソトー	1,900	718.00	1,364,200	
東海染工	600	836.00	501,600	
小松マテーレ	24,600	727.00	17,884,200	
ワコールホールディングス	34,600	3,747.00	129,646,200	
ホギメディカル	22,300	3,930.00	87,639,000	

T S I ホールディングス	55,000	853.00	46,915,000
マツオカコーポレーション	1,800	1,560.00	2,808,000
ワールド	23,900	2,041.00	48,779,900
三陽商会	7,200	2,491.00	17,935,200
ナイガイ	2,100	259.00	543,900
オンワードホールディングス	99,700	613.00	61,116,100
ルックホールディングス	5,000	2,685.00	13,425,000
ゴールドウイン	29,900	7,962.00	238,063,800
デサント	29,100	3,285.00	95,593,500
キング	2,200	667.00	1,467,400
ヤマトインターナショナル	4,600	338.00	1,554,800
特種東海製紙	9,200	3,550.00	32,660,000
王子ホールディングス	703,600	628.40	442,142,240
日本製紙	95,300	942.00	89,772,600
三菱製紙	7,600	734.00	5,578,400
北越コーポレーション	83,000	1,117.00	92,711,000
中越パルプ工業	2,300	1,552.00	3,569,600
大王製紙	74,600	888.20	66,259,720
阿波製紙	1,500	484.00	726,000
レンゴー	153,800	1,074.00	165,181,200
トーモク	9,800	2,768.00	27,126,400
ザ・パック	12,500	3,800.00	47,500,000
北の達人コーポレーション	71,200	168.00	11,961,600
クラレ	246,100	1,895.00	466,359,500
旭化成	1,142,600	1,028.00	1,174,592,800
共和レザー	3,200	775.00	2,480,000
巴川コーポレーション	1,600	968.00	1,548,800
レゾナック・ホールディングス	163,200	3,465.00	565,488,000
住友化学	1,253,400	317.90	398,455,860
住友精化	7,900	5,010.00	39,579,000
日産化学	78,900	4,534.00	357,732,600
ラサ工業	6,500	2,986.00	19,409,000
クレハ	36,900	2,888.00	106,567,200
多木化学	6,600	3,935.00	25,971,000
テイカ	14,400	1,584.00	22,809,600
石原産業	28,000	1,605.00	44,940,000

片倉コープアグリ	1,300	1,144.00	1,487,200	
日本曹達	19,900	5,050.00	100,495,000	
東ソー	225,500	1,965.50	443,220,250	
トクヤマ	54,500	3,040.00	165,680,000	
セントラル硝子	18,000	3,470.00	62,460,000	
東亜合成	81,200	1,517.00	123,180,400	
大阪ソーダ	11,800	8,580.00	101,244,000	
関東電化工業	32,700	886.00	28,972,200	
デンカ	61,400	2,196.50	134,865,100	
信越化学工業	1,514,600	5,889.00	8,919,479,400	
日本カーバイド工業	8,000	1,798.00	14,384,000	
堺化学工業	12,900	2,783.00	35,900,700	
第一稀元素化学工業	18,500	842.00	15,577,000	
エア・ウォーター	159,400	2,241.50	357,295,100	
日本酸素ホールディングス	163,900	4,500.00	737,550,000	
日本化学工業	6,200	2,350.00	14,570,000	
東邦アセチレン	5,900	360.00	2,124,000	
日本パーカライジング	75,300	1,188.00	89,456,400	
高压ガス工業	24,500	890.00	21,805,000	
チタン工業	700	1,015.00	710,500	
四国化成ホールディングス	21,500	1,999.00	42,978,500	
戸田工業	3,800	1,820.00	6,916,000	
ステラ ケミファ	9,200	4,345.00	39,974,000	
保土谷化学工業	5,300	5,000.00	26,500,000	
日本触媒	98,400	1,606.50	158,079,600	
大日精化工業	11,700	3,070.00	35,919,000	
カネカ	42,700	4,114.00	175,667,800	
三菱瓦斯化学	123,300	2,950.50	363,796,650	
三井化学	139,300	4,659.00	648,998,700	
東京応化工業	80,600	4,204.00	338,842,400	
大阪有機化学工業	14,100	3,480.00	49,068,000	
三菱ケミカルグループ	1,234,700	814.30	1,005,416,210	
KHネオケム	25,800	2,248.00	57,998,400	
ダイセル	217,100	1,557.50	338,133,250	
住友ベークライト	47,300	4,180.00	197,714,000	
積水化学工業	339,400	2,240.00	760,256,000	

日本ゼオン	115,800	1,425.50	165,072,900	
アイカ工業	42,600	3,406.00	145,095,600	
UBE	80,400	2,893.50	232,637,400	
積水樹脂	25,200	2,374.00	59,824,800	
タキロンシーアイ	43,100	715.00	30,816,500	
旭有機材	11,200	4,670.00	52,304,000	
ニチバン	9,200	1,754.00	16,136,800	
リケンテクノス	31,700	1,014.00	32,143,800	
大倉工業	7,800	2,945.00	22,971,000	
積水化成成品工業	23,700	445.00	10,546,500	
群栄化学工業	4,000	3,140.00	12,560,000	
タイガースポリマー	2,600	824.00	2,142,400	
ミライアル	1,900	1,538.00	2,922,200	
ダイキアクシス	2,300	726.00	1,669,800	
ダイキョーニシカワ	37,300	690.00	25,737,000	
竹本容器	2,100	846.00	1,776,600	
森六ホールディングス	8,800	2,704.00	23,795,200	
恵和	12,200	1,479.00	18,043,800	
日本化薬	129,000	1,247.00	160,863,000	
カーリットホールディングス	18,200	1,193.00	21,712,600	
日本精化	11,200	2,613.00	29,265,600	
扶桑化学工業	17,900	3,915.00	70,078,500	
トリケミカル研究所	20,500	4,355.00	89,277,500	
ADEKA	58,900	3,200.00	188,480,000	
日油	152,900	2,041.00	312,068,900	
新日本理化	7,700	180.00	1,386,000	
ハリマ化成グループ	11,800	870.00	10,266,000	
花王	381,900	6,891.00	2,631,672,900	
第一工業製薬	6,700	3,785.00	25,359,500	
石原ケミカル	7,600	1,826.00	13,877,600	
日華化学	2,200	1,085.00	2,387,000	
ニイタカ	1,100	1,873.00	2,060,300	
三洋化成工業	10,400	3,985.00	41,444,000	
有機合成薬品工業	4,500	307.00	1,381,500	
大日本塗料	18,700	1,200.00	22,440,000	
日本ペイントホールディングス	896,800	1,038.00	930,878,400	

関西ペイント	146,000	2,272.00	331,712,000	
神東塗料	4,700	125.00	587,500	
中国塗料	34,700	2,051.00	71,169,700	
日本特殊塗料	4,000	1,283.00	5,132,000	
藤倉化成	19,500	524.00	10,218,000	
太陽ホールディングス	29,400	3,115.00	91,581,000	
D I C	66,000	3,221.00	212,586,000	
サカタインクス	37,600	1,817.00	68,319,200	
a r t i e n c e	36,800	3,350.00	123,280,000	
富士フイルムホールディングス	941,200	3,559.00	3,349,730,800	
資生堂	353,100	4,989.00	1,761,615,900	
ライオン	215,200	1,253.00	269,645,600	
高砂香料工業	12,700	3,605.00	45,783,500	
マンダム	36,500	1,188.00	43,362,000	
ミルボン	23,000	3,325.00	76,475,000	
ファンケル	74,000	1,938.00	143,412,000	
コーセー	34,400	9,716.00	334,230,400	
コタ	17,100	1,423.00	24,333,300	
シーボン	800	1,392.00	1,113,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	86,700	1,311.00	113,663,700	
ノエビアホールディングス	15,100	5,300.00	80,030,000	
アジュバンホールディングス	1,400	846.00	1,184,400	
新日本製薬	9,600	1,650.00	15,840,000	
I - n e	4,500	1,462.00	6,579,000	
アクシージア	11,100	960.00	10,656,000	
エステー	13,100	1,522.00	19,938,200	
アグロ カネショウ	6,800	1,107.00	7,527,600	
コニシ	48,800	1,214.00	59,243,200	
長谷川香料	32,300	2,986.00	96,447,800	
小林製薬	49,200	5,401.00	265,729,200	
荒川化学工業	14,300	1,095.00	15,658,500	
メック	13,900	4,325.00	60,117,500	
日本高純度化学	3,800	3,275.00	12,445,000	
タカラバイオ	45,600	1,003.00	45,736,800	
J C U	18,700	3,640.00	68,068,000	
新田ゼラチン	3,800	788.00	2,994,400	

OATアグリオ	6,300	1,490.00	9,387,000	
デクセリアルズ	42,200	6,562.00	276,916,400	
アース製薬	15,400	4,630.00	71,302,000	
北興化学工業	17,000	1,513.00	25,721,000	
大成ラミック	4,900	2,795.00	13,695,500	
クミアイ化学工業	67,200	762.00	51,206,400	
日本農薬	31,000	722.00	22,382,000	
アキレス	10,700	1,587.00	16,980,900	
有沢製作所	29,600	1,506.00	44,577,600	
日東電工	108,600	12,125.00	1,316,775,000	
レック	21,700	1,185.00	25,714,500	
三光合成	21,300	676.00	14,398,800	
きもと	9,300	211.00	1,962,300	
藤森工業	13,400	4,230.00	56,682,000	
前澤化成工業	10,900	1,808.00	19,707,200	
未来工業	6,100	3,970.00	24,217,000	
ウェーブロックホールディングス	2,100	631.00	1,325,100	
JSP	11,900	2,143.00	25,501,700	
エフピコ	32,000	2,412.00	77,184,000	
天馬	12,300	2,446.00	30,085,800	
信越ポリマー	36,500	1,492.00	54,458,000	
東リ	12,400	393.00	4,873,200	
ニフコ	50,600	3,525.00	178,365,000	
バルカー	14,100	3,640.00	51,324,000	
ユニ・チャーム	352,300	4,922.00	1,734,020,600	
ショーエイコーポレーション	1,800	586.00	1,054,800	
協和キリン	204,300	2,559.00	522,803,700	
武田薬品工業	1,496,700	4,113.00	6,155,927,100	
アステラス製薬	1,483,400	1,535.50	2,277,760,700	
住友ファーマ	125,400	285.00	35,739,000	
塩野義製薬	213,200	6,990.00	1,490,268,000	
わかもと製薬	5,900	253.00	1,492,700	
日本新薬	44,300	2,789.00	123,552,700	
中外製薬	529,400	4,684.00	2,479,709,600	
科研製薬	29,000	3,619.00	104,951,000	
エーザイ	205,700	6,666.00	1,371,196,200	

ロート製薬	163,800	2,676.50	438,410,700
小野薬品工業	345,900	2,204.00	762,363,600
久光製薬	37,600	3,672.00	138,067,200
持田製薬	19,300	2,925.00	56,452,500
参天製薬	298,400	1,614.50	481,766,800
扶桑薬品工業	6,000	2,242.00	13,452,000
日本ケミファ	600	1,562.00	937,200
ツムラ	53,200	3,769.00	200,510,800
キッセイ薬品工業	28,000	3,035.00	84,980,000
生化学工業	28,700	775.00	22,242,500
栄研化学	30,300	2,061.00	62,448,300
鳥居薬品	9,100	3,665.00	33,351,500
JCRファーマ	57,200	536.00	30,659,200
東和薬品	26,000	2,862.00	74,412,000
富士製薬工業	12,500	1,457.00	18,212,500
ゼリア新薬工業	23,400	1,939.00	45,372,600
ネクセラファーマ	74,000	1,393.00	103,082,000
第一三共	1,473,300	5,452.00	8,032,431,600
杏林製薬	36,700	1,703.00	62,500,100
大幸薬品	35,100	362.00	12,706,200
ダイト	12,900	2,206.00	28,457,400
大塚ホールディングス	351,700	6,102.00	2,146,073,400
ペプチドリーム	82,000	1,969.50	161,499,000
セルソース	6,200	1,296.00	8,035,200
あすか製薬ホールディングス	17,300	2,323.00	40,187,900
サワイグループホールディングス	38,700	5,790.00	224,073,000
日本コークス工業	171,600	132.00	22,651,200
ニチレキ	22,000	2,439.00	53,658,000
ユシロ化学工業	8,800	1,662.00	14,625,600
ビーピー・カストロール	2,200	975.00	2,145,000
富士石油	49,300	501.00	24,699,300
MORESCO	2,000	1,371.00	2,742,000
出光興産	878,100	1,037.00	910,589,700
ENEOSホールディングス	2,677,300	800.20	2,142,375,460
コスモエネルギーホールディングス	50,100	7,621.00	381,812,100
横浜ゴム	85,500	3,922.00	335,331,000

TOYO TIRE	97,200	2,673.00	259,815,600	
ブリヂストン	495,000	6,808.00	3,369,960,000	
住友ゴム工業	165,900	1,726.00	286,343,400	
藤倉コンポジット	14,600	1,341.00	19,578,600	
オカモト	8,000	4,690.00	37,520,000	
フコク	8,900	2,062.00	18,351,800	
ニッタ	17,200	4,045.00	69,574,000	
住友理工	26,200	1,244.00	32,592,800	
三ツ星ベルト	19,600	4,340.00	85,064,000	
バンドー化学	25,100	1,794.00	45,029,400	
日東紡績	21,400	7,230.00	154,722,000	
A G C	150,800	5,427.00	818,391,600	
日本板硝子	80,700	457.00	36,879,900	
石塚硝子	1,000	2,860.00	2,860,000	
日本山村硝子	2,200	1,711.00	3,764,200	
日本電気硝子	69,100	3,603.00	248,967,300	
オハラ	8,100	1,313.00	10,635,300	
住友大阪セメント	28,200	3,859.00	108,823,800	
太平洋セメント	100,000	3,927.00	392,700,000	
日本ヒューム	14,900	1,062.00	15,823,800	
日本コンクリート工業	33,000	355.00	11,715,000	
三谷セキサン	7,100	5,130.00	36,423,000	
アジアパイルホールディングス	24,100	971.00	23,401,100	
東海カーボン	156,100	983.80	153,571,180	
日本カーボン	9,000	5,470.00	49,230,000	
東洋炭素	11,900	6,880.00	81,872,000	
ノリタケカンパニーリミテド	18,700	3,905.00	73,023,500	
TOTO	111,600	3,851.00	429,771,600	
日本碍子	196,700	2,083.50	409,824,450	
日本特殊陶業	141,600	4,635.00	656,316,000	
MARUWA	6,200	36,000.00	223,200,000	
品川リフラクトリーズ	20,900	1,941.00	40,566,900	
黒崎播磨	13,800	2,993.00	41,303,400	
ヨータイ	10,500	1,765.00	18,532,500	
東京窯業	6,200	431.00	2,672,200	
ニッカトー	2,700	561.00	1,514,700	

フジミインコーポレーテッド	45,500	3,000.00	136,500,000	
クニミネ工業	1,700	1,135.00	1,929,500	
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,411.00	1,693,200	
ニチアス	42,800	4,665.00	199,662,000	
ニチハ	21,200	3,490.00	73,988,000	
日本製鉄	779,200	3,349.00	2,609,540,800	
神戸製鋼所	349,900	1,991.50	696,825,850	
中山製鋼所	39,800	947.00	37,690,600	
合同製鐵	9,700	5,210.00	50,537,000	
J F Eホールディングス	483,900	2,302.50	1,114,179,750	
東京製鐵	48,900	1,577.00	77,115,300	
共英製鋼	19,800	2,110.00	41,778,000	
大和工業	32,800	8,244.00	270,403,200	
東京鐵鋼	7,700	4,980.00	38,346,000	
大阪製鐵	8,000	2,335.00	18,680,000	
淀川製鋼所	19,800	5,550.00	109,890,000	
中部鋼板	11,400	2,723.00	31,042,200	
丸一鋼管	53,000	3,725.00	197,425,000	
モリ工業	3,800	5,180.00	19,684,000	
大同特殊鋼	109,600	1,572.00	172,291,200	
日本高周波鋼業	2,300	441.00	1,014,300	
日本冶金工業	12,700	4,825.00	61,277,500	
山陽特殊製鋼	17,200	2,162.00	37,186,400	
愛知製鋼	10,000	3,645.00	36,450,000	
日本金属	1,500	762.00	1,143,000	
大平洋金属	14,800	1,273.00	18,840,400	
新日本電工	86,600	281.00	24,334,600	
栗本鐵工所	8,100	4,810.00	38,961,000	
虹技	800	1,165.00	932,000	
三菱製鋼	12,900	1,488.00	19,195,200	
日亜鋼業	5,900	306.00	1,805,400	
日本精線	13,800	1,272.00	17,553,600	
エンビプロ・ホールディングス	15,000	499.00	7,485,000	
シンニッタン	7,300	231.00	1,686,300	
新家工業	1,300	4,940.00	6,422,000	
大紀アルミニウム工業所	22,000	1,295.00	28,490,000	

日本軽金属ホールディングス	50,800	1,890.00	96,012,000
三井金属鉱業	50,600	5,130.00	259,578,000
三菱マテリアル	124,400	3,078.00	382,903,200
住友金属鉱山	201,700	5,167.00	1,042,183,900
DOWAホールディングス	43,000	5,825.00	250,475,000
古河機械金属	23,000	1,920.00	44,160,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,200	2,752.00	83,110,400
東邦チタニウム	36,000	1,227.00	44,172,000
UACJ	24,400	4,425.00	107,970,000
CKサンエツ	4,200	3,685.00	15,477,000
古河電気工業	57,900	4,269.00	247,175,100
住友電気工業	650,800	2,559.00	1,665,397,200
フジクラ	205,200	3,278.00	672,645,600
SWCC	19,400	4,745.00	92,053,000
タツタ電線	31,900	715.00	22,808,500
カナレ電気	1,000	1,555.00	1,555,000
平河ビューテック	11,100	1,346.00	14,940,600
リョービ	18,500	2,473.00	45,750,500
アーレスティ	6,300	687.00	4,328,100
AREホールディングス	65,400	2,019.00	132,042,600
稲葉製作所	9,700	1,859.00	18,032,300
宮地エンジニアリンググループ	8,700	4,435.00	38,584,500
トーカロ	50,200	1,944.00	97,588,800
アルファC o	2,100	1,358.00	2,851,800
SUMCO	309,100	2,360.00	729,476,000
川田テクノロジーズ	12,300	2,697.00	33,173,100
RS Technologies	11,600	3,080.00	35,728,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,727.00	1,727,000
信和	3,700	736.00	2,723,200
東洋製罐グループホールディングス	99,800	2,581.00	257,583,800
ホッカンホールディングス	8,500	1,629.00	13,846,500
コロナ	9,700	911.00	8,836,700
横河ブリッジホールディングス	27,200	2,700.00	73,440,000
駒井ハルテック	1,000	1,789.00	1,789,000
高田機工	400	3,570.00	1,428,000
三和ホールディングス	174,800	2,870.50	501,763,400

文化シャッター	45,500	1,742.00	79,261,000	
三協立山	21,900	841.00	18,417,900	
アルインコ	13,300	1,080.00	14,364,000	
東洋シャッター	1,300	886.00	1,151,800	
L I X I L	271,700	1,700.00	461,890,000	
日本ファイルコン	3,800	542.00	2,059,600	
ノーリツ	27,600	1,737.00	47,941,200	
長府製作所	17,300	2,182.00	37,748,600	
リンナイ	83,200	3,713.00	308,921,600	
ダイニチ工業	2,900	671.00	1,945,900	
日東精工	25,200	581.00	14,641,200	
三洋工業	700	3,055.00	2,138,500	
岡部	31,100	769.00	23,915,900	
ジーテクト	22,200	1,913.00	42,468,600	
東プレ	30,700	2,218.00	68,092,600	
高周波熱錬	25,800	1,080.00	27,864,000	
東京製綱	11,300	1,300.00	14,690,000	
サンコール	17,100	440.00	7,524,000	
モリテック スチール	5,100	232.00	1,183,200	
パイオラックス	21,600	2,211.00	47,757,600	
エイチワン	17,900	849.00	15,197,100	
日本発條	153,900	1,735.50	267,093,450	
中央発條	12,900	1,001.00	12,912,900	
アドバネクス	700	1,080.00	756,000	
立川ブラインド工業	7,900	1,345.00	10,625,500	
三益半導体工業	15,700	3,695.00	58,011,500	
日本ドライケミカル	1,400	2,602.00	3,642,800	
日本製鋼所	46,900	4,743.00	222,446,700	
三浦工業	71,100	3,014.00	214,295,400	
タクマ	57,600	1,666.00	95,961,600	
ツガミ	37,900	1,445.00	54,765,500	
オークマ	14,900	6,758.00	100,694,200	
芝浦機械	17,000	3,400.00	57,800,000	
アマダ	258,100	1,767.50	456,191,750	
アイダエンジニアリング	39,500	886.00	34,997,000	
F U J I	80,200	2,493.00	199,938,600	

牧野フライス製作所	18,800	6,560.00	123,328,000	
オーエスジー	75,100	1,943.50	145,956,850	
ダイジェット工業	600	836.00	501,600	
旭ダイヤモンド工業	39,300	873.00	34,308,900	
DMG森精機	105,700	4,499.00	475,544,300	
ソディック	41,500	712.00	29,548,000	
ディスコ	82,000	62,730.00	5,143,860,000	
日東工器	8,300	2,297.00	19,065,100	
日進工具	15,800	949.00	14,994,200	
パンチ工業	5,600	462.00	2,587,200	
富士ダイス	11,100	772.00	8,569,200	
豊和工業	3,100	805.00	2,495,500	
リケンNPR	18,500	2,680.00	49,580,000	
東洋機械金属	4,700	720.00	3,384,000	
エンシュウ	1,400	679.00	950,600	
島精機製作所	27,100	1,475.00	39,972,500	
オプトラン	28,000	2,086.00	58,408,000	
NCホールディングス	1,300	1,479.00	1,922,700	
イワキポンプ	11,400	2,410.00	27,474,000	
フリー	16,100	998.00	16,067,800	
ヤマシンフィルタ	40,600	353.00	14,331,800	
日阪製作所	18,600	1,010.00	18,786,000	
やまびこ	27,800	2,151.00	59,797,800	
野村マイクロ・サイエンス	23,100	4,655.00	107,530,500	
平田機工	8,100	6,880.00	55,728,000	
PEGASUS	18,900	505.00	9,544,500	
マルマエ	7,400	2,095.00	15,503,000	
タツモ	10,300	3,475.00	35,792,500	
ナブテスコ	106,900	2,565.00	274,198,500	
三井海洋開発	21,600	2,695.00	58,212,000	
レオン自動機	19,700	1,557.00	30,672,900	
SMC	51,000	78,970.00	4,027,470,000	
ホソカワミクロン	11,900	4,285.00	50,991,500	
ユニオンツール	7,500	5,490.00	41,175,000	
瑞光	12,300	1,048.00	12,890,400	
オイレス工業	23,100	2,164.00	49,988,400	

日精エー・エス・ビー機械	6,800	5,070.00	34,476,000
サトーホールディングス	24,200	2,103.00	50,892,600
技研製作所	16,000	1,838.00	29,408,000
日本エアテック	8,000	1,157.00	9,256,000
カワタ	1,800	877.00	1,578,600
日精樹脂工業	12,700	1,007.00	12,788,900
オカダアイヨン	1,900	2,490.00	4,731,000
ワイエイシイホールディングス	7,200	2,272.00	16,358,400
小松製作所	798,300	4,535.00	3,620,290,500
住友重機械工業	100,800	4,175.00	420,840,000
日立建機	67,800	4,226.00	286,522,800
日工	25,300	710.00	17,963,000
巴工業	6,700	4,110.00	27,537,000
井関農機	16,000	1,003.00	16,048,000
TOWA	19,000	12,560.00	238,640,000
丸山製作所	1,000	2,310.00	2,310,000
北川鉄工所	6,700	1,362.00	9,125,400
ローツェ	8,900	30,050.00	267,445,000
タカキタ	1,900	455.00	864,500
クボタ	890,400	2,209.50	1,967,338,800
荅原実業	9,000	3,395.00	30,555,000
三菱化工機	6,000	4,065.00	24,390,000
月島ホールディングス	23,100	1,374.00	31,739,400
帝国電機製作所	11,700	2,284.00	26,722,800
新東工業	34,500	1,069.00	36,880,500
澁谷工業	16,000	3,775.00	60,400,000
アイチ コーポレーション	23,700	1,113.00	26,378,100
小森コーポレーション	42,000	1,247.00	52,374,000
鶴見製作所	13,000	4,035.00	52,455,000
日本ギア工業	2,200	539.00	1,185,800
酒井重工業	3,000	5,660.00	16,980,000
荅原製作所	69,900	11,765.00	822,373,500
石井鐵工所	700	2,762.00	1,933,400
西島製作所	14,700	3,235.00	47,554,500
北越工業	17,100	2,140.00	36,594,000
ダイキン工業	203,300	22,945.00	4,664,718,500

オルガノ	20,500	8,460.00	173,430,000	
トーヨーカネツ	5,800	3,815.00	22,127,000	
栗田工業	95,300	6,577.00	626,788,100	
椿本チエイン	24,000	5,840.00	140,160,000	
大同工業	2,500	811.00	2,027,500	
木村化工機	13,100	687.00	8,999,700	
アネスト岩田	26,300	1,329.00	34,952,700	
ダイフク	287,400	2,783.50	799,977,900	
サムコ	4,600	4,460.00	20,516,000	
加藤製作所	2,900	1,305.00	3,784,500	
油研工業	1,000	2,340.00	2,340,000	
タダノ	98,000	1,076.00	105,448,000	
フジテック	39,800	4,165.00	165,767,000	
CKD	47,100	3,015.00	142,006,500	
平和	50,400	1,996.00	100,598,400	
理想科学工業	13,600	3,075.00	41,820,000	
SANKYO	164,000	1,492.50	244,770,000	
日本金銭機械	20,600	1,203.00	24,781,800	
マースグループホールディングス	8,600	3,325.00	28,595,000	
フクシマガリレイ	11,100	5,940.00	65,934,000	
オーイズミ	2,200	348.00	765,600	
ダイコク電機	8,400	3,550.00	29,820,000	
竹内製作所	30,900	6,040.00	186,636,000	
アマノ	48,300	3,715.00	179,434,500	
JUKI	26,400	494.00	13,041,600	
ジャノメ	17,300	672.00	11,625,600	
マックス	24,000	3,590.00	86,160,000	
グローリー	40,900	2,640.50	107,996,450	
新晃工業	17,200	4,000.00	68,800,000	
大和冷機工業	26,100	1,426.00	37,218,600	
セガサミーホールディングス	152,100	2,114.00	321,539,400	
T P R	21,600	2,271.00	49,053,600	
ツバキ・ナカシマ	34,100	773.00	26,359,300	
ホシザキ	100,500	5,508.00	553,554,000	
大豊工業	14,800	800.00	11,840,000	
日本精工	315,300	758.40	239,123,520	

NTN	369,400	301.80	111,484,920	
ジェイテクト	151,600	1,153.50	174,870,600	
不二越	12,600	3,410.00	42,966,000	
日本トムソン	46,400	595.00	27,608,000	
THK	98,300	3,008.00	295,686,400	
ユーシン精機	13,500	704.00	9,504,000	
前澤給装工業	12,200	1,335.00	16,287,000	
イーグル工業	18,800	1,806.00	33,952,800	
前澤工業	3,600	1,363.00	4,906,800	
日本ピラー工業	15,800	5,080.00	80,264,000	
キッツ	57,000	1,088.00	62,016,000	
マキタ	194,200	4,643.00	901,670,600	
三井E&S	84,500	1,385.00	117,032,500	
日立造船	150,300	1,096.00	164,728,800	
三菱重工業	2,978,200	1,308.00	3,895,485,600	
IHI	126,800	3,831.00	485,770,800	
スター精密	31,300	2,066.00	64,665,800	
日清紡ホールディングス	128,000	1,070.50	137,024,000	
イビデン	88,900	6,283.00	558,558,700	
コニカミノルタ	380,700	454.70	173,104,290	
ブラザー工業	227,600	2,908.50	661,974,600	
ミネベアミツミ	296,300	3,229.00	956,752,700	
日立製作所	818,500	15,855.00	12,977,317,500	
三菱電機	1,895,500	2,698.50	5,115,006,750	
富士電機	103,600	9,461.00	980,159,600	
東洋電機製造	2,000	1,082.00	2,164,000	
安川電機	185,000	5,982.00	1,106,670,000	
シンフォニアテクノロジー	18,800	3,610.00	67,868,000	
明電舎	31,600	4,135.00	130,666,000	
オリジン	1,300	1,300.00	1,690,000	
山洋電気	7,400	7,110.00	52,614,000	
デンヨー	13,000	2,576.00	33,488,000	
PHCホールディングス	32,000	1,098.00	35,136,000	
KOKUSAI ELECTRIC	88,100	4,165.00	366,936,500	
ソシオネクスト	124,000	4,473.00	554,652,000	
東芝テック	21,800	3,125.00	68,125,000	

芝浦メカトロニクス	9,700	6,960.00	67,512,000
マブチモーター	83,800	2,396.00	200,784,800
ニデック	376,000	7,840.00	2,947,840,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,300	383.00	4,327,900
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,753.00	15,601,700
東光高岳	10,400	2,094.00	21,777,600
ダブル・スコープ	48,800	448.00	21,862,400
ダイヘン	16,100	8,570.00	137,977,000
ヤーマン	33,300	924.00	30,769,200
JVCケンウッド	134,700	841.00	113,282,700
ミマキエンジニアリング	16,300	1,702.00	27,742,600
I-PEX	11,900	1,972.00	23,466,800
大崎電気工業	37,300	663.00	24,729,900
オムロン	130,000	5,250.00	682,500,000
日東工業	23,000	3,580.00	82,340,000
I D E C	25,100	2,669.00	66,991,900
正興電機製作所	2,100	1,516.00	3,183,600
不二電機工業	1,300	1,117.00	1,452,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66,500	3,090.00	205,485,000
サクサホールディングス	1,300	2,707.00	3,519,100
メルコホールディングス	5,400	3,425.00	18,495,000
テクノメディカ	4,300	1,758.00	7,559,400
日本電気	223,700	11,590.00	2,592,683,000
富士通	1,567,100	2,250.50	3,526,758,550
沖電気工業	77,000	1,034.00	79,618,000
岩崎通信機	2,700	668.00	1,803,600
電気興業	6,900	2,075.00	14,317,500
サンケン電気	15,800	5,265.00	83,187,000
ナカヨ	900	1,148.00	1,033,200
アイホン	9,200	2,904.00	26,716,800
ルネサスエレクトロニクス	1,061,700	2,932.00	3,112,904,400
セイコーエプソン	218,500	2,476.50	541,115,250
ワコム	124,400	697.00	86,706,800
アルバック	37,300	11,125.00	414,962,500
アクセル	7,800	1,259.00	9,820,200
E I Z O	12,500	4,850.00	60,625,000

日本信号	38,800	981.00	38,062,800	
京三製作所	35,700	582.00	20,777,400	
能美防災	23,100	2,229.00	51,489,900	
ホーチキ	12,800	2,150.00	27,520,000	
星和電機	2,900	560.00	1,624,000	
エレコム	40,800	1,535.00	62,628,000	
パナソニック ホールディングス	2,011,800	1,341.50	2,698,829,700	
シャープ	287,100	935.60	268,610,760	
アンリツ	119,900	1,169.50	140,223,050	
富士通ゼネラル	48,300	2,161.00	104,376,300	
ソニーグループ	1,192,800	12,495.00	14,904,036,000	
TDK	269,700	7,701.00	2,076,959,700	
帝国通信工業	7,600	1,946.00	14,789,600	
タムラ製作所	67,800	682.00	46,239,600	
アルプスアルパイン	152,200	1,461.50	222,440,300	
池上通信機	1,800	751.00	1,351,800	
日本電波工業	20,600	1,080.00	22,248,000	
鈴木	9,200	1,416.00	13,027,200	
メイコー	16,900	7,090.00	119,821,000	
日本トリム	3,900	3,205.00	12,499,500	
ローランド ディー. ジー.	9,500	5,340.00	50,730,000	
フォスター電機	12,600	1,601.00	20,172,600	
SMK	4,500	2,392.00	10,764,000	
ヨコオ	15,200	2,005.00	30,476,000	
ホシデン	38,800	1,950.00	75,660,000	
ヒロセ電機	25,100	17,340.00	435,234,000	
日本航空電子工業	40,700	2,409.00	98,046,300	
TOA	19,400	1,055.00	20,467,000	
マクセル	37,700	1,628.00	61,375,600	
古野電気	22,200	2,025.00	44,955,000	
スミダコーポレーション	23,000	1,141.00	26,243,000	
アイコム	6,600	2,992.00	19,747,200	
リオン	7,100	2,952.00	20,959,200	
横河電機	186,300	4,048.00	754,142,400	
新電元工業	6,500	2,946.00	19,149,000	
アズビル	116,000	4,370.00	506,920,000	

東亜ディーケーケー	2,900	844.00	2,447,600	
日本光電工業	72,400	4,546.00	329,130,400	
チノー	7,000	2,595.00	18,165,000	
共和電業	5,200	443.00	2,303,600	
日本電子材料	10,400	3,690.00	38,376,000	
堀場製作所	32,200	12,450.00	400,890,000	
アドバンテスト	483,100	5,665.00	2,736,761,500	
小野測器	2,600	669.00	1,739,400	
エスペック	13,600	3,180.00	43,248,000	
キーエンス	168,700	70,010.00	11,810,687,000	
日置電機	8,000	7,010.00	56,080,000	
シスメックス	436,600	2,601.50	1,135,814,900	
日本マイクロニクス	30,300	6,110.00	185,133,000	
メガチップス	13,400	4,095.00	54,873,000	
OBARA GROUP	10,600	4,170.00	44,202,000	
澤藤電機	800	1,219.00	975,200	
原田工業	2,800	578.00	1,618,400	
コーセル	18,200	1,374.00	25,006,800	
イリソ電子工業	15,600	3,020.00	47,112,000	
オブテックグループ	31,000	1,681.00	52,111,000	
千代田インテグレ	6,700	2,781.00	18,632,700	
レーザーテック	77,300	41,700.00	3,223,410,000	
スタンレー電気	108,000	2,817.00	304,236,000	
ウシオ電機	74,700	2,057.50	153,695,250	
岡谷電機産業	5,100	240.00	1,224,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	6,000	485.00	2,910,000	
エノモト	1,700	1,470.00	2,499,000	
日本セラミック	13,800	2,511.00	34,651,800	
遠藤照明	2,700	1,581.00	4,268,700	
古河電池	12,600	1,177.00	14,830,200	
双信電機	3,500	479.00	1,676,500	
山一電機	15,200	3,540.00	53,808,000	
図研	14,700	3,780.00	55,566,000	
日本電子	42,300	6,540.00	276,642,000	
カシオ計算機	121,800	1,165.00	141,897,000	
ファナック	822,200	4,516.00	3,713,055,200	

日本シイエムケイ	39,900	562.00	22,423,800	
エンプラス	4,900	7,020.00	34,398,000	
大真空	25,400	688.00	17,475,200	
ローム	311,900	2,020.00	630,038,000	
浜松ホトニクス	135,400	4,648.00	629,339,200	
三井ハイテック	15,000	7,026.00	105,390,000	
新光電気工業	59,700	5,593.00	333,902,100	
京セラ	1,047,800	1,790.50	1,876,085,900	
太陽誘電	82,200	3,237.00	266,081,400	
村田製作所	1,534,200	2,945.00	4,518,219,000	
双葉電子工業	32,600	510.00	16,626,000	
北陸電気工業	2,200	1,373.00	3,020,600	
ニチコン	44,400	1,141.00	50,660,400	
日本ケミコン	18,100	1,551.00	28,073,100	
KOA	25,700	1,463.00	37,599,100	
市光工業	30,800	542.00	16,693,600	
小糸製作所	174,800	2,149.50	375,732,600	
ミツバ	31,600	1,043.00	32,958,800	
S C R E E Nホールディングス	57,700	15,140.00	873,578,000	
キャノン電子	18,700	2,237.00	41,831,900	
キャノン	841,000	4,495.00	3,780,295,000	
リコー	422,800	1,378.00	582,618,400	
象印マホービン	45,900	1,464.00	67,197,600	
MU T O Hホールディングス	900	2,454.00	2,208,600	
東京エレクトロン	356,900	35,380.00	12,627,122,000	
イノテック	11,300	1,688.00	19,074,400	
トヨタ紡織	71,000	2,265.00	160,815,000	
芦森工業	1,200	2,420.00	2,904,000	
ユニプレス	30,300	1,467.00	44,450,100	
豊田自動織機	143,800	14,810.00	2,129,678,000	
モリタホールディングス	29,600	1,750.00	51,800,000	
三櫻工業	25,800	999.00	25,774,200	
デンソー	1,391,200	2,546.50	3,542,690,800	
東海理化電機製作所	47,600	2,190.00	104,244,000	
川崎重工業	137,600	5,993.00	824,636,800	
名村造船所	47,200	1,943.00	91,709,600	

日本車輛製造	5,600	2,231.00	12,493,600
三菱ロジスネクスト	26,900	1,603.00	43,120,700
近畿車輛	800	1,909.00	1,527,200
日産自動車	2,275,500	554.30	1,261,309,650
いすゞ自動車	490,200	2,068.00	1,013,733,600
トヨタ自動車	9,258,700	3,390.00	31,386,993,000
日野自動車	253,600	442.00	112,091,200
三菱自動車工業	657,800	429.20	282,327,760
エフテック	4,000	641.00	2,564,000
レシップホールディングス	2,400	560.00	1,344,000
GMB	1,100	1,376.00	1,513,600
ファルテック	1,200	553.00	663,600
武蔵精密工業	41,300	1,694.00	69,962,200
日産車体	17,100	914.00	15,629,400
新明和工業	48,600	1,384.00	67,262,400
極東開発工業	27,800	2,446.00	67,998,800
トピー工業	13,700	2,422.00	33,181,400
ティラド	3,800	3,550.00	13,490,000
曙ブレーキ工業	102,900	137.00	14,097,300
タチエス	31,100	1,925.00	59,867,500
NOK	65,500	2,108.50	138,106,750
フタバ産業	45,300	903.00	40,905,900
カヤバ	15,900	5,280.00	83,952,000
大同メタル工業	33,100	587.00	19,429,700
プレス工業	67,400	668.00	45,023,200
ミクニ	7,200	400.00	2,880,000
太平洋工業	38,700	1,541.00	59,636,700
アイシン	130,100	5,746.00	747,554,600
マツダ	557,700	1,603.00	893,993,100
今仙電機製作所	3,600	617.00	2,221,200
本田技研工業	3,995,200	1,740.00	6,951,648,000
スズキ	1,238,800	1,859.00	2,302,929,200
SUBARU	522,900	3,415.00	1,785,703,500
安永	2,500	609.00	1,522,500
ヤマハ発動機	728,700	1,501.00	1,093,778,700
TBK	6,200	300.00	1,860,000

エクセディ	27,600	2,558.00	70,600,800	
豊田合成	48,300	2,992.00	144,513,600	
愛三工業	28,000	1,392.00	38,976,000	
盟和産業	800	1,004.00	803,200	
日本プラスト	4,900	439.00	2,151,100	
ヨロズ	15,900	1,058.00	16,822,200	
エフ・シー・シー	29,900	2,166.00	64,763,400	
シマノ	68,000	25,440.00	1,729,920,000	
テイ・エス テック	60,100	1,872.00	112,507,200	
ジャムコ	9,200	1,397.00	12,852,400	
テルモ	940,000	2,694.00	2,532,360,000	
クリエートメディック	1,800	977.00	1,758,600	
日機装	39,300	1,221.00	47,985,300	
日本エム・ディ・エム	13,400	611.00	8,187,400	
島津製作所	224,000	4,124.00	923,776,000	
JMS	15,600	521.00	8,127,600	
長野計器	12,300	3,095.00	38,068,500	
ブイ・テクノロジー	8,900	3,020.00	26,878,000	
東京計器	12,900	3,175.00	40,957,500	
愛知時計電機	7,300	2,111.00	15,410,300	
インターアクション	10,200	1,481.00	15,106,200	
オーバル	4,900	451.00	2,209,900	
東京精密	34,500	11,220.00	387,090,000	
マニー	67,500	1,847.50	124,706,250	
ニコン	243,800	1,626.50	396,540,700	
トプコン	82,000	1,697.50	139,195,000	
オリンパス	996,100	2,461.50	2,451,900,150	
理研計器	23,900	3,905.00	93,329,500	
タムロン	10,300	8,500.00	87,550,000	
HOYA	331,900	18,635.00	6,184,956,500	
シード	3,400	555.00	1,887,000	
ノーリツ鋼機	16,000	4,025.00	64,400,000	
A&Dホロンホールディングス	24,600	2,951.00	72,594,600	
朝日インテック	205,500	2,138.00	439,359,000	
シチズン時計	155,100	1,006.00	156,030,600	
リズム	1,300	3,740.00	4,862,000	

大研医器	4,800	540.00	2,592,000	
メニコン	58,000	1,296.00	75,168,000	
シンシア	700	458.00	320,600	
松風	7,600	3,615.00	27,474,000	
セイコーグループ	23,500	4,445.00	104,457,500	
ニプロ	140,600	1,190.50	167,384,300	
KYORITSU	8,300	165.00	1,369,500	
中本パックス	1,800	1,640.00	2,952,000	
パラマウントベッドホールディングス	35,000	2,607.00	91,245,000	
トランザクション	11,100	1,824.00	20,246,400	
粧美堂	1,500	532.00	798,000	
ニホンフラッシュ	15,800	900.00	14,220,000	
前田工織	14,600	3,120.00	45,552,000	
永大産業	6,600	240.00	1,584,000	
アートネイチャー	15,200	800.00	12,160,000	
フルヤ金属	5,300	12,910.00	68,423,000	
バンダイナムコホールディングス	461,900	2,891.50	1,335,583,850	
アイフイスジャパン	1,500	575.00	862,500	
SHOEI	47,400	2,006.00	95,084,400	
フランスベッドホールディングス	21,800	1,148.00	25,026,400	
パイロットコーポレーション	23,700	4,285.00	101,554,500	
萩原工業	11,300	1,497.00	16,916,100	
フジシールインターナショナル	34,100	2,326.00	79,316,600	
タカラトミー	76,700	2,779.00	213,149,300	
広済堂ホールディングス	49,000	581.00	28,469,000	
エステールホールディングス	1,300	641.00	833,300	
タカノ	2,100	926.00	1,944,600	
プロネクサス	17,500	1,211.00	21,192,500	
ホクシン	4,300	116.00	498,800	
ウッドワン	2,000	926.00	1,852,000	
TOPPANホールディングス	207,300	3,955.00	819,871,500	
大日本印刷	174,800	4,767.00	833,271,600	
共同印刷	4,700	3,500.00	16,450,000	
NISSHA	28,900	1,889.00	54,592,100	
光村印刷	500	1,558.00	779,000	
TAKARA & COMPANY	10,000	2,614.00	26,140,000	

アシックス	143,700	8,655.00	1,243,723,500	
ツツミ	3,900	2,204.00	8,595,600	
ローランド	12,400	4,000.00	49,600,000	
小松ウオール工業	6,900	3,200.00	22,080,000	
ヤマハ	106,300	3,450.00	366,735,000	
河合楽器製作所	5,100	3,095.00	15,784,500	
クリナップ	16,500	696.00	11,484,000	
ビジョン	107,400	1,497.00	160,777,800	
キングジム	14,900	890.00	13,261,000	
リンテック	33,800	3,255.00	110,019,000	
イトーキ	34,400	1,526.00	52,494,400	
任天堂	1,064,600	8,269.00	8,803,177,400	
三菱鉛筆	23,900	2,261.00	54,037,900	
タカラスタANDARD	35,300	1,670.00	58,951,000	
コクヨ	69,000	2,608.50	179,986,500	
ナカバヤシ	18,200	523.00	9,518,600	
グローブライト	15,100	2,011.00	30,366,100	
オカムラ	50,800	2,208.00	112,166,400	
美津濃	16,800	7,850.00	131,880,000	
東京電力ホールディングス	1,520,000	926.30	1,407,976,000	
中部電力	621,300	2,110.50	1,311,253,650	
関西電力	651,100	2,815.50	1,833,172,050	
中国電力	292,900	1,126.00	329,805,400	
北陸電力	172,400	1,160.50	200,070,200	
東北電力	443,900	1,547.50	686,935,250	
四国電力	157,000	1,488.00	233,616,000	
九州電力	388,700	1,880.50	730,950,350	
北海道電力	162,900	1,675.00	272,857,500	
沖縄電力	43,100	1,121.00	48,315,100	
電源開発	138,500	2,605.00	360,792,500	
エフオン	12,300	394.00	4,846,200	
イーレックス	30,000	674.00	20,220,000	
レノバ	45,000	1,016.00	45,720,000	
東京瓦斯	328,300	3,411.00	1,119,831,300	
大阪瓦斯	336,000	3,380.00	1,135,680,000	
東邦瓦斯	73,000	3,855.00	281,415,000	

北海道瓦斯	10,100	3,475.00	35,097,500
広島ガス	35,600	374.00	13,314,400
西部ガスホールディングス	17,600	1,897.00	33,387,200
静岡ガス	33,600	944.00	31,718,400
メタウォーター	20,200	1,948.00	39,349,600
SBSホールディングス	15,000	2,508.00	37,620,000
東武鉄道	185,200	2,714.00	502,632,800
相鉄ホールディングス	60,300	2,442.50	147,282,750
東急	472,800	1,823.50	862,150,800
京浜急行電鉄	208,700	1,150.00	240,005,000
小田急電鉄	278,800	1,620.50	451,795,400
京王電鉄	81,100	3,741.00	303,395,100
京成電鉄	108,700	5,444.00	591,762,800
富士急行	20,800	3,010.00	62,608,000
東日本旅客鉄道	929,300	2,796.50	2,598,787,450
西日本旅客鉄道	400,000	3,104.00	1,241,600,000
東海旅客鉄道	649,500	3,445.00	2,237,527,500
西武ホールディングス	204,000	2,352.50	479,910,000
鴻池運輸	28,700	2,195.00	62,996,500
西日本鉄道	45,000	2,434.00	109,530,000
ハマキョウレックス	14,400	3,935.00	56,664,000
サカイ引越センター	18,700	2,286.00	42,748,200
近鉄グループホールディングス	168,300	3,285.00	552,865,500
阪急阪神ホールディングス	224,500	4,050.00	909,225,000
南海電気鉄道	75,100	2,609.50	195,973,450
京阪ホールディングス	92,800	2,903.00	269,398,400
神戸電鉄	4,600	2,793.00	12,847,800
名古屋鉄道	173,600	2,001.00	347,373,600
山陽電気鉄道	12,700	2,067.00	26,250,900
アルプス物流	13,400	5,650.00	75,710,000
ヤマトホールディングス	204,600	1,737.50	355,492,500
山九	42,800	5,492.00	235,057,600
丸運	3,300	350.00	1,155,000
丸全昭和運輸	10,400	4,890.00	50,856,000
センコーグループホールディングス	89,100	1,132.00	100,861,200
トナミホールディングス	3,700	4,815.00	17,815,500

ニッコンホールディングス	53,600	2,897.50	155,306,000
日本石油輸送	600	2,868.00	1,720,800
福山通運	19,200	3,710.00	71,232,000
セイノーホールディングス	94,700	2,015.00	190,820,500
エスライングループ本社	1,600	1,490.00	2,384,000
神奈川中央交通	4,800	3,005.00	14,424,000
AZ-COM丸和ホールディングス	43,000	1,162.00	49,966,000
C&Fロジホールディングス	16,200	4,995.00	80,919,000
九州旅客鉄道	119,000	3,365.00	400,435,000
SGホールディングス	282,700	1,559.00	440,729,300
NIPPON EXPRESSホールディングス	57,100	7,610.00	434,531,000
日本郵船	482,700	5,084.00	2,454,046,800
商船三井	365,700	5,156.00	1,885,549,200
川崎汽船	405,900	2,392.00	970,912,800
NSユニテッド海運	9,200	5,010.00	46,092,000
飯野海運	62,300	1,365.00	85,039,500
共栄タンカー	1,700	1,183.00	2,011,100
乾汽船	20,400	1,080.00	22,032,000
日本航空	413,500	2,624.00	1,085,024,000
ANAホールディングス	458,100	2,980.00	1,365,138,000
パスコ	1,100	1,820.00	2,002,000
トランコム	4,900	6,000.00	29,400,000
日新	12,800	4,385.00	56,128,000
三菱倉庫	41,300	5,158.00	213,025,400
三井倉庫ホールディングス	15,700	4,185.00	65,704,500
住友倉庫	45,200	2,503.00	113,135,600
澁澤倉庫	7,700	3,000.00	23,100,000
東陽倉庫	1,500	1,485.00	2,227,500
日本トランスシティ	33,900	853.00	28,916,700
ケイヒン	1,000	2,015.00	2,015,000
中央倉庫	9,000	1,151.00	10,359,000
川西倉庫	1,000	1,141.00	1,141,000
安田倉庫	11,500	1,426.00	16,399,000
ファイズホールディングス	800	992.00	793,600
東洋埠頭	1,600	1,344.00	2,150,400

上組	77,700	3,098.00	240,714,600	
サンリツ	1,400	858.00	1,201,200	
キムラユニティー	2,700	1,696.00	4,579,200	
キューソー流通システム	8,600	1,163.00	10,001,800	
東海運	3,300	290.00	957,000	
エーアイテイー	10,600	1,777.00	18,836,200	
内外トランスライン	6,700	2,515.00	16,850,500	
日本コンセプト	6,100	1,835.00	11,193,500	
NEC ネットエスアイ	65,900	2,185.00	143,991,500	
クロスキャット	10,700	1,255.00	13,428,500	
システナ	255,900	271.00	69,348,900	
デジタルアーツ	10,700	3,560.00	38,092,000	
日鉄ソリューションズ	28,900	4,920.00	142,188,000	
キューブシステム	9,000	1,080.00	9,720,000	
コア	7,500	1,839.00	13,792,500	
手間いらず	2,900	2,843.00	8,244,700	
ラクーンホールディングス	12,600	652.00	8,215,200	
ソリトンシステムズ	8,700	1,139.00	9,909,300	
ソフトクリエイトホールディングス	13,900	1,939.00	26,952,100	
T I S	178,800	2,814.00	503,143,200	
テクミラホールディングス	2,600	389.00	1,011,400	
グリー	56,700	503.00	28,520,100	
GMOペパボ	2,100	1,384.00	2,906,400	
コーエーテクモホールディングス	106,000	1,237.50	131,175,000	
三菱総合研究所	8,300	4,575.00	37,972,500	
電算	700	1,481.00	1,036,700	
A G S	2,300	940.00	2,162,000	
ファインデックス	13,400	917.00	12,287,800	
ブレインパッド	14,100	1,072.00	15,115,200	
K L a b	31,100	217.00	6,748,700	
ポールトゥウィンホールディングス	28,900	452.00	13,062,800	
ネクソン	371,000	2,620.50	972,205,500	
アイスタイル	56,500	441.00	24,916,500	
エムアップホールディングス	20,700	1,172.00	24,260,400	
エイチーム	11,300	648.00	7,322,400	
エニグモ	21,600	322.00	6,955,200	

テクノスジャパン	5,000	609.00	3,045,000	
コロプラ	65,300	562.00	36,698,600	
ブロードリーフ	80,300	482.00	38,704,600	
クロス・マーケティンググループ	2,700	572.00	1,544,400	
デジタルハーツホールディングス	10,600	917.00	9,720,200	
メディアドゥ	7,600	1,377.00	10,465,200	
じげん	49,300	601.00	29,629,300	
ブイキューブ	20,300	236.00	4,790,800	
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	617.00	802,100	
サイバーリンクス	2,200	713.00	1,568,600	
フィックスターズ	19,000	1,755.00	33,345,000	
CARTA HOLDINGS	8,000	1,584.00	12,672,000	
オブティム	17,400	689.00	11,988,600	
セレス	6,800	1,967.00	13,375,600	
SHIFT	11,200	16,055.00	179,816,000	
ティーガイア	17,700	1,896.00	33,559,200	
セック	2,300	4,205.00	9,671,500	
テクマトリックス	30,900	1,792.00	55,372,800	
プロシップ	8,100	1,391.00	11,267,100	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,000	2,571.50	113,146,000	
GMOペイメントゲートウェイ	38,600	7,133.00	275,333,800	
ザッパラス	1,300	416.00	540,800	
システムリサーチ	11,600	1,520.00	17,632,000	
インターネットイニシアティブ	80,800	2,186.00	176,628,800	
さくらインターネット	19,000	5,130.00	97,470,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	2,771.00	14,409,200	
SRAホールディングス	8,700	3,940.00	34,278,000	
システムインテグレータ	1,700	359.00	610,300	
朝日ネット	18,200	642.00	11,684,400	
eBASE	23,800	663.00	15,779,400	
アバントグループ	21,400	1,281.00	27,413,400	
アドソル日進	7,100	1,590.00	11,289,000	
ODKソリューションズ	1,100	589.00	647,900	
フリービット	7,400	1,381.00	10,219,400	
コムチュア	24,400	1,794.00	43,773,600	
アステリア	13,300	535.00	7,115,500	

アイル	9,500	2,581.00	24,519,500	
マークライNZ	9,200	2,995.00	27,554,000	
メディカル・データ・ビジョン	20,200	487.00	9,837,400	
g u m i	27,500	358.00	9,845,000	
ショーケース	1,300	285.00	370,500	
モバイルファクトリー	1,200	657.00	788,400	
テラスカイ	7,300	1,838.00	13,417,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,800	1,645.00	14,476,000	
P C I ホールディングス	2,300	931.00	2,141,300	
アイビーシー	900	450.00	405,000	
ネオジャパン	5,700	1,339.00	7,632,300	
P R T I M E S	3,400	1,675.00	5,695,000	
ラクス	80,000	1,693.00	135,440,000	
ランドコンピュータ	2,700	826.00	2,230,200	
ダブルスタンダード	5,100	1,645.00	8,389,500	
オープンドア	9,900	578.00	5,722,200	
アカツキ	8,200	2,017.00	16,539,400	
ベネフィットジャパン	400	1,154.00	461,600	
U b i c o mホールディングス	5,300	1,106.00	5,861,800	
カナミックネットワーク	21,300	495.00	10,543,500	
ノムラシステムコーポレーション	6,200	130.00	806,000	
チェンジホールディングス	36,800	1,143.00	42,062,400	
シンクロ・フード	3,600	563.00	2,026,800	
オークネット	6,300	2,266.00	14,275,800	
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	779.00	856,900	
セグエグループ	5,200	568.00	2,953,600	
エイトレッド	900	1,522.00	1,369,800	
マクロミル	33,200	864.00	28,684,800	
ビーグリー	1,200	1,087.00	1,304,400	
オロ	6,100	2,684.00	16,372,400	
ユーザーローカル	7,100	2,017.00	14,320,700	
テモナ	1,400	215.00	301,000	
ニーズウェル	3,100	764.00	2,368,400	
マネーフォワード	37,800	5,278.00	199,508,400	
サインポスト	2,200	641.00	1,410,200	
S u n A s t e r i s k	12,000	826.00	9,912,000	

プラスアルファ・コンサルティング	21,300	1,821.00	38,787,300
電算システムホールディングス	7,500	2,495.00	18,712,500
Appier Group	57,900	1,235.00	71,506,500
ビジョナル	19,800	7,370.00	145,926,000
ソルクシーズ	4,600	311.00	1,430,600
フェイス	1,600	420.00	672,000
プロトコーポレーション	18,500	1,318.00	24,383,000
ハイマックス	5,300	1,331.00	7,054,300
野村総合研究所	366,200	4,085.00	1,495,927,000
CEホールディングス	2,700	542.00	1,463,400
日本システム技術	14,100	1,553.00	21,897,300
インテージホールディングス	19,100	1,372.00	26,205,200
東邦システムサイエンス	6,900	1,341.00	9,252,900
ソースネクスト	77,500	190.00	14,725,000
インフォコム	21,700	4,550.00	98,735,000
シンプレクス・ホールディングス	25,700	2,640.00	67,848,000
HEROZ	6,700	1,260.00	8,442,000
ラクスル	40,800	838.00	34,190,400
メルカリ	82,500	1,779.00	146,767,500
I P S	4,900	2,093.00	10,255,700
F I G	6,500	326.00	2,119,000
システムサポート	6,600	1,865.00	12,309,000
イーソル	12,200	903.00	11,016,600
東海ソフト	900	1,350.00	1,215,000
ウイングアーク1st	17,600	2,784.00	48,998,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,700	910.00	5,187,000
サーバーワークス	3,500	2,932.00	10,262,000
東名	600	2,335.00	1,401,000
ヴィッツ	600	781.00	468,600
トビラシステムズ	1,600	773.00	1,236,800
S a n s a n	55,500	1,603.00	88,966,500
L i n k - U グループ	1,100	631.00	694,100
ギフトィ	14,800	1,051.00	15,554,800
メドレー	22,700	3,080.00	69,916,000
ベース	5,900	2,877.00	16,974,300

JMDC	28,800	2,577.00	74,217,600	
フォーカスシステムズ	11,300	1,072.00	12,113,600	
クレスコ	13,900	2,302.00	31,997,800	
フジ・メディア・ホールディングス	162,400	1,660.50	269,665,200	
オービック	56,500	20,265.00	1,144,972,500	
ジャストシステム	24,300	2,537.00	61,649,100	
TDCソフト	31,700	1,034.00	32,777,800	
LINEヤフー	2,407,800	358.80	863,918,640	
トレンドマイクロ	80,000	7,133.00	570,640,000	
IDホールディングス	11,400	1,380.00	15,732,000	
日本オラクル	32,400	11,945.00	387,018,000	
アルファシステムズ	4,400	2,712.00	11,932,800	
フューチャー	36,100	1,486.00	53,644,600	
CAC Holdings	9,100	1,878.00	17,089,800	
SBテクノロジー	7,100	2,945.00	20,909,500	
トーセ	1,600	687.00	1,099,200	
オービックビジネスコンサルタント	23,800	6,358.00	151,320,400	
アイティフォー	21,700	1,302.00	28,253,400	
東計電算	4,700	3,590.00	16,873,000	
エクスネット	800	1,478.00	1,182,400	
大塚商会	167,700	2,901.00	486,497,700	
サイボウズ	23,300	1,527.00	35,579,100	
電通総研	20,600	5,090.00	104,854,000	
ACCESS	17,600	1,410.00	24,816,000	
デジタルガレージ	27,000	2,335.00	63,045,000	
EMシステムズ	28,200	626.00	17,653,200	
ウェザーニューズ	5,200	4,515.00	23,478,000	
C I J	42,200	436.00	18,399,200	
ビジネスエンジニアリング	3,500	3,295.00	11,532,500	
日本エンタープライズ	5,900	131.00	772,900	
WOWOW	12,700	1,032.00	13,106,400	
スカラ	15,700	705.00	11,068,500	
インテリジェント ウェイブ	3,000	1,043.00	3,129,000	
ANYCOLOR	23,900	2,128.00	50,859,200	
IMAGICA GROUP	17,000	517.00	8,789,000	
ネットワンシステムズ	67,900	2,900.00	196,910,000	

システムソフト	59,100	61.00	3,605,100	
アルゴグラフィックス	15,500	3,905.00	60,527,500	
マーベラス	27,500	590.00	16,225,000	
エイベックス	28,800	1,183.00	34,070,400	
B I P R O G Y	55,300	4,075.00	225,347,500	
都築電気	8,900	2,200.00	19,580,000	
T B S ホールディングス	85,000	3,387.00	287,895,000	
日本テレビホールディングス	149,700	2,063.00	308,831,100	
朝日放送グループホールディングス	15,900	647.00	10,287,300	
テレビ朝日ホールディングス	41,100	1,898.00	78,007,800	
スカパー J S A T ホールディングス	131,400	875.00	114,975,000	
テレビ東京ホールディングス	12,200	2,980.00	36,356,000	
日本BS放送	2,000	885.00	1,770,000	
ビジョン	25,500	1,157.00	29,503,500	
スマートバリュー	1,600	400.00	640,000	
U-NEXT HOLDINGS	19,000	4,345.00	82,555,000	
ワイヤレスゲート	2,500	225.00	562,500	
日本通信	166,600	179.00	29,821,400	
クロップス	700	1,068.00	747,600	
日本電信電話	50,303,700	152.00	7,646,162,400	
K D D I	1,306,800	4,276.00	5,587,876,800	
ソフトバンク	2,699,100	1,874.50	5,059,462,950	
光通信	17,000	24,740.00	420,580,000	
エムティーアイ	11,600	852.00	9,883,200	
GMOインターネットグループ	62,200	2,459.50	152,980,900	
ファイバーゲート	9,100	1,239.00	11,274,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,600	230.00	368,000	
KADOKAWA	89,400	3,177.00	284,023,800	
学研ホールディングス	30,400	964.00	29,305,600	
ゼンリン	28,900	837.00	24,189,300	
昭文社ホールディングス	2,400	354.00	849,600	
インプレスホールディングス	5,700	158.00	900,600	
アイネット	10,200	2,242.00	22,868,400	
松竹	8,800	9,181.00	80,792,800	
東宝	94,100	4,840.00	455,444,000	
東映	27,900	3,400.00	94,860,000	

NTTデータグループ	442,200	2,356.00	1,041,823,200	
ピー・シー・エー	9,700	1,930.00	18,721,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	2,086.00	13,767,600	
D T S	35,500	4,070.00	144,485,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,300	4,509.00	348,545,700	
シーイーシー	21,300	1,680.00	35,784,000	
カプコン	302,500	2,730.00	825,825,000	
アイ・エス・ビー	8,700	1,374.00	11,953,800	
S C S K	118,300	2,943.00	348,156,900	
N S W	7,500	2,961.00	22,207,500	
アイネス	13,200	1,644.00	21,700,800	
T K C	29,400	3,265.00	95,991,000	
富士ソフト	34,000	6,270.00	213,180,000	
N S D	60,000	2,761.00	165,660,000	
コナミグループ	63,300	10,905.00	690,286,500	
福井コンピュータホールディングス	10,400	2,176.00	22,630,400	
J B C Cホールディングス	11,200	3,000.00	33,600,000	
ミロク情報サービス	15,400	1,825.00	28,105,000	
ソフトバンクグループ	834,200	8,964.00	7,477,768,800	
リョーサン菱洋ホールディングス	33,600	3,205.00	107,688,000	
高千穂交易	6,300	3,575.00	22,522,500	
オルバヘルスケアホールディングス	1,000	2,138.00	2,138,000	
伊藤忠食品	4,000	6,920.00	27,680,000	
エレマテック	16,000	1,988.00	31,808,000	
あらた	27,300	3,135.00	85,585,500	
トーメンデバイス	2,600	7,160.00	18,616,000	
東京エレクトロン デバイス	17,800	4,495.00	80,011,000	
円谷フィールズホールディングス	30,600	1,470.00	44,982,000	
双日	198,600	4,070.00	808,302,000	
アルフレッサ ホールディングス	179,100	2,122.00	380,050,200	
横浜冷凍	48,400	982.00	47,528,800	
ラサ商事	7,900	1,730.00	13,667,000	
アルコニックス	23,500	1,456.00	34,216,000	
神戸物産	138,000	3,380.00	466,440,000	
ハイパー	1,400	297.00	415,800	
あい ホールディングス	28,600	2,443.00	69,869,800	

ディービーエックス	1,600	1,000.00	1,600,000	
ダイワボウホールディングス	79,000	2,716.00	214,564,000	
マクニカホールディングス	42,200	6,392.00	269,742,400	
ラクト・ジャパン	7,000	2,743.00	19,201,000	
グリムス	7,500	2,023.00	15,172,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,000	1,290.00	34,830,000	
八洲電機	14,400	1,436.00	20,678,400	
メディアスホールディングス	10,400	858.00	8,923,200	
レスター	15,200	2,911.00	44,247,200	
ジオリーブグループ	1,400	1,198.00	1,677,200	
大光	3,100	640.00	1,984,000	
OCHIホールディングス	1,400	1,449.00	2,028,600	
TOKAIホールディングス	96,900	948.00	91,861,200	
黒谷	1,600	721.00	1,153,600	
C o m i n i x	1,200	850.00	1,020,000	
三洋貿易	20,000	1,579.00	31,580,000	
ビューティガレージ	5,600	2,025.00	11,340,000	
ウイン・パートナーズ	11,600	1,129.00	13,096,400	
ミタチ産業	1,700	1,123.00	1,909,100	
シップヘルスケアホールディングス	64,100	2,230.00	142,943,000	
明治電機工業	6,600	1,638.00	10,810,800	
デリカフーズホールディングス	2,600	574.00	1,492,400	
スターティアホールディングス	1,600	2,037.00	3,259,200	
コメダホールディングス	43,700	2,614.00	114,231,800	
ピーバンドットコム	800	373.00	298,400	
アセンテック	6,900	551.00	3,801,900	
富士興産	1,700	1,647.00	2,799,900	
協栄産業	600	2,740.00	1,644,000	
フルサト・マルカホールディングス	15,900	2,148.00	34,153,200	
ヤマエグループホールディングス	15,700	2,271.00	35,654,700	
小野建	17,800	1,585.00	28,213,000	
南陽	2,400	1,101.00	2,642,400	
佐島電機	11,200	2,096.00	23,475,200	
エコートレーディング	1,200	1,221.00	1,465,200	
伯東	10,200	5,050.00	51,510,000	
コンドーテック	13,700	1,280.00	17,536,000	

中山福	3,200	362.00	1,158,400	
ナガイレーベン	22,500	2,272.00	51,120,000	
三菱食品	16,500	5,090.00	83,985,000	
松田産業	13,600	2,789.00	37,930,400	
第一興商	69,000	1,615.00	111,435,000	
メディパルホールディングス	181,400	2,240.00	406,336,000	
S P K	7,900	2,037.00	16,092,300	
萩原電気ホールディングス	7,700	3,945.00	30,376,500	
アズワン	55,600	2,340.00	130,104,000	
スズデン	6,200	1,816.00	11,259,200	
尾家産業	1,400	1,922.00	2,690,800	
シモジマ	11,900	1,258.00	14,970,200	
ドウシシャ	16,500	2,180.00	35,970,000	
小津産業	1,300	1,819.00	2,364,700	
高速	10,600	2,112.00	22,387,200	
たけびし	6,800	2,091.00	14,218,800	
リックス	3,900	3,035.00	11,836,500	
丸文	15,900	1,213.00	19,286,700	
ハピネット	15,200	3,435.00	52,212,000	
橋本総業ホールディングス	7,100	1,284.00	9,116,400	
日本ライフライン	52,000	1,120.00	58,240,000	
タカショー	15,600	488.00	7,612,800	
I D O M	47,200	1,293.00	61,029,600	
進和	10,900	2,722.00	29,669,800	
エスケイジャパン	1,500	845.00	1,267,500	
ダイトロン	7,000	3,090.00	21,630,000	
シークス	25,400	1,288.00	32,715,200	
田中商事	1,700	770.00	1,309,000	
オーハシテクニカ	9,400	1,646.00	15,472,400	
白銅	5,000	2,960.00	14,800,000	
ダイコー通産	600	1,301.00	780,600	
伊藤忠商事	1,199,200	7,288.00	8,739,769,600	
丸紅	1,479,800	3,094.00	4,578,501,200	
高島	4,000	1,045.00	4,180,000	
長瀬産業	81,800	3,046.00	249,162,800	
蝶理	11,200	3,535.00	39,592,000	

豊田通商	156,300	9,583.00	1,497,822,900	
三共生興	24,700	728.00	17,981,600	
兼松	74,600	2,589.00	193,139,400	
ツカモトコーポレーション	800	1,171.00	936,800	
三井物産	1,336,300	8,065.00	10,777,259,500	
日本紙パルプ商事	8,500	5,910.00	50,235,000	
カメイ	19,000	2,020.00	38,380,000	
東都水産	500	6,430.00	3,215,000	
ＯＵＧホールディングス	900	2,638.00	2,374,200	
スターゼン	12,300	2,739.00	33,689,700	
山善	54,100	1,333.00	72,115,300	
椿本興業	11,100	2,118.00	23,509,800	
住友商事	1,079,700	4,048.00	4,370,625,600	
内田洋行	7,200	6,900.00	49,680,000	
三菱商事	3,425,600	3,357.00	11,499,739,200	
第一実業	16,800	2,303.00	38,690,400	
キャノンマーケティングジャパン	41,300	4,360.00	180,068,000	
西華産業	7,000	3,865.00	27,055,000	
佐藤商事	12,400	1,633.00	20,249,200	
東京産業	16,300	636.00	10,366,800	
ユアサ商事	13,900	5,370.00	74,643,000	
神鋼商事	4,500	6,950.00	31,275,000	
トルク	4,300	236.00	1,014,800	
阪和興業	32,000	6,640.00	212,480,000	
正栄食品工業	11,900	4,405.00	52,419,500	
カナデン	13,400	1,586.00	21,252,400	
RYODEN	14,400	2,512.00	36,172,800	
岩谷産業	40,600	9,002.00	365,481,200	
ナイス	1,800	1,803.00	3,245,400	
ニチモウ	1,900	2,038.00	3,872,200	
極東貿易	10,700	1,696.00	18,147,200	
アステナホールディングス	33,600	483.00	16,228,800	
三愛オブリ	41,600	2,045.00	85,072,000	
稲畑産業	35,300	3,305.00	116,666,500	
G S I クレオス	9,600	2,145.00	20,592,000	
明和産業	21,100	721.00	15,213,100	

クワザワホールディングス	2,100	912.00	1,915,200	
ワキタ	29,500	1,566.00	46,197,000	
東邦ホールディングス	49,100	3,828.00	187,954,800	
サンゲツ	41,100	2,932.00	120,505,200	
ミツウロコグループホールディングス	22,800	1,262.00	28,773,600	
シナネンホールディングス	4,900	4,645.00	22,760,500	
伊藤忠エネクス	44,200	1,520.00	67,184,000	
サンリオ	144,900	2,341.00	339,210,900	
サンワテクノス	9,100	2,240.00	20,384,000	
新光商事	24,000	934.00	22,416,000	
トーヨー	7,000	3,015.00	21,105,000	
三信電気	7,200	2,100.00	15,120,000	
東陽テクニカ	18,000	1,495.00	26,910,000	
モスフードサービス	26,200	3,400.00	89,080,000	
加賀電子	16,300	5,740.00	93,562,000	
ソーダニッカ	15,800	1,037.00	16,384,600	
立花エレテック	11,800	2,939.00	34,680,200	
フォーバル	7,000	1,271.00	8,897,000	
PAL TAC	24,000	4,127.00	99,048,000	
三谷産業	31,200	353.00	11,013,600	
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,500	4,065.00	18,292,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	500	2,693.00	1,346,500	
コーア商事ホールディングス	12,500	727.00	9,087,500	
K P Pグループホールディングス	46,200	810.00	37,422,000	
ヤマタネ	7,900	2,711.00	21,416,900	
丸紅建材リース	500	3,060.00	1,530,000	
泉州電業	11,100	5,700.00	63,270,000	
トラスコ中山	37,500	2,429.00	91,087,500	
オートバックスセブン	62,100	1,515.50	94,112,550	
モリト	12,800	1,460.00	18,688,000	
加藤産業	22,100	4,050.00	89,505,000	
北恵	1,500	855.00	1,282,500	
イエローハット	28,300	2,014.00	56,996,200	
J Kホールディングス	13,700	1,021.00	13,987,700	
日伝	12,000	3,135.00	37,620,000	
北沢産業	3,600	351.00	1,263,600	

杉本商事	8,600	2,356.00	20,261,600
因幡電機産業	46,300	3,715.00	172,004,500
東テク	17,900	2,575.00	46,092,500
ミスミグループ本社	269,400	2,765.00	744,891,000
アルテック	3,200	270.00	864,000
タキヒヨー	1,400	1,116.00	1,562,400
蔵王産業	1,100	2,524.00	2,776,400
スズケン	63,700	4,602.00	293,147,400
ジェコス	10,700	982.00	10,507,400
サンエー	13,700	4,690.00	64,253,000
カワチ薬品	14,100	2,823.00	39,804,300
エービーシー・マート	78,200	2,910.50	227,601,100
ハードオフコーポレーション	7,300	2,015.00	14,709,500
アスクル	43,200	2,173.00	93,873,600
ゲオホールディングス	20,200	1,694.00	34,218,800
アダストリア	21,600	3,445.00	74,412,000
くら寿司	21,000	4,700.00	98,700,000
キャンドウ	6,500	2,881.00	18,726,500
I Kホールディングス	3,000	419.00	1,257,000
パルグループホールディングス	35,200	1,773.00	62,409,600
エディオン	70,900	1,534.00	108,760,600
サーラコーポレーション	37,900	802.00	30,395,800
ワッツ	3,000	644.00	1,932,000
ハローズ	8,200	4,190.00	34,358,000
あみやき亭	4,400	5,980.00	26,312,000
大黒天物産	5,500	7,840.00	43,120,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,639.00	26,224,000
ファーマライズホールディングス	1,900	640.00	1,216,000
アルペン	14,900	1,975.00	29,427,500
ハブ	2,400	827.00	1,984,800
クオールホールディングス	24,700	1,443.00	35,642,100
ジーンズホールディングス	13,700	3,660.00	50,142,000
ビックカメラ	107,000	1,529.00	163,603,000
DCMホールディングス	94,500	1,495.00	141,277,500
Monotaro	253,100	1,570.00	397,367,000
東京一番フーズ	2,400	514.00	1,233,600

きちりホールディングス	1,700	920.00	1,564,000	
J. フロント リテイリング	205,000	1,473.00	301,965,000	
ドトール・日レスホールディングス	31,800	2,117.00	67,320,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	324,700	2,148.50	697,617,950	
ブロンコビリー	10,600	3,910.00	41,446,000	
ZOZO	113,800	3,528.00	401,486,400	
トレジャー・ファクトリー	11,300	1,517.00	17,142,100	
物語コーポレーション	29,900	3,400.00	101,660,000	
三越伊勢丹ホールディングス	300,800	3,188.00	958,950,400	
H a m e e	7,500	1,280.00	9,600,000	
マーケットエンタープライズ	1,000	741.00	741,000	
ウエルシアホールディングス	92,700	2,124.50	196,941,150	
クリエイトSDホールディングス	25,400	3,275.00	83,185,000	
丸善CHIホールディングス	8,000	333.00	2,664,000	
ミサワ	1,800	618.00	1,112,400	
ティーライフ	1,100	1,389.00	1,527,900	
チムニー	1,800	1,290.00	2,322,000	
シュッピン	16,400	1,259.00	20,647,600	
オイシックス・ラ・大地	24,300	1,106.00	26,875,800	
ネクステージ	40,900	2,485.00	101,636,500	
ジョイフル本田	52,100	2,077.00	108,211,700	
エターナルホスピタリティグループ	6,700	3,780.00	25,326,000	
ホットランド	13,800	2,547.00	35,148,600	
すかいらーくホールディングス	244,000	2,120.00	517,280,000	
SFPホールディングス	8,600	2,020.00	17,372,000	
綿半ホールディングス	14,100	1,571.00	22,151,100	
ヨシックスホールディングス	4,200	2,736.00	11,491,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,200	863.00	43,322,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	512.00	4,454,400	
B E E N O S	10,800	2,057.00	22,215,600	
あさひ	16,800	1,409.00	23,671,200	
日本調剤	12,000	1,386.00	16,632,000	
コスモス薬品	15,200	12,860.00	195,472,000	
トーエル	3,100	780.00	2,418,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,826,500	2,025.00	3,698,662,500	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,800	1,041.00	125,752,800	
ツルハホールディングス	37,500	9,060.00	339,750,000	
サンマルクホールディングス	14,500	2,100.00	30,450,000	
フェリシモ	1,700	915.00	1,555,500	
トリドールホールディングス	50,100	3,707.00	185,720,700	
TOKYO BASE	21,500	298.00	6,407,000	
ウイルプラスホールディングス	1,500	1,044.00	1,566,000	
JMホールディングス	13,600	2,774.00	37,726,400	
サツドラホールディングス	2,800	858.00	2,402,400	
アレンザホールディングス	13,700	1,096.00	15,015,200	
串カツ田中ホールディングス	5,000	1,581.00	7,905,000	
バロックジャパンリミテッド	14,300	776.00	11,096,800	
クスリのアオキホールディングス	53,800	3,060.00	164,628,000	
力の源ホールディングス	10,300	1,376.00	14,172,800	
FOOD & LIFE COMPANIES	95,300	2,824.00	269,127,200	
メディカルシステムネットワーク	19,900	607.00	12,079,300	
はるやまホールディングス	3,400	581.00	1,975,400	
ノジマ	52,000	1,671.00	86,892,000	
カッパ・クリエイト	28,000	1,617.00	45,276,000	
ライトオン	4,500	380.00	1,710,000	
良品計画	212,600	2,518.50	535,433,100	
パリミキホールディングス	8,300	354.00	2,938,200	
アドヴァングループ	16,900	1,006.00	17,001,400	
アルビス	6,000	2,605.00	15,630,000	
コナカ	7,000	296.00	2,072,000	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,587.00	1,587,000	
G-7ホールディングス	19,700	1,511.00	29,766,700	
イオン北海道	52,900	913.00	48,297,700	
コジマ	34,800	854.00	29,719,200	
ヒマラヤ	2,500	910.00	2,275,000	
コーナン商事	21,900	4,155.00	90,994,500	
エコス	6,800	2,207.00	15,007,600	
ワタミ	18,800	882.00	16,581,600	
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	360,300	3,978.00	1,433,273,400	
西松屋チェーン	35,300	2,191.00	77,342,300	

ゼンショーホールディングス	90,900	6,116.00	555,944,400
幸楽苑ホールディングス	13,200	1,231.00	16,249,200
ハークスレイ	2,200	774.00	1,702,800
サイゼリヤ	26,400	5,010.00	132,264,000
VTホールディングス	69,700	482.00	33,595,400
魚力	6,400	2,360.00	15,104,000
フジ・コーポレーション	8,700	1,753.00	15,251,100
ユナイテッドアローズ	21,200	1,705.00	36,146,000
ハイデイ日高	26,600	2,860.00	76,076,000
YU-WA Creation Holdings	5,700	128.00	729,600
コロワイド	76,700	1,966.50	150,830,550
壺番屋	70,800	1,103.00	78,092,400
PLANT	1,500	1,553.00	2,329,500
スギホールディングス	108,000	2,285.50	246,834,000
薬王堂ホールディングス	8,800	2,735.00	24,068,000
スクロール	26,900	1,034.00	27,814,600
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,870.00	31,977,000
木曾路	27,100	2,458.00	66,611,800
SRSホールディングス	29,700	1,170.00	34,749,000
千趣会	32,800	319.00	10,463,200
リテールパートナーズ	26,700	1,613.00	43,067,100
上新電機	17,800	2,540.00	45,212,000
日本瓦斯	94,700	2,339.00	221,503,300
ロイヤルホールディングス	31,400	2,592.00	81,388,800
いなげや	17,400	1,221.00	21,245,400
チヨダ	17,400	890.00	15,486,000
ライフコーポレーション	18,700	4,065.00	76,015,500
リンガーハット	23,000	2,275.00	52,325,000
MrMaxHD	23,000	654.00	15,042,000
AOKIホールディングス	38,500	1,234.00	47,509,000
オークワ	25,800	902.00	23,271,600
コメリ	27,500	3,635.00	99,962,500
青山商事	38,400	1,480.00	56,832,000
しまむら	41,900	7,475.00	313,202,500
はせがわ	3,800	339.00	1,288,200

高島屋	123,300	2,447.50	301,776,750	
松屋	30,400	960.00	29,184,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,000	2,384.00	188,336,000	
近鉄百貨店	7,800	2,106.00	16,426,800	
丸井グループ	118,500	2,267.50	268,698,750	
アクシアル リテイリング	49,000	971.00	47,579,000	
イオン	604,800	3,287.00	1,987,977,600	
イズミ	31,700	3,318.00	105,180,600	
平和堂	29,900	2,320.00	69,368,000	
フジ	27,400	1,880.00	51,512,000	
ヤオコー	21,100	8,994.00	189,773,400	
ゼビオホールディングス	24,500	1,128.00	27,636,000	
ケーズホールディングス	120,100	1,419.00	170,421,900	
O l y m p i c グループ	3,300	509.00	1,679,700	
日産東京販売ホールディングス	9,400	507.00	4,765,800	
シルバーライフ	5,200	880.00	4,576,000	
G e n k y D r u g S t o r e s	7,900	5,590.00	44,161,000	
ナルミヤ・インターナショナル	1,200	1,307.00	1,568,400	
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,503.00	17,885,700	
ギフトホールディングス	7,700	2,898.00	22,314,600	
アインホールディングス	24,600	5,748.00	141,400,800	
元気寿司	10,200	3,125.00	31,875,000	
ヤマダホールディングス	549,500	432.80	237,823,600	
アークランズ	53,300	1,914.00	102,016,200	
ニトリホールディングス	65,000	17,230.00	1,119,950,000	
グルメ杵屋	14,800	1,085.00	16,058,000	
愛眼	4,400	182.00	800,800	
ケーユーホールディングス	8,700	1,165.00	10,135,500	
吉野家ホールディングス	65,800	2,855.00	187,859,000	
松屋フーズホールディングス	8,500	5,290.00	44,965,000	
サガミホールディングス	27,000	1,508.00	40,716,000	
関西フードマーケット	12,300	2,470.00	30,381,000	
王将フードサービス	13,300	8,490.00	112,917,000	
ミニストップ	13,000	1,555.00	20,215,000	
アークス	32,800	2,892.00	94,857,600	
パローホールディングス	34,200	2,367.00	80,951,400	

ベルク	8,900	7,150.00	63,635,000	
大庄	9,800	1,200.00	11,760,000	
ファーストリテイリング	100,300	40,420.00	4,054,126,000	
サンドラッグ	60,300	3,880.00	233,964,000	
サクスパー ホールディングス	15,500	753.00	11,671,500	
ヤマザワ	1,500	1,268.00	1,902,000	
やまや	1,300	3,015.00	3,919,500	
ベルーナ	43,500	706.00	30,711,000	
いよぎんホールディングス	197,600	1,427.50	282,074,000	
しずおかフィナンシャルグループ	369,000	1,549.50	571,765,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	139,800	1,642.00	229,551,600	
楽天銀行	77,000	2,839.00	218,603,000	
京都フィナンシャルグループ	210,400	2,697.00	567,448,800	
島根銀行	1,600	561.00	897,600	
じもとホールディングス	4,900	368.00	1,803,200	
めぶきフィナンシャルグループ	769,600	610.70	469,994,720	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,300	4,685.00	99,790,500	
九州フィナンシャルグループ	321,400	1,017.00	326,863,800	
ゆうちょ銀行	1,824,900	1,528.50	2,789,359,650	
富山第一銀行	52,700	1,107.00	58,338,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	891,100	936.90	834,871,590	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,200	2,075.00	193,390,000	
三十三フィナンシャルグループ	14,900	2,071.00	30,857,900	
第四北越フィナンシャルグループ	26,100	4,880.00	127,368,000	
ひろぎんホールディングス	236,400	1,234.00	291,717,600	
おきなわフィナンシャルグループ	14,200	2,597.00	36,877,400	
十六フィナンシャルグループ	21,500	4,605.00	99,007,500	
北國フィナンシャルホールディングス	17,500	5,190.00	90,825,000	
プロクレアホールディングス	19,000	1,800.00	34,200,000	
あいちフィナンシャルグループ	34,100	2,581.00	88,012,100	
あおぞら銀行	119,300	2,359.50	281,488,350	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,113,500	1,637.00	16,555,799,500	
りそなホールディングス	1,920,600	1,024.00	1,966,694,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	596,300	3,554.00	2,119,250,200	
三井住友フィナンシャルグループ	1,180,700	10,040.00	11,854,228,000	
千葉銀行	462,800	1,432.00	662,729,600	

群馬銀行	322,300	1,043.50	336,320,050	
武蔵野銀行	23,200	3,150.00	73,080,000	
千葉興業銀行	35,300	966.00	34,099,800	
筑波銀行	72,900	316.00	23,036,400	
七十七銀行	48,300	4,615.00	222,904,500	
秋田銀行	11,100	2,444.00	27,128,400	
山形銀行	18,400	1,114.00	20,497,600	
岩手銀行	10,500	2,675.00	28,087,500	
東邦銀行	131,400	337.00	44,281,800	
東北銀行	2,700	1,212.00	3,272,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	144,600	4,413.00	638,119,800	
スルガ銀行	146,400	1,036.00	151,670,400	
八十二銀行	356,400	1,065.50	379,744,200	
山梨中央銀行	18,600	1,936.00	36,009,600	
大垣共立銀行	31,700	2,214.00	70,183,800	
福井銀行	14,800	1,938.00	28,682,400	
清水銀行	6,600	1,593.00	10,513,800	
富山銀行	900	1,816.00	1,634,400	
滋賀銀行	27,600	4,245.00	117,162,000	
南都銀行	25,000	3,515.00	87,875,000	
百五銀行	156,200	668.00	104,341,600	
紀陽銀行	59,400	1,857.00	110,305,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	102,800	2,176.00	223,692,800	
山陰合同銀行	103,900	1,430.00	148,577,000	
鳥取銀行	1,900	1,365.00	2,593,500	
百十四銀行	16,300	3,295.00	53,708,500	
四国銀行	24,300	1,119.00	27,191,700	
阿波銀行	23,300	2,793.00	65,076,900	
大分銀行	10,000	3,395.00	33,950,000	
宮崎銀行	10,000	3,370.00	33,700,000	
佐賀銀行	9,700	2,631.00	25,520,700	
琉球銀行	35,300	1,215.00	42,889,500	
セブン銀行	520,500	262.60	136,683,300	
みずほフィナンシャルグループ	2,241,600	3,132.00	7,020,691,200	
高知銀行	1,900	886.00	1,683,400	
山口フィナンシャルグループ	162,800	1,831.00	298,086,800	

名古屋銀行	10,600	7,320.00	77,592,000	
北洋銀行	251,600	547.00	137,625,200	
大光銀行	1,800	1,728.00	3,110,400	
愛媛銀行	22,400	1,207.00	27,036,800	
トマト銀行	2,000	1,200.00	2,400,000	
京葉銀行	68,400	829.00	56,703,600	
栃木銀行	82,900	378.00	31,336,200	
北日本銀行	5,400	2,515.00	13,581,000	
東和銀行	30,500	686.00	20,923,000	
福島銀行	5,800	269.00	1,560,200	
大東銀行	2,400	718.00	1,723,200	
トモニホールディングス	157,200	400.00	62,880,000	
フィデアホールディングス	17,200	1,611.00	27,709,200	
池田泉州ホールディングス	230,300	408.00	93,962,400	
F P G	61,800	2,018.00	124,712,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	27,000	1,301.00	35,127,000	
マーキュリアホールディングス	2,900	829.00	2,404,100	
S B I ホールディングス	266,500	3,900.00	1,039,350,000	
ジャフコ グループ	49,500	1,843.50	91,253,250	
大和証券グループ本社	1,286,500	1,182.50	1,521,286,250	
野村ホールディングス	2,792,800	928.20	2,592,276,960	
岡三証券グループ	145,900	761.00	111,029,900	
丸三証券	55,300	1,010.00	55,853,000	
東洋証券	44,300	364.00	16,125,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,300	584.00	115,223,200	
光世証券	1,400	596.00	834,400	
水戸証券	49,200	531.00	26,125,200	
いちよし証券	31,200	807.00	25,178,400	
松井証券	81,800	800.00	65,440,000	
マネックスグループ	162,800	781.00	127,146,800	
極東証券	22,800	1,424.00	32,467,200	
岩井コスモホールディングス	19,000	2,200.00	41,800,000	
アイザワ証券グループ	24,000	1,981.00	47,544,000	
マネーパートナーズグループ	6,000	251.00	1,506,000	
スパークス・グループ	18,500	1,722.00	31,857,000	
かんぽ生命保険	169,100	2,865.50	484,556,050	

F P パートナー	4,400	4,065.00	17,886,000	
S O M P O ホールディングス	749,500	3,306.00	2,477,847,000	
アニコム ホールディングス	56,400	595.00	33,558,000	
MS & A D インシュアランスグループホールディングス	1,115,500	3,316.00	3,698,998,000	
第一生命ホールディングス	780,800	4,157.00	3,245,785,600	
東京海上ホールディングス	1,621,400	5,361.00	8,692,325,400	
T & D ホールディングス	445,900	2,744.50	1,223,772,550	
アドバンスクリエイト	10,600	993.00	10,525,800	
N E X Y Z . G r o u p	2,600	600.00	1,560,000	
全国保証	43,500	5,597.00	243,469,500	
あんしん保証	4,600	218.00	1,002,800	
イントラスト	2,700	793.00	2,141,100	
日本モーゲージサービス	4,100	401.00	1,644,100	
C a s a	2,700	847.00	2,286,900	
S B I アルヒ	16,600	833.00	13,827,800	
プレミアグループ	28,300	2,072.00	58,637,600	
ネットプロテクションズホールディングス	57,700	163.00	9,405,100	
クレディセゾン	105,400	3,331.00	351,087,400	
芙蓉総合リース	15,300	12,405.00	189,796,500	
みずほリース	139,500	1,038.00	144,801,000	
東京センチュリー	124,500	1,424.00	177,288,000	
日本証券金融	61,400	1,595.00	97,933,000	
アイフル	245,700	400.00	98,280,000	
リコーリース	15,900	5,020.00	79,818,000	
イオンフィナンシャルサービス	95,800	1,309.50	125,450,100	
アコム	297,700	396.40	118,008,280	
ジャックス	17,800	4,820.00	85,796,000	
オリエントコーポレーション	54,700	1,036.00	56,669,200	
オリックス	996,100	3,344.00	3,330,958,400	
三菱H C キャピタル	740,500	1,013.00	750,126,500	
九州リースサービス	2,600	1,110.00	2,886,000	
日本取引所グループ	428,300	3,675.00	1,574,002,500	
イー・ギャランティ	27,400	1,333.00	36,524,200	
アサックス	3,100	842.00	2,610,200	
N E C キャピタルソリューション	8,300	3,820.00	31,706,000	

r o b o t h o m e	49,800	162.00	8,067,600	
大東建託	60,900	16,350.00	995,715,000	
いちご	192,500	379.00	72,957,500	
日本駐車場開発	200,500	190.00	38,095,000	
スター・マイカ・ホールディングス	20,200	594.00	11,998,800	
S R Eホールディングス	7,300	3,600.00	26,280,000	
A Dワークスグループ	14,000	225.00	3,150,000	
ヒューリック	387,700	1,440.50	558,481,850	
野村不動産ホールディングス	92,600	3,845.00	356,047,000	
三重交通グループホールディングス	36,500	553.00	20,184,500	
サムティ	26,600	2,573.00	68,441,800	
ディア・ライフ	28,800	845.00	24,336,000	
地主	12,900	2,310.00	29,799,000	
プレサンスコーポレーション	26,600	1,721.00	45,778,600	
ハウスコム	1,500	968.00	1,452,000	
J P M C	10,000	1,185.00	11,850,000	
サンセイランディック	2,100	996.00	2,091,600	
フージャースホールディングス	25,600	1,074.00	27,494,400	
オープンハウスグループ	61,000	4,352.00	265,472,000	
東急不動産ホールディングス	499,800	1,026.00	512,794,800	
飯田グループホールディングス	159,400	2,064.00	329,001,600	
イーグランド	1,200	1,537.00	1,844,400	
ムゲンエステート	4,100	1,118.00	4,583,800	
A n d D oホールディングス	10,000	1,140.00	11,400,000	
シーアールイー	9,700	1,292.00	12,532,400	
ケイアイスター不動産	8,100	3,335.00	27,013,500	
グッドコムアセット	16,100	647.00	10,416,700	
ジェイ・エス・ビー	8,500	2,703.00	22,975,500	
ロードスターキャピタル	11,000	2,861.00	31,471,000	
テンポイノベーション	2,300	840.00	1,932,000	
フェイスネットワーク	1,900	1,643.00	3,121,700	
霞ヶ関キャピタル	6,800	16,310.00	110,908,000	
パーク24	108,200	1,599.50	173,065,900	
パラカ	6,200	1,973.00	12,232,600	
三井不動産	2,304,300	1,391.50	3,206,433,450	
三菱地所	1,085,700	2,556.00	2,775,049,200	

平和不動産	27,100	3,795.00	102,844,500
東京建物	145,300	2,420.00	351,626,000
京阪神ビルディング	31,400	1,506.00	47,288,400
住友不動産	240,300	4,775.00	1,147,432,500
テーオーシー	30,300	678.00	20,543,400
レオパレス21	166,200	522.00	86,756,400
スターツコーポレーション	24,000	3,210.00	77,040,000
フジ住宅	21,700	733.00	15,906,100
空港施設	24,300	596.00	14,482,800
明和地所	11,200	920.00	10,304,000
ゴールドクレスト	13,700	2,343.00	32,099,100
エスリード	8,000	3,955.00	31,640,000
日神グループホールディングス	27,700	507.00	14,043,900
日本エスコン	31,100	1,024.00	31,846,400
MIRARTHホールディングス	76,300	473.00	36,089,900
AVANTIA	3,700	822.00	3,041,400
イオンモール	86,400	1,858.00	160,531,200
毎日コムネット	2,700	770.00	2,079,000
ファースト住建	2,700	1,038.00	2,802,600
カチタス	44,900	1,585.00	71,166,500
トーセイ	27,900	2,166.00	60,431,400
穴吹興産	1,600	2,197.00	3,515,200
サンフロンティア不動産	24,900	1,930.00	48,057,000
FJネクストホールディングス	17,900	1,206.00	21,587,400
インテリックス	1,300	543.00	705,900
ランドビジネス	2,000	242.00	484,000
サンネクスタグループ	2,300	1,018.00	2,341,400
グランディハウス	14,900	570.00	8,493,000
日本空港ビルデング	58,800	5,479.00	322,165,200
明豊ファシリティワークス	3,200	882.00	2,822,400
LIFULL	60,600	157.00	9,514,200
MIXI	37,300	2,797.00	104,328,100
ジェイエイシーリクルートメント	63,000	661.00	41,643,000
日本M&Aセンターホールディングス	276,500	731.00	202,121,500
メンバーズ	6,200	795.00	4,929,000
中広	1,500	553.00	829,500

UTグループ	22,600	2,924.00	66,082,400
アイティメディア	6,800	1,755.00	11,934,000
ケアネット	35,900	499.00	17,914,100
E・Jホールディングス	10,300	1,793.00	18,467,900
オープンアップグループ	52,200	1,994.00	104,086,800
コシダカホールディングス	52,200	820.00	42,804,000
アルトナー	2,500	2,036.00	5,090,000
パソナグループ	21,100	2,119.00	44,710,900
CDS	1,600	1,750.00	2,800,000
リンクアンドモチベーション	49,900	420.00	20,958,000
エス・エム・エス	60,900	1,822.00	110,959,800
サニーサイドアップグループ	2,400	666.00	1,598,400
パーソルホールディングス	1,765,700	220.00	388,454,000
リニカル	4,300	386.00	1,659,800
クックパッド	49,000	173.00	8,477,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,100	745.00	2,309,500
学情	9,000	1,717.00	15,453,000
スタジオアリス	8,800	2,003.00	17,626,400
エプロ	1,900	810.00	1,539,000
NJS	3,900	3,415.00	13,318,500
総合警備保障	289,800	937.00	271,542,600
カカコム	112,600	1,861.50	209,604,900
アイロムグループ	7,100	2,784.00	19,766,400
セントケア・ホールディング	12,900	811.00	10,461,900
サイネックス	1,300	710.00	923,000
ルネサンス	13,700	923.00	12,645,100
ディップ	26,600	2,589.00	68,867,400
デジタルホールディングス	9,200	1,003.00	9,227,600
新日本科学	15,900	1,321.00	21,003,900
キャリアデザインセンター	1,200	1,657.00	1,988,400
エムスリー	342,700	1,496.50	512,850,550
ツカダ・グローバルホールディング	3,700	477.00	1,764,900
ウェルネット	5,600	621.00	3,477,600
ワールドホールディングス	7,900	2,155.00	17,024,500
ディー・エヌ・エー	61,800	1,384.50	85,562,100
博報堂DYホールディングス	221,200	1,282.00	283,578,400

ぐるなび	33,100	295.00	9,764,500	
タカミヤ	24,000	475.00	11,400,000	
ファンコミュニケーションズ	24,900	409.00	10,184,100	
ライク	6,600	1,581.00	10,434,600	
A o b a - B B T	2,800	351.00	982,800	
エスプール	50,600	323.00	16,343,800	
WDBホールディングス	9,000	1,718.00	15,462,000	
ティア	4,400	459.00	2,019,600	
C D G	800	1,299.00	1,039,200	
アドウェイズ	24,500	378.00	9,261,000	
バリューコマース	15,400	1,150.00	17,710,000	
インフォマート	180,700	292.00	52,764,400	
J Pホールディングス	44,900	499.00	22,405,100	
エコナックホールディングス	6,900	126.00	869,400	
C Lホールディングス	4,300	1,316.00	5,658,800	
プレステージ・インターナショナル	81,500	647.00	52,730,500	
アミューズ	10,700	1,576.00	16,863,200	
ドリームインキュベータ	6,000	2,133.00	12,798,000	
クイック	12,200	2,140.00	26,108,000	
T A C	4,100	179.00	733,900	
電通グループ	170,400	4,101.00	698,810,400	
イオンファンタジー	6,300	2,142.00	13,494,600	
シーティーエス	22,200	749.00	16,627,800	
H. U. グループホールディングス	50,900	2,477.50	126,104,750	
アルプス技研	16,500	2,539.00	41,893,500	
日本空調サービス	18,900	973.00	18,389,700	
オリエンタルランド	917,400	4,368.00	4,007,203,200	
ダスキン	38,500	3,575.00	137,637,500	
明光ネットワークジャパン	21,400	711.00	15,215,400	
ファルコホールディングス	7,800	2,280.00	17,784,000	
ラウンドワン	163,700	666.00	109,024,200	
リゾートトラスト	75,400	2,419.50	182,430,300	
ビー・エム・エル	21,400	2,710.00	57,994,000	
リソー教育	89,500	260.00	23,270,000	
早稲田アカデミー	9,800	1,531.00	15,003,800	
ユー・エス・エス	389,100	1,243.00	483,651,300	

東京個別指導学院	21,200	409.00	8,670,800	
サイバーエージェント	383,300	939.60	360,148,680	
楽天グループ	1,487,600	800.70	1,191,121,320	
クリーク・アンド・リバー社	8,900	1,668.00	14,845,200	
SBIグローバルアセットマネジメント	34,300	646.00	22,157,800	
テー・オー・ダブリュー	34,600	352.00	12,179,200	
山田コンサルティンググループ	7,700	1,891.00	14,560,700	
セントラルスポーツ	6,600	2,466.00	16,275,600	
フルキャストホールディングス	16,700	1,391.00	23,229,700	
エン・ジャパン	28,300	2,573.00	72,815,900	
リソルホールディングス	600	4,830.00	2,898,000	
テクノプロ・ホールディングス	101,600	2,601.00	264,261,600	
アトラグループ	1,700	160.00	272,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	1,222.00	11,242,400	
Keepers 技研	10,800	3,700.00	39,960,000	
ファーストロジック	2,300	498.00	1,145,400	
三機サービス	1,200	1,235.00	1,482,000	
Gunosy	14,100	696.00	9,813,600	
デザインワン・ジャパン	3,600	139.00	500,400	
イー・ガーディアン	8,400	1,842.00	15,472,800	
リブセンス	3,700	221.00	817,700	
ジャパンマテリアル	53,200	1,949.00	103,686,800	
ベクトル	21,400	1,289.00	27,584,600	
ウチヤマホールディングス	3,200	339.00	1,084,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	14,600	1,443.00	21,067,800	
キャリアリンク	6,500	2,379.00	15,463,500	
I B J	13,700	580.00	7,946,000	
アサンテ	8,700	1,686.00	14,668,200	
バリューHR	15,300	1,380.00	21,114,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,100	2,060.00	29,046,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,049.00	7,447,900	
ERIホールディングス	1,700	2,307.00	3,921,900	
アビスト	1,000	3,305.00	3,305,000	
シグマクシス・ホールディングス	22,900	1,342.00	30,731,800	
ウィルグループ	14,700	935.00	13,744,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	139.00	1,195,400	

メドピア	15,500	572.00	8,866,000	
レアジョブ	1,500	425.00	637,500	
リクルートホールディングス	1,248,400	7,764.00	9,692,577,600	
エラン	23,200	827.00	19,186,400	
土木管理総合試験所	3,400	322.00	1,094,800	
日本郵政	2,037,100	1,450.50	2,954,813,550	
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,569.00	29,497,200	
鎌倉新書	15,200	529.00	8,040,800	
SMN	1,800	291.00	523,800	
グローバルキッズCOMPANY	1,500	643.00	964,500	
エアトリ	12,900	1,253.00	16,163,700	
アトラエ	13,700	624.00	8,548,800	
ストライク	8,600	3,990.00	34,314,000	
ソラスト	48,300	457.00	22,073,100	
セラク	5,500	1,061.00	5,835,500	
インソース	37,900	926.00	35,095,400	
ベイカレント・コンサルティング	127,500	3,221.00	410,677,500	
Orchestra Holdings	4,000	1,293.00	5,172,000	
アイモバイル	22,600	457.00	10,328,200	
キャリアインデックス	3,400	166.00	564,400	
MS-Japan	7,300	1,000.00	7,300,000	
船場	1,400	1,240.00	1,736,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	56,300	2,773.00	156,119,900	
フルテック	1,000	1,111.00	1,111,000	
GameWith	3,400	282.00	958,800	
MS&Consulting	1,200	596.00	715,200	
エル・ティール・エス	2,100	2,066.00	4,338,600	
ミダックホールディングス	10,700	1,429.00	15,290,300	
キュービーネットホールディングス	10,200	1,111.00	11,332,200	
RPAホールディングス	24,500	242.00	5,929,000	
スプリックス	2,000	777.00	1,554,000	
マネジメントソリューションズ	7,600	1,682.00	12,783,200	
プロレド・パートナーズ	4,800	652.00	3,129,600	
テノ.ホールディングス	1,300	417.00	542,100	
フロンティア・マネジメント	4,500	1,241.00	5,584,500	

コプロ・ホールディングス	2,000	1,417.00	2,834,000
ギークス	1,300	449.00	583,700
アンビスホールディングス	37,200	1,994.00	74,176,800
カーブスホールディングス	47,700	716.00	34,153,200
フォーラムエンジニアリング	23,900	830.00	19,837,000
Fast Fitness Japan	6,100	1,229.00	7,496,900
ダイレクトマーケティングミックス	18,900	232.00	4,384,800
ポピンズ	2,800	1,228.00	3,438,400
LITALICO	13,600	1,693.00	23,024,800
コンフィデンス・インターワークス	700	1,783.00	1,248,100
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	465.00	1,674,000
リログループ	87,000	1,540.00	133,980,000
東祥	12,400	692.00	8,580,800
ID&Eホールディングス	10,500	4,110.00	43,155,000
ビーウィズ	3,700	1,918.00	7,096,600
TREホールディングス	33,400	1,119.00	37,374,600
人・夢・技術グループ	7,100	1,696.00	12,041,600
NISSOホールディングス	15,300	817.00	12,500,100
大栄環境	31,600	2,447.00	77,325,200
日本管財ホールディングス	18,300	2,506.00	45,859,800
M&A総研ホールディングス	18,500	3,970.00	73,445,000
エイチ・アイ・エス	50,500	1,671.00	84,385,500
ラックランド	8,000	1,737.00	13,896,000
共立メンテナンス	54,500	3,008.00	163,936,000
イチネンホールディングス	18,500	1,615.00	29,877,500
建設技術研究所	9,000	4,895.00	44,055,000
スペース	11,600	1,052.00	12,203,200
燦ホールディングス	16,500	1,158.00	19,107,000
スバル興業	5,800	2,633.00	15,271,400
東京テアトル	2,100	1,102.00	2,314,200
タナベコンサルティンググループ	6,500	1,001.00	6,506,500
ナガワ	5,400	7,330.00	39,582,000
東京都競馬	14,600	4,085.00	59,641,000
カナモト	27,000	2,596.00	70,092,000
ニシオホールディングス	16,100	3,840.00	61,824,000
トランス・コスモス	21,600	3,290.00	71,064,000

乃村工藝社	75,900	811.00	61,554,900	
藤田観光	6,900	6,000.00	41,400,000	
KN T - C Tホールディングス	10,300	1,312.00	13,513,600	
トーカイ	15,500	2,034.00	31,527,000	
セコム	176,600	9,887.00	1,746,044,200	
セントラル警備保障	9,400	2,858.00	26,865,200	
丹青社	33,900	808.00	27,391,200	
メイテックグループホールディングス	62,200	3,032.00	188,590,400	
応用地質	16,300	2,555.00	41,646,500	
船井総研ホールディングス	34,800	2,141.00	74,506,800	
進学会ホールディングス	2,500	238.00	595,000	
オオバ	4,100	1,079.00	4,423,900	
いであ	1,700	2,331.00	3,962,700	
学究社	7,000	2,075.00	14,525,000	
イオンディライト	18,700	3,845.00	71,901,500	
ナック	15,200	525.00	7,980,000	
ダイセキ	35,500	3,105.00	110,227,500	
ステップ	6,400	1,903.00	12,179,200	
合 計	270,769,200		652,736,925,880	

(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、「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 284 条及び第 307 条の規定により、「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 25 期中間計算期間(2024 年 5 月 30 日から 2024 年 11 月 29 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

2025年2月7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 中島紀子
業務執行社員

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・オープンの2024年5月30日から2024年11月29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・オープンの2024年11月29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（2024年5月30日から2024年11月29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】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第 24 期 (2024 年 5 月 29 日現在)	第 25 期中間計算期間 (2024 年 11 月 29 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,662,722	29,760,506
親投資信託受益証券	8,043,603,675	7,635,058,034
未収入金	1,244,125	4,291,795
未収利息	57	175
流動資産合計	8,075,510,579	7,669,110,510
資産合計	8,075,510,579	7,669,110,510
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	161,230,553	-
未払解約金	2,081,426	4,035,096
未払受託者報酬	2,958,048	3,030,066
未払委託者報酬	22,396,597	22,941,831
その他未払費用	407,522	216,371
流動負債合計	189,074,146	30,223,364
負債合計	189,074,146	30,223,364
純資産の部		
元本等		
元本	4,478,626,499	4,401,174,688
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	3,407,809,934	3,237,712,458
(分配準備積立金)	3,515,070,788	3,392,105,626
元本等合計	7,886,436,433	7,638,887,146
純資産合計	7,886,436,433	7,638,887,146
負債純資産合計	8,075,510,579	7,669,110,510

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 24 期中間計算期間 自 2023 年 5 月 30 日 至 2023 年 11 月 29 日	第 25 期中間計算期間 自 2024 年 5 月 30 日 至 2024 年 11 月 29 日
営業収益		
受取利息	45	16,371
有価証券売買等損益	713,863,062	△85,872,071
営業収益合計	713,863,107	△85,855,700
営業費用		
支払利息	3,730	-
受託者報酬	2,748,981	3,030,066
委託者報酬	20,813,617	22,941,831
その他費用	196,291	216,371
営業費用合計	23,762,619	26,188,268
営業利益又は営業損失 (△)	690,100,488	△112,043,968
経常利益又は経常損失 (△)	690,100,488	△112,043,968
中間純利益又は中間純損失 (△)	690,100,488	△112,043,968
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 (△)	18,789,576	△1,001,347
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	1,900,092,602	3,407,809,934
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,810,565	62,184,362
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	33,810,565	62,184,362
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,659,627	121,239,217
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,659,627	121,239,217
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	2,519,554,452	3,237,712,458

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 24 期 (2024 年 5 月 29 日現在)	第 25 期中間計算期間 (2024 年 11 月 29 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,478,626,499 口	4,401,174,688 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) 1,7609 円 (17,609 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1,7356 円 (17,356 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 25 期中間計算期間 (2024 年 11 月 29 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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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 24 期 自 2023 年 5 月 30 日 至 2024 年 5 月 29 日	第 25 期中間計算期間 自 2024 年 5 月 30 日 至 2024 年 11 月 29 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,830,504,061 円	4,478,626,499 円
期中追加設定元本額	97,895,504 円	82,236,923 円
期中一部解約元本額	449,773,066 円	159,688,734 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,618,859,967
株式	686,413,204,800
派生商品評価勘定	251,683,200
未収入金	317,441,642
未収配当金	5,264,489,620
未収利息	115,498
差入委託証拠金	624,547,637
流動資産合計	712,490,342,364
資産合計	712,490,342,364
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,834,300
前受金	199,103,000
未払金	13,446,131,651
未払解約金	34,448,191
流動負債合計	13,732,517,142
負債合計	13,732,517,142
純資産の部	
元本等	
元本	248,249,603,332
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	450,508,221,890
元本等合計	698,757,825,222
純資産合計	698,757,825,222
負債純資産合計	712,490,342,364

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年11月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		248,249,603,332 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	2.8147 円 (28,147 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

期首	2024年5月30日
期首元本額	233,518,775,755円
期中追加設定元本額	26,496,180,558円
期中一部解約元本額	11,765,352,981円
期末元本額	248,249,603,332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）	260,642,037円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,247,495,257円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,098,332円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,432,237,745円
世界経済インデックスファンド	6,828,998,238円
日本株式インデックス・オープン	2,712,565,472円
DCマイセレクション25	4,769,246,366円
DCマイセレクション50	16,221,262,894円
DCマイセレクション75	18,597,902,379円
DC日本株式インデックス・オープン	5,958,750,424円
DCマイセレクションS25	3,484,099,521円
DCマイセレクションS50	11,145,027,184円
DCマイセレクションS75	11,023,444,065円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,648,729,473円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	36,539,092円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	546,780,041円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	454,487,920円
DC世界経済インデックスファンド	3,709,890,210円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	334,769,032円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,257,230円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,504,518円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,727,486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）	94,665,804円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,891,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	10,788,877円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	43,176,241円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,119,749円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,336,284円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	309,244,496円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	276,077,409円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,881,328,790円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,343,237円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,295,524円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	278,734,653円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	148,710,192円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	208,645,795円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,711,647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）	357,694,414円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,278,170,245円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,105,695円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	709,543,591円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	425,695,720円
コア投資戦略ファンド（切替型）	553,090,106円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,909,027円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,719,859円
SMTインデックスバランス・オープン	46,034,864円

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,217,067,833円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	188,949,882円
SMT 世界経済インデックス・オープン	60,214,527円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	276,291,343円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	44,339,426円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,208,173円
グローバル経済コア	305,388,793円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	36,140,155円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,259,421,322円
DCターゲット・イヤーフンド2055	29,791,840円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	503,973,750円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	131,503,154円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	68,161,126円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	71,522,508円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	33,421,293円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	43,261,199円
10資産分散投資ファンド	113,801,435円
グローバル10資産バランスファンド	50,967,408円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,678,030円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	432,318円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	155,429円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	278,953円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	129,757円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	111,815円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	25,326円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	50,848円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	768,316,136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）	43,949,035,610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）	225,552,380円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	306,737,133円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	22,096,045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）	51,551,862,990円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,330,957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）	228,439,997円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年11月29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	12,177,877,000	—	12,376,980,000	199,103,000
合計		12,177,877,000	—	12,376,980,000	199,103,000

（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】

【純資産額計算書】

(2024年12月30日現在)

I 資産総額	7,912,697,841円
II 負債総額	7,124,876円
III 純資産総額 (I - II)	7,905,572,965円
IV 発行済口数	4,381,112,808口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.8045円
(1万口当たり純資産額)	(18,045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12月30日現在)

I 資産総額	730,841,539,611円
II 負債総額	421,230,891円
III 純資産総額 (I - II)	730,420,308,720円
IV 発行済口数	249,458,929,129口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.9280円
(1万口当たり純資産額)	(29,280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とします。）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12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

会社が取締役（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 2025 年 2 月 28 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 12 月 30 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	525	15,838,205
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	202,229
単位型公社債投資信託	52	171,026
合計	634	16,211,460

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財務諸表等規則並びに同規則第 2 条、第 282 条及び第 306 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 38 期事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第 39 期事業年度の中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	△510	△1,071
評価・換算差額等合計	△460	△710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077
その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	—	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	—	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	—
その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	—
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	—	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	—	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				△3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	△560	△250	△250
当期変動額合計	310	△560	△250	968
当期末残高	360	△1,071	△710	67,103

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株 式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8. ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	—	—	(10)
通貨関連取引	—	(136)	—	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

当事業年度 (2024年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	—	17,579
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,517	—	4,517
資産計	1,530	20,565	—	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	—	(530)
通貨関連取引	—	21	—	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	—	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 1,017 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 18,596 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式 (貸借対照表計上額 876 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 359 百万円) は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスク

の対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	—	—	—
未収委託者報酬	10,943	—	—	—
未収運用受託報酬	5,967	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	1,829	807	—

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	△287
小計	1,123	1,410	△287
合計	4,517	4,004	513

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

(単位:百万円)

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2023年3月31日)

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度 (2024年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	—	4	4
	英ポンド	288	—	0	0
	カナダドル	145	—	△0	△0
	スイスフラン	180	—	0	0
	香港ドル	217	—	0	0
	ユーロ	664	—	3	3
	合計	8,231	—	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度（2023年3月31日）

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	—	△268	△268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	—	△262	△262
合計		14,490	—	△530	△530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	—	1
	英ポンド		4,586	—	7
	スイスフラン		28	—	0
	香港ドル		83	—	0
	ユーロ		63	—	0
	シンガポールドル		448	—	1
合計			7,337	—	10

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	△57	△85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	△6	△17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	—	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 109 百万円、当事業年度 122 百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	〃	220	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	〃	298	〃
税務上の費用認識差額	412	〃	256	〃
繰延ヘッジ損益	225	〃	472	〃
その他	75	〃	78	〃
繰延税金資産 合計	1,236	〃	1,390	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△21	〃	△159	〃
その他	△32	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△54	〃	△194	〃
繰延税金資産の純額	1,181	〃	1,196	〃

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223 百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有 (被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

② 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2023 年 3 月 31 日）

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

当事業年度（2024 年 3 月 31 日）

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	22,044,962 円 63 銭	22,367,677 円 92 銭
1 株当たり当期純利益金額	1,816,227 円 49 銭	1,528,527 円 02 銭

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

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
当期純利益	5,448 百万円	4,585 百万円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	5,448 百万円	4,585 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

独立監査人の中間監査報告書

2024年12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 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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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 39 期中間会計期間末

(2024 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268
固定資産		
有形固定資産	※1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047
投資その他の資産		
投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850
固定資産合計		21,491
資産合計		80,759
負債の部		
流動負債		
未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	※2	2,306
流動負債合計		12,364
固定負債		
退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154
その他		53
固定負債合計		1,244
負債合計		13,608

(単位：百万円)

第 39 期中間会計期間末

(2024 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		45,816
利益剰余金合計		48,416
株主資本合計		67,655
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		453
繰延ヘッジ損益		△958
評価・換算差額等合計		△504
純資産合計		67,150
負債・純資産合計		80,759

中間損益計算書

(単位：百万円)

第 39 期中間会計期間

(自 2024 年 4 月 1 日

至 2024 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	※1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	※2	193
営業外費用	※3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		△129
法人税等調整額		△22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			△2,943	△2,943	△2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
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	—	—	△157	△157	△157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	△1,071	△710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	△958	△504	67,150

注記事項

(重要な会計方針)

第 39 期中間会計期間
(自 2024 年 4 月 1 日
至 2024 年 9 月 30 日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

第 39 期中間会計期末 (2024 年 9 月 30 日)	
※1 有形固定資産の減価償却累計額	1,128 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	83 百万円
無形固定資産	1,211 百万円
※2 営業外収益の主要項目	
投資有価証券売却益	149 百万円
※3 営業外費用の主要項目	
金銭の信託運用損	263 百万円
投資有価証券償還損	239 百万円
為替差損	146 百万円
デリバティブ費用	138 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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39期中間会計期間末(2024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、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。)第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません((1)*2及び(注2)、(注3)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	2,561	15,657	—	18,219
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	—	3,269	—	3,269
資産計	2,561	18,927	—	21,488
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(281)	(230)	—	(511)
通貨関連取引	—	(286)	—	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	—	(798)

(*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、非上場株式（中間貸借対照表計上額 876 百万円）、時価算定適用指針第 24-3 項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額 1,991 百万円）及び第 24-16 項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額 478 百万円）は上記に含めておりません。

(*3) 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。時価算定適用指針第 24-3 項の取扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

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ズワップの時価は、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	876
関係会社株式	6,077

(注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報
第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	△8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末(2024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	6,077

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	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	△57
小計	2,249	2,306	△57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額876百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額478百万円)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39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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	5,053	—	△83	△83
	英ポンド	173	—	△5	△5
	カナダドル	130	—	△2	△2
	スイスフラン	74	—	△1	△1
	香港ドル	120	—	△1	△1
	ユーロ	461	—	△9	△9
	買建				
	米ドル	42	—	△0	△0
	ユーロ	11	—	△0	△0
合計		6,068	—	△104	△104

(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	10,399	—	△281	△281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	—	△230	△230
合計		15,923	—	△511	△511

(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		1,833	—	△30
	英ポンド		4,463	—	△137
	スイスフラン		49	—	△0
	香港ドル		95	—	△1
	ユーロ		31	—	△0
	シンガポールドル		433	—	△11
合計			6,906	—	△182

(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39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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	5,620 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

	第 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
1 株当たり純資産額	22,383,579 円 15 銭
1 株当たり中間純利益	928,397 円 37 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
中間純利益	2,785 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	2,785 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

2025年2月28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
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 16 条に基づき、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（以下「有価証券先物取引等」といいます。）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。

4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（繰越分およびマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）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、市況動向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があります。

(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、委託者の判断に基づき、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
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1条の2 受託者は、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および限度額)

第2条 委託者は、金1,070,333,786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、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第41条第7項、第42条第1項、第43条第1項、第44条第1項および第46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4条 委託者は、第2条第1項による受益権について1,070,333,786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7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5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6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4条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法)

第7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、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た追加設定時における信託財産留保額（以下「追加設定時信託財産留保額」といいます。）を加算した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8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9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、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、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、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4条第1項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。
- ④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、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。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第10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11条 指定販売会社は、第4条第1項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ては、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限り、1口の整数倍をもって取得申込に応ずることができます。

- ②第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込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追加設定時信託財産留保額を加算した額(以下「販売基準価額」といいます。)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前の取得申込に係る当該価額は、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前項の手数料の額は、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前各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基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31条に規定する各計算期間終了日の販売基準価額とします。

⑥前各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11条の2 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11条の3 受益権の譲渡は、前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。

(受益証券の再交付)

第12条 (削除)

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第13条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第14条 (削除)

(運用の指図範囲等)

第15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、前各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せん。）
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せん。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、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を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、前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、信託金を前項第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前2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。

(運用の基本方針)

第16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17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前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18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前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19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前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 20 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るものとします。

②前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ます。

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証書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

(先物取引等の運用指図、目的および範囲)

第 21 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

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、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。

②前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ます。

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ます。

(保管業務の委任)

第 23 条 受託者は、委託者と協議のうえ、投資信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券等の保管)

第 24 条 受託者は、投資信託財産に属する有価証券等を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 24 条の 2 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 25 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 26 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 27 条 委託者は、前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 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。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前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 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%以内

③前項の借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

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 29 条 委託者の指示に基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 30 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前 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 31 条 この信託の計算期間は、毎年 5 月 30 日から翌年 5 月 29 日までとすることを原則とします。

- ②前項の規定にかかわらず、前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 3 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 32 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計算書および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総計算書および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 33 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（消費税を含みます。）は、第 31 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 34 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、次の各号により計算された額の合計額とします。

1. 第 31 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
 2. 第 22 条に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料（貸付有価証券の利子または配当金等相当額を含まないものとします。また、有価証券の貸付にあたって担保として金銭を受け入れた場合には、当該品貸料に、当該金銭の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付の相手方に支払う当該金銭に対する利息額を控除して得た額（ただし、この額が負の場合は、零とします。）とすることができます。以下同じ。）に 100 分の 50 未満の率を乗じて得た額
 3. マザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合は、マザーファンドの投資信託財産に属する品貸料のうち投資信託財産に属するとみなした額（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品貸料の割合を乗じて得た額とします。）に 100 分の 50 未満の率を乗じて得た額
- ②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ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 35 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. 投資信託財産に属する配当等収益（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をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から諸経費、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て得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（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、分配準備金として積み立てることができます。

②前項第1号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の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の割合を乗じて得た額をいいます。

③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い込みと支払いに関する受託者の免責）

第36条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、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38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38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、前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。

（収益分配金の再投資）

第37条（削除）

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第38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前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基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9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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、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受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

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ます。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎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ます。

(受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い)

第 39 条 (削除)

(収益分配金および償還金の時効)

第 40 条 受益者が、収益分配金については第 38 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第 38 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 41 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位または指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約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平成 19 年 1 月 4 日以降の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。ただし、平成 19 年 1 月 4 日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成 19 年 1 月 4 日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券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前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から、当該基準価額に 0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額（「解約時信託財産留保額」といいます。）を控除した価額とします。

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前項により一部解約の実行の請求の受け付け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。

⑦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。

⑧委託者は、前項の事項について、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。

⑨前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。

⑩前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 7 項の投資信託契約の解約をしません。

⑪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交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑫第 9 項から前項までの規定は、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 9 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。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第 41 条の 2 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け、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 42 条 委託者は、第 3 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、前項の事項について、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。

③前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前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 項の投資信託契約の解約をしません。

⑤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。

⑥第 3 項から前項までの規定は、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 3 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 43 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、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第 47 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 44 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前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 47 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 45 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 46 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 47 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 47 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、前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前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前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 48 条 第 41 条第 7 項から同条第 12 項および第 42 条に規定する投資信託契約の解約または前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 41 条第 9 項または第 42 条第 3 項または前条第 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 48 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 49 条 委託者が行う公告は、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 50 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、委託者と受託者の協議により定めます。

(付則)

第 1 条 第 38 条第 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、各受益者毎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ます。また、第 38 条第 6 項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎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ます。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の投資信託約款第 9 条、第 10 条、第 12 条から第 14 条、第 39 条の規定お

よび受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 12 年 5 月 30 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