

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

追加型投信／国内／株式

投資信託説明書

（請求目論見書）

2025年3月20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。

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2025年3月19日に関東財務局長に提出しており、2025年3月20日にその届出の効力が生じております。

発行者名	:	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
代表者の役職・氏名	:	代表取締役社長 菱田 賀夫
本店の所在の場所	:	東京都港区芝公園一丁目1番1号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	:	該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行（売出）価額の総額】	1
(4)【発行（売出）価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	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】	2
(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】	12
3【投資リスク】	32
4【手数料等及び税金】	35
5【運用状況】	39
第2【管理及び運営】	52
1【申込（販売）手続等】	52
2【換金（解約）手続等】	54
3【資産管理等の概要】	56
4【受益者の権利等】	60
第3【ファンドの経理状況】	61
1【財務諸表】	64
2【ファンドの現況】	150
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	152
第三部【委託会社等の情報】	153
第1【委託会社等の概況】	153
1【委託会社等の概況】	153
2【事業の内容及び営業の概況】	154
3【委託会社等の経理状況】	155
4【利害関係人との取引制限】	189
5【その他】	189
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- 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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2025年3月20日から2025年9月19日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。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、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	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				
		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)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「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は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

<ファンドの特色>

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

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

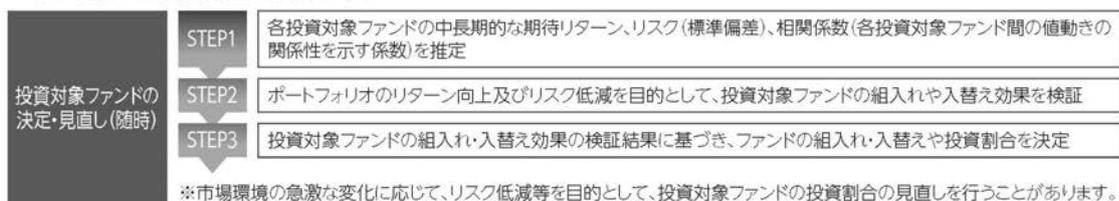
※投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2) 投資対象 (参考) 投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

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

ポートフォリオ構築プロセス

●運用に当たっては三井住友信託銀行(委託会社の親会社である三井住友トラストグループ株式会社の連結子会社)から投資助言を受けます。



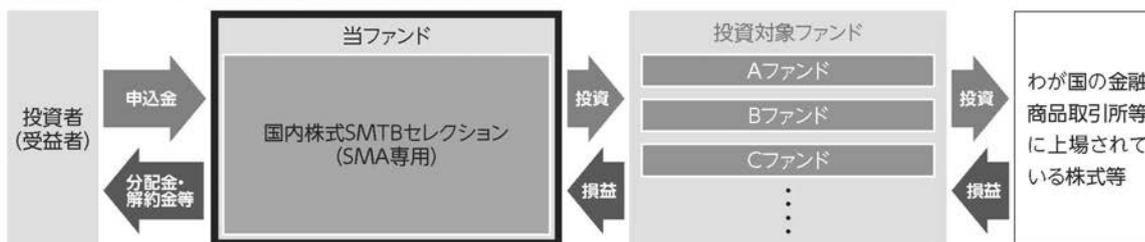
定期的なリバランスの実施(年4回)	相対的に値上がりしたファンドの売却や値下がりしたファンドの購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正
-------------------	---

※市場環境等によっては、定期的なリバランスを行わない場合があります。また、臨時に行うこともあります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日

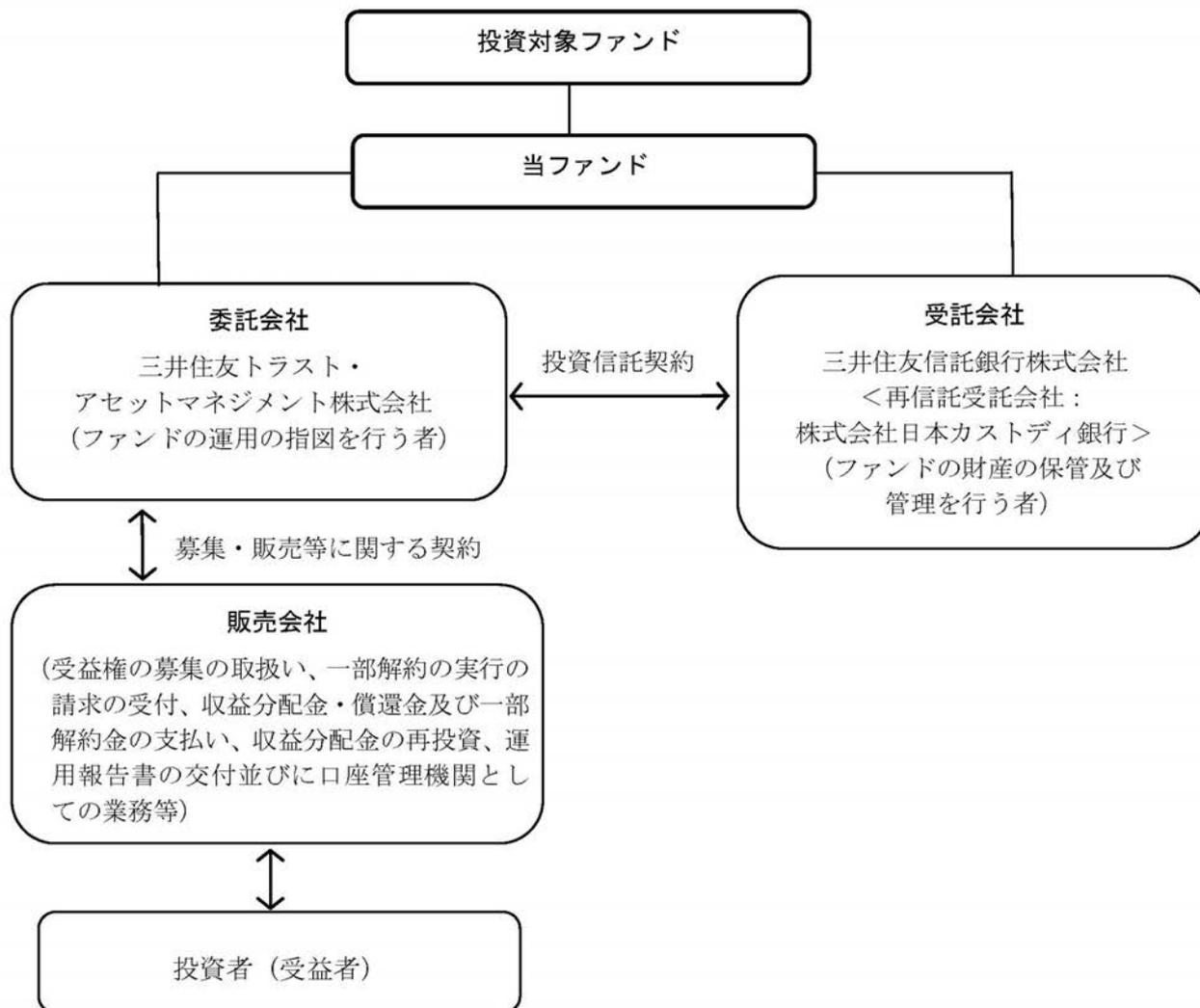
当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2023年9月21日

信託期間の延長(終了日を2024年12月20日から無期限へ変更)

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2025年1月31日現在）

イ. 資本金の額：20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラストグループ株式会社	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、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

②投資対象

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

③投資態度

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

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

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

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

- 1. 有価証券
- 2. 金銭債権
- 3. 約束手形

ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産

- 1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

- 1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
- 2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.の証券の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

③金融商品の指図範囲

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

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

ロ. 上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「(参考) 投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

(参考) 投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2025年1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社 (*) *2025年9月1日付で「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」へ変更いたします。
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド (以下「マザーファンド」といいます。) 受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式 (これに準ずるものを含みます。) に投資を行ない、T O P I X (東証株価指数) (配当込み) (※) の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合 (マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。) は、原則として、信託財産の総額の 50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式 (新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。) への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券 (マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の総額の 5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ④デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	T O P I X (東証株価指数) (配当込み)
決算日	年 1 回 : 2 月 15 日 (休業日の場合は翌営業日)

収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2035年2月15日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社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。

2. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、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。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信

	<p>託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

- 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 J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤ 本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥ J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦ J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みT O P I Xの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧ 以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

3. 日本株式E S Gセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の 50%以下とします。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>④一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、</p>

	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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年 1 回：4 月 5 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021 年 4 月 23 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又は MSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI 当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。MSCI 及び MSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなる MSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくは MSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算する MSCI 指数の所有者です。いかなる MSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなる MSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなる MSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源から MSCI 指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれの MSCI 当事者も、いかなる MSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなる MSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合も MSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断

するために最初に MSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するために MSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人も MSCI との関係を主張することはできません。

4. 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークである T O P I X（東証株価指数）（配当込み）（※）に対する超過リターンを目指します。</p> <p>②株式の組入比率は、原則として信託財産総額の 90%以上とします。</p> <p>③信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>④投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>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、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑦同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑧一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</p>

	<p>ジャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年 1 回：11 月 30 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002 年 12 月 20 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

5. 国内株式アクティブバリュースタイルファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	<p>日興アセットマネジメント株式会社（*）</p> <p>*2025 年 9 月 1 日付で「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」へ変更いたします。</p>
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式</p>

	<p>以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。)は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は行ないません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないません。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑨一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポ</p>

	<p>ージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

7. FOFs 用国内株式 EVI バリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株 EVI ハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（※）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュースタイル指標（PBR、PER、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 <p>②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>③株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑤信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取</p>

	<p>引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑦信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>⑧安定した収益の確保および効率的な運用を行うためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第 61 条の 5 第 1 項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。</p> <p>イ. 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的</p> <p>ロ. 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20%以内とします。</p> <p>③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 5%以内とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 10%以内とします。</p> <p>⑥外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑦デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年 1 回：6 月 6 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、運用会社が決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>③留保益の運用については特に制限を設けず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>

信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

8. SMDAM 日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友 DS アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、GARP（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>②銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。</p> <p>③TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（※）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <p>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信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の 50% 以下とします。</p> <p>⑤デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>⑥資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5% 以下とします。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20% 以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこ</p>

	ととします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>②収益分配金額は、運用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、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>③留保益の運用については特に制限を定めず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に対して以下に定める率とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額 200 億円未満の部分 年率 0.495%（税抜 0.45%） ・純資産総額 200 億円以上 400 億円未満の部分 年率 0.44%（税抜 0.4%） ・純資産総額 400 億円以上の部分 年率 0.385%（税抜 0.35%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

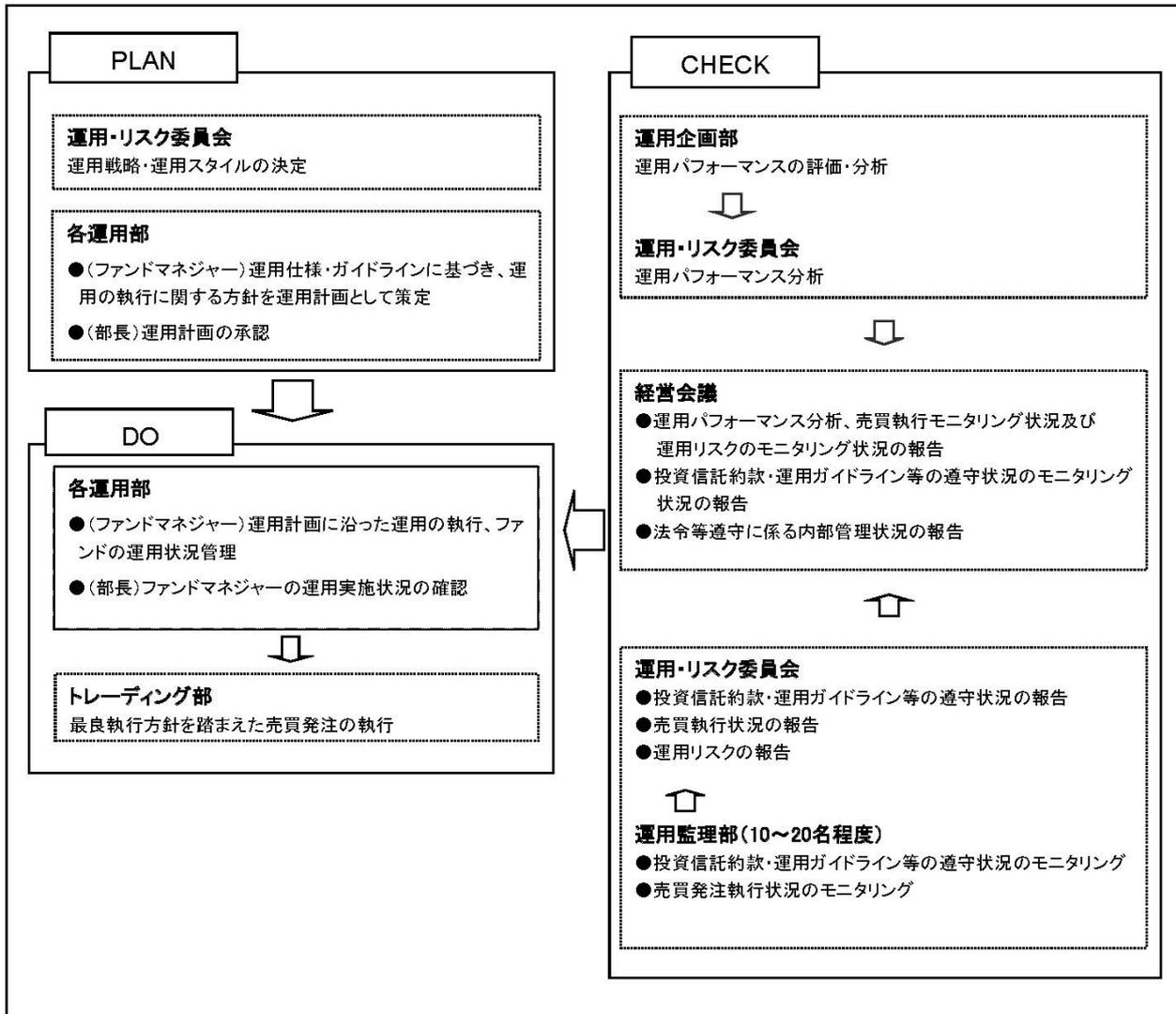
9. マネープールマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。
投資態度	<p>①主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>②公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>③株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>④信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>⑧資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑤投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資</p>

	<p>産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2010年2月26日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・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。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ. 株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ. 外貨建資産への投資

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

ニ. デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ. 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合

計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 金利変動リスク

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

③ 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。

④ 有価証券の貸付等に係るリスク

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

⑤ ESG の投資リスク

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

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

⑥ 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 同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

② 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戻しに相当

する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

- ③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。
これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

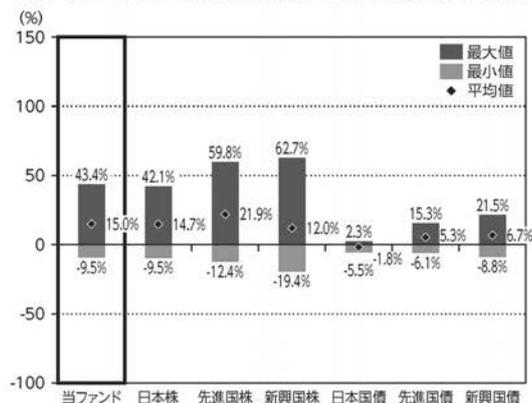
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2020年2月～2025年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・カバント・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・デバースファイド (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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 0.605%（税抜 0.55%）

（※）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

※2025年3月19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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.374% (税抜 0.34%)
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517% (税抜 0.47%)
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095% (税抜 0.645%)
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495% (税抜 0.45%)
SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額 200 億円未満の部分 年率 0.495% (税抜 0.45%) ・純資産総額 200 億円以上 400 億円未満の部分 年率 0.44% (税抜 0.4%) ・純資産総額 400 億円以上の部分 年率 0.385% (税抜 0.35%)
マネープールマザーファンド	ありません。

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

◎実質的な信託報酬率：年率 0.605%～1.1774%程度（税抜 0.55%～1.08%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率 0.0%～0.5724%程度（税抜 0.0%～0.53%程度））

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

(4) 【その他の手数料等】

- 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（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
- 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（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担す

る場合を含みます。)

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。

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

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.055%(税抜0.05%)を乗じて得たものとします。

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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

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

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

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、2025年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.96%	0.60%	0.36%

※対象期間は2023年12月21日～2024年12月20日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2025年1月31日現在の状況について記載してあります。

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	178,932,187,330	69.32
親投資信託受益証券	日本	76,492,264,262	29.63
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	2,712,254,943	1.05
合計（純資産総額）		258,136,706,535	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	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューフア ンド（適格機関投資家専用）	25,701,076,084	1.992	51,198,471,728	2.0319	52,222,016,495	20.23
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューフア ンド（適格機関投資家専用）	26,546,132,568	1.8763	49,809,220,590	1.9268	51,149,088,232	19.81
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	17,432,242,918	2.8378	49,470,196,964	2.9322	51,114,822,684	19.80
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド （適格機関投資家専用）	11,951,384,402	3.1261	37,361,225,655	3.168	37,861,985,785	14.67
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用戦 略ファンド（適格機関投資家専用）	9,893,594,920	2.4753	24,489,889,863	2.5681	25,407,741,114	9.84
日本	親投資信託受益証券	日本株式ESGセレクト・リーダー ズインデックスマザーファンド	7,792,057,375	1.5861	12,359,119,644	1.6418	12,792,999,798	4.96
日本	親投資信託受益証券	日本株式エクセレント・フォーカ スマザーファンド	1,930,956,824	6.3204	12,204,580,659	6.5172	12,584,431,813	4.88
日本	投資信託受益証券	SMDAM日本グロース株ファンド （適格機関投資家専用）	11,003,899,467	1.117	12,291,811,434	1.117	12,291,355,704	4.76
日本	親投資信託受益証券	マネーパールマザーファンド	9,953	1.0014	9,966	1.0015	9,967	0.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	69.32
親投資信託受益証券	29.63
合計	98.95

（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1期計算期間末 (2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末 (2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末 (2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末 (2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282
第5期計算期間末 (2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
第6期計算期間末 (2020年12月21日)	142,930,348,485	142,930,348,485	13,862	13,862
第7期計算期間末 (2021年12月20日)	144,548,292,355	144,548,292,355	15,531	15,531
第8期計算期間末 (2022年12月20日)	154,756,463,658	154,756,463,658	15,497	15,497
第9期計算期間末 (2023年12月20日)	193,100,062,864	193,100,062,864	19,400	19,400
第10期計算期間末 (2024年12月20日)	253,757,455,661	253,757,455,661	23,767	23,767
2024年1月末日	206,822,704,319	—	20,895	—
2月末日	220,800,126,321	—	22,220	—
3月末日	230,861,281,280	—	23,214	—
4月末日	216,070,373,396	—	22,739	—
5月末日	223,306,256,164	—	23,184	—
6月末日	234,872,922,074	—	23,807	—
7月末日	229,881,678,358	—	23,414	—
8月末日	232,183,697,656	—	22,962	—
9月末日	243,126,470,014	—	23,429	—
10月末日	245,003,072,455	—	23,305	—
11月末日	247,546,406,449	—	23,341	—
12月末日	263,037,976,218	—	24,565	—
2025年1月末日	258,136,706,535	—	24,337	—

②【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 1 期計算期間	2015 年 2 月 6 日～2015 年 12 月 21 日	0
第 2 期計算期間	2015 年 12 月 22 日～2016 年 12 月 20 日	0
第 3 期計算期間	2016 年 12 月 21 日～2017 年 12 月 20 日	0
第 4 期計算期間	2017 年 12 月 21 日～2018 年 12 月 20 日	0
第 5 期計算期間	2018 年 12 月 21 日～2019 年 12 月 20 日	0
第 6 期計算期間	2019 年 12 月 21 日～2020 年 12 月 21 日	0
第 7 期計算期間	2020 年 12 月 22 日～2021 年 12 月 20 日	0
第 8 期計算期間	2021 年 12 月 21 日～2022 年 12 月 20 日	0
第 9 期計算期間	2022 年 12 月 21 日～2023 年 12 月 20 日	0
第 10 期計算期間	2023 年 12 月 21 日～2024 年 12 月 20 日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 1 期計算期間	2015 年 2 月 6 日～2015 年 12 月 21 日	10.5
第 2 期計算期間	2015 年 12 月 22 日～2016 年 12 月 20 日	1.1
第 3 期計算期間	2016 年 12 月 21 日～2017 年 12 月 20 日	19.7
第 4 期計算期間	2017 年 12 月 21 日～2018 年 12 月 20 日	△15.6
第 5 期計算期間	2018 年 12 月 21 日～2019 年 12 月 20 日	15.9
第 6 期計算期間	2019 年 12 月 21 日～2020 年 12 月 21 日	6.0
第 7 期計算期間	2020 年 12 月 22 日～2021 年 12 月 20 日	12.0
第 8 期計算期間	2021 年 12 月 21 日～2022 年 12 月 20 日	△0.2
第 9 期計算期間	2022 年 12 月 21 日～2023 年 12 月 20 日	25.2
第 10 期計算期間	2023 年 12 月 21 日～2024 年 12 月 20 日	22.5

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

(注 2) 小数第 2 位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

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

第10期計算期間	2023年12月21日～2024年12月20日	32,503,118,250	25,271,040,052	106,770,499,878
----------	-------------------------	----------------	----------------	-----------------

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	729,804,799,860	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,768,357,173	0.65
合計(純資産総額)		734,573,157,033	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,186,500,000	0.57

(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	9,746,400	3,315.20	32,311,271,721	2,973.50	28,980,920,400	3.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,583,400	1,635.78	18,947,907,132	1,978.50	22,917,756,900	3.12
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,324,600	2,530.88	16,006,803,648	3,440.00	21,756,624,000	2.96
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,768,400	3,259.75	15,543,799,902	3,946.00	18,816,106,400	2.56
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,470,500	8,011.06	11,780,265,238	10,930.00	16,072,565,000	2.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,767,000	3,347.75	12,610,993,146	3,868.00	14,570,756,000	1.98
日本	株式	キーエンス	電気機器	183,400	69,459.98	12,738,961,637	67,250.00	12,333,650,000	1.68
日本	株式	任天堂	その他製品	1,157,500	8,286.02	9,591,072,622	10,230.00	11,841,225,000	1.61
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,437,300	3,150.60	7,678,977,232	4,307.00	10,497,451,100	1.43
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	388,000	34,399.57	13,347,036,519	26,205.00	10,167,540,000	1.38

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,304,000	7,273.91	9,485,189,622	7,183.00	9,366,632,000	1.28
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,763,000	5,358.56	9,447,147,894	5,160.00	9,097,080,000	1.24
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,585,200	3,304.91	11,848,764,257	2,489.50	8,925,355,400	1.22
日本	株式	三井物産	卸売業	2,850,100	3,946.45	11,247,802,776	3,086.00	8,795,408,600	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	907,100	8,923.60	8,094,598,480	9,411.00	8,536,718,100	1.16
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,696,600	151.96	8,311,726,823	152.70	8,352,170,820	1.14
日本	株式	信越化学工業	化学	1,633,100	5,875.05	9,594,544,155	4,877.00	7,964,628,700	1.08
日本	株式	HOYA	精密機器	358,200	18,705.68	6,700,377,226	20,975.00	7,513,245,000	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	3,238,300	1,375.60	4,454,631,940	2,296.00	7,435,136,800	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,735,400	5,388.05	9,350,432,908	4,277.00	7,422,305,800	1.01
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,352,500	4,320.09	5,842,929,979	5,186.00	7,014,065,000	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,636,200	4,110.34	6,725,339,454	4,209.00	6,886,765,800	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,344,100	1,706.08	7,411,403,305	1,478.50	6,422,751,850	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,435,000	187.87	5,530,109,684	200.20	5,892,887,000	0.80
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	109,100	40,919.34	4,464,300,892	51,030.00	5,567,373,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,142,900	2,050.64	4,394,330,880	2,469.50	5,291,891,550	0.72
日本	株式	富士通	電気機器	1,704,000	2,291.12	3,904,074,248	3,018.00	5,142,672,000	0.70
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	577,800	6,036.23	3,487,735,299	8,659.00	5,003,170,200	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,883,500	2,665.94	5,021,307,459	2,571.50	4,843,420,250	0.66
日本	株式	キヤノン	電気機器	914,500	4,507.45	4,122,072,060	5,018.00	4,588,961,000	0.62

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.23
		建設業	2.12
		食料品	2.93
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.14
		化学	4.92
		医薬品	4.23
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.63
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.50
		機械	5.58

	電気機器	17.69
	輸送用機器	7.53
	精密機器	2.42
	その他製品	2.84
	電気・ガス業	1.19
	陸運業	2.26
	海運業	0.64
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.51
	卸売業	6.45
	小売業	4.55
	銀行業	9.03
	証券、商品先物取引業	0.95
	保険業	3.13
	その他金融業	1.15
	不動産業	1.84
	サービス業	5.15
	小計	99.35
合計		99.35

(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	150円		4,091,132,500	4,186,500,000	0.57

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

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

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	17,812,502,180	98.35
投資証券	日本	104,784,500	0.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	193,939,697	1.07

合計(純資産総額)	18,111,226,377	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	189,788,000	1.05

(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	452,600	3,422.81	1,549,163,806	2,973.50	1,345,806,100	7.43
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	275,200	2,579.72	709,938,944	3,440.00	946,688,000	5.23
日本	株式	日立製作所	電気機器	204,400	2,938.44	600,617,136	3,946.00	806,562,400	4.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	61,800	7,099.49	438,748,482	10,930.00	675,474,000	3.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	164,400	2,939.72	483,289,968	3,868.00	635,899,200	3.51
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	19,800	34,981.21	692,627,958	26,205.00	518,859,000	2.86
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	106,300	2,938.04	312,313,652	4,307.00	457,834,100	2.53
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	8,400	44,492.45	373,736,580	51,030.00	428,652,000	2.37
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	82,800	4,876.13	403,743,564	5,160.00	427,248,000	2.36
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	42,100	8,875.24	373,647,604	9,411.00	396,203,100	2.19
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	52,400	6,894.88	361,291,712	7,183.00	376,389,200	2.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	67,600	4,453.40	301,049,840	5,186.00	350,573,600	1.94
日本	株式	第一三共	医薬品	77,300	4,764.46	368,292,758	4,277.00	330,612,100	1.83
日本	株式	三菱重工業	機械	141,300	1,441.84	203,731,992	2,296.00	324,424,800	1.79
日本	株式	HOYA	精密機器	15,400	17,823.71	274,485,134	20,975.00	323,015,000	1.78
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	33,800	6,180.51	208,901,238	8,659.00	292,674,200	1.62
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,261,100	191.59	241,614,149	200.20	252,472,220	1.39
日本	株式	富士通	電気機器	73,000	2,445.08	178,490,840	3,018.00	220,314,000	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,600	20,072.96	232,846,336	18,370.00	213,092,000	1.18
日本	株式	キャノン	電気機器	41,200	5,054.05	208,226,860	5,018.00	206,741,600	1.14
日本	株式	中外製薬	医薬品	29,600	6,500.48	192,414,208	6,734.00	199,326,400	1.10
日本	株式	ファナック	電気機器	41,700	4,209.86	175,551,162	4,659.00	194,280,300	1.07
日本	株式	MS&ADインシュアラン	保険業	56,700	2,846.69	161,407,323	3,249.00	184,218,300	1.02

		スグループホールディングス							
日本	株式	小松製作所	機械	38,600	4,370.88	168,715,968	4,736.00	182,809,600	1.01
日本	株式	S O M P Oホールディングス	保険業	39,300	3,185.45	125,188,185	4,352.00	171,033,600	0.94
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	49,400	3,375.44	166,746,736	3,445.00	170,183,000	0.94
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	48,100	4,522.12	217,513,972	3,501.00	168,398,100	0.93
日本	株式	オリックス	その他金融業	50,900	3,211.93	163,487,237	3,297.00	167,817,300	0.93
日本	株式	日本電気	電気機器	10,800	11,375.37	122,853,996	15,525.00	167,670,000	0.93
日本	株式	三井不動産	不動産業	117,800	1,549.02	182,474,556	1,409.50	166,039,100	0.92

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.40
		建設業	1.87
		食料品	2.76
		繊維製品	0.44
		化学	5.51
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	0.47
		鉄鋼	0.44
		非鉄金属	0.49
		金属製品	0.12
		機械	5.83
		電気機器	22.67
		輸送用機器	7.72
		精密機器	2.20
		その他製品	1.04
		電気・ガス業	0.98
		陸運業	1.72
		海運業	0.52
		空運業	0.11
		情報・通信業	7.29
		卸売業	3.53
小売業	4.65		
銀行業	6.65		
証券、商品先物取引業	1.11		

		保険業	4.67
		その他金融業	0.98
		不動産業	2.44
		サービス業	5.98
		小計	98.35
投資証券	—	—	0.58
合計			98.93

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	68円		186,772,734	189,788,000	1.05

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

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

日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	49,348,755,650	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	410,933,488	0.83
合計(純資産総額)		49,759,689,138	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	三越伊勢丹ホールディングス	小売業	962,500	2,172.41	2,090,944,625	2,697.00	2,595,862,500	5.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,213,000	1,826.56	2,215,617,280	1,978.50	2,399,920,500	4.82
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	325,700	5,588.98	1,820,330,786	7,066.00	2,301,396,200	4.63

日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	57,400	43,490.84	2,496,374,216	38,320.00	2,199,568,000	4.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	535,800	3,823.13	2,048,433,054	3,868.00	2,072,474,400	4.16
日本	株式	日立製作所	電気機器	513,800	3,946.16	2,027,537,008	3,946.00	2,027,454,800	4.07
日本	株式	三菱重工業	機械	878,500	2,246.14	1,973,233,990	2,296.00	2,017,036,000	4.05
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	582,100	3,014.20	1,754,565,820	3,440.00	2,002,424,000	4.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	181,700	10,620.13	1,929,677,621	10,930.00	1,985,981,000	3.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	66,600	23,644.07	1,574,695,062	26,205.00	1,745,253,000	3.51
日本	株式	ディスコ	機械	34,300	41,348.35	1,418,248,405	44,740.00	1,534,582,000	3.08
日本	株式	信越化学工業	化学	287,000	5,546.13	1,591,739,310	4,877.00	1,399,699,000	2.81
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,800	65,260.00	1,357,408,000	67,250.00	1,398,800,000	2.81
日本	株式	第一三共	医薬品	294,600	4,871.13	1,435,034,898	4,277.00	1,260,004,200	2.53
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	145,000	8,422.48	1,221,259,600	8,659.00	1,255,555,000	2.52
日本	株式	荏原製作所	機械	466,000	2,264.73	1,055,364,180	2,579.50	1,202,047,000	2.42
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	225,100	4,570.08	1,028,725,008	5,293.00	1,191,454,300	2.39
日本	株式	三菱商事	卸売業	476,600	2,565.22	1,222,583,852	2,489.50	1,186,495,700	2.38
日本	株式	マツキョココカラ&カンパニー	小売業	478,500	2,124.65	1,016,645,025	2,301.50	1,101,267,750	2.21
日本	株式	NTTデータグループ	情報・通信業	348,000	2,879.62	1,002,107,760	3,029.00	1,054,092,000	2.12
日本	株式	J. フロント リテイリング	小売業	464,400	1,825.97	847,980,468	2,184.50	1,014,481,800	2.04
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	308,600	2,949.22	910,129,292	2,912.50	898,797,500	1.81
日本	株式	西武ホールディングス	陸運業	250,300	3,042.06	761,427,618	3,356.00	840,006,800	1.69
日本	株式	SHIFT	情報・通信業	646,500	1,162.35	751,463,154	1,292.00	835,278,000	1.68
日本	株式	ダイフク	機械	259,100	3,221.34	834,649,194	3,217.00	833,524,700	1.68
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	272,800	2,611.06	712,297,168	2,973.50	811,170,800	1.63
日本	株式	HOYA	精密機器	36,500	19,527.81	712,765,065	20,975.00	765,587,500	1.54
日本	株式	富士電機	電気機器	101,100	8,693.00	878,862,300	7,435.00	751,678,500	1.51
日本	株式	SMC	機械	12,500	64,590.00	807,375,000	58,880.00	736,000,000	1.48
日本	株式	ニデック	電気機器	255,400	2,748.81	702,046,074	2,689.50	686,898,300	1.38

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	0.82
		化学	3.72
		医薬品	3.19
		ガラス・土石製品	4.42
		鉄鋼	0.52
		非鉄金属	2.24
		機械	13.60
		電気機器	21.57

	輸送用機器	8.18
	精密機器	1.54
	陸運業	2.75
	情報・通信業	6.76
	卸売業	2.38
	小売業	12.28
	銀行業	8.99
	保険業	0.33
	不動産業	1.89
	サービス業	3.99
	小計	99.17
合計		99.17

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

マネープールマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	72,962,062,000	51.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	69,905,185,492	48.93
合計(純資産総額)		142,867,247,492	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第1220回国庫短期証券	45,000,000,000	99.94	44,973,360,000	99.95	44,981,550,000	—	2025/3/21	31.48
日本	国債証券	第1226回国庫短期証券	28,000,000,000	99.91	27,974,800,000	99.93	27,980,512,000	—	2025/4/21	19.58

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	51.07
合計	51.07

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

投資不動産物件

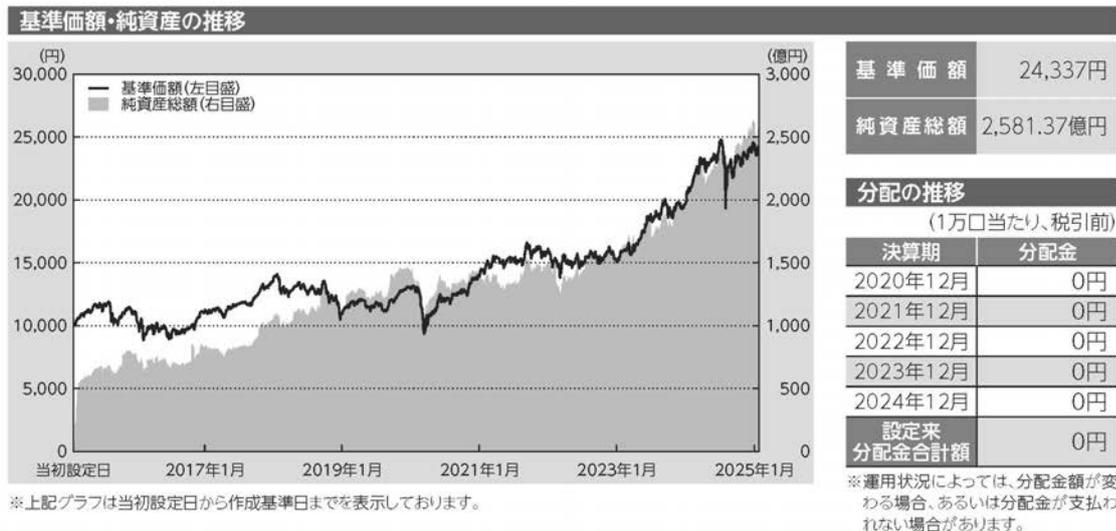
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

運用実績

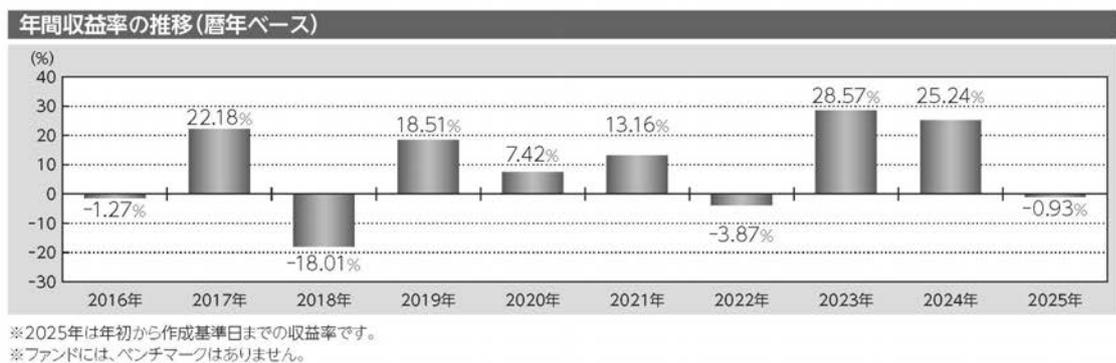
当初設定日：2015年2月6日
作成基準日：2025年1月31日



主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs用国内株式EVI/バリューファンド(適格機関投資家専用)	20.2%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	19.8%
国内株式インデックス マザーファンド	19.8%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	14.7%
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9.8%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	5.0%
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	4.9%
SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	4.8%
マネープールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

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

<申込価額>

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

ありません。

<申込受付の中止等>

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

<その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<解約価額>

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

<一部解約代金の支払い>

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

<受付不可日>

ありません。

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②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。

③マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・公社債等

計算日における次の a. から c. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

<基準価額の照会方法>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。(2015年2月6日設定)

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

(4)【計算期間】

原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

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

(5)【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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）に係る書面決議の手続き

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

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

<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違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

<運用報告書>

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

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

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

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- ①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- ②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2023年12月21日から2024年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2025年2月28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」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2023年12月21日から2024年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2024年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンズ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】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2023年12月20日現在)	第10期 (2024年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,795,849,990	3,728,956,366
投資信託受益証券	123,913,255,193	176,441,510,713
親投資信託受益証券	67,127,123,773	74,746,359,834
未収利息	-	22,131
流動資産合計	193,836,228,956	254,916,849,044
資産合計	193,836,228,956	254,916,849,044
負債の部		
流動負債		
未払解約金	179,715,401	441,249,314
未払受託者報酬	30,283,666	39,095,459
未払委託者報酬	524,916,896	677,654,620
未払利息	995	-
その他未払費用	1,249,134	1,393,990
流動負債合計	736,166,092	1,159,393,383
負債合計	736,166,092	1,159,393,383
純資産の部		
元本等		
元本	99,538,421,680	106,770,499,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	93,561,641,184	146,986,955,783
（分配準備積立金）	49,461,251,446	75,405,943,817
元本等合計	193,100,062,864	253,757,455,661
純資産合計	193,100,062,864	253,757,455,661
負債純資産合計	193,836,228,956	254,916,849,044

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期		第10期	
	自 2022年12月21日 至 2023年12月20日		自 2023年12月21日 至 2024年12月20日	
営業収益				
受取配当金		370,669,580		470,349,751
受取利息		11,726		3,618,921
有価証券売買等損益		39,915,759,113		45,593,180,172
営業収益合計		40,286,440,419		46,067,148,844
営業費用				
支払利息		1,169,198		100,750
受託者報酬		57,515,166		74,700,466
委託者報酬		996,929,493		1,294,807,915
その他費用		2,443,421		2,729,815
営業費用合計		1,058,057,278		1,372,338,946
営業利益又は営業損失(△)		39,228,383,141		44,694,809,898
経常利益又は経常損失(△)		39,228,383,141		44,694,809,898
当期純利益又は当期純損失(△)		39,228,383,141		44,694,809,898
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(△)		6,456,248,925		7,581,627,827
期首剰余金又は期首欠損金(△)		54,893,611,371		93,561,641,184
剰余金増加額又は欠損金減少額		21,071,809,548		40,805,731,800
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,071,809,548		40,805,731,800
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,175,913,951		24,493,599,272
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,175,913,951		24,493,599,272
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		93,561,641,184		146,986,955,783

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2023年12月20日現在)	第10期 (2024年12月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,538,421,680 口	106,770,499,878 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) 1,940 円 (19,400 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,376 円 (23,767 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日			第10期 自 2023年12月21日 至 2024年12月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,945,964,388 円	費用控除後の配当等収益額	A	1,908,348,254 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	30,289,222,490 円	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	35,204,833,817 円
収益調整金額	C	44,100,389,738 円	収益調整金額	C	71,581,011,966 円
分配準備積立金額	D	17,226,064,568 円	分配準備積立金額	D	38,292,761,746 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	93,561,641,184 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	146,986,955,783 円
当ファンドの期末残存口数	F	99,538,421,680 口	当ファンドの期末残存口数	F	106,770,499,878 口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,399 円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	13,766 円
1万口当たり分配金額	H	－円	1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 2023年12月21日 至 2024年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理

等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 10 期 (2024 年 12 月 20 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

(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 9 期 自 2022 年 12 月 21 日 至 2023 年 12 月 20 日	第 10 期 自 2023 年 12 月 21 日 至 2024 年 12 月 20 日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	99,862,852,287 円	99,538,421,680 円
期中追加設定元本額	26,608,308,961 円	32,503,118,250 円
期中一部解約元本額	26,932,739,568 円	25,271,040,052 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 9 期 (2023 年 12 月 20 日現在)	第 10 期 (2024 年 12 月 20 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	22,196,910,701	30,306,197,033
親投資信託受益証券	11,601,154,183	8,970,195,402
合計	33,798,064,884	39,276,392,435

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	26,649,241,409	50,001,971,655	
	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9,952,764,283	24,630,105,771	
	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	12,018,347,456	37,570,555,982	
	SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	11,342,670,133	12,670,896,805	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	25,886,240,902	51,567,980,500	
投資信託受益証券合計		85,849,264,183	176,441,510,713	
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	17,391,571,178	49,343,365,746	
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	8,027,809,034	12,732,907,908	
	日本株式エクセレント・フォーカスマザーファンド	2,004,790,616	12,670,076,214	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,966	
親投資信託受益証券合計		27,424,180,781	74,746,359,834	
合計			251,187,870,547	

(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12月20日現在
--	---------------

項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,366,838,196
株式	703,276,744,860
未収入金	341,100,000
未収配当金	84,968,627
未収利息	55,592
前払金	47,520,000
差入委託証拠金	154,440,352
流動資産合計	713,271,667,627
資産合計	713,271,667,627
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,593,700
未払金	5,456,123,372
未払解約金	142,335,597
流動負債合計	5,646,052,669
負債合計	5,646,052,669
純資産の部	
元本等	
元本	249,411,424,228
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	458,214,190,730
元本等合計	707,625,614,958
純資産合計	707,625,614,958
負債純資産合計	713,271,667,627

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
--	----------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

		2024年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		249,411,424,228 円
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)	2.8372 円 (28,372 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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	243,831,636,576円
期中追加設定元本額	39,434,648,823円
期中一部解約元本額	33,854,861,171円
期末元本額	249,411,424,228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)	258,857,222円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,232,742,210円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,143,879円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,320,482,671円
世界経済インデックスファンド	6,887,310,999円
日本株式インデックス・オープン	2,704,330,283円
DCマイセレクション25	4,737,691,401円
DCマイセレクション50	16,138,008,960円
DCマイセレクション75	18,570,838,967円
DC日本株式インデックス・オープン	5,939,983,613円
DCマイセレクションS25	3,670,441,938円
DCマイセレクションS50	11,135,956,006円
DCマイセレクションS75	11,058,437,330円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,597,808,828円
DCターゲット・イヤーフンド2025	36,273,093円
DCターゲット・イヤーフンド2035	545,505,178円
DCターゲット・イヤーフンド2045	453,235,552円
DC世界経済インデックスファンド	3,703,628,830円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	313,809,390円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,593,706円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	7,965,145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)	94,630,927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)	10,530,560円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	42,575,829円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	12,859,556円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	40,343,390円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	300,984,596円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	274,586,779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)	25,602,590円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	8,320,394円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	275,673,714円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	147,346,032円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	204,222,128円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,656,000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)	357,639,534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	1,859,808,586円
コア投資戦略ファンド(安定型)	503,870,105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	6,163,278,838円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	714,969,472円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	426,294,928円
コア投資戦略ファンド(切替型)	527,848,263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)	9,664,075円
SMT インデックスバランス・オープン	45,596,098円
国内株式SMT Bセクション(SMA専用)	17,391,571,178円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	184,654,439円
SMT 世界経済インデックス・オープン	60,690,114円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	280,794,573円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	44,840,253円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,272,860円
グローバル経済コア	308,863,495円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	36,210,314円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	3,191,170,894円
DCターゲット・イヤーフンド2055	30,463,169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	68,979,756円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	71,955,662円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	33,939,780円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	43,964,917円
10資産分散投資ファンド	113,768,432円
グローバル10資産バランスファンド	52,114,644円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	5,854,558円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2035	2,990,641円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2040	2,123,279円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2045	4,459,271円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2050	1,201,432円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2055	620,467円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2060	123,411円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2065	102,256円
DCマイセクションS50(2024-2026リスク抑制型)	767,210,613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)	43,930,678,240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)	220,627,438円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	304,806,635円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,723,231円
SMT AM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	52,599,807,123円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,455,761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)	236,445,966円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1(適格機関投資家専用)	26,259円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2(適格機関投資家専用)	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3(適格機関投資家専用)	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4(適格機関投資家専用)	39,240円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5(適格機関投資家専用)	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6(適格機関投資家専用)	21,737円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
----	---------------

	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△6,767,357,125
合計	△6,767,357,125

(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12月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,668,200,000	—	3,620,680,000	△47,520,000
合計		3,668,200,000	—	3,620,680,000	△47,520,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	10,700	3,970.00	42,479,000	
ニッセイ	254,700	878.50	223,753,950	
マルハニチロ	37,800	2,909.50	109,979,100	
雪国まいたけ	21,700	1,011.00	21,938,700	
カネコ種苗	7,200	1,423.00	10,245,600	
サカタのタネ	28,400	3,380.00	95,992,000	
ホクト	22,700	1,802.00	40,905,400	
ホクリヨウ	900	1,139.00	1,025,100	
住石ホールディングス	28,000	787.00	22,036,000	
日鉄鉱業	10,200	4,260.00	43,452,000	
I N P E X	770,000	1,941.50	1,494,955,000	
石油資源開発	139,700	1,082.00	151,155,400	
K&Oエナジーグループ	11,600	3,020.00	35,032,000	
ショーボンドホールディングス	33,500	5,245.00	175,707,500	

ミライト・ワン	83,300	2,297.50	191,381,750
タマホーム	16,000	3,435.00	54,960,000
サンヨーホームズ	600	722.00	433,200
日本アクア	2,700	806.00	2,176,200
ファーストコーポレーション	1,500	833.00	1,249,500
ベステラ	1,300	1,020.00	1,326,000
キャンディル	1,000	569.00	569,000
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,279.00	1,406,900
第一カッター興業	7,300	1,430.00	10,439,000
安藤・間	147,600	1,178.00	173,872,800
東急建設	79,800	703.00	56,099,400
コムシスホールディングス	90,400	3,240.00	292,896,000
ビーアールホールディングス	37,300	335.00	12,495,500
高松コンストラクショングループ	18,900	2,716.00	51,332,400
東建コーポレーション	6,400	11,980.00	76,672,000
ソネック	600	839.00	503,400
ヤマウラ	12,900	1,182.00	15,247,800
オリエンタル白石	94,300	390.00	36,777,000
大成建設	161,800	6,563.00	1,061,893,400
大林組	588,300	2,049.00	1,205,426,700
清水建設	505,300	1,221.00	616,971,300
長谷工コーポレーション	163,500	2,026.50	331,332,750
松井建設	16,600	893.00	14,823,800
銭高組	600	3,665.00	2,199,000
鹿島建設	395,100	2,808.00	1,109,440,800
不動テトラ	12,100	2,014.00	24,369,400
大末建設	1,500	1,552.00	2,328,000
鉄建建設	12,500	2,195.00	27,437,500
西松建設	28,400	5,159.00	146,515,600
三井住友建設	143,700	416.00	59,779,200
大豊建設	6,000	3,325.00	19,950,000
佐田建設	2,400	973.00	2,335,200
ナカノフドー建設	2,700	751.00	2,027,700
奥村組	31,500	3,835.00	120,802,500
東鉄工業	19,600	3,190.00	62,524,000
イチケン	900	2,556.00	2,300,400

富士ピー・エス	1,700	398.00	676,600	
浅沼組	71,400	619.00	44,196,600	
戸田建設	219,200	940.10	206,069,920	
熊谷組	29,400	3,935.00	115,689,000	
北野建設	700	4,135.00	2,894,500	
植木組	1,100	1,541.00	1,695,100	
矢作建設工業	24,200	1,532.00	37,074,400	
ピーエス・コンストラクション	12,900	1,096.00	14,138,400	
日本ハウスホールディングス	38,100	321.00	12,230,100	
新日本建設	25,000	1,489.00	37,225,000	
東亜道路工業	33,500	1,280.00	42,880,000	
日本道路	20,400	1,761.00	35,924,400	
東亜建設工業	53,800	1,187.00	63,860,600	
日本国土開発	50,700	502.00	25,451,400	
若築建設	6,000	3,715.00	22,290,000	
東洋建設	51,300	1,296.00	66,484,800	
五洋建設	233,200	621.50	144,933,800	
世紀東急工業	25,400	1,470.00	37,338,000	
福田組	6,700	5,220.00	34,974,000	
住友林業	154,000	5,207.00	801,878,000	
日本基礎技術	2,300	576.00	1,324,800	
巴コーポレーション	4,700	920.00	4,324,000	
大和ハウス工業	537,700	4,753.00	2,555,688,100	
ライト工業	36,200	2,242.00	81,160,400	
積水ハウス	540,600	3,615.00	1,954,269,000	
日特建設	17,000	973.00	16,541,000	
北陸電気工事	12,200	1,110.00	13,542,000	
ユアテック	34,400	1,420.00	48,848,000	
日本リーテック	13,900	1,266.00	17,597,400	
四電工	22,400	1,576.00	35,302,400	
中電工	27,700	3,260.00	90,302,000	
関電工	97,600	2,367.00	231,019,200	
きんでん	123,900	3,081.00	381,735,900	
東京エネシス	19,000	1,044.00	19,836,000	
トーエネック	29,600	925.00	27,380,000	
住友電設	14,500	4,830.00	70,035,000	

日本電設工業	33,500	1,999.00	66,966,500
エクシオグループ	188,700	1,717.50	324,092,250
新日本空調	11,500	4,140.00	47,610,000
九電工	38,500	5,067.00	195,079,500
三機工業	37,600	3,190.00	119,944,000
日揮ホールディングス	176,400	1,260.00	222,264,000
中外炉工業	5,800	3,470.00	20,126,000
ヤマト	3,100	1,300.00	4,030,000
太平電業	11,400	4,990.00	56,886,000
高砂熱学工業	43,000	6,436.00	276,748,000
三晃金属工業	500	4,230.00	2,115,000
朝日工業社	16,600	2,194.00	36,420,400
明星工業	33,700	1,370.00	46,169,000
大気社	22,800	4,830.00	110,124,000
ダイダン	23,400	3,940.00	92,196,000
日比谷総合設備	14,500	3,840.00	55,680,000
飛島ホールディングス	18,300	1,573.00	28,785,900
フィル・カンパニー	3,500	877.00	3,069,500
テスホールディングス	38,400	253.00	9,715,200
インフロニア・ホールディングス	186,800	1,155.50	215,847,400
東洋エンジニアリング	26,200	692.00	18,130,400
レイズネクスト	25,800	1,539.00	39,706,200
ニッポン	58,900	2,128.00	125,339,200
日清製粉グループ本社	186,100	1,820.00	338,702,000
日東富士製粉	3,200	6,550.00	20,960,000
昭和産業	16,400	2,790.00	45,756,000
鳥越製粉	3,300	800.00	2,640,000
中部飼料	24,800	1,279.00	31,719,200
フィード・ワン	26,100	752.00	19,627,200
東洋精糖	700	1,445.00	1,011,500
日本甜菜製糖	10,200	2,349.00	23,959,800
DM三井製糖ホールディングス	17,700	3,420.00	60,534,000
塩水港精糖	4,900	310.00	1,519,000
ウェルネオシュガー	10,700	2,126.00	22,748,200
森永製菓	74,800	2,743.00	205,176,400
中村屋	4,500	3,195.00	14,377,500

江崎グリコ	51,200	4,740.00	242,688,000	
名糖産業	7,900	1,938.00	15,310,200	
井村屋グループ	10,400	2,445.00	25,428,000	
不二家	12,300	2,707.00	33,296,100	
山崎製パン	119,700	2,931.00	350,840,700	
第一屋製パン	800	540.00	432,000	
モロゾフ	5,800	4,780.00	27,724,000	
亀田製菓	11,400	4,050.00	46,170,000	
寿スピリッツ	105,800	2,130.00	225,354,000	
カルビー	81,900	3,163.00	259,049,700	
森永乳業	68,700	2,906.50	199,676,550	
六甲バター	13,100	1,361.00	17,829,100	
ヤクルト本社	255,700	3,028.00	774,259,600	
明治ホールディングス	239,300	3,163.00	756,905,900	
雪印メグミルク	48,100	2,712.00	130,447,200	
プリマハム	24,000	2,194.00	52,656,000	
日本ハム	77,000	4,940.00	380,380,000	
林兼産業	1,300	455.00	591,500	
丸大食品	18,000	1,663.00	29,934,000	
S Foods	19,700	2,708.00	53,347,600	
柿安本店	7,000	2,805.00	19,635,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	27,300	3,895.00	106,333,500	
サッポロホールディングス	58,900	8,476.00	499,236,400	
アサヒグループホールディングス	1,343,500	1,663.00	2,234,240,500	
キリンホールディングス	745,300	2,058.50	1,534,200,050	
シマダヤ	5,700	1,350.00	7,695,000	
宝ホールディングス	120,600	1,350.00	162,810,000	
オエノンホールディングス	57,900	396.00	22,928,400	
養命酒製造	5,900	2,500.00	14,750,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	126,100	2,443.00	308,062,300	
ライフドリンク カンパニー	39,100	2,312.00	90,399,200	
サントリー食品インターナショナル	126,000	5,055.00	636,930,000	
ダイドーグループホールディングス	20,300	3,345.00	67,903,500	
伊藤園	59,900	3,558.00	213,124,200	
キーコーヒー	20,000	2,015.00	40,300,000	

ユニカフェ	1,200	948.00	1,137,600	
日清オイリオグループ	25,200	5,100.00	128,520,000	
不二製油グループ本社	35,700	3,571.00	127,484,700	
かどや製油	500	3,590.00	1,795,000	
J-オイルミルズ	20,500	2,128.00	43,624,000	
キッコーマン	592,800	1,736.50	1,029,397,200	
味の素	414,500	6,418.00	2,660,261,000	
ブルドックソース	9,500	1,800.00	17,100,000	
キューピー	96,100	3,376.00	324,433,600	
ハウス食品グループ本社	60,200	2,856.00	171,931,200	
カゴメ	76,600	2,936.00	224,897,600	
アリアケジャパン	17,800	5,530.00	98,434,000	
ピエトロ	500	1,739.00	869,500	
エバラ食品工業	4,800	2,893.00	13,886,400	
やまみ	500	3,775.00	1,887,500	
ニチレイ	72,900	4,137.00	301,587,300	
東洋水産	82,900	10,720.00	888,688,000	
イトアンドホールディングス	9,300	2,110.00	19,623,000	
大冷	500	1,899.00	949,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,800	1,294.00	12,681,200	
日清食品ホールディングス	230,600	3,782.00	872,129,200	
一正蒲鉾	1,600	742.00	1,187,200	
フジッコ	18,400	1,681.00	30,930,400	
ロック・フィールド	21,800	1,507.00	32,852,600	
日本たばこ産業	1,087,200	4,143.00	4,504,269,600	
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,002.00	24,024,000	
わらべや日洋ホールディングス	12,000	1,954.00	23,448,000	
なとり	11,200	2,171.00	24,315,200	
イフジ産業	700	1,629.00	1,140,300	
ファーマフーズ	23,700	926.00	21,946,200	
ユーグレナ	111,200	397.00	44,146,400	
紀文食品	15,500	1,061.00	16,445,500	
ピックルスホールディングス	10,500	1,010.00	10,605,000	
ミヨシ油脂	1,500	1,535.00	2,302,500	
理研ビタミン	15,500	2,407.00	37,308,500	
片倉工業	16,800	1,863.00	31,298,400	

グンゼ	13,000	5,400.00	70,200,000
東洋紡	78,800	931.00	73,362,800
ユニチカ	60,000	141.00	8,460,000
富士紡ホールディングス	7,900	5,400.00	42,660,000
倉敷紡績	12,900	5,420.00	69,918,000
シキボウ	13,100	994.00	13,021,400
日本毛織	46,800	1,280.00	59,904,000
トーア紡コーポレーション	1,600	414.00	662,400
帝国繊維	20,600	2,365.00	48,719,000
帝人	175,000	1,283.50	224,612,500
東レ	1,330,400	987.80	1,314,169,120
SUMINOE	800	2,018.00	1,614,400
日本フェルト	2,900	474.00	1,374,600
イチカワ	700	1,570.00	1,099,000
日東製網	400	1,504.00	601,600
アツギ	2,700	990.00	2,673,000
ダイニツク	1,200	736.00	883,200
セーレン	35,200	2,796.00	98,419,200
ソトー	1,300	655.00	851,500
東海染工	400	701.00	280,400
小松マテーレ	26,400	777.00	20,512,800
ワコールホールディングス	37,700	5,328.00	200,865,600
ホギメディカル	24,500	4,785.00	117,232,500
T S I ホールディングス	57,800	1,062.00	61,383,600
マツオカコーポレーション	1,200	2,019.00	2,422,800
ワールド	28,100	2,512.00	70,587,200
三陽商会	9,400	2,822.00	26,526,800
ナイガイ	1,500	231.00	346,500
オンワードホールディングス	118,100	563.00	66,490,300
ルックホールディングス	5,800	2,422.00	14,047,600
ゴールドウイン	32,200	8,458.00	272,347,600
キング	1,500	730.00	1,095,000
ヤマトインターナショナル	3,100	333.00	1,032,300
特種東海製紙	9,500	3,480.00	33,060,000
王子ホールディングス	689,300	590.50	407,031,650
日本製紙	94,800	848.00	80,390,400

三菱製紙	5,200	467.00	2,428,400	
北越コーポレーション	102,200	1,505.00	153,811,000	
中越パルプ工業	1,500	1,470.00	2,205,000	
大王製紙	91,900	829.00	76,185,100	
阿波製紙	1,000	446.00	446,000	
レンゴー	165,800	853.30	141,477,140	
トーモク	10,500	2,159.00	22,669,500	
ザ・パック	13,500	3,490.00	47,115,000	
北の達人コーポレーション	76,700	140.00	10,738,000	
クラレ	265,200	2,183.50	579,064,200	
旭化成	1,231,300	1,058.50	1,303,331,050	
共和レザー	2,200	673.00	1,480,600	
巴川コーポレーション	1,100	696.00	765,600	
レゾナック・ホールディングス	163,300	4,075.00	665,447,500	
住友化学	1,463,900	342.50	501,385,750	
住友精化	8,600	4,590.00	39,474,000	
日産化学	93,600	4,877.00	456,487,200	
ラサ工業	6,900	2,767.00	19,092,300	
クレハ	37,700	2,746.00	103,524,200	
多木化学	7,100	3,500.00	24,850,000	
テイカ	14,600	1,542.00	22,513,200	
石原産業	30,200	1,485.00	44,847,000	
片倉コープアグリ	900	951.00	855,900	
日本曹達	38,600	2,831.00	109,276,600	
東ソー	243,000	2,054.50	499,243,500	
トクヤマ	58,800	2,564.50	150,792,600	
セントラル硝子	23,000	3,205.00	73,715,000	
東亜合成	87,500	1,502.00	131,425,000	
大阪ソーダ	63,600	1,997.00	127,009,200	
関東電化工業	39,100	1,004.00	39,256,400	
デンカ	66,200	2,104.50	139,317,900	
信越化学工業	1,632,100	5,054.00	8,248,633,400	
日本カーバイド工業	9,600	1,686.00	16,185,600	
堺化学工業	13,600	2,523.00	34,312,800	
第一稀元素化学工業	19,900	663.00	13,193,700	
エア・ウォーター	171,700	1,865.00	320,220,500	

日本酸素ホールディングス	176,600	4,407.00	778,276,200	
日本化学工業	6,700	2,313.00	15,497,100	
東邦アセチレン	4,000	368.00	1,472,000	
日本パーカライジング	81,100	1,291.00	104,700,100	
高压ガス工業	26,400	771.00	20,354,400	
チタン工業	500	799.00	399,500	
四国化成ホールディングス	20,600	2,007.00	41,344,200	
戸田工業	4,100	1,160.00	4,756,000	
ステラ ケミファ	9,900	4,000.00	39,600,000	
保土谷化学工業	5,700	3,650.00	20,805,000	
日本触媒	116,600	1,861.00	216,992,600	
大日精化工業	12,600	2,900.00	36,540,000	
カネカ	44,800	3,637.00	162,937,600	
三菱瓦斯化学	147,600	2,700.50	398,593,800	
三井化学	163,800	3,332.00	545,781,600	
東京応化工業	86,800	3,504.00	304,147,200	
大阪有機化学工業	15,200	2,840.00	43,168,000	
三菱ケミカルグループ	1,330,500	768.40	1,022,356,200	
KHネオケム	32,800	2,002.00	65,665,600	
ダイセル	207,000	1,361.50	281,830,500	
住友ベークライト	57,300	3,718.00	213,041,400	
積水化学工業	362,400	2,375.00	860,700,000	
日本ゼオン	140,400	1,439.50	202,105,800	
アイカ工業	45,900	3,231.00	148,302,900	
UBE	93,800	2,321.50	217,756,700	
積水樹脂	26,600	2,183.00	58,067,800	
旭有機材	12,100	4,455.00	53,905,500	
ニチバン	11,300	1,996.00	22,554,800	
リケンテクノス	34,100	1,058.00	36,077,800	
大倉工業	8,400	3,010.00	25,284,000	
積水化成成品工業	25,500	345.00	8,797,500	
群栄化学工業	4,300	2,605.00	11,201,500	
タイガースポリマー	1,700	703.00	1,195,100	
ミライアル	1,300	1,287.00	1,673,100	
ダイキアクシス	1,600	726.00	1,161,600	
ダイキョーニシカワ	40,200	610.00	24,522,000	

竹本容器	1,400	860.00	1,204,000	
森六ホールディングス	10,100	1,932.00	19,513,200	
恵和	11,800	993.00	11,717,400	
日本化薬	127,400	1,265.00	161,161,000	
カーリット	19,200	1,240.00	23,808,000	
日本精化	12,100	2,236.00	27,055,600	
扶桑化学工業	16,900	3,480.00	58,812,000	
トリケミカル研究所	19,900	2,761.00	54,943,900	
A D E K A	63,500	2,792.00	177,292,000	
日油	214,200	2,170.00	464,814,000	
新日本理化	5,300	190.00	1,007,000	
ハリマ化成グループ	14,200	860.00	12,212,000	
花王	443,200	6,484.00	2,873,708,800	
第一工業製薬	7,100	3,850.00	27,335,000	
石原ケミカル	8,000	2,386.00	19,088,000	
日華化学	1,500	1,144.00	1,716,000	
ニイタカ	800	2,002.00	1,601,600	
三洋化成工業	11,200	3,990.00	44,688,000	
有機合成薬品工業	3,100	260.00	806,000	
大日本塗料	20,200	1,102.00	22,260,400	
日本ペイントホールディングス	805,400	1,016.50	818,689,100	
関西ペイント	152,400	2,216.50	337,794,600	
神東塗料	3,200	129.00	412,800	
中国塗料	41,100	2,303.00	94,653,300	
日本特殊塗料	2,700	1,246.00	3,364,200	
藤倉化成	23,100	501.00	11,573,100	
太陽ホールディングス	31,700	3,970.00	125,849,000	
D I C	64,700	3,592.00	232,402,400	
サカタインクス	40,500	1,670.00	67,635,000	
a r t i e n c e	32,600	3,025.00	98,615,000	
富士フイルムホールディングス	1,098,700	3,267.00	3,589,452,900	
資生堂	380,500	2,710.50	1,031,345,250	
ライオン	231,900	1,764.00	409,071,600	
高砂香料工業	12,300	5,600.00	68,880,000	
マンダム	38,500	1,293.00	49,780,500	
ミルボン	29,300	3,505.00	102,696,500	

コーセー	37,100	6,892.00	255,693,200	
コタ	18,500	1,592.00	29,452,000	
シーボン	500	1,064.00	532,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	93,400	1,463.50	136,690,900	
ノエビアホールディングス	16,200	4,865.00	78,813,000	
アジュバンホールディングス	900	807.00	726,300	
新日本製薬	10,400	1,953.00	20,311,200	
I - n e	6,000	1,907.00	11,442,000	
アクシージア	12,000	504.00	6,048,000	
エステー	14,800	1,532.00	22,673,600	
アグロ カネショウ	6,300	1,890.00	11,907,000	
コニシ	57,400	1,224.00	70,257,600	
長谷川香料	34,800	3,060.00	106,488,000	
小林製薬	47,700	5,962.00	284,387,400	
荒川化学工業	16,800	1,081.00	18,160,800	
メック	15,000	3,225.00	48,375,000	
日本高純度化学	4,500	3,165.00	14,242,500	
タカラバイオ	57,300	992.00	56,841,600	
J C U	20,100	3,790.00	76,179,000	
新田ゼラチン	2,600	725.00	1,885,000	
O A Tアグリオ	7,500	1,963.00	14,722,500	
デクセリアルズ	159,600	2,437.00	388,945,200	
アース製薬	16,600	5,570.00	92,462,000	
北興化学工業	16,300	1,291.00	21,043,300	
大成ラミック	5,300	2,423.00	12,841,900	
クミアイ化学工業	72,400	728.00	52,707,200	
日本農薬	32,700	665.00	21,745,500	
アキレス	11,200	1,430.00	16,016,000	
有沢製作所	27,400	1,426.00	39,072,400	
日東電工	576,300	2,564.50	1,477,921,350	
レック	23,300	1,231.00	28,682,300	
三光合成	22,900	591.00	13,533,900	
きもと	6,300	277.00	1,745,100	
Z A C R O S	14,400	4,220.00	60,768,000	
前澤化成工業	12,800	1,741.00	22,284,800	
未来工業	6,500	3,640.00	23,660,000	

ウェーブロックホールディングス	1,400	644.00	901,600	
JSP	14,900	2,132.00	31,766,800	
エフピコ	40,200	2,785.00	111,957,000	
天馬	15,200	2,987.00	45,402,400	
信越ポリマー	39,300	1,620.00	63,666,000	
東リ	8,500	467.00	3,969,500	
ニフコ	68,100	3,730.00	254,013,000	
バルカー	14,900	3,140.00	46,786,000	
ユニ・チャーム	379,700	3,965.00	1,505,510,500	
ショーエイコーポレーション	1,200	570.00	684,000	
協和キリン	214,300	2,375.50	509,069,650	
武田薬品工業	1,621,500	4,105.00	6,656,257,500	
アステラス製薬	1,598,500	1,542.50	2,465,686,250	
住友ファーマ	162,200	579.00	93,913,800	
塩野義製薬	604,500	2,194.50	1,326,575,250	
わかもと製薬	4,000	229.00	916,000	
日本新薬	47,700	4,183.00	199,529,100	
中外製薬	570,400	6,650.00	3,793,160,000	
科研製薬	31,200	4,237.00	132,194,400	
エーザイ	241,800	4,316.00	1,043,608,800	
ロート製薬	192,600	2,719.00	523,679,400	
小野薬品工業	372,700	1,606.00	598,556,200	
久光製薬	40,500	4,119.00	166,819,500	
持田製薬	22,900	3,485.00	79,806,500	
参天製薬	346,300	1,544.50	534,860,350	
扶桑薬品工業	7,100	2,567.00	18,225,700	
日本ケミファ	400	1,511.00	604,400	
ツムラ	62,600	4,847.00	303,422,200	
キッセイ薬品工業	30,200	3,445.00	104,039,000	
生化学工業	34,700	786.00	27,274,200	
栄研化学	28,800	2,150.00	61,920,000	
鳥居薬品	9,800	4,400.00	43,120,000	
JCRファーマ	61,700	607.00	37,451,900	
東和薬品	24,500	2,915.00	71,417,500	
富士製薬工業	13,500	1,549.00	20,911,500	
ゼリア新薬工業	28,900	2,406.00	69,533,400	

ネクセラファーマ	85,500	1,034.00	88,407,000	
第一三共	1,719,900	4,382.00	7,536,601,800	
杏林製薬	39,500	1,447.00	57,156,500	
大幸薬品	41,300	317.00	13,092,100	
ダイト	13,600	2,018.00	27,444,800	
大塚ホールディングス	454,800	8,483.00	3,858,068,400	
ペプチドリーム	88,300	2,570.00	226,931,000	
セルソース	12,100	828.00	10,018,800	
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,050.00	37,515,000	
サワイグループホールディングス	107,200	2,178.50	233,535,200	
日本コークス工業	184,900	93.00	17,195,700	
ニチレキグループ	19,400	2,555.00	49,567,000	
ユシロ化学工業	9,400	2,110.00	19,834,000	
ビーピー・カストロール	1,800	891.00	1,603,800	
富士石油	51,900	280.00	14,532,000	
MORESCO	1,400	1,277.00	1,787,800	
出光興産	851,600	1,008.50	858,838,600	
ENEOSホールディングス	3,091,100	807.50	2,496,063,250	
コスモエネルギーホールディングス	60,000	6,689.00	401,340,000	
横浜ゴム	92,200	3,276.00	302,047,200	
TOYO TIRE	104,700	2,434.00	254,839,800	
ブリヂストン	533,400	5,247.00	2,798,749,800	
住友ゴム工業	178,700	1,756.50	313,886,550	
藤倉コンポジット	17,500	1,521.00	26,617,500	
オカモト	9,700	5,510.00	53,447,000	
フコク	10,800	1,720.00	18,576,000	
ニッタ	18,100	3,565.00	64,526,500	
住友理工	35,300	1,657.00	58,492,100	
三ツ星ベルト	25,400	3,970.00	100,838,000	
バンドー化学	27,000	1,820.00	49,140,000	
日東紡績	20,500	6,210.00	127,305,000	
AGC	177,300	4,554.00	807,424,200	
日本板硝子	93,300	347.00	32,375,100	
石塚硝子	700	2,256.00	1,579,200	
日本山村硝子	1,400	1,575.00	2,205,000	
日本電気硝子	67,600	3,363.00	227,338,800	

オハラ	8,700	1,090.00	9,483,000	
住友大阪セメント	32,700	3,282.00	107,321,400	
太平洋セメント	112,400	3,541.00	398,008,400	
日本ヒューム	16,000	1,327.00	21,232,000	
日本コンクリート工業	35,400	363.00	12,850,200	
三谷セキサン	7,600	5,420.00	41,192,000	
アジアパイルホールディングス	25,900	790.00	20,461,000	
東海カーボン	168,100	879.00	147,759,900	
日本カーボン	10,500	4,405.00	46,252,500	
東洋炭素	12,800	4,215.00	53,952,000	
ノリタケ	20,200	3,775.00	76,255,000	
TOTO	132,300	3,801.00	502,872,300	
日本碍子	212,000	1,954.50	414,354,000	
日本特殊陶業	148,900	4,944.00	736,161,600	
MARUWA	7,600	44,640.00	339,264,000	
品川リフラクトリーズ	22,400	1,692.00	37,900,800	
黒崎播磨	14,500	2,419.00	35,075,500	
ヨータイ	10,400	1,590.00	16,536,000	
東京窯業	4,100	410.00	1,681,000	
ニッカトー	1,700	510.00	867,000	
フジインコーポレーテッド	49,000	2,363.00	115,787,000	
クニミネ工業	1,100	1,014.00	1,115,400	
エーアンドエーマテリアル	800	1,246.00	996,800	
ニチアス	46,100	5,754.00	265,259,400	
ニチハ	22,800	2,912.00	66,393,600	
日本製鉄	949,300	2,982.00	2,830,812,600	
神戸製鋼所	377,000	1,471.50	554,755,500	
中山製鋼所	41,900	709.00	29,707,100	
合同製鉄	10,500	3,720.00	39,060,000	
JFEホールディングス	564,800	1,670.00	943,216,000	
東京製鉄	52,400	1,452.00	76,084,800	
共英製鋼	20,900	1,761.00	36,804,900	
大和工業	35,300	7,295.00	257,513,500	
東京製鋼	8,300	6,440.00	53,452,000	
大阪製鉄	8,600	2,929.00	25,189,400	
淀川製鋼所	17,300	5,480.00	94,804,000	

中部鋼板	12,300	2,320.00	28,536,000
丸一鋼管	57,100	3,385.00	193,283,500
モリ工業	4,800	4,655.00	22,344,000
大同特殊鋼	118,100	1,115.00	131,681,500
日本高周波鋼業	1,600	344.00	550,400
日本冶金工業	13,400	3,760.00	50,384,000
山陽特殊製鋼	18,500	1,745.00	32,282,500
愛知製鋼	10,800	4,955.00	53,514,000
日本金属	1,000	637.00	637,000
大太平洋金属	17,300	1,416.00	24,496,800
新日本電工	112,000	276.00	30,912,000
栗本鐵工所	8,700	4,080.00	35,496,000
虹技	500	1,190.00	595,000
三菱製鋼	13,900	1,435.00	19,946,500
日垂鋼業	4,100	308.00	1,262,800
日本精線	14,900	1,290.00	19,221,000
エンビプロ・ホールディングス	18,500	394.00	7,289,000
シンニッタン	5,000	199.00	995,000
新家工業	900	5,020.00	4,518,000
大紀アルミニウム工業所	27,200	1,021.00	27,771,200
日本軽金属ホールディングス	55,100	1,488.00	81,988,800
三井金属鉱業	46,900	4,524.00	212,175,600
三菱マテリアル	134,300	2,286.50	307,076,950
住友金属鉱山	237,300	3,455.00	819,871,500
DOWAホールディングス	50,700	4,317.00	218,871,900
古河機械金属	25,100	1,529.00	38,377,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,800	1,779.00	58,351,200
東邦チタニウム	39,300	997.00	39,182,100
UACJ	26,400	5,190.00	137,016,000
CKサンエツ	4,700	3,795.00	17,836,500
古河電気工業	62,500	6,872.00	429,500,000
住友電気工業	647,600	2,800.50	1,813,603,800
フジクラ	201,100	6,244.00	1,255,668,400
SWCC	25,200	7,350.00	185,220,000
カナレ電気	1,000	1,440.00	1,440,000
平河ヒューテック	12,300	1,503.00	18,486,900

リョービ	20,200	2,168.00	43,793,600	
アーレスティ	4,900	544.00	2,665,600	
AREホールディングス	76,200	1,672.00	127,406,400	
稲葉製作所	10,400	1,660.00	17,264,000	
宮地エンジニアリンググループ	22,600	1,900.00	42,940,000	
トーカロ	54,100	1,828.00	98,894,800	
アルファC o	1,400	1,070.00	1,498,000	
SUMCO	356,900	1,120.50	399,906,450	
川田テクノロジーズ	13,000	2,628.00	34,164,000	
RS Technologies	14,300	3,290.00	47,047,000	
ジェイテックコーポレーション	700	1,203.00	842,100	
信和	2,500	733.00	1,832,500	
東洋製罐グループホールディングス	119,500	2,439.50	291,520,250	
ホッカンホールディングス	10,100	1,611.00	16,271,100	
コロナ	10,500	966.00	10,143,000	
横河ブリッジホールディングス	32,300	2,778.00	89,729,400	
駒井ハルテック	700	1,573.00	1,101,100	
高田機工	900	1,007.00	906,300	
三和ホールディングス	185,100	4,507.00	834,245,700	
文化シャッター	49,100	1,860.00	91,326,000	
三協立山	23,600	650.00	15,340,000	
アルインコ	14,300	1,038.00	14,843,400	
東洋シャッター	900	774.00	696,600	
LIXIL	273,300	1,687.00	461,057,100	
日本ファイルコン	2,600	500.00	1,300,000	
ノーリツ	26,400	1,665.00	43,956,000	
長府製作所	20,900	1,885.00	39,396,500	
リンナイ	99,700	3,148.00	313,855,600	
ダイニチ工業	2,000	615.00	1,230,000	
日東精工	27,200	615.00	16,728,000	
三洋工業	500	2,816.00	1,408,000	
岡部	33,500	762.00	25,527,000	
ジーテクト	23,400	1,635.00	38,259,000	
東プレ	33,000	1,914.00	63,162,000	
高周波熱錬	27,800	958.00	26,632,400	
東京製網	11,900	1,271.00	15,124,900	

サンコール	20,800	269.00	5,595,200	
モリテック スチール	3,500	157.00	549,500	
パイオラックス	25,200	2,549.00	64,234,800	
エイチワン	19,300	998.00	19,261,400	
日本発條	165,800	1,873.50	310,626,300	
中央発條	13,600	1,282.00	17,435,200	
アドバネクス	500	935.00	467,500	
立川ブラインド工業	8,500	1,330.00	11,305,000	
日本ドライケミカル	900	4,360.00	3,924,000	
日本製鋼所	55,600	6,215.00	345,554,000	
三浦工業	85,100	3,994.00	339,889,400	
タクマ	62,000	1,612.00	99,944,000	
ツガミ	39,200	1,420.00	55,664,000	
オークマ	32,100	3,210.00	103,041,000	
芝浦機械	23,600	3,475.00	82,010,000	
アマダ	255,000	1,477.00	376,635,000	
アイダエンジニアリング	41,500	797.00	33,075,500	
F U J I	79,800	2,278.00	181,784,400	
牧野フライス製作所	20,300	7,420.00	150,626,000	
オーエスジー	80,900	1,783.00	144,244,700	
ダイジェット工業	400	689.00	275,600	
旭ダイヤモンド工業	45,900	802.00	36,811,800	
DMG森精機	115,800	2,436.50	282,146,700	
ソディック	48,400	718.00	34,751,200	
ディスコ	88,400	41,540.00	3,672,136,000	
日東工器	8,300	2,557.00	21,223,100	
日進工具	16,700	730.00	12,191,000	
パンチ工業	3,900	398.00	1,552,200	
富士ダイス	13,600	782.00	10,635,200	
豊和工業	2,100	1,225.00	2,572,500	
リケンN P R	23,000	2,469.00	56,787,000	
東洋機械金属	3,200	645.00	2,064,000	
エンシュウ	1,000	545.00	545,000	
島精機製作所	29,200	992.00	28,966,400	
オプトラン	30,100	1,905.00	57,340,500	
イワキポンプ	12,200	2,527.00	30,829,400	

フリー	17,300	1,080.00	18,684,000	
ヤマシンフィルタ	42,700	646.00	27,584,200	
日阪製作所	22,300	1,059.00	23,615,700	
やまびこ	30,000	2,508.00	75,240,000	
野村マイクロ・サイエンス	30,400	1,582.00	48,092,800	
平田機工	8,800	5,240.00	46,112,000	
PEGASUS	20,300	430.00	8,729,000	
マルマエ	8,000	1,377.00	11,016,000	
タツモ	13,100	2,153.00	28,204,300	
ナブテスコ	115,200	2,731.00	314,611,200	
三井海洋開発	23,200	3,145.00	72,964,000	
レオン自動機	20,800	1,425.00	29,640,000	
SMC	54,900	61,290.00	3,364,821,000	
ホソカワミクロン	12,800	4,175.00	53,440,000	
ユニオンツール	8,100	4,865.00	39,406,500	
瑞光	12,900	1,155.00	14,899,500	
オイレス工業	24,900	2,426.00	60,407,400	
日精エー・エス・ビー機械	6,300	4,930.00	31,059,000	
サトーホールディングス	24,600	2,149.00	52,865,400	
技研製作所	17,200	1,730.00	29,756,000	
日本エアーテック	8,600	1,171.00	10,070,600	
カワタ	1,200	797.00	956,400	
日精樹脂工業	13,400	961.00	12,877,400	
オカダアイオン	1,300	1,835.00	2,385,500	
ワイエイシイホールディングス	9,300	1,785.00	16,600,500	
小松製作所	904,600	4,162.00	3,764,945,200	
住友重機械工業	108,600	3,208.00	348,388,800	
日立建機	73,100	3,395.00	248,174,500	
日工	27,200	703.00	19,121,600	
巴工業	7,200	3,795.00	27,324,000	
井関農機	17,200	910.00	15,652,000	
TOWA	56,200	1,411.00	79,298,200	
丸山製作所	700	1,988.00	1,391,600	
北川鉄工所	7,200	1,147.00	8,258,400	
ローツェ	95,900	1,512.00	145,000,800	
タカキタ	1,300	368.00	478,400	

クボタ	959,400	1,821.00	1,747,067,400
荏原実業	8,800	4,040.00	35,552,000
三菱化工機	6,500	3,550.00	23,075,000
月島ホールディングス	24,800	1,422.00	35,265,600
帝国電機製作所	12,600	2,715.00	34,209,000
新東工業	40,800	903.00	36,842,400
澁谷工業	17,200	3,755.00	64,586,000
アイチ コーポレーション	30,400	1,411.00	42,894,400
小森コーポレーション	45,200	1,184.00	53,516,800
鶴見製作所	14,000	3,125.00	43,750,000
日本ギア工業	1,500	522.00	783,000
酒井重工業	7,200	2,315.00	16,668,000
荏原製作所	376,800	2,536.00	955,564,800
西島製作所	15,800	2,386.00	37,698,800
北越工業	18,500	1,760.00	32,560,000
ダイキン工業	239,000	17,660.00	4,220,740,000
オルガノ	28,400	8,120.00	230,608,000
トーヨーカネツ	6,800	4,140.00	28,152,000
栗田工業	102,600	5,433.00	557,425,800
椿本チエイン	83,200	1,887.00	156,998,400
大同工業	1,700	760.00	1,292,000
木村化工機	14,000	893.00	12,502,000
アネスト岩田	31,200	1,438.00	44,865,600
ダイフク	309,700	3,360.00	1,040,592,000
サムコ	4,400	2,924.00	12,865,600
加藤製作所	2,000	1,391.00	2,782,000
油研工業	700	2,580.00	1,806,000
タダノ	105,600	1,128.50	119,169,600
フジテック	59,000	6,144.00	362,496,000
CKD	50,800	2,468.00	125,374,400
平和	61,000	2,320.00	141,520,000
理想科学工業	14,700	3,100.00	45,570,000
SANKYO	212,000	2,062.00	437,144,000
日本金銭機械	22,200	986.00	21,889,200
マースグループホールディングス	12,400	3,185.00	39,494,000
フクシマガリレイ	13,500	5,220.00	70,470,000

オーイズミ	1,500	324.00	486,000	
ダイコク電機	8,800	2,842.00	25,009,600	
竹内製作所	33,300	4,835.00	161,005,500	
アマノ	52,100	4,284.00	223,196,400	
J U K I	28,500	357.00	10,174,500	
ジャノメ	18,200	972.00	17,690,400	
マックス	22,600	3,370.00	76,162,000	
グローリー	48,100	2,598.00	124,963,800	
新晃工業	55,500	1,239.00	68,764,500	
大和冷機工業	28,100	1,464.00	41,138,400	
セガサミーホールディングス	163,900	2,610.00	427,779,000	
T P R	23,300	2,301.00	53,613,300	
ツバキ・ナカシマ	45,300	466.00	21,109,800	
ホシザキ	118,100	6,251.00	738,243,100	
大豊工業	15,900	582.00	9,253,800	
日本精工	339,800	665.00	225,967,000	
NTN	434,200	249.80	108,463,160	
ジェイテクト	163,300	1,128.00	184,202,400	
不二越	13,500	3,070.00	41,445,000	
日本トムソン	50,000	494.00	24,700,000	
THK	105,900	3,640.00	385,476,000	
ユーシン精機	17,000	652.00	11,084,000	
前澤給装工業	13,200	1,282.00	16,922,400	
イーグル工業	20,300	1,951.00	39,605,300	
前澤工業	2,400	1,199.00	2,877,600	
P I L L A R	17,000	4,105.00	69,785,000	
キッツ	61,400	1,097.00	67,355,800	
マキタ	228,300	4,723.00	1,078,260,900	
三井E&S	98,100	1,724.00	169,124,400	
カナデビア	150,400	925.00	139,120,000	
三菱重工業	3,209,300	2,236.50	7,177,599,450	
I H I	147,100	8,347.00	1,227,843,700	
スター精密	30,900	1,856.00	57,350,400	
日清紡ホールディングス	138,000	865.00	119,370,000	
イビデン	105,300	4,363.00	459,423,900	
コニカミノルタ	410,200	671.50	275,449,300	

ブラザー工業	245,300	2,731.50	670,036,950
ミネベアミツミ	319,300	2,500.00	798,250,000
日立製作所	4,725,700	3,865.00	18,264,830,500
三菱電機	1,866,600	2,599.00	4,851,293,400
富士電機	111,600	8,502.00	948,823,200
東洋電機製造	1,400	1,115.00	1,561,000
安川電機	199,300	3,886.00	774,479,800
シンフォニアテクノロジー	18,200	6,710.00	122,122,000
明電舎	30,900	4,345.00	134,260,500
オリジン	900	1,136.00	1,022,400
山洋電気	8,000	8,470.00	67,760,000
デンヨー	14,000	2,828.00	39,592,000
PHCホールディングス	34,600	931.00	32,212,600
KOKUSAI ELECTRIC	128,600	2,113.50	271,796,100
ソシオネクスト	182,900	2,643.50	483,496,150
東芝テック	27,400	3,555.00	97,407,000
芝浦メカトロニクス	13,300	7,710.00	102,543,000
マブチモーター	80,600	2,260.00	182,156,000
ニデック	810,400	2,750.00	2,228,600,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	12,300	281.00	3,456,300
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,136.00	10,678,400
東光高岳	10,900	2,060.00	22,454,000
ダブル・スコープ	56,300	249.00	14,018,700
ダイヘン	17,400	7,530.00	131,022,000
ヤーマン	36,000	717.00	25,812,000
JVCケンウッド	145,000	1,720.00	249,400,000
ミマキエンジニアリング	17,200	1,579.00	27,158,800
I-PEX	10,100	2,962.00	29,916,200
大崎電気工業	39,400	808.00	31,835,200
オムロン	168,200	5,128.00	862,529,600
日東工業	24,700	2,805.00	69,283,500
IDEC	27,100	2,351.00	63,712,100
正興電機製作所	1,400	1,173.00	1,642,200
不二電機工業	900	1,100.00	990,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	82,000	2,511.50	205,943,000
サクサ	900	2,772.00	2,494,800

メルコホールディングス	5,700	2,078.00	11,844,600	
テクノメディカ	4,500	1,791.00	8,059,500	
日本電気	259,600	13,470.00	3,496,812,000	
富士通	1,688,700	2,809.50	4,744,402,650	
沖電気工業	88,900	1,063.00	94,500,700	
電気興業	7,400	1,606.00	11,884,400	
サンケン電気	18,800	5,887.00	110,675,600	
ナカヨ	600	1,128.00	676,800	
アイホン	11,100	2,662.00	29,548,200	
ルネサスエレクトロニクス	1,398,300	2,029.50	2,837,849,850	
セイコーエプソン	235,400	2,826.50	665,358,100	
ワコム	129,300	755.00	97,621,500	
アルバック	40,200	6,053.00	243,330,600	
アクセル	9,300	1,208.00	11,234,400	
E I Z O	23,900	2,161.00	51,647,900	
日本信号	41,800	902.00	37,703,600	
京三製作所	42,700	505.00	21,563,500	
能美防災	24,900	3,280.00	81,672,000	
ホーチキ	13,500	2,527.00	34,114,500	
星和電機	2,000	528.00	1,056,000	
エレコム	44,000	1,487.00	65,428,000	
パナソニック ホールディングス	2,168,100	1,588.00	3,442,942,800	
シャープ	265,200	989.90	262,521,480	
アンリツ	129,300	1,310.50	169,447,650	
富士通ゼネラル	52,000	2,322.00	120,744,000	
ソニーグループ	6,363,100	3,284.00	20,896,420,400	
T D K	1,585,100	2,019.00	3,200,316,900	
帝国通信工業	8,100	2,557.00	20,711,700	
タムラ製作所	73,100	489.00	35,745,900	
アルプスアルパイン	149,100	1,578.50	235,354,350	
池上通信機	1,200	650.00	780,000	
日本電波工業	21,700	840.00	18,228,000	
鈴木	9,900	1,790.00	17,721,000	
メイコー	18,200	9,130.00	166,166,000	
日本トリム	4,200	3,710.00	15,582,000	
フォスター電機	18,700	1,488.00	27,825,600	

SMK	4,800	2,442.00	11,721,600	
ヨコオ	16,300	1,752.00	28,557,600	
ホシデン	46,000	2,238.00	102,948,000	
ヒロセ電機	26,700	18,500.00	493,950,000	
日本航空電子工業	47,800	2,771.00	132,453,800	
TOA	20,400	963.00	19,645,200	
マクセル	37,300	1,741.00	64,939,300	
古野電気	23,500	2,642.00	62,087,000	
スミダコーポレーション	25,000	876.00	21,900,000	
アイコム	7,100	2,624.00	18,630,400	
リオン	7,600	2,583.00	19,630,800	
横河電機	200,800	3,465.00	695,772,000	
新電元工業	7,000	2,348.00	16,436,000	
アズビル	500,000	1,244.00	622,000,000	
東亜ディーケーケー	2,000	730.00	1,460,000	
日本光電工業	162,700	2,148.00	349,479,600	
チノー	7,600	2,172.00	16,507,200	
共和電業	3,900	425.00	1,657,500	
日本電子材料	11,200	2,123.00	23,777,600	
堀場製作所	34,400	9,043.00	311,079,200	
アドバンテスト	572,600	8,609.00	4,929,513,400	
小野測器	2,100	605.00	1,270,500	
エスペック	16,200	2,623.00	42,492,600	
キーエンス	181,800	64,180.00	11,667,924,000	
日置電機	9,600	7,450.00	71,520,000	
シスメックス	470,500	2,915.50	1,371,742,750	
日本マイクロニクス	30,000	3,845.00	115,350,000	
メガチップス	14,100	6,220.00	87,702,000	
OBARA GROUP	11,400	4,050.00	46,170,000	
澤藤電機	600	900.00	540,000	
原田工業	2,000	514.00	1,028,000	
コーセル	19,600	1,091.00	21,383,600	
イリソ電子工業	18,500	2,640.00	48,840,000	
オブテックスグループ	33,500	1,714.00	57,419,000	
千代田インテグレ	6,400	3,495.00	22,368,000	
レーザーテック	83,300	14,800.00	1,232,840,000	

スタンレー電気	113,900	2,531.00	288,280,900	
ウシオ電機	80,500	2,064.00	166,152,000	
岡谷電機産業	3,700	221.00	817,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	953.00	3,907,300	
エノモト	1,200	1,455.00	1,746,000	
日本セラミック	16,700	2,572.00	42,952,400	
遠藤照明	1,800	1,425.00	2,565,000	
古河電池	13,500	1,370.00	18,495,000	
山一電機	16,100	2,260.00	36,386,000	
図研	16,700	4,300.00	71,810,000	
日本電子	42,100	5,497.00	231,423,700	
カシオ計算機	145,400	1,287.00	187,129,800	
ファナック	879,300	4,017.00	3,532,148,100	
日本シイエムケイ	53,800	401.00	21,573,800	
エンプラス	5,300	4,820.00	25,546,000	
大真空	26,900	534.00	14,364,600	
ローム	329,400	1,409.00	464,124,600	
浜松ホトニクス	291,800	1,747.00	509,774,600	
三井ハイテック	80,700	844.00	68,110,800	
新光電気工業	64,300	5,540.00	356,222,000	
京セラ	1,129,100	1,521.00	1,717,361,100	
太陽誘電	79,700	2,197.50	175,140,750	
村田製作所	1,623,200	2,440.00	3,960,608,000	
双葉電子工業	35,000	499.00	17,465,000	
北陸電気工業	1,600	1,577.00	2,523,200	
ニチコン	47,900	1,036.00	49,624,400	
日本ケミコン	22,600	944.00	21,334,400	
KOA	30,500	956.00	29,158,000	
市光工業	33,300	380.00	12,654,000	
小糸製作所	188,400	2,014.50	379,531,800	
ミツバ	34,100	886.00	30,212,600	
S C R E E Nホールディングス	75,900	9,278.00	704,200,200	
キヤノン電子	17,300	2,423.00	41,917,900	
キヤノン	906,300	5,163.00	4,679,226,900	
リコー	478,600	1,778.00	850,950,800	
象印マホービン	54,400	1,816.00	98,790,400	

MUTOHホールディングス	600	2,425.00	1,455,000	
東京エレクトロン	384,600	23,300.00	8,961,180,000	
イノテック	13,200	1,336.00	17,635,200	
トヨタ紡織	76,500	1,990.50	152,273,250	
芦森工業	800	2,627.00	2,101,600	
ユニプレス	32,600	1,060.00	34,556,000	
豊田自動織機	155,000	11,515.00	1,784,825,000	
モリタホールディングス	28,700	2,101.00	60,298,700	
三櫻工業	27,200	707.00	19,230,400	
デンソー	1,927,400	2,050.00	3,951,170,000	
東海理化電機製作所	51,200	2,179.00	111,564,800	
川崎重工業	136,900	6,524.00	893,135,600	
名村造船所	51,900	1,671.00	86,724,900	
日本車輛製造	7,000	2,191.00	15,337,000	
三菱ロジスネクスト	29,000	1,937.00	56,173,000	
近畿車輛	500	1,400.00	700,000	
日産自動車	2,271,200	443.00	1,006,141,600	
いすゞ自動車	561,200	2,078.50	1,166,454,200	
トヨタ自動車	9,659,200	2,771.50	26,770,472,800	
日野自動車	273,300	486.00	132,823,800	
三菱自動車工業	708,800	466.60	330,726,080	
エフテック	2,700	500.00	1,350,000	
レシップホールディングス	1,800	470.00	846,000	
GMB	800	975.00	780,000	
ファルテック	800	424.00	339,200	
武蔵精密工業	44,500	4,125.00	183,562,500	
日産車体	27,600	1,006.00	27,765,600	
新明和工業	52,300	1,359.00	71,075,700	
極東開発工業	24,600	2,402.00	59,089,200	
トピー工業	14,700	1,896.00	27,871,200	
ティラド	4,000	3,540.00	14,160,000	
曙ブレーキ工業	110,900	113.00	12,531,700	
タチエス	33,500	1,655.00	55,442,500	
NOK	70,600	2,429.00	171,487,400	
フタバ産業	54,800	700.00	38,360,000	
カヤバ	31,000	2,811.00	87,141,000	

大同メタル工業	35,600	476.00	16,945,600	
プレス工業	71,100	526.00	37,398,600	
ミクニ	4,900	311.00	1,523,900	
太平洋工業	41,700	1,303.00	54,335,100	
アイシン	384,800	1,733.00	666,858,400	
マツダ	558,100	983.40	548,835,540	
今仙電機製作所	2,500	502.00	1,255,000	
本田技研工業	4,305,200	1,229.50	5,293,243,400	
スズキ	1,468,400	1,737.50	2,551,345,000	
S U B A R U	547,900	2,599.50	1,424,266,050	
安永	1,700	465.00	790,500	
ヤマハ発動機	767,100	1,398.00	1,072,405,800	
T B K	4,300	261.00	1,122,300	
エクセディ	29,700	4,585.00	136,174,500	
豊田合成	52,000	2,736.00	142,272,000	
愛三工業	34,500	1,603.00	55,303,500	
盟和産業	600	1,275.00	765,000	
日本プラスト	3,300	338.00	1,115,400	
ヨロズ	18,700	1,177.00	22,009,900	
エフ・シー・シー	31,800	3,155.00	100,329,000	
シマノ	79,000	21,145.00	1,670,455,000	
テイ・エス テック	73,900	1,731.00	127,920,900	
ジャムコ	11,000	1,471.00	16,181,000	
リガク・ホールディングス	91,800	921.00	84,547,800	
テルモ	1,215,500	3,027.00	3,679,318,500	
クリエートメディック	1,200	926.00	1,111,200	
日機装	47,000	942.00	44,274,000	
日本エム・ディ・エム	14,400	578.00	8,323,200	
島津製作所	261,500	4,447.00	1,162,890,500	
J M S	16,800	432.00	7,257,600	
長野計器	12,900	2,490.00	32,121,000	
ブイ・テクノロジー	9,400	2,315.00	21,761,000	
東京計器	13,600	3,135.00	42,636,000	
愛知時計電機	8,600	1,985.00	17,071,000	
インターアクション	11,000	973.00	10,703,000	
オーバル	3,400	352.00	1,196,800	

東京精密	37,200	7,085.00	263,562,000	
マニー	72,700	1,777.00	129,187,900	
ニコン	286,600	1,637.00	469,164,200	
トプコン	103,100	2,796.00	288,267,600	
オリンパス	1,040,300	2,375.50	2,471,232,650	
理研計器	25,700	3,755.00	96,503,500	
タムロン	25,000	4,420.00	110,500,000	
HOYA	355,000	19,530.00	6,933,150,000	
シード	2,300	522.00	1,200,600	
ノーリツ鋼機	17,200	5,000.00	86,000,000	
A&Dホロンホールディングス	22,700	1,966.00	44,628,200	
朝日インテック	221,500	2,527.00	559,730,500	
シチズン時計	167,200	905.00	151,316,000	
リズム	900	3,805.00	3,424,500	
大研医器	3,300	518.00	1,709,400	
メニコン	67,700	1,434.00	97,081,800	
シンシア	400	518.00	207,200	
松風	18,200	2,170.00	39,494,000	
セイコーグループ	28,100	4,715.00	132,491,500	
ニプロ	151,500	1,457.50	220,811,250	
三井松島ホールディングス	12,400	3,280.00	40,672,000	
KYORITSU	5,700	164.00	934,800	
中本パックス	1,300	1,791.00	2,328,300	
パラマウントベッドホールディングス	42,000	2,696.00	113,232,000	
トランザクション	12,000	2,115.00	25,380,000	
粧美堂	1,000	503.00	503,000	
ニホンフラッシュ	16,700	791.00	13,209,700	
前田工織	32,400	1,921.00	62,240,400	
永大産業	4,500	207.00	931,500	
アートネイチャー	18,700	801.00	14,978,700	
フルヤ金属	17,300	3,510.00	60,723,000	
バンダイナムコホールディングス	493,300	3,773.00	1,861,220,900	
アイフィスジャパン	1,100	563.00	619,300	
SHOEI	51,100	2,239.00	114,412,900	
フランスベッドホールディングス	26,100	1,280.00	33,408,000	
パイロットコーポレーション	28,400	4,772.00	135,524,800	

萩原工業	12,100	1,642.00	19,868,200	
フジシールインターナショナル	40,900	2,485.00	101,636,500	
タカラトミー	76,300	4,596.00	350,674,800	
広済堂ホールディングス	68,600	502.00	34,437,200	
エステールホールディングス	900	602.00	541,800	
タカノ	1,400	696.00	974,400	
プロネクサス	18,800	1,302.00	24,477,600	
ホクシン	2,900	99.00	287,100	
ウッドワン	1,400	850.00	1,190,000	
TOPPANホールディングス	238,200	3,855.00	918,261,000	
大日本印刷	376,800	2,211.50	833,293,200	
共同印刷	5,100	3,920.00	19,992,000	
NISSHA	31,100	1,564.00	48,640,400	
光村印刷	300	1,403.00	420,900	
TAKARA & COMPANY	10,700	2,953.00	31,597,100	
アシックス	670,900	3,085.00	2,069,726,500	
ツツミ	4,200	2,096.00	8,803,200	
ローランド	13,400	3,870.00	51,858,000	
小松ウオール工業	14,400	1,500.00	21,600,000	
ヤマハ	332,100	1,099.00	364,977,900	
河合楽器製作所	5,500	2,962.00	16,291,000	
クリナップ	17,800	651.00	11,587,800	
ピジョン	115,700	1,464.00	169,384,800	
キングジム	16,000	861.00	13,776,000	
リンテック	36,500	2,988.00	109,062,000	
イトーキ	36,300	1,646.00	59,749,800	
任天堂	1,147,200	9,131.00	10,475,083,200	
三菱鉛筆	25,100	2,373.00	59,562,300	
タカラスタンダード	41,800	1,667.00	69,680,600	
コクヨ	90,800	2,786.50	253,014,200	
ナカバヤシ	19,600	505.00	9,898,000	
グローブライド	17,900	1,862.00	33,329,800	
オカムラ	54,700	2,031.00	111,095,700	
美津濃	18,100	9,210.00	166,701,000	
グリムス	8,100	2,551.00	20,663,100	
東京電力ホールディングス	1,528,700	444.50	679,507,150	

中部電力	669,600	1,535.00	1,027,836,000	
関西電力	886,300	1,663.50	1,474,360,050	
中国電力	315,700	852.20	269,039,540	
北陸電力	185,800	829.10	154,046,780	
東北電力	478,400	1,131.50	541,309,600	
四国電力	169,200	1,174.00	198,640,800	
九州電力	418,900	1,333.00	558,393,700	
北海道電力	190,200	790.20	150,296,040	
沖縄電力	46,400	917.00	42,548,800	
電源開発	136,800	2,459.00	336,391,200	
エフオン	13,200	371.00	4,897,200	
イーレックス	35,400	562.00	19,894,800	
レノバ	49,600	694.00	34,422,400	
東京瓦斯	343,500	4,191.00	1,439,608,500	
大阪瓦斯	357,000	3,217.00	1,148,469,000	
東邦瓦斯	71,500	3,980.00	284,570,000	
北海道瓦斯	54,200	527.00	28,563,400	
広島ガス	38,500	371.00	14,283,500	
西部ガスホールディングス	19,000	1,681.00	31,939,000	
静岡ガス	41,400	1,002.00	41,482,800	
メタウォーター	24,900	1,784.00	44,421,600	
SBSホールディングス	16,200	2,347.00	38,021,400	
東武鉄道	191,400	2,491.50	476,873,100	
相鉄ホールディングス	60,000	2,468.00	148,080,000	
東急	509,500	1,676.50	854,176,750	
京浜急行電鉄	224,800	1,290.50	290,104,400	
小田急電鉄	300,500	1,417.50	425,958,750	
京王電鉄	96,100	3,800.00	365,180,000	
京成電鉄	105,400	4,176.00	440,150,400	
富士急行	22,400	2,239.00	50,153,600	
東日本旅客鉄道	1,002,100	2,740.00	2,745,754,000	
西日本旅客鉄道	464,200	2,720.50	1,262,856,100	
東海旅客鉄道	699,900	2,864.00	2,004,513,600	
東京地下鉄	303,800	1,580.00	480,004,000	
西武ホールディングス	197,800	3,398.00	672,124,400	
鴻池運輸	31,000	3,005.00	93,155,000	

西日本鉄道	52,600	2,179.00	114,615,400	
ハマキョウレックス	62,000	1,312.00	81,344,000	
サカイ引越センター	23,000	2,426.00	55,798,000	
近鉄グループホールディングス	194,300	3,193.00	620,399,900	
阪急阪神ホールディングス	241,900	4,065.00	983,323,500	
南海電気鉄道	80,900	2,377.50	192,339,750	
京阪ホールディングス	100,000	3,281.00	328,100,000	
神戸電鉄	4,900	2,263.00	11,088,700	
名古屋鉄道	200,500	1,694.00	339,647,000	
山陽電気鉄道	13,700	1,999.00	27,386,300	
ヤマトホールディングス	220,500	1,723.50	380,031,750	
山九	43,800	5,425.00	237,615,000	
丸運	2,200	440.00	968,000	
丸全昭和運輸	11,200	5,880.00	65,856,000	
センコーグループホールディングス	106,700	1,515.00	161,650,500	
トナミホールディングス	4,000	5,750.00	23,000,000	
ニッコンホールディングス	103,100	2,002.00	206,406,200	
日本石油輸送	400	2,775.00	1,110,000	
福山通運	19,400	3,675.00	71,295,000	
セイノーホールディングス	89,300	2,390.00	213,427,000	
神奈川中央交通	5,100	3,785.00	19,303,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	56,300	1,094.00	61,592,200	
九州旅客鉄道	138,900	3,865.00	536,848,500	
SGホールディングス	304,600	1,462.50	445,477,500	
NIPPON EXPRESSホールディングス	65,000	7,242.00	470,730,000	
日本郵船	375,900	5,055.00	1,900,174,500	
商船三井	344,900	5,220.00	1,800,378,000	
川崎汽船	413,000	2,107.00	870,191,000	
NSユニテッド海運	11,500	3,840.00	44,160,000	
飯野海運	66,800	1,120.00	74,816,000	
共栄タンカー	1,000	1,017.00	1,017,000	
乾汽船	23,200	1,633.00	37,885,600	
日本航空	415,800	2,498.00	1,038,668,400	
ANAホールディングス	493,600	2,856.50	1,409,968,400	
日新	12,400	4,400.00	54,560,000	

三菱倉庫	189,300	1,159.50	219,493,350
三井倉庫ホールディングス	18,700	7,330.00	137,071,000
住友倉庫	53,800	2,768.00	148,918,400
澁澤倉庫	8,300	3,025.00	25,107,500
東陽倉庫	1,000	1,436.00	1,436,000
日本トランスシティ	36,500	1,040.00	37,960,000
ケイヒン	700	1,987.00	1,390,900
中央倉庫	10,700	1,516.00	16,221,200
川西倉庫	700	1,049.00	734,300
安田倉庫	12,400	1,755.00	21,762,000
ファイズホールディングス	600	911.00	546,600
東洋埠頭	1,100	1,261.00	1,387,100
上組	83,800	3,413.00	286,009,400
サンリツ	900	783.00	704,700
キムラユニティー	1,800	1,438.00	2,588,400
キューソー流通システム	12,100	2,160.00	26,136,000
東海運	2,200	335.00	737,000
エーアイテイー	11,400	1,661.00	18,935,400
内外トランスライン	7,300	2,711.00	19,790,300
日本コンセプト	6,600	1,828.00	12,064,800
NEC ネットエスアイ	69,500	3,310.00	230,045,000
クロスキャット	11,300	1,014.00	11,458,200
システナ	260,500	370.00	96,385,000
デジタルアーツ	11,500	6,010.00	69,115,000
日鉄ソリューションズ	62,200	4,098.00	254,895,600
キューブシステム	9,600	1,050.00	10,080,000
コア	8,100	1,823.00	14,766,300
手間いらず	3,100	3,255.00	10,090,500
ラクーンホールディングス	13,600	740.00	10,064,000
ソリトンシステムズ	9,400	1,155.00	10,857,000
ソフトクリエイトホールディングス	14,700	2,294.00	33,721,800
T I S	192,600	3,801.00	732,072,600
テクミラホールディングス	1,800	321.00	577,800
グリー	61,100	449.00	27,433,900
GMOペパボ	2,200	1,550.00	3,410,000
コーエーテクモホールディングス	137,000	1,820.50	249,408,500

三菱総合研究所	8,900	4,655.00	41,429,500
電算	500	1,435.00	717,500
A G S	1,600	804.00	1,286,400
ファインデックス	14,500	802.00	11,629,000
ブレインパッド	15,200	1,171.00	17,799,200
K L a b	45,900	171.00	7,848,900
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	433.00	13,163,200
ネクソン	400,400	2,278.00	912,111,200
アイスタイル	60,900	466.00	28,379,400
エムアップホールディングス	22,300	1,581.00	35,256,300
エイチーム	12,100	1,017.00	12,305,700
セルシス	25,900	1,380.00	35,742,000
エニグモ	22,700	291.00	6,605,700
テクノスジャパン	3,400	764.00	2,597,600
コロプラ	61,900	461.00	28,535,900
ブロードリーフ	73,200	675.00	49,410,000
クロス・マーケティンググループ	1,800	785.00	1,413,000
デジタルハーツホールディングス	13,000	816.00	10,608,000
メディアドゥ	8,300	1,419.00	11,777,700
じげん	52,000	485.00	25,220,000
ブイキューブ	25,100	188.00	4,718,800
エンカレッジ・テクノロジー	900	572.00	514,800
サイバーリンクス	1,500	781.00	1,171,500
フィックスターズ	18,300	1,802.00	32,976,600
CARTA HOLDINGS	10,300	1,412.00	14,543,600
オプティム	18,800	698.00	13,122,400
セレス	8,200	3,230.00	26,486,000
SHIFT	12,100	17,075.00	206,607,500
セック	3,100	4,260.00	13,206,000
テクマトリックス	39,300	2,436.00	95,734,800
プロシップ	8,600	1,532.00	13,175,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,200	3,239.00	146,402,800
GMOペイメントゲートウェイ	41,600	7,981.00	332,009,600
ザッパラス	900	357.00	321,300
システムリサーチ	12,500	1,445.00	18,062,500
インターネットイニシアティブ	99,600	3,002.00	298,999,200

さくらインターネット	28,500	4,255.00	121,267,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,600	2,403.00	13,456,800
SRAホールディングス	10,400	4,165.00	43,316,000
システムインテグレータ	1,200	301.00	361,200
朝日ネット	19,600	654.00	12,818,400
eBASE	25,600	636.00	16,281,600
アバントグループ	23,000	1,978.00	45,494,000
アドソル日進	7,700	2,038.00	15,692,600
ODKソリューションズ	800	560.00	448,000
フリービット	8,000	1,474.00	11,792,000
コムチュア	25,700	2,300.00	59,110,000
アステリア	14,300	519.00	7,421,700
アイル	10,200	2,711.00	27,652,200
マークライنز	10,800	2,144.00	23,155,200
メディカル・データ・ビジョン	21,800	375.00	8,175,000
gumi	29,600	438.00	12,964,800
ショーケース	900	349.00	314,100
モバイルファクトリー	800	937.00	749,600
テラスカイ	7,700	2,094.00	16,123,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,500	2,140.00	20,330,000
PCIホールディングス	100	859.00	85,900
アイビーシー	600	656.00	393,600
ネオジャパン	5,900	1,689.00	9,965,100
PR TIMES	3,700	1,706.00	6,312,200
ラクス	86,200	1,885.00	162,487,000
ランドコンピュータ	1,900	652.00	1,238,800
ダブルスタンダード	6,500	1,571.00	10,211,500
オーブンドア	12,800	616.00	7,884,800
アカツキ	8,900	2,792.00	24,848,800
ベネフィットジャパン	200	1,074.00	214,800
Ubicomホールディングス	5,800	1,255.00	7,279,000
カナミックネットワーク	22,900	503.00	11,518,700
ノムラシステムコーポレーション	4,300	120.00	516,000
チェンジホールディングス	45,200	1,249.00	56,454,800
シンクロ・フード	2,500	353.00	882,500
オークネット	8,400	2,651.00	22,268,400

キャピタル・アセット・プランニング	800	750.00	600,000	
セグエグループ	3,500	629.00	2,201,500	
エイトレッド	600	1,503.00	901,800	
マクロミル	35,300	1,207.00	42,607,100	
ビーグリー	700	1,647.00	1,152,900	
オロ	7,700	2,391.00	18,410,700	
ユーザローカル	7,700	1,850.00	14,245,000	
テモナ	900	187.00	168,300	
ニーズウェル	4,200	391.00	1,642,200	
PKSHA Technology	14,700	3,790.00	55,713,000	
マネーフォワード	44,600	5,051.00	225,274,600	
サインポスト	1,500	399.00	598,500	
Sun Asterisk	13,100	680.00	8,908,000	
プラスアルファ・コンサルティング	23,100	1,879.00	43,404,900	
電算システムホールディングス	8,100	2,372.00	19,213,200	
Appier Group	55,600	1,522.00	84,623,200	
ビジョナル	21,600	8,030.00	173,448,000	
ソルクシーズ	3,100	326.00	1,010,600	
フェイス	1,100	1,217.00	1,338,700	
ハイマックス	5,700	1,382.00	7,877,400	
野村総合研究所	394,900	4,647.00	1,835,100,300	
CEホールディングス	1,800	543.00	977,400	
日本システム技術	16,900	2,060.00	34,814,000	
インテージホールディングス	20,600	1,623.00	33,433,800	
東邦システムサイエンス	8,500	1,410.00	11,985,000	
ソースネクスト	92,700	165.00	15,295,500	
シンプレクス・ホールディングス	35,700	2,506.00	89,464,200	
HEROZ	7,200	918.00	6,609,600	
ラクスル	44,100	1,344.00	59,270,400	
メルカリ	89,000	1,825.00	162,425,000	
I P S	5,300	2,451.00	12,990,300	
F I G	4,500	296.00	1,332,000	
システムサポート	7,100	1,771.00	12,574,100	
イーソル	12,200	594.00	7,246,800	
東海ソフト	600	1,364.00	818,400	
ウイングアーク 1 s t	19,000	3,620.00	68,780,000	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,100	822.00	5,014,200	
サーバーワークス	3,700	2,342.00	8,665,400	
東名	800	2,347.00	1,877,600	
ヴィッツ	400	947.00	378,800	
トビラシステムズ	1,100	805.00	885,500	
S a n s a n	60,000	2,385.00	143,100,000	
L i n k-Uグループ	800	396.00	316,800	
ギフトィ	16,000	1,322.00	21,152,000	
メドレー	20,000	3,885.00	77,700,000	
ベース	8,900	2,900.00	25,810,000	
JMDC	22,200	3,858.00	85,647,600	
フォーカスシステムズ	12,200	1,111.00	13,554,200	
クレスコ	29,900	1,187.00	35,491,300	
フジ・メディア・ホールディングス	175,000	1,848.00	323,400,000	
オービック	338,400	4,700.00	1,590,480,000	
ジャストシステム	26,200	3,550.00	93,010,000	
TDCソフト	33,400	1,491.00	49,799,400	
L I N Eヤフー	2,915,400	426.20	1,242,543,480	
トレンドマイクロ	95,700	8,383.00	802,253,100	
IDホールディングス	12,300	1,546.00	19,015,800	
日本オラクル	34,900	14,565.00	508,318,500	
アルファシステムズ	5,700	3,350.00	19,095,000	
フューチャー	45,300	1,881.00	85,209,300	
C A C H o l d i n g s	11,200	1,664.00	18,636,800	
トーセ	1,100	611.00	672,100	
オービックビジネスコンサルタント	30,700	7,027.00	215,728,900	
アイティフォー	22,800	1,440.00	32,832,000	
東計電算	5,100	4,215.00	21,496,500	
エクスネット	500	1,492.00	746,000	
大塚商会	206,600	3,602.00	744,173,200	
サイボウズ	25,100	2,644.00	66,364,400	
電通総研	17,700	5,770.00	102,129,000	
A C C E S S	19,000	852.00	16,188,000	
デジタルガレージ	29,100	3,820.00	111,162,000	
EMシステムズ	30,400	796.00	24,198,400	

ウェザーニューズ	11,300	3,215.00	36,329,500	
C I J	45,400	457.00	20,747,800	
ビジネスエンジニアリング	4,300	3,610.00	15,523,000	
日本エンタープライズ	4,100	125.00	512,500	
WOWOW	13,700	998.00	13,672,600	
スカラ	16,900	381.00	6,438,900	
インテリジェント ウェイブ	2,000	1,105.00	2,210,000	
ANYCOLOR	25,400	2,856.00	72,542,400	
I M A G I C A G R O U P	18,200	550.00	10,010,000	
システムソフト	63,500	53.00	3,365,500	
アルゴグラフィックス	16,700	4,990.00	83,333,000	
マーベラス	33,800	567.00	19,164,600	
エイベックス	34,200	1,503.00	51,402,600	
B I P R O G Y	61,600	4,652.00	286,563,200	
都築電気	11,000	2,840.00	31,240,000	
T B S ホールディングス	91,600	4,110.00	376,476,000	
日本テレビホールディングス	161,300	2,811.50	453,494,950	
朝日放送グループホールディングス	17,100	626.00	10,704,600	
テレビ朝日ホールディングス	44,200	2,349.00	103,825,800	
スカパー J S A T ホールディングス	141,600	902.00	127,723,200	
テレビ東京ホールディングス	11,200	3,160.00	35,392,000	
日本BS放送	1,400	890.00	1,246,000	
ビジョン	27,300	1,294.00	35,326,200	
スマートバリュー	1,100	319.00	350,900	
U-NEXT HOLDINGS	61,300	1,702.00	104,332,600	
ワイヤレスゲート	1,900	217.00	412,300	
日本通信	175,500	123.00	21,586,500	
クロップス	500	1,011.00	505,500	
日本電信電話	54,206,900	155.60	8,434,593,640	
K D D I	1,340,400	4,970.00	6,661,788,000	
ソフトバンク	29,161,100	196.60	5,733,072,260	
光通信	21,100	34,450.00	726,895,000	
エムティーアイ	12,500	1,217.00	15,212,500	
GMOインターネットグループ	59,300	2,687.00	159,339,100	
ファイバーゲート	9,800	902.00	8,839,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,100	229.00	251,900	

KADOKAWA	96,300	3,689.00	355,250,700	
学研ホールディングス	33,400	1,028.00	34,335,200	
ゼンリン	31,200	821.00	25,615,200	
昭文社ホールディングス	1,700	391.00	664,700	
インプレスホールディングス	3,900	150.00	585,000	
アイネット	11,000	1,565.00	17,215,000	
松竹	10,400	11,150.00	115,960,000	
東宝	114,000	6,616.00	754,224,000	
東映	30,100	6,320.00	190,232,000	
NTTデータグループ	476,500	2,966.50	1,413,537,250	
ピー・シー・エー	12,000	2,105.00	25,260,000	
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	2,090.00	16,302,000	
DTS	33,000	4,215.00	139,095,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	91,600	6,247.00	572,225,200	
シーイーシー	23,000	1,927.00	44,321,000	
カプコン	362,200	3,401.00	1,231,842,200	
アイ・エス・ビー	8,600	1,367.00	11,756,200	
SCSK	148,800	3,266.00	485,980,800	
NSW	8,100	3,055.00	24,745,500	
アイネス	14,200	1,801.00	25,574,200	
TKC	32,500	3,850.00	125,125,000	
富士ソフト	50,000	9,757.00	487,850,000	
NSD	70,100	3,400.00	238,340,000	
コナミグループ	68,300	14,905.00	1,018,011,500	
福井コンピュータホールディングス	12,700	3,095.00	39,306,500	
JBCCHホールディングス	12,100	4,555.00	55,115,500	
ミロク情報サービス	16,600	1,963.00	32,585,800	
ソフトバンクグループ	899,000	8,760.00	7,875,240,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	32,500	2,243.00	72,897,500	
高千穂交易	7,600	3,815.00	28,994,000	
オルパヘルスケアホールディングス	700	2,012.00	1,408,400	
伊藤忠食品	4,300	6,980.00	30,014,000	
あらた	29,400	3,085.00	90,699,000	
トーメンデバイス	2,800	6,460.00	18,088,000	
東京エレクトロン デバイス	19,200	2,805.00	53,856,000	
円谷フィールズホールディングス	31,100	1,730.00	53,803,000	

双日	214,000	3,039.00	650,346,000	
アルフレッサ ホールディングス	179,200	2,154.50	386,086,400	
横浜冷凍	48,300	829.00	40,040,700	
ラサ商事	10,600	1,392.00	14,755,200	
アルコニックス	27,400	1,457.00	39,921,800	
神戸物産	148,700	3,475.00	516,732,500	
ハイパー	900	306.00	275,400	
あい ホールディングス	31,100	2,092.00	65,061,200	
ディーブイエックス	1,100	913.00	1,004,300	
ダイワボウホールディングス	85,100	3,071.00	261,342,100	
マクニカホールディングス	148,900	1,724.50	256,778,050	
ラクト・ジャパン	8,200	2,719.00	22,295,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,144.00	32,604,000	
八洲電機	15,500	1,670.00	25,885,000	
メディアスホールディングス	11,200	841.00	9,419,200	
レスター	16,300	2,495.00	40,668,500	
ジオリーブグループ	900	1,064.00	957,600	
大光	2,100	583.00	1,224,300	
OCHIホールディングス	900	1,312.00	1,180,800	
TOKAIホールディングス	104,400	951.00	99,284,400	
黒谷	1,100	549.00	603,900	
Cominix	800	898.00	718,400	
三洋貿易	19,700	1,538.00	30,298,600	
ビューティガレージ	6,100	1,310.00	7,991,000	
ウイン・パートナーズ	14,000	1,275.00	17,850,000	
ミタチ産業	1,100	1,194.00	1,313,400	
シップヘルスケアホールディングス	76,000	2,191.50	166,554,000	
明治電機工業	7,200	1,370.00	9,864,000	
デリカフーズホールディングス	1,800	510.00	918,000	
スターティアホールディングス	1,100	2,206.00	2,426,600	
コメダホールディングス	50,300	2,836.00	142,650,800	
ピーバンドットコム	500	375.00	187,500	
アセンテック	7,400	946.00	7,000,400	
富士興産	1,100	1,406.00	1,546,600	
協栄産業	400	2,245.00	898,000	
フルサト・マルカホールディングス	15,400	2,441.00	37,591,400	

ヤマエグループホールディングス	20,700	1,889.00	39,102,300	
小野建	21,100	1,442.00	30,426,200	
南陽	1,700	1,093.00	1,858,100	
佐鳥電機	13,400	1,704.00	22,833,600	
エコトレーディング	800	903.00	722,400	
伯東	11,000	4,135.00	45,485,000	
コンドーテック	14,800	1,360.00	20,128,000	
中山福	2,200	360.00	792,000	
ナガイレーベン	24,300	2,165.00	52,609,500	
三菱食品	17,800	4,930.00	87,754,000	
松田産業	14,600	3,090.00	45,114,000	
第一興商	74,400	1,846.50	137,379,600	
メディパルホールディングス	208,500	2,381.50	496,542,750	
S P K	8,300	2,040.00	16,932,000	
萩原電気ホールディングス	8,300	3,145.00	26,103,500	
アズワン	59,600	2,688.50	160,234,600	
スズデン	8,200	1,824.00	14,956,800	
尾家産業	1,000	2,005.00	2,005,000	
シモジマ	12,900	1,292.00	16,666,800	
ドウシシャ	17,800	2,139.00	38,074,200	
小津産業	900	1,655.00	1,489,500	
高速	11,400	2,388.00	27,223,200	
たけびし	8,200	2,001.00	16,408,200	
リックス	4,700	2,765.00	12,995,500	
丸文	17,200	1,019.00	17,526,800	
ハビネット	14,700	4,880.00	71,736,000	
橋本総業ホールディングス	7,600	1,280.00	9,728,000	
日本ライフライン	51,500	1,333.00	68,649,500	
タカショー	16,400	447.00	7,330,800	
I D O M	65,400	1,097.00	71,743,800	
進和	11,800	2,877.00	33,948,600	
エスケイジャパン	1,000	703.00	703,000	
ダイトロン	8,300	2,722.00	22,592,600	
シークス	27,400	1,136.00	31,126,400	
田中商事	1,200	661.00	793,200	
オーハシテクニカ	9,900	1,965.00	19,453,500	

白銅	5,400	2,341.00	12,641,400	
ダイコー通産	400	1,314.00	525,600	
伊藤忠商事	1,292,300	7,483.00	9,670,280,900	
丸紅	1,579,800	2,236.00	3,532,432,800	
高島	2,700	1,245.00	3,361,500	
長瀬産業	85,900	3,151.00	270,670,900	
蝶理	10,300	3,830.00	39,449,000	
豊田通商	577,400	2,645.00	1,527,223,000	
三共生興	26,100	606.00	15,816,600	
兼松	80,400	2,567.00	206,386,800	
ツカモトコーポレーション	600	1,068.00	640,800	
三井物産	2,824,600	3,147.00	8,889,016,200	
日本紙パルプ商事	91,900	663.00	60,929,700	
カメイ	20,400	1,803.00	36,781,200	
東都水産	300	5,500.00	1,650,000	
OUGホールディングス	600	2,618.00	1,570,800	
スターゼン	13,300	2,912.00	38,729,600	
山善	64,800	1,387.00	89,877,600	
椿本興業	11,700	2,042.00	23,891,400	
住友商事	1,152,100	3,277.00	3,775,431,700	
内田洋行	7,800	6,580.00	51,324,000	
三菱商事	3,553,100	2,496.50	8,870,314,150	
第一実業	18,100	2,769.00	50,118,900	
キヤノンマーケティングジャパン	37,700	5,102.00	192,345,400	
西華産業	9,200	4,845.00	44,574,000	
佐藤商事	13,300	1,412.00	18,779,600	
東京産業	19,500	715.00	13,942,500	
ユアサ商事	16,500	4,255.00	70,207,500	
神鋼商事	4,700	6,010.00	28,247,000	
トルク	2,900	234.00	678,600	
阪和興業	31,600	4,770.00	150,732,000	
正栄食品工業	12,800	3,865.00	49,472,000	
カナデン	14,400	1,466.00	21,110,400	
RYODEN	15,500	2,346.00	36,363,000	
岩谷産業	191,000	1,751.00	334,441,000	
ナイス	1,300	1,657.00	2,154,100	

ニチモウ	1,300	1,935.00	2,515,500
極東貿易	11,500	1,529.00	17,583,500
アステナホールディングス	36,200	470.00	17,014,000
三愛オブリ	44,800	1,853.00	83,014,400
稲畑産業	52,100	3,195.00	166,459,500
G S I クレオス	10,300	2,168.00	22,330,400
明和産業	27,400	627.00	17,179,800
クワザワホールディングス	1,500	666.00	999,000
ワキタ	31,100	1,628.00	50,630,800
東邦ホールディングス	51,900	4,228.00	219,433,200
サンゲツ	48,300	2,851.00	137,703,300
ミツウロコグループホールディングス	24,500	1,776.00	43,512,000
シナネンホールディングス	5,300	6,340.00	33,602,000
伊藤忠エネクス	47,700	1,596.00	76,129,200
サンリオ	156,200	5,130.00	801,306,000
サンワテクノス	9,600	2,198.00	21,100,800
新光商事	25,800	956.00	24,664,800
トーヨー	8,200	2,832.00	23,222,400
三信電気	7,700	1,875.00	14,437,500
東陽テクニカ	17,700	1,417.00	25,080,900
モスフードサービス	28,300	3,710.00	104,993,000
加賀電子	39,000	2,877.00	112,203,000
ソーダニッカ	19,900	1,141.00	22,705,900
立花エレテック	12,500	2,590.00	32,375,000
フォーバル	7,500	1,376.00	10,320,000
PAL TAC	30,000	4,397.00	131,910,000
三谷産業	33,600	320.00	10,752,000
西本Wismettacホールディングス	11,500	1,920.00	22,080,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,442.00	732,600
コア商事ホールディングス	14,200	606.00	8,605,200
K P P グループホールディングス	39,800	616.00	24,516,800
ヤマタネ	8,300	3,725.00	30,917,500
丸紅建材リース	300	3,065.00	919,500
泉州電業	13,300	5,000.00	66,500,000
トラスコ中山	40,400	2,339.00	94,495,600
オートボックスセブン	66,900	1,419.00	94,931,100

モリト	15,300	1,502.00	22,980,600
加藤産業	23,800	4,480.00	106,624,000
北恵	1,000	790.00	790,000
イエローハット	33,900	2,604.00	88,275,600
J Kホールディングス	14,800	1,031.00	15,258,800
日伝	12,300	3,045.00	37,453,500
北沢産業	2,500	351.00	877,500
杉本商事	18,200	1,361.00	24,770,200
因幡電機産業	53,700	3,901.00	209,483,700
東テク	19,200	2,653.00	50,937,600
ミスミグループ本社	290,500	2,408.00	699,524,000
アルテック	2,200	210.00	462,000
タキヒヨー	900	1,410.00	1,269,000
蔵王産業	700	2,434.00	1,703,800
スズケン	63,400	4,706.00	298,360,400
ジェコス	11,500	987.00	11,350,500
インターメスティック	11,000	2,544.00	27,984,000
サンエー	32,700	2,786.00	91,102,200
カワチ薬品	15,200	2,488.00	37,817,600
エービーシー・マート	84,200	3,216.00	270,787,200
ハードオフコーポレーション	8,500	1,800.00	15,300,000
アスクル	45,700	1,712.00	78,238,400
ゲオホールディングス	21,800	1,588.00	34,618,400
アダストリア	26,600	3,575.00	95,095,000
くら寿司	22,600	3,030.00	68,478,000
キャンドウ	6,900	3,415.00	23,563,500
I Kホールディングス	2,200	398.00	875,600
パルグループホールディングス	44,100	3,105.00	136,930,500
エディオン	83,900	1,778.00	149,174,200
サーラコーポレーション	40,800	851.00	34,720,800
ワッツ	2,200	662.00	1,456,400
ハローズ	8,600	3,980.00	34,228,000
あみやき亭	14,200	1,624.00	23,060,800
大黒天物産	5,900	9,610.00	56,699,000
ハニーズホールディングス	17,300	1,616.00	27,956,800
ファーマライズホールディングス	1,500	559.00	838,500

アルペン	16,000	2,060.00	32,960,000	
ハブ	1,700	743.00	1,263,100	
クオールホールディングス	26,100	1,402.00	36,592,200	
ジズホールディングス	14,700	6,620.00	97,314,000	
ビックカメラ	115,300	1,714.00	197,624,200	
DCMホールディングス	99,800	1,409.00	140,618,200	
MonotaRO	272,700	2,723.50	742,698,450	
東京一番フーズ	1,800	495.00	891,000	
きちりホールディングス	1,100	899.00	988,900	
J. フロント リテイリング	220,800	1,953.00	431,222,400	
ドトール・日レスホールディングス	34,200	2,309.00	78,967,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	339,100	2,182.00	739,916,200	
ブロンコビリー	11,400	3,705.00	42,237,000	
ZOZO	143,000	4,867.00	695,981,000	
トレジャー・ファクトリー	13,500	1,387.00	18,724,500	
物語コーポレーション	34,400	3,555.00	122,292,000	
三越伊勢丹ホールディングス	291,900	2,431.00	709,608,900	
Hamee	8,000	1,371.00	10,968,000	
マーケットエンタープライズ	700	964.00	674,800	
ウエルシアホールディングス	99,900	1,905.00	190,309,500	
クリエイイトSDホールディングス	27,400	2,773.00	75,980,200	
丸善CHIホールディングス	5,800	321.00	1,861,800	
ミサワ	1,400	698.00	977,200	
ティーライフ	800	1,116.00	892,800	
チムニー	1,200	1,245.00	1,494,000	
シュッピン	19,300	1,014.00	19,570,200	
オイシックス・ラ・大地	31,300	1,287.00	40,283,100	
ネクステージ	44,200	1,310.00	57,902,000	
ジョイフル本田	53,500	1,831.00	97,958,500	
エターナルホスピタリティグループ	7,200	2,810.00	20,232,000	
ホットランド	14,900	2,231.00	33,241,900	
すかいらーくホールディングス	262,900	2,442.00	642,001,800	
SFPホールディングス	10,900	1,944.00	21,189,600	
綿半ホールディングス	15,200	1,511.00	22,967,200	
ヨシックスホールディングス	6,400	3,325.00	21,280,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールデ	87,400	733.00	64,064,200	

インクス				
B E E N O S	12,000	4,000.00	48,000,000	
あさひ	17,700	1,584.00	28,036,800	
日本調剤	12,900	1,372.00	17,698,800	
コスモス薬品	32,700	6,406.00	209,476,200	
トーエル	2,200	745.00	1,639,000	
セブン&アイ・ホールディングス	2,123,700	2,416.00	5,130,859,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	144,600	1,160.00	167,736,000	
ツルハホールディングス	40,400	8,018.00	323,927,200	
サンマルクホールディングス	15,600	2,561.00	39,951,600	
フェリシモ	1,300	830.00	1,079,000	
トリドールホールディングス	54,100	3,881.00	209,962,100	
T O K Y O B A S E	21,600	312.00	6,739,200	
ウイルプラスホールディングス	1,100	998.00	1,097,800	
J Mホールディングス	14,300	2,430.00	34,749,000	
サツドラホールディングス	2,000	786.00	1,572,000	
アレンザホールディングス	14,700	1,091.00	16,037,700	
串カツ田中ホールディングス	6,000	1,412.00	8,472,000	
バロックジャパンリミテッド	22,900	787.00	18,022,300	
クスリのアオキホールディングス	64,400	3,227.00	207,818,800	
力の源ホールディングス	14,400	953.00	13,723,200	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	102,600	3,464.00	355,406,400	
メディカルシステムネットワーク	21,200	412.00	8,734,400	
はるやまホールディングス	2,500	602.00	1,505,000	
ノジマ	62,900	2,250.00	141,525,000	
カッパ・クリエイト	30,200	1,583.00	47,806,600	
良品計画	229,000	3,446.00	789,134,000	
パリミキホールディングス	5,900	292.00	1,722,800	
アドヴァングループ	16,800	953.00	16,010,400	
アルビス	6,400	2,601.00	16,646,400	
コナカ	4,800	220.00	1,056,000	
ハウス オブ ローゼ	700	1,434.00	1,003,800	
G - 7ホールディングス	21,200	1,402.00	29,722,400	
イオン北海道	47,400	882.00	41,806,800	
コジマ	37,400	1,045.00	39,083,000	
ヒマラヤ	1,800	843.00	1,517,400	

コーナン商事	21,300	3,530.00	75,189,000
エコス	7,300	2,024.00	14,775,200
ワタミ	23,200	951.00	22,063,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	388,400	4,166.00	1,618,074,400
西松屋チェーン	42,700	2,236.00	95,477,200
ゼンショーホールディングス	109,300	9,259.00	1,012,008,700
幸楽苑	14,200	1,052.00	14,938,400
ハークスレイ	1,700	682.00	1,159,400
サイゼリヤ	28,500	5,460.00	155,610,000
V Tホールディングス	75,700	483.00	36,563,100
魚力	6,800	2,433.00	16,544,400
フジ・コーポレーション	9,100	2,054.00	18,691,400
ユナイテッドアローズ	22,200	2,685.00	59,607,000
ハイデイ日高	31,200	2,720.00	84,864,000
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	87.00	426,300
コロワイド	108,500	1,671.50	181,357,750
壺番屋	76,300	998.00	76,147,400
P L A N T	1,100	1,595.00	1,754,500
スギホールディングス	103,400	2,444.00	252,709,600
薬王堂ホールディングス	9,600	1,936.00	18,585,600
スクロール	28,900	1,075.00	31,067,500
ヨンドシーホールディングス	18,400	1,861.00	34,242,400
木曽路	29,300	2,096.00	61,412,800
S R Sホールディングス	32,000	1,165.00	37,280,000
千趣会	38,900	299.00	11,631,100
リテールパートナーズ	28,800	1,252.00	36,057,600
上新電機	19,200	2,241.00	43,027,200
日本瓦斯	92,200	2,080.00	191,776,000
ロイヤルホールディングス	33,900	2,399.00	81,326,100
チヨダ	18,600	1,341.00	24,942,600
ライフコーポレーション	20,200	3,430.00	69,286,000
リンガーハット	24,800	2,169.00	53,791,200
M r M a x H D	24,700	715.00	17,660,500
A O K Iホールディングス	41,500	1,284.00	53,286,000
オークワ	30,800	884.00	27,227,200

コメリ	26,000	3,270.00	85,020,000	
青山商事	41,200	2,260.00	93,112,000	
しまむら	45,200	8,561.00	386,957,200	
はせがわ	2,900	303.00	878,700	
高島屋	267,200	1,268.00	338,809,600	
松屋	32,600	971.00	31,654,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	93,600	2,197.50	205,686,000	
近鉄百貨店	11,200	2,090.00	23,408,000	
丸井グループ	127,600	2,509.00	320,148,400	
アクシアル リテイリング	52,800	895.00	47,256,000	
イオン	711,000	3,679.00	2,615,769,000	
イズミ	29,200	3,187.00	93,060,400	
平和堂	31,500	2,289.00	72,103,500	
フジ	35,400	2,049.00	72,534,600	
ヤオコー	22,800	9,080.00	207,024,000	
ゼビオホールディングス	26,300	1,135.00	29,850,500	
ケーズホールディングス	129,400	1,391.50	180,060,100	
O l y m p i c グループ	2,400	459.00	1,101,600	
日産東京販売ホールディングス	6,700	493.00	3,303,100	
シルバーライフ	5,700	693.00	3,950,100	
Genky Drug Stores	17,000	3,125.00	53,125,000	
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,332.00	1,198,800	
ブックオフグループホールディングス	14,200	1,492.00	21,186,400	
ギフトホールディングス	9,600	3,305.00	31,728,000	
アインホールディングス	26,600	4,268.00	113,528,800	
Genki Global Dining	11,000	3,450.00	37,950,000	
ヤマダホールディングス	592,100	445.50	263,780,550	
アークランズ	57,400	1,655.00	94,997,000	
ニトリホールディングス	70,000	18,340.00	1,283,800,000	
グルメ杵屋	15,900	1,052.00	16,726,800	
愛眼	3,000	141.00	423,000	
ケーユーホールディングス	11,600	1,092.00	12,667,200	
吉野家ホールディングス	75,300	3,128.00	235,538,400	
松屋フーズホールディングス	9,100	6,680.00	60,788,000	
サガミホールディングス	31,100	1,762.00	54,798,200	
玉将フードサービス	38,100	3,030.00	115,443,000	

ミニストップ	16,000	1,673.00	26,768,000	
アークス	32,500	2,547.00	82,777,500	
バローホールディングス	36,800	2,124.00	78,163,200	
ベルク	9,600	6,570.00	63,072,000	
大庄	11,900	1,072.00	12,756,800	
ファーストリテイリング	108,100	52,770.00	5,704,437,000	
サンドラッグ	65,000	3,921.00	254,865,000	
サックスパー ホールディングス	18,600	974.00	18,116,400	
ヤマザワ	1,100	1,181.00	1,299,100	
やまや	900	2,865.00	2,578,500	
ベルーナ	46,700	772.00	36,052,400	
いよぎんホールディングス	234,300	1,493.50	349,927,050	
しずおかフィナンシャルグループ	394,200	1,260.00	496,692,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	150,700	1,594.50	240,291,150	
楽天銀行	83,000	4,385.00	363,955,000	
京都フィナンシャルグループ	225,200	2,211.50	498,029,800	
島根銀行	1,100	500.00	550,000	
じもとホールディングス	3,300	287.00	947,100	
めぶきフィナンシャルグループ	898,400	629.30	565,363,120	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,900	4,430.00	101,447,000	
九州フィナンシャルグループ	314,900	681.90	214,730,310	
ゆうちょ銀行	1,474,900	1,448.00	2,135,655,200	
富山第一銀行	56,800	1,059.00	60,151,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	952,000	859.00	817,768,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	110,200	1,978.00	217,975,600	
三十三フィナンシャルグループ	16,000	2,190.00	35,040,000	
第四北越フィナンシャルグループ	56,200	2,826.00	158,821,200	
ひろぎんホールディングス	251,800	1,140.50	287,177,900	
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,593.00	38,635,700	
十六フィナンシャルグループ	25,100	4,190.00	105,169,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,500	5,140.00	89,950,000	
プロクレアホールディングス	20,400	1,666.00	33,986,400	
あいちフィナンシャルグループ	33,400	2,354.00	78,623,600	
あおぞら銀行	123,500	2,424.50	299,425,750	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,736,500	1,773.00	20,808,814,500	
りそなホールディングス	2,210,200	1,106.50	2,445,586,300	

三井住友トラストグループ	637,300	3,641.00	2,320,409,300	
三井住友フィナンシャルグループ	3,733,300	3,651.00	13,630,278,300	
千葉銀行	554,100	1,198.00	663,811,800	
群馬銀行	310,800	1,070.00	332,556,000	
武蔵野銀行	27,200	2,895.00	78,744,000	
千葉興業銀行	42,300	1,378.00	58,289,400	
筑波銀行	78,500	235.00	18,447,500	
七十七銀行	57,300	4,460.00	255,558,000	
秋田銀行	12,000	2,197.00	26,364,000	
山形銀行	19,900	968.00	19,263,200	
岩手銀行	11,300	2,656.00	30,012,800	
東邦銀行	154,400	281.00	43,386,400	
東北銀行	1,800	1,144.00	2,059,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	155,800	3,909.00	609,022,200	
スルガ銀行	120,600	1,146.00	138,207,600	
八十二銀行	418,900	996.80	417,559,520	
山梨中央銀行	20,000	1,800.00	36,000,000	
大垣共立銀行	34,100	1,831.00	62,437,100	
福井銀行	16,000	1,762.00	28,192,000	
清水銀行	7,100	1,408.00	9,996,800	
富山銀行	600	1,535.00	921,000	
滋賀銀行	27,100	3,765.00	102,031,500	
南都銀行	26,900	3,175.00	85,407,500	
百五銀行	168,400	604.00	101,713,600	
紀陽銀行	64,000	2,129.00	136,256,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	100,700	1,894.50	190,776,150	
山陰合同銀行	112,000	1,212.00	135,744,000	
鳥取銀行	1,300	1,202.00	1,562,600	
百十四銀行	17,500	3,190.00	55,825,000	
四国銀行	26,200	1,092.00	28,610,400	
阿波銀行	25,100	2,643.00	66,339,300	
大分銀行	10,800	3,060.00	33,048,000	
宮崎銀行	11,700	2,975.00	34,807,500	
佐賀銀行	10,500	2,105.00	22,102,500	
琉球銀行	41,000	1,020.00	41,820,000	
セブン銀行	641,100	312.20	200,151,420	

みずほフィナンシャルグループ	2,415,500	3,766.00	9,096,773,000	
高知銀行	1,300	804.00	1,045,200	
山口フィナンシャルグループ	175,500	1,597.00	280,273,500	
名古屋銀行	11,200	6,180.00	69,216,000	
北洋銀行	244,000	449.00	109,556,000	
大光銀行	1,200	1,392.00	1,670,400	
愛媛銀行	26,100	1,079.00	28,161,900	
トマト銀行	1,300	1,183.00	1,537,900	
京葉銀行	80,400	776.00	62,390,400	
栃木銀行	87,400	274.00	23,947,600	
北日本銀行	6,300	2,752.00	17,337,600	
東和銀行	32,800	627.00	20,565,600	
福島銀行	3,900	218.00	850,200	
大東銀行	1,600	718.00	1,148,800	
トモニホールディングス	171,000	437.00	74,727,000	
フィデアホールディングス	18,500	1,364.00	25,234,000	
池田泉州ホールディングス	248,200	386.00	95,805,200	
F P G	63,800	2,749.00	175,386,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	29,000	1,044.00	30,276,000	
マーキュリアホールディングス	1,700	816.00	1,387,200	
S B I ホールディングス	288,000	3,958.00	1,139,904,000	
ジャフコ グループ	53,300	2,155.50	114,888,150	
大和証券グループ本社	1,279,700	1,013.00	1,296,336,100	
野村ホールディングス	3,009,400	893.30	2,688,297,020	
岡三証券グループ	141,400	621.00	87,809,400	
丸三証券	59,600	968.00	57,692,800	
東洋証券	53,500	549.00	29,371,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	212,500	477.00	101,362,500	
光世証券	1,000	430.00	430,000	
水戸証券	49,100	550.00	27,005,000	
いちよし証券	36,100	988.00	35,666,800	
松井証券	123,300	806.00	99,379,800	
マネックスグループ	175,300	962.00	168,638,600	
極東証券	24,000	1,415.00	33,960,000	
岩井コスモホールディングス	20,400	2,272.00	46,348,800	
アイザワ証券グループ	25,800	1,691.00	43,627,800	

スパークス・グループ	20,000	1,507.00	30,140,000
かんぽ生命保険	208,300	2,884.50	600,841,350
F P パートナー	7,800	2,075.00	16,185,000
S O M P O ホールディングス	874,900	4,090.00	3,578,341,000
アニコム ホールディングス	60,800	647.00	39,337,600
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,311,500	3,390.00	4,445,985,000
第一生命ホールディングス	841,600	4,153.00	3,495,164,800
東京海上ホールディングス	1,747,200	5,520.00	9,644,544,000
T & D ホールディングス	480,500	2,783.00	1,337,231,500
アドバンスクリエイト	14,100	457.00	6,443,700
N E X Y Z . G r o u p	2,000	720.00	1,440,000
全国保証	46,900	5,387.00	252,650,300
あんしん保証	4,300	153.00	657,900
イントラスト	2,200	817.00	1,797,400
日本モーゲージサービス	3,400	421.00	1,431,400
C a s a	2,100	823.00	1,728,300
S B I アルヒ	19,000	807.00	15,333,000
プレミアグループ	30,500	2,499.00	76,219,500
ネットプロテクションズホールディングス	60,800	502.00	30,521,600
クレディセゾン	113,600	3,600.00	408,960,000
芙蓉総合リース	16,500	11,400.00	188,100,000
みずほリース	135,000	1,003.00	135,405,000
東京センチュリー	134,100	1,529.50	205,105,950
日本証券金融	66,100	2,056.00	135,901,600
アイフル	298,200	322.00	96,020,400
リコーリース	17,100	5,040.00	86,184,000
イオンフィナンシャルサービス	103,200	1,247.00	128,690,400
アコム	427,400	378.20	161,642,680
ジャックス	21,600	3,645.00	78,732,000
オリエントコーポレーション	59,100	817.00	48,284,700
オリックス	1,073,400	3,293.00	3,534,706,200
三菱H C キャピタル	897,700	1,004.50	901,739,650
九州リースサービス	2,100	1,012.00	2,125,200
日本取引所グループ	1,065,000	1,764.50	1,879,192,500
イー・ギャランティ	29,500	1,749.00	51,595,500

アサックス	2,400	700.00	1,680,000	
NECキャピタルソリューション	8,900	3,730.00	33,197,000	
r o b o t h o m e	53,600	134.00	7,182,400	
大東建託	60,900	17,630.00	1,073,667,000	
いちご	152,900	361.00	55,196,900	
日本駐車場開発	215,700	215.00	46,375,500	
スター・マイカ・ホールディングス	19,200	757.00	14,534,400	
SREホールディングス	7,700	3,075.00	23,677,500	
ADワークスグループ	9,500	208.00	1,976,000	
ヒューリック	417,900	1,347.50	563,120,250	
野村不動産ホールディングス	112,300	3,726.00	418,429,800	
三重交通グループホールディングス	39,400	485.00	19,109,000	
ディア・ライフ	31,000	1,030.00	31,930,000	
地主	16,100	2,120.00	34,132,000	
プレサンスコーポレーション	24,000	1,922.00	46,128,000	
ハウスコム	1,200	1,395.00	1,674,000	
JPMC	10,800	1,130.00	12,204,000	
サンセイランディック	1,800	948.00	1,706,400	
フージャースホールディングス	27,600	998.00	27,544,800	
オープンハウスグループ	65,700	5,387.00	353,925,900	
東急不動産ホールディングス	538,600	936.60	504,452,760	
飯田グループホールディングス	171,700	2,361.00	405,383,700	
イーグランド	1,000	1,380.00	1,380,000	
ムゲンエステート	3,300	1,963.00	6,477,900	
And Doホールディングス	10,700	1,146.00	12,262,200	
シーアールイー	8,400	1,200.00	10,080,000	
ケイアイスター不動産	9,800	4,200.00	41,160,000	
グッドコムアセット	15,200	837.00	12,722,400	
ジェイ・エス・ビー	7,700	2,602.00	20,035,400	
ロードスターキャピタル	10,400	2,489.00	25,885,600	
イノベーションホールディングス	1,800	922.00	1,659,600	
フェイスネットワーク	1,400	1,647.00	2,305,800	
霞ヶ関キャピタル	7,400	11,980.00	88,652,000	
パーク24	139,700	2,207.00	308,317,900	
パラカ	5,900	1,866.00	11,009,400	
三井不動産	2,484,100	1,237.50	3,074,073,750	

三菱地所	1,036,800	2,145.50	2,224,454,400	
平和不動産	29,200	4,195.00	122,494,000	
東京建物	156,600	2,530.00	396,198,000	
京阪神ビルディング	33,100	1,590.00	52,629,000	
住友不動産	291,300	4,781.00	1,392,705,300	
テーオーシー	32,700	644.00	21,058,800	
レオパレス21	156,700	581.00	91,042,700	
スターツコーポレーション	29,500	3,720.00	109,740,000	
フジ住宅	23,300	780.00	18,174,000	
空港施設	26,200	571.00	14,960,200	
明和地所	14,900	995.00	14,825,500	
ゴールドクレスト	12,300	3,350.00	41,205,000	
エスリード	8,500	4,380.00	37,230,000	
日神グループホールディングス	29,800	519.00	15,466,200	
日本エスコン	46,900	928.00	43,523,200	
MIRARTHホールディングス	104,900	496.00	52,030,400	
AVANTIA	2,800	782.00	2,189,600	
イオンモール	108,500	2,005.50	217,596,750	
毎日コムネット	2,100	716.00	1,503,600	
ファースト住建	2,100	1,002.00	2,104,200	
カチタス	48,300	2,179.00	105,245,700	
トーセイ	30,000	2,468.00	74,040,000	
穴吹興産	1,200	2,001.00	2,401,200	
サンフロンティア不動産	30,100	1,859.00	55,955,900	
FJネクストホールディングス	19,300	1,166.00	22,503,800	
インテリックス	900	782.00	703,800	
ランドビジネス	1,400	209.00	292,600	
サンネクスタグループ	1,800	1,022.00	1,839,600	
グランディハウス	17,700	564.00	9,982,800	
日本空港ビルデング	63,400	4,905.00	310,977,000	
明豊ファシリティワークス	2,200	871.00	1,916,200	
LIFULL	46,400	200.00	9,280,000	
MIXI	35,100	3,105.00	108,985,500	
ジェイエイシーリクルートメント	67,700	726.00	49,150,200	
日本M&Aセンターホールディングス	275,000	653.10	179,602,500	
メンバーズ	7,400	1,041.00	7,703,400	

中広	900	439.00	395,100	
UTグループ	24,400	2,120.00	51,728,000	
アイティメディア	10,100	1,510.00	15,251,000	
ケアネット	38,500	556.00	21,406,000	
E・Jホールディングス	11,000	1,678.00	18,458,000	
オープンアップグループ	56,200	1,794.00	100,822,800	
コシダカホールディングス	56,700	1,149.00	65,148,300	
アルトナー	1,700	2,019.00	3,432,300	
パソナグループ	22,700	1,950.00	44,265,000	
CDS	1,300	1,834.00	2,384,200	
リンクアンドモチベーション	46,100	588.00	27,106,800	
エス・エム・エス	71,500	1,566.50	112,004,750	
サニーサイドアップグループ	1,600	551.00	881,600	
パーソルホールディングス	1,743,600	236.90	413,058,840	
リニカル	3,000	329.00	987,000	
クックパッド	52,100	149.00	7,762,900	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	737.00	2,137,300	
学情	9,600	2,247.00	21,571,200	
スタジオアリス	9,400	2,107.00	19,805,800	
エプコ	1,300	789.00	1,025,700	
NJS	4,700	3,700.00	17,390,000	
総合警備保障	312,100	1,082.00	337,692,200	
カカコム	134,700	2,430.50	327,388,350	
アイロムグループ	7,600	2,783.00	21,150,800	
セントケア・ホールディング	13,500	727.00	9,814,500	
サイネックス	900	753.00	677,700	
ルネサンス	14,700	1,005.00	14,773,500	
ディップ	32,800	2,414.00	79,179,200	
デジタルホールディングス	9,600	1,289.00	12,374,400	
新日本科学	19,900	1,604.00	31,919,600	
キャリアデザインセンター	800	1,824.00	1,459,200	
エムスリー	369,200	1,365.50	504,142,600	
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	432.00	1,339,200	
ウェルネット	3,700	817.00	3,022,900	
ワールドホールディングス	7,400	1,995.00	14,763,000	
ディー・エヌ・エー	74,800	2,694.50	201,548,600	

博報堂DYホールディングス	211,900	1,244.00	263,603,600	
ぐるなび	35,300	276.00	9,742,800	
タカミヤ	25,700	406.00	10,434,200	
ファンコミュニケーションズ	26,500	414.00	10,971,000	
ライク	7,100	1,356.00	9,627,600	
A o b a - B B T	2,000	320.00	640,000	
エスプール	59,600	311.00	18,535,600	
W D B ホールディングス	9,600	1,662.00	15,955,200	
ティア	3,000	428.00	1,284,000	
アドウェイズ	23,300	299.00	6,966,700	
バリューコマース	16,500	1,189.00	19,618,500	
インフォマート	176,800	298.00	52,686,400	
J P ホールディングス	48,000	656.00	31,488,000	
エコナックホールディングス	4,800	113.00	542,400	
C L ホールディングス	4,700	681.00	3,200,700	
プレステージ・インターナショナル	87,700	687.00	60,249,900	
プロトコーポレーション	20,100	1,289.00	25,908,900	
アミューズ	11,500	1,422.00	16,353,000	
ドリームインキュベータ	5,800	3,295.00	19,111,000	
クイック	13,000	2,269.00	29,497,000	
T A C	2,900	199.00	577,100	
電通グループ	198,700	3,943.00	783,474,100	
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,100	968.00	8,808,800	
イオンファンタジー	8,100	3,000.00	24,300,000	
シーティーエス	25,800	915.00	23,607,000	
H. U. グループホールディングス	54,700	2,538.50	138,855,950	
アルプス技研	16,300	2,626.00	42,803,800	
日本空調サービス	20,200	1,006.00	20,321,200	
オリエンタルランド	1,112,100	3,380.00	3,758,898,000	
ダスキン	40,800	3,650.00	148,920,000	
明光ネットワークジャパン	22,900	720.00	16,488,000	
ファルコホールディングス	8,200	2,342.00	19,204,400	
ラウンドワン	176,400	1,343.00	236,905,200	
リゾートトラスト	73,800	3,102.00	228,927,600	
ビー・エム・エル	23,000	2,903.00	66,769,000	
リソー教育	117,200	298.00	34,925,600	

早稲田アカデミー	10,400	1,856.00	19,302,400
ユー・エス・エス	384,300	1,369.00	526,106,700
東京個別指導学院	22,600	349.00	7,887,400
サイバーエージェント	413,000	1,107.00	457,191,000
楽天グループ	1,316,200	919.80	1,210,640,760
クリーク・アンド・リバー社	9,500	1,503.00	14,278,500
SBIグローバルアセットマネジメント	36,800	648.00	23,846,400
テー・オー・ダブリュー	37,100	314.00	11,649,400
山田コンサルティンググループ	9,500	1,886.00	17,917,000
セントラルスポーツ	7,100	2,403.00	17,061,300
フルキャストホールディングス	15,400	1,428.00	21,991,200
エン・ジャパン	30,500	2,128.00	64,904,000
リソルホールディングス	400	5,120.00	2,048,000
テクノプロ・ホールディングス	108,500	2,849.50	309,170,750
アトラグループ	1,500	144.00	216,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,900	719.00	7,118,100
Keep 技研	11,600	4,700.00	54,520,000
楽待	1,500	667.00	1,000,500
三機サービス	800	980.00	784,000
Gunosy	15,000	658.00	9,870,000
デザインワン・ジャパン	2,500	110.00	275,000
イー・ガーディアン	9,000	1,886.00	16,974,000
リブセンス	3,000	142.00	426,000
ジャパンマテリアル	57,200	1,624.00	92,892,800
ベクトル	25,700	1,034.00	26,573,800
ウチヤマホールディングス	2,200	307.00	675,400
チャーム・ケア・コーポレーション	15,700	1,309.00	20,551,300
キャリアリンク	6,900	2,405.00	16,594,500
I B J	14,500	608.00	8,816,000
アサンテ	9,300	1,639.00	15,242,700
バリューHR	16,800	1,811.00	30,424,800
M&Aキャピタルパートナーズ	15,200	2,707.00	41,146,400
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,600	997.00	7,577,200
ERIホールディングス	1,200	2,117.00	2,540,400
アビスト	700	3,020.00	2,114,000
シグマクシス・ホールディングス	54,600	900.00	49,140,000

ウィルグループ	15,800	983.00	15,531,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	139.00	834,000	
メドピア	15,300	462.00	7,068,600	
レアジョブ	1,200	360.00	432,000	
リクルートホールディングス	1,457,400	10,865.00	15,834,651,000	
エラン	24,900	753.00	18,749,700	
土木管理総合試験所	2,400	306.00	734,400	
日本郵政	2,092,100	1,497.00	3,131,873,700	
ベルシステム24ホールディングス	20,200	1,249.00	25,229,800	
鎌倉新書	16,200	515.00	8,343,000	
SMN	1,400	404.00	565,600	
グローバルキッズCOMPANY	1,000	676.00	676,000	
エアトリ	13,800	1,151.00	15,883,800	
アトラエ	13,500	816.00	11,016,000	
ストライク	9,200	3,605.00	33,166,000	
ソラスト	51,800	460.00	23,828,000	
セラク	5,800	1,380.00	8,004,000	
インソース	40,700	1,129.00	45,950,300	
ベイカレント	137,300	5,347.00	734,143,100	
Orchestra Holdings	4,300	820.00	3,526,000	
アイモバイル	24,000	524.00	12,576,000	
ディスラプターズ	2,300	153.00	351,900	
MS-Japan	10,300	1,072.00	11,041,600	
船場	1,000	1,390.00	1,390,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	72,700	2,908.00	211,411,600	
フルテック	700	1,179.00	825,300	
GameWith	2,400	212.00	508,800	
MS&Consulting	800	415.00	332,000	
エル・ティー・エス	2,600	2,320.00	6,032,000	
ミダックホールディングス	11,400	1,535.00	17,499,000	
キュービーネットホールディングス	10,900	1,002.00	10,921,800	
オープングループ	30,400	181.00	5,502,400	
スプリックス	1,400	894.00	1,251,600	
マネジメントソリューションズ	9,200	1,731.00	15,925,200	
プロレド・パートナーズ	4,900	408.00	1,999,200	

テノ・ホールディングス	900	466.00	419,400
フロンティア・マネジメント	5,800	736.00	4,268,800
コプロ・ホールディングス	1,400	1,615.00	2,261,000
ギークス	900	379.00	341,100
アンビスホールディングス	40,200	731.00	29,386,200
カーブスホールディングス	51,200	800.00	40,960,000
フォーラムエンジニアリング	25,000	1,026.00	25,650,000
Fast Fitness Japan	6,500	1,354.00	8,801,000
Macbee Planet	5,300	2,978.00	15,783,400
ダイレクトマーケティングミックス	23,100	278.00	6,421,800
ポピンズ	3,600	1,225.00	4,410,000
LITALICO	17,200	871.00	14,981,200
コンフィデンス・インターワークス	400	1,560.00	624,000
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	633.00	1,455,900
リログループ	104,100	1,955.50	203,567,550
東祥	15,900	633.00	10,064,700
ID&Eホールディングス	11,100	6,470.00	71,817,000
ビーウィズ	3,900	1,473.00	5,744,700
サンウェルズ	7,400	714.00	5,283,600
TREホールディングス	43,000	1,481.00	63,683,000
人・夢・技術グループ	7,800	1,410.00	10,998,000
NISSOホールディングス	16,400	752.00	12,332,800
大栄環境	40,800	2,845.00	116,076,000
GENOVA	6,500	1,265.00	8,222,500
日本管財ホールディングス	19,600	2,600.00	50,960,000
M&A総研ホールディングス	20,200	1,837.00	37,107,400
エイチ・アイ・エス	59,800	1,550.00	92,690,000
ラックランド	8,300	1,732.00	14,375,600
共立メンテナンス	58,700	2,847.50	167,148,250
イチネンホールディングス	19,500	1,863.00	36,328,500
建設技術研究所	9,700	5,090.00	49,373,000
スペース	13,700	1,162.00	15,919,400
燦ホールディングス	17,000	1,151.00	19,567,000
スバル興業	7,300	3,200.00	23,360,000
東京テアトル	1,400	1,078.00	1,509,200
タナベコンサルティンググループ	8,200	1,233.00	10,110,600

ナガワ	5,700	6,760.00	38,532,000	
東京都競馬	13,700	4,405.00	60,348,500	
カナモト	29,000	3,285.00	95,265,000	
ニシオホールディングス	15,500	4,395.00	68,122,500	
トランス・コスモス	23,900	3,325.00	79,467,500	
乃村工藝社	81,600	847.00	69,115,200	
藤田観光	8,300	7,750.00	64,325,000	
KNT-CTホールディングス	11,100	1,165.00	12,931,500	
トーカイ	16,600	2,380.00	39,508,000	
セコム	380,500	5,288.00	2,012,084,000	
セントラル警備保障	10,100	2,893.00	29,219,300	
丹青社	39,600	978.00	38,728,800	
メイテックグループホールディングス	69,000	2,884.50	199,030,500	
応用地質	17,500	2,496.00	43,680,000	
船井総研ホールディングス	37,400	2,400.00	89,760,000	
進学会ホールディングス	1,800	202.00	363,600	
オオバ	2,800	975.00	2,730,000	
いであ	1,100	2,451.00	2,696,100	
学究社	7,500	2,081.00	15,607,500	
イオンディライト	20,100	4,330.00	87,033,000	
ナック	19,300	579.00	11,174,700	
ダイセキ	45,100	3,695.00	166,644,500	
ステップ	6,900	2,136.00	14,738,400	
合 計	342,007,400		703,276,744,860	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,719,899
株式	17,617,833,570
投資証券	102,219,100
未収入金	15,300,000
未収配当金	953,324
未収利息	372
前払金	922,250
差入委託証拠金	2,100,826
流動資産合計	17,802,049,341
資産合計	17,802,049,341
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	924,098
未払解約金	7,744,091
流動負債合計	8,668,189
負債合計	8,668,189
純資産の部	
元本等	
元本	11,218,094,543
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	6,575,286,609
元本等合計	17,793,381,152
純資産合計	17,793,381,152
負債純資産合計	17,802,049,341

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	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。
	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
	(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12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		11,218,094,543 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)	1.5861 円 (15,861 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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	9,690,665,416円
期中追加設定元本額	3,094,112,777円
期中一部解約元本額	1,566,683,650円
期末元本額	11,218,094,543円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	149,819,293円
コア投資戦略ファンド(成長型)	402,453,080円
コア投資戦略ファンド(切替型)	159,832,532円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	8,027,809,034円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	83,155,128円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	151,461,746円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	38,162,596円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	2,079,791,788円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド(適格機関投資家専用)	58,282,819円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	67,326,527円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	548,761,236
投資証券	△3,295,900
合計	545,465,336

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年12月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	57,664,250	—	56,742,000	△922,250
合計		57,664,250	—	56,742,000	△922,250

(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)	
INPEX	39,700	1,941.50	77,077,550	
大林組	29,300	2,049.00	60,035,700	
戸田建設	9,400	940.10	8,836,940	
住友林業	7,000	5,207.00	36,449,000	
大和ハウス工業	26,700	4,753.00	126,905,100	
積水ハウス	26,900	3,615.00	97,243,500	
高砂熱学工業	1,900	6,436.00	12,228,400	
明治ホールディングス	10,600	3,163.00	33,527,800	
サッポロホールディングス	2,800	8,476.00	23,732,800	
アサヒグループホールディングス	65,100	1,663.00	108,261,300	
麒麟ホールディングス	35,000	2,058.50	72,047,500	
サントリー食品インターナショナル	6,300	5,055.00	31,846,500	
伊藤園	2,400	3,558.00	8,539,200	
キッコーマン	30,600	1,736.50	53,136,900	
味の素	20,900	6,418.00	134,136,200	
カゴメ	3,400	2,936.00	9,982,400	
ニチレイ	4,800	4,137.00	19,857,600	
日清食品ホールディングス	9,000	3,782.00	34,038,000	
東洋紡	3,800	931.00	3,537,800	
帝人	8,000	1,283.50	10,268,000	
東レ	62,500	987.80	61,737,500	

クラレ	12,800	2,183.50	27,948,800	
旭化成	56,500	1,058.50	59,805,250	
レゾナック・ホールディングス	7,900	4,075.00	32,192,500	
住友化学	67,200	342.50	23,016,000	
日産化学	5,900	4,877.00	28,774,300	
クレハ	1,600	2,746.00	4,393,600	
日本曹達	1,900	2,831.00	5,378,900	
東ソー	11,700	2,054.50	24,037,650	
デンカ	3,600	2,104.50	7,576,200	
エア・ウォーター	8,300	1,865.00	15,479,500	
カネカ	1,900	3,637.00	6,910,300	
三井化学	7,700	3,332.00	25,656,400	
東京応化工業	4,300	3,504.00	15,067,200	
三菱ケミカルグループ	61,100	768.40	46,949,240	
ダイセル	10,600	1,361.50	14,431,900	
積水化学工業	17,000	2,375.00	40,375,000	
UBE	4,300	2,321.50	9,982,450	
日本化薬	6,100	1,265.00	7,716,500	
花王	21,000	6,484.00	136,164,000	
日本ペイントホールディングス	42,700	1,016.50	43,404,550	
関西ペイント	6,300	2,216.50	13,963,950	
中国塗料	1,600	2,303.00	3,684,800	
D I C	3,400	3,592.00	12,212,800	
サカタインクス	1,800	1,670.00	3,006,000	
a r t i e n c e	1,700	3,025.00	5,142,500	
富士フイルムホールディングス	50,400	3,267.00	164,656,800	
資生堂	18,000	2,710.50	48,789,000	
ライオン	12,200	1,764.00	21,520,800	
長谷川香料	1,400	3,060.00	4,284,000	
日東電工	31,800	2,564.50	81,551,100	
信越ポリマー	1,700	1,620.00	2,754,000	
ニフコ	3,600	3,730.00	13,428,000	
ユニ・チャーム	16,800	3,965.00	66,612,000	
協和キリン	10,900	2,375.50	25,892,950	
アステラス製薬	81,500	1,542.50	125,713,750	
塩野義製薬	34,100	2,194.50	74,832,450	

中外製薬	30,300	6,650.00	201,495,000
エーザイ	11,400	4,316.00	49,202,400
第一三共	78,900	4,382.00	345,739,800
E N E O Sホールディングス	123,000	807.50	99,322,500
ブリヂストン	25,700	5,247.00	134,847,900
太平洋セメント	5,100	3,541.00	18,059,100
東海カーボン	9,100	879.00	7,998,900
T O T O	6,400	3,801.00	24,326,400
日本特殊陶業	6,700	4,944.00	33,124,800
神戸製鋼所	17,000	1,471.50	25,015,500
J F Eホールディングス	25,900	1,670.00	43,253,000
大同特殊鋼	5,900	1,115.00	6,578,500
日本軽金属ホールディングス	2,500	1,488.00	3,720,000
三井金属鉱業	2,500	4,524.00	11,310,000
三菱マテリアル	5,600	2,286.50	12,804,400
住友金属鉱山	11,100	3,455.00	38,350,500
D O W Aホールディングス	2,400	4,317.00	10,360,800
東邦チタニウム	1,400	997.00	1,395,800
U A C J	1,600	5,190.00	8,304,000
L I X I L	12,900	1,687.00	21,762,300
三浦工業	4,000	3,994.00	15,976,000
ナブテスコ	4,900	2,731.00	13,381,900
小松製作所	39,500	4,162.00	164,399,000
日立建機	4,800	3,395.00	16,296,000
クボタ	42,400	1,821.00	77,210,400
荏原製作所	20,800	2,536.00	52,748,800
ダイキン工業	11,900	17,660.00	210,154,000
栗田工業	4,700	5,433.00	25,535,100
ダイフク	14,500	3,360.00	48,720,000
セガサミーホールディングス	7,100	2,610.00	18,531,000
カナデビア	7,300	925.00	6,752,500
三菱重工業	144,400	2,236.50	322,950,600
I H I	6,300	8,347.00	52,586,100
イビデン	5,400	4,363.00	23,560,200
コニカミノルタ	20,400	671.50	13,698,600
ブラザー工業	10,500	2,731.50	28,680,750

日立製作所	208,900	3,865.00	807,398,500
富士電機	6,100	8,502.00	51,862,200
オムロン	7,900	5,128.00	40,511,200
日本電気	11,100	13,470.00	149,517,000
富士通	74,600	2,809.50	209,588,700
ルネサスエレクトロニクス	75,900	2,029.50	154,039,050
セイコーエプソン	13,000	2,826.50	36,744,500
アルバック	2,000	6,053.00	12,106,000
パナソニック ホールディングス	105,100	1,588.00	166,898,800
シャープ	11,700	989.90	11,581,830
アンリツ	6,100	1,310.50	7,994,050
ソニーグループ	281,300	3,284.00	923,789,200
アルプスアルパイン	8,400	1,578.50	13,259,400
マクセル	1,800	1,741.00	3,133,800
横河電機	10,300	3,465.00	35,689,500
アズビル	20,400	1,244.00	25,377,600
アドバンテスト	34,500	8,609.00	297,010,500
シスメックス	22,700	2,915.50	66,181,850
スタンレー電気	5,700	2,531.00	14,426,700
ウシオ電機	3,400	2,064.00	7,017,600
ファナック	42,600	4,017.00	171,124,200
太陽誘電	5,600	2,197.50	12,306,000
キヤノン	42,100	5,163.00	217,362,300
リコー	23,800	1,778.00	42,316,400
東京エレクトロン	20,200	23,300.00	470,660,000
トヨタ自動車	462,600	2,771.50	1,282,095,900
ヤマハ発動機	41,600	1,398.00	58,156,800
島津製作所	10,700	4,447.00	47,582,900
ニコン	12,700	1,637.00	20,789,900
HOYA	15,700	19,530.00	306,621,000
ノーリツ鋼機	800	5,000.00	4,000,000
メニコン	2,800	1,434.00	4,015,200
前田工織	1,800	1,921.00	3,457,800
大日本印刷	17,500	2,211.50	38,701,250
N I S S H A	1,700	1,564.00	2,658,800
アシックス	30,800	3,085.00	95,018,000

ヤマハ	17,100	1,099.00	18,792,900	
ピジョン	5,200	1,464.00	7,612,800	
リンテック	1,700	2,988.00	5,079,600	
美津濃	800	9,210.00	7,368,000	
東北電力	20,400	1,131.50	23,082,600	
九州電力	18,200	1,333.00	24,260,600	
レノバ	1,800	694.00	1,249,200	
東京瓦斯	15,300	4,191.00	64,122,300	
大阪瓦斯	16,400	3,217.00	52,758,800	
東邦瓦斯	3,300	3,980.00	13,134,000	
西部ガスホールディングス	1,100	1,681.00	1,849,100	
相鉄ホールディングス	3,500	2,468.00	8,638,000	
東急	23,900	1,676.50	40,068,350	
京王電鉄	4,600	3,800.00	17,480,000	
西日本旅客鉄道	19,800	2,720.50	53,865,900	
西武ホールディングス	10,200	3,398.00	34,659,600	
西日本鉄道	2,700	2,179.00	5,883,300	
阪急阪神ホールディングス	10,300	4,065.00	41,869,500	
南海電気鉄道	4,600	2,377.50	10,936,500	
京阪ホールディングス	4,300	3,281.00	14,108,300	
ヤマトホールディングス	11,400	1,723.50	19,647,900	
山九	2,000	5,425.00	10,850,000	
センコーグループホールディングス	5,300	1,515.00	8,029,500	
九州旅客鉄道	6,400	3,865.00	24,736,000	
S Gホールディングス	14,400	1,462.50	21,060,000	
日本郵船	19,700	5,055.00	99,583,500	
A N Aホールディングス	7,200	2,856.50	20,566,800	
T I S	9,600	3,801.00	36,489,600	
S H I F T	600	17,075.00	10,245,000	
インターネットイニシアティブ	5,000	3,002.00	15,010,000	
マネーフォワード	2,000	5,051.00	10,102,000	
野村総合研究所	17,000	4,647.00	78,999,000	
メルカリ	5,200	1,825.00	9,490,000	
S a n s a n	3,100	2,385.00	7,393,500	
フリー	2,000	3,215.00	6,430,000	
L I N Eヤフー	128,800	426.20	54,894,560	

B I P R O G Y	3,400	4,652.00	15,816,800
スカパー J S A Tホールディングス	7,400	902.00	6,674,800
K D D I	69,100	4,970.00	343,427,000
ソフトバンク	1,288,800	196.60	253,378,080
コナミグループ	4,500	14,905.00	67,072,500
ソフトバンクグループ	43,000	8,760.00	376,680,000
あらた	1,200	3,085.00	3,702,000
双日	10,100	3,039.00	30,693,900
アルフレッサ ホールディングス	7,800	2,154.50	16,805,100
アズワン	2,500	2,688.50	6,721,250
伊藤忠商事	53,600	7,483.00	401,088,800
丸紅	64,200	2,236.00	143,551,200
三愛オブリ	2,100	1,853.00	3,891,300
伊藤忠エネクス	2,400	1,596.00	3,830,400
サンリオ	8,100	5,130.00	41,553,000
P A L T A C	1,300	4,397.00	5,716,100
アスクル	1,700	1,712.00	2,910,400
アダストリア	1,100	3,575.00	3,932,500
エディオン	3,300	1,778.00	5,867,400
ジズホールディングス	500	6,620.00	3,310,000
ビックカメラ	4,200	1,714.00	7,198,800
J. フロント リテイリング	11,000	1,953.00	21,483,000
マツキヨココカラ&カンパニー	15,000	2,182.00	32,730,000
Z O Z O	6,100	4,867.00	29,688,700
三越伊勢丹ホールディングス	14,900	2,431.00	36,221,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,600	733.00	2,638,800
イオン北海道	1,900	882.00	1,675,800
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	17,200	4,166.00	71,655,200
スギホールディングス	4,700	2,444.00	11,486,800
日本瓦斯	4,600	2,080.00	9,568,000
青山商事	1,800	2,260.00	4,068,000
丸井グループ	7,500	2,509.00	18,817,500
イオン	29,500	3,679.00	108,530,500
イズミ	1,500	3,187.00	4,780,500
ヤオコー	900	9,080.00	8,172,000

ケーズホールディングス	6,400	1,391.50	8,905,600
ヤマダホールディングス	24,000	445.50	10,692,000
ファーストリテイリング	8,600	52,770.00	453,822,000
三井住友トラストグループ	29,300	3,641.00	106,681,300
三井住友フィナンシャルグループ	168,000	3,651.00	613,368,000
みずほフィナンシャルグループ	108,700	3,766.00	409,364,200
大和証券グループ本社	60,100	1,013.00	60,881,300
野村ホールディングス	135,400	893.30	120,952,820
SOMPOホールディングス	40,200	4,090.00	164,418,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	58,000	3,390.00	196,620,000
東京海上ホールディングス	84,700	5,520.00	467,544,000
T&Dホールディングス	22,100	2,783.00	61,504,300
東京センチュリー	6,700	1,529.50	10,247,650
オリックス	52,000	3,293.00	171,236,000
ヒューリック	20,800	1,347.50	28,028,000
オープンハウスグループ	3,500	5,387.00	18,854,500
東急不動産ホールディングス	25,900	936.60	24,257,940
三井不動産	120,300	1,237.50	148,871,250
三菱地所	48,700	2,145.50	104,485,850
平和不動産	900	4,195.00	3,775,500
東京建物	8,500	2,530.00	21,505,000
住友不動産	13,900	4,781.00	66,455,900
MIXI	1,700	3,105.00	5,278,500
ジェイエイシーリクルートメント	3,000	726.00	2,178,000
パーソルホールディングス	78,800	236.90	18,667,720
H. U. グループホールディングス	2,500	2,538.50	6,346,250
オリエンタルランド	49,200	3,380.00	166,296,000
リゾートトラスト	3,700	3,102.00	11,477,400
ビー・エム・エル	1,000	2,903.00	2,903,000
ユー・エス・エス	18,500	1,369.00	25,326,500
楽天グループ	67,800	919.80	62,362,440
リクルートホールディングス	63,200	10,865.00	686,668,000
インソース	2,100	1,129.00	2,370,900
カーブスホールディングス	2,300	800.00	1,840,000
トーカイ	900	2,380.00	2,142,000

セコム	18,900	5,288.00	99,943,200	
合 計	6,901,300		17,617,833,570	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	69	8,452,500	
	積水ハウス・リート投資法人	197	14,755,300	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	58	31,436,000	
	オリックス不動産投資法人	118	18,974,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	133	18,260,900	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	40	10,340,000	
合 計		615	102,219,100	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	201,962,930
株式	48,564,006,350
未収配当金	1,614,500
未収利息	1,198
流動資産合計	48,767,584,978
資産合計	48,767,584,978
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,671,131
流動負債合計	19,671,131
負債合計	19,671,131
純資産の部	
元本等	
元本	7,713,449,371

剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	41,034,464,476
元本等合計	48,747,913,847
純資産合計	48,747,913,847
負債純資産合計	48,767,584,978

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年12月20日現在
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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,713,449,371 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.3199 円 (1万口当たり純資産額) (63,199 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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額

	によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	5,363,180,694円
期中追加設定元本額	2,971,308,385円
期中一部解約元本額	621,039,708円
期末元本額	7,713,449,371円
期末元本額の内訳	
DC日本株式エクセレント・フォーカス	5,165,795,518円
コア投資戦略ファンド(安定型)	39,419,591円
コア投資戦略ファンド(成長型)	96,061,665円
コア投資戦略ファンド(切替型)	41,704,486円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	2,004,790,616円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	20,879,736円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	37,842,119円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	9,524,459円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	228,620,294円
FOFs用 日本株式エクセレント・フォーカスS(適格機関投資家専用)	15,339,719円
SMTETF日本株厳選投資アクティブ	53,267,389円
日本株式エクセレント・フォーカスVA(適格機関投資家専用)	203,779円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	632,032,471
合計	632,032,471

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式エクセレント・フォーカスマザーファンド」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)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和ハウス工業	84,500	4,753.00	401,628,500	
信越化学工業	291,100	5,054.00	1,471,219,400	
ユニ・チャーム	125,900	3,965.00	499,193,500	
エーザイ	71,300	4,316.00	307,730,800	
第一三共	298,800	4,382.00	1,309,341,600	
MARUWA	58,200	44,640.00	2,598,048,000	
日本製鉄	82,000	2,982.00	244,524,000	
住友金属鉱山	61,600	3,455.00	212,828,000	
住友電気工業	313,000	2,800.50	876,556,500	
ディスコ	34,800	41,540.00	1,445,592,000	
SMC	12,700	61,290.00	778,383,000	
荏原製作所	472,700	2,536.00	1,198,767,200	
ダイキン工業	24,600	17,660.00	434,436,000	
ダイフク	262,800	3,360.00	883,008,000	
三菱重工業	891,100	2,236.50	1,992,945,150	
イビデン	52,900	4,363.00	230,802,700	
日立製作所	521,200	3,865.00	2,014,438,000	
富士電機	102,600	8,502.00	872,305,200	
ニデック	259,100	2,750.00	712,525,000	
ソニーグループ	590,500	3,284.00	1,939,202,000	
アドバンテスト	147,100	8,609.00	1,266,383,900	
キーエンス	21,100	64,180.00	1,354,198,000	
村田製作所	256,400	2,440.00	625,616,000	
東京エレクトロン	67,600	23,300.00	1,575,080,000	
デンソー	219,900	2,050.00	450,795,000	
川崎重工業	330,400	6,524.00	2,155,529,600	
トヨタ自動車	276,700	2,771.50	766,874,050	
シマノ	22,600	21,145.00	477,877,000	
HOYA	37,000	19,530.00	722,610,000	
東海旅客鉄道	185,600	2,864.00	531,558,400	
西武ホールディングス	253,900	3,398.00	862,752,200	
SHIFT	43,700	17,075.00	746,177,500	
GMOペイメントゲートウェイ	34,800	7,981.00	277,738,800	
野村総合研究所	228,300	4,647.00	1,060,910,100	

NTTデータグループ	353,000	2,966.50	1,047,174,500
三菱商事	483,400	2,496.50	1,206,808,100
J. フロント リテイリング	471,100	1,953.00	920,058,300
マツキヨココカラ&カンパニー	485,400	2,182.00	1,059,142,800
三越伊勢丹ホールディングス	976,300	2,431.00	2,373,385,300
良品計画	121,000	3,446.00	416,966,000
ニトリホールディングス	20,100	18,340.00	368,634,000
ファーストリテイリング	10,900	52,770.00	575,193,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,230,400	1,773.00	2,181,499,200
三井住友フィナンシャルグループ	543,500	3,651.00	1,984,318,500
第一生命ホールディングス	39,000	4,153.00	161,967,000
パーク24	325,900	2,207.00	719,261,300
三井不動産	201,700	1,237.50	249,603,750
リクルートホールディングス	184,300	10,865.00	2,002,419,500
合 計	12,182,500		48,564,006,350

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2024年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	69,875,544,209
国債証券	72,969,434,000
未収利息	414,716
流動資産合計	142,845,392,925
資産合計	142,845,392,925
負債の部	
流動負債	

未払解約金	1,185,758
流動負債合計	1,185,758
負債合計	1,185,758
純資産の部	
元本等	
元本	142,645,892,304
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	198,314,863
元本等合計	142,844,207,167
純資産合計	142,844,207,167
負債純資産合計	142,845,392,925

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月20日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	142,645,892,304 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 1.0014 円 (1万口当たり純資産額) (10,014 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12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月21日
期首元本額	222,083,264,767円
期中追加設定元本額	77,037,640,143円
期中一部解約元本額	156,475,012,606円
期末元本額	142,645,892,304円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円

外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952 円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951 円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951 円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990 円
債券コア・セレクション	9,956 円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970 円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972 円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989 円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983 円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983 円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983 円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987 円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990 円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990 円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990 円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,994 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,994 円
オーストラリア公社債ファンド (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,995 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型・奇数月決算型)	9,995 円
スマート・コントロール 世界株式戦略ファンド	9,996 円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	24,620,823,586 円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	2,972,540,925 円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	13,501,015,451 円
リスクプレミア α ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872 円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,716,568,481 円
TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,508,486,049 円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,273,749,460 円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	9,647,120,614 円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,787,776,851 円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,187,198,113 円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	478,634,545 円

家専用)	
TOPIXベアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	6,176,470,429 円
TOPIXベアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	5,099,163,481 円
TOPIXベアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,076,933,151 円
TOPIXベアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,337,412,035 円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型Z) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF15 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795 円
TOPIXベアファンドF16 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795 円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	241,544,469 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	21,274,000
合計	21,274,000

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第1220回国庫短期証券	45,000,000,000	44,985,870,000	
	第1226回国庫短期証券	28,000,000,000	27,983,564,000	
合計		73,000,000,000	72,969,434,000	

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。

2 【ファンドの現況】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

【純資産額計算書】

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	258,562,063,966円
II 負債総額	425,357,431円
III 純資産総額（I－II）	258,136,706,535円
IV 発行済口数	106,068,048,100口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4337円
(1万口当たり純資産額)	(24,337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

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	737,591,144,569円
II 負債総額	3,017,987,536円
III 純資産総額（I－II）	734,573,157,033円
IV 発行済口数	250,522,802,465口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9322円
(1万口当たり純資産額)	(29,322円)

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	18,117,016,218円
II 負債総額	5,789,841円
III 純資産総額（I－II）	18,111,226,377円
IV 発行済口数	11,031,590,373口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6418円
(1万口当たり純資産額)	(16,418円)

日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	49,761,373,729円
II 負債総額	1,684,591円
III 純資産総額 (I - II)	49,759,689,138円
IV 発行済口数	7,635,178,953口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	6.5172円
(1万口当たり純資産額)	(65,172円)

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	142,867,248,452円
II 負債総額	960円
III 純資産総額 (I - II)	142,867,247,492円
IV 発行済口数	142,656,379,917口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0015円
(1万口当たり純資産額)	(10,015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（2025年1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネージャーが運用仕様・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 3 月 19 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2025 年 1 月 31 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	527	15,887,722
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	56	202,010
単位型公社債投資信託	52	168,562
合計	635	16,258,294

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. X B R 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

	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

	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

	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) 通常の見取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2025年3月19日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
国内株式 SMTB セレクション (SMA 専用)
投資信託約款

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

投資信託約款第 19 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、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

- ①主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。
- ②各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ③投資対象ファンドについては、各投資対象ファンドに係る定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。
- ④投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- ⑤投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する株式以外の資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ⑥資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②株式への直接投資は行いません。
- ③外貨建資産への直接投資は行いません。なお、投資対象ファンドへの投資を通じて実質的に保有する外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ④デリバティブの直接利用は行いません。
- ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 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) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- (3) 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
国内株式 SMTB セレクション (SMA 専用)
投資信託約款

(信託の種類、委託者及び受託者)

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、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項、第18条第2項及び第21条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

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

(信託の目的及び金額)

第3条 委託者は、金50万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

②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5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第39条第1項、第39条第2項、第40条第1項、第41条第1項及び第43条第2項の規定による信託終了の日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

第7条 この投資信託契約締結当初及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8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。

(受益権の分割及び再分割)

第8条 委託者は、第3条による受益権については50万口を上限として、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9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、受託者と協議のうえ、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。

(追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（第20条に規定する借入公社

債を除きます。)を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権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10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11条 この信託の全ての受益権は、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ることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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。)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。)

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又は当該指定が効力を失った場合であつて、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8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があつた場合、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又は記録を行います。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、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。

(受益権の申込単位及び価額)

第13条 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及び委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)は、第8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、販売会社が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、販売会社と別に定める分配金再投資に関する契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1円以上1円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②前項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された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(第3項又は第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。

③第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円とします。

④第3項の規定にかかわらず、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価額は、原則として、第29条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑤前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、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。

（受益権の譲渡に係る記載又は記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載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。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前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又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、委託者が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託者及び受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第16条 この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

（運用の指図範囲等）

第17条 委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの

3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）

4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

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。

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託者の利害関係人、第21条第1項に定める信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条及び第24条から第26条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者又は受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役及び委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項及び同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条及び第24条から第26条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

④前3項の場合、委託者及び受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19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従って、その指図を行います。

（公社債の借入れの指図、目的及び範囲）

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、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内と

します。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④第1項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

(信託業務の委託等)

第21条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前各項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者及び委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 投資信託財産の保存に係る業務
2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第22条 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。以下本条において同じ。）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)

第23条 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、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者又は受託者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。

(一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図)

第 24 条 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券に係る投資信託契約の一部解約の請求及び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 25 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第 26 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 27 条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 28 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替えがある場合で、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、有価証券等に係る利子等及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 項の立替金の決済及び利息については、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 29 条 この信託の計算期間は、毎年 12 月 21 日から翌年 12 月 20 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、平成 27 年 2 月 6 日から平成 27 年 12 月 21 日までとします。

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 5 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等)

第 30 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託

者に提出します。

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

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類又は電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報及び当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧又は謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用)

第31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及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投資信託財産の監査費用及び当該監査費用に係る消費税及び地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額及び支弁の方法)

第32条 委託者及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29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55の率を乗じて得た額

2. マザーファンド(別に定める投資信託証券に親投資信託を含む場合における当該親投資信託をいいます。以下本項において同じ。)において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又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。)のうち投資信託財産に属するとみなした額に100分の50未満の率を乗じて得た額

3. 前号において、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当該マザーファンドの受益証券の時価総額に当該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。

②前項の信託報酬は、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投資信託財産中から支弁するものとし、委託者及び受託者間の配分は別に定めます。

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33条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配

することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い)

第 34 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又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、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、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 11 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載又は記録されます。

③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。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又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又は記録が行われます。

④一部解約金（第 37 条第 4 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第 37 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6 営業日目から当該受益者に支払います。

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

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

(収益分配金、償還金及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 35 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までに、償還金については前条第 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前条第 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、償還金及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。

(収益分配金及び償還金の時効)

第 36 条 受益者が、収益分配金については第 34 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、並びに信託終了による償還金については第 34 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 37 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し販売会社が定める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受益者が前項の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、
- 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又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日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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、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。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行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、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取扱い)

第 38 条 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、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

- 第 39 条 委託者は、信託期間中において、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、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 - ③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - ④前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - ⑤第 3 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあたる多数をもって行います。
 - ⑥第 3 項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第 3 項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第 40 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の変更をしようとするときは、第 44 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 41 条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又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 44 条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い)

第 42 条 委託者は、事業の全部又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又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。

(受託者の辞任及び解任に伴う取扱い)

第 43 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違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 44 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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等)

第 44 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき又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又はこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第 2 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第 2 項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(信託期間の延長)

第 45 条 (削除)

(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第 46 条 この信託の受益者は、委託者又は受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 47 条 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 48 条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第 49 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付則)

第 1 条 第 34 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、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 27 年 2 月 6 日

委託者 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

1. 別に定める投資信託証券

投資信託約款第 17 条第 1 項、第 32 条第 1 項及び別に定める運用の基本方針の「別に定める投資信託証券」とは、次の投資信託の受益証券（振替受益権を含みます。）をいいます。

追加型証券投資信託 FOFs 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

親投資信託 国内株式インデックス マザーファンド

親投資信託 日本株式 ESG セレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

親投資信託 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

追加型証券投資信託 国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 FOFs 用国内株式 EVI バリューファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 SMD AM 日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

親投資信託 マネープールマザーファンド