

三井住友・DCつみたてNISA・ 日本株インデックスファンド

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を2024年2月26日に関東財務局長に提出しており、2024年2月27日にその届出の効力が生じております。

発行者名	三井住友DS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 猿田 隆
本店の所在の場所	東京都港区虎ノ門一丁目17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。



三井住友DSアセットマネジメント

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。

1. 本書は、金融商品取引法第13条第2項第2号に定める内容を記載した目論見書です。
2. 運用による損益はすべて投資家の皆さまに帰属いたします。したがって、預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。
3. 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。
4. 投資信託は、預金保険、貯金保険または保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。
5. 税制に関する本書の記載内容は、税法の改正等により将来変更されることがあります。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド
以下「当ファンド」といいます。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

*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、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友DSアセットマネジメント株式会社は、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。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、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また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)【発行（売出）価額の総額】

2兆5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC積N日株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター※	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

※お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2024年2月27日から2024年8月28日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱いますので、委託会社は販売会社としての役割も有します。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの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】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の

規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該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。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

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】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。
- ロ TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして運用を行います。
詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、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。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。
- (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	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います。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、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います。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

《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)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経 225
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ()	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンドオブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券(株 式 一般))		アフリカ		
資産複合 ()		中近東(中東)		その他 ()
資産配分固定型		エマージング		
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2011年12月9日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年9月21日	「三井住友・DC日本株式インデックスファンドS」から「三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド」に名称を変更。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

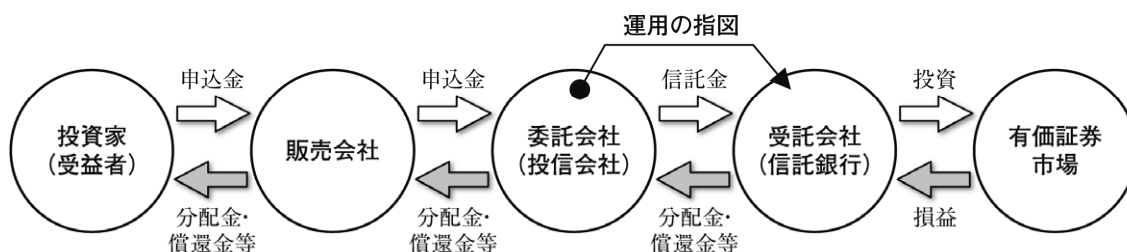
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

※委託会社は販売会社としての役割も有します。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2023年12月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社に商号変更

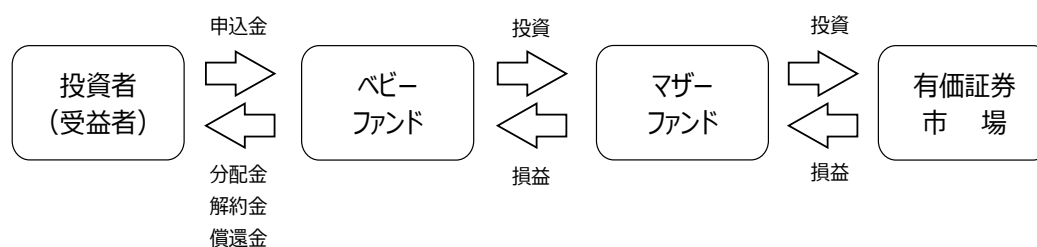
(ハ) 大株主の状況

(2023年12月29日現在)

名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

ハ ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。
- (ロ) 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。
- (ハ) 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。
- (ニ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ホ) 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。

ファンドの特色

1

マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。

- TOPIX（東証株価指数）採用銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- TOPIX（東証株価指数、配当込み）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。



TOPIX（東証株価指数）とは

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株価指数です。日本の株式市場を投資対象とする金融商品の運用目標や評価の基準（ベンチマーク）として広く利用されています。

2

株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

※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。

ファンドのしくみ

□ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



TOPIX(東証株価指数)の概要

銘柄数:2,155

配当利回り:2.21%

予想PER:14.98倍



配当利回りとは

株価に対する実績年間配当金の割合(1株当たり実績年間配当金÷株価)です。

予想PER(Price Earnings Ratio)とは

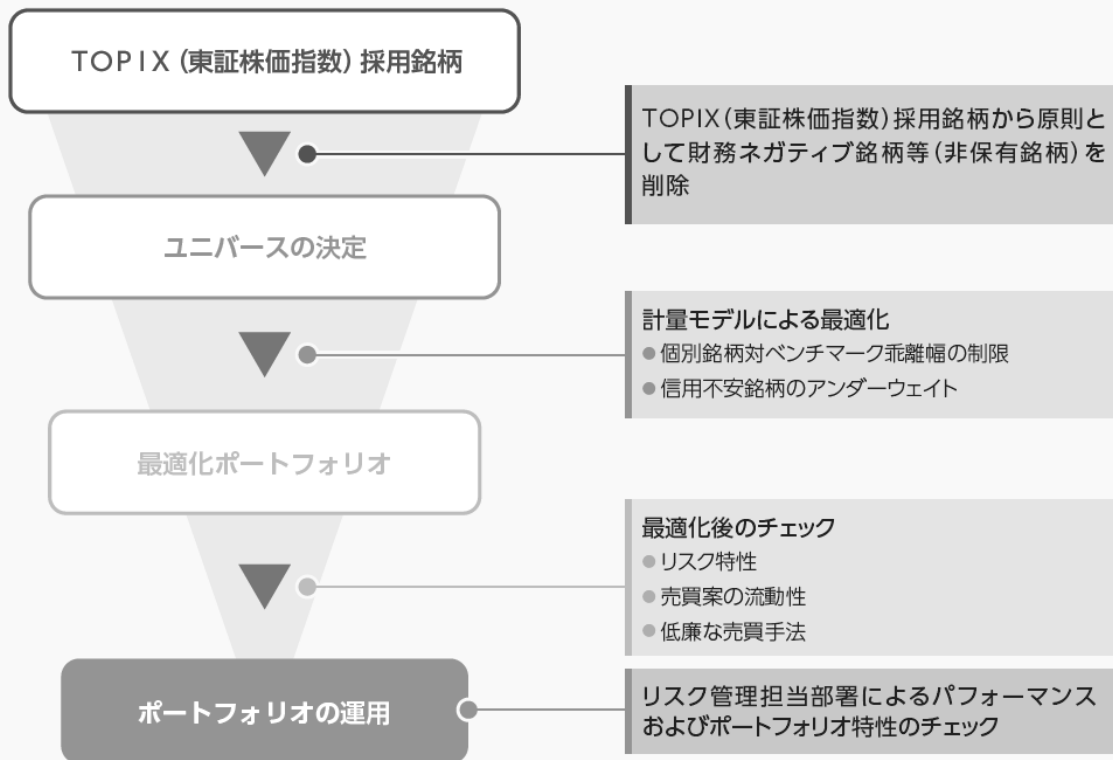
株価の1株当たり予想利益に対する倍率(株価÷1株当たり予想利益)です。

(注)2023年12月末現在

(出所)FactSetの情報を基に委託会社作成

※データは、上記指数の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

運用プロセス



最適化(法)とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

TOPIXの著作権など

- TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- JPXは、TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- JPXは、TOPIXの指数値およ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ありません。また、JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- JPXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズをTOPIXの指数値を算出する銘柄構成および

計算に考慮するものではありません。

- ・以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売およ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ません。

(2) 【投資対象】

イ 投資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（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンド受益証券または次の有価証券（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きます。）に投資することを指図します。

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

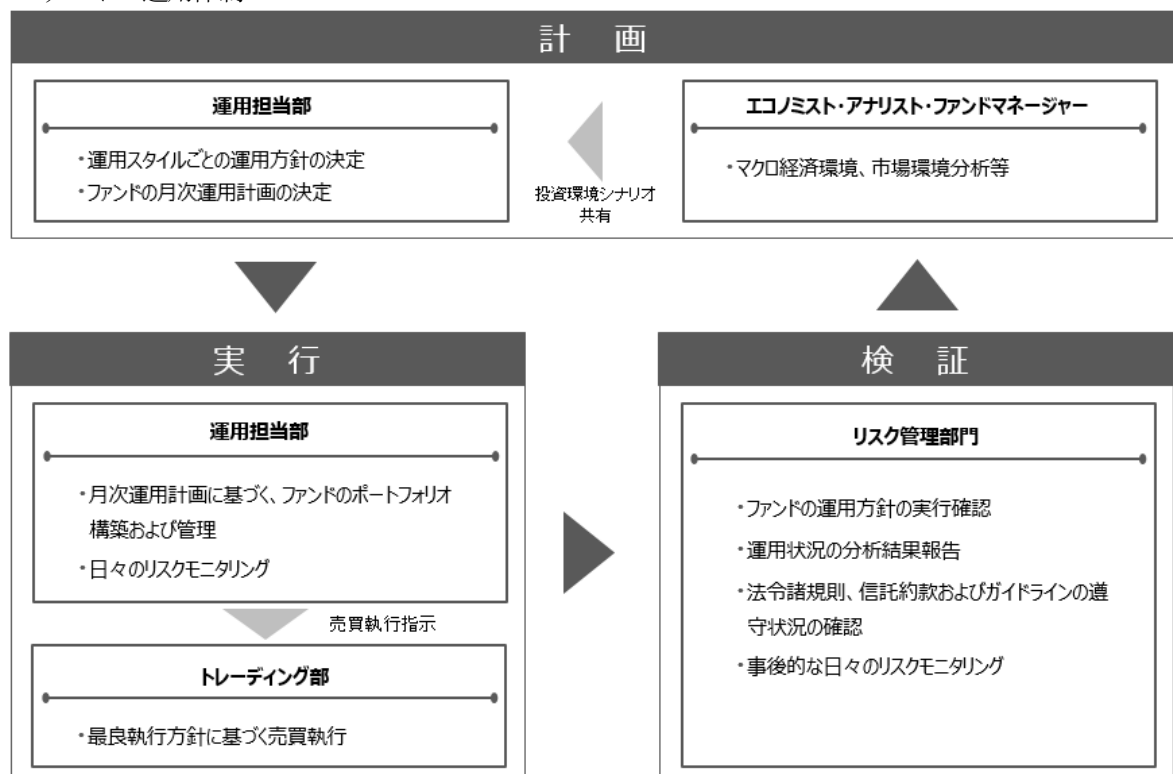
ハ 投資対象とする金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



※リスク管理部門の人員数は、約40名です。

※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

(4) 【分配方針】

年1回（原則として毎年11月30日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 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。
- ロ 収益分配金額は、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等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、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。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

(5) 【投資制限】

I ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
- ロ 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 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。
- ニ 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。
- ホ 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、価格変動リスクおよび金利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。

II ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
(イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社

の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ）。
- (ロ) 委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、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（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

へ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記（イ）に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記（イ）の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる有価証券の時価総額が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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

チ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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するものとします。
- (ロ) 上記（イ）の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当て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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は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、信託財産中から支弁します。

ヌ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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。

Ⅲ 法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（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かかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：国内株式インデックス・マザーファンド（B号）の投資方針等)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、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指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。

(ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、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。

(ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
7. 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。）

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ハ) 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。

(ニ) 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、価格変動リスクおよび金利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。

3 【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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。したがって、投資者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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、株価が下落した場合はファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ロ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ハ) 流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

ロ その他の留意点

(イ) ファンド固有の留意点

対象インデックスの動きと連動しない要因

ファンドは、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指して運用を行いますが、以下の要因等により、対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること

(ロ) 投資信託に関する留意点

- ・当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や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、換金申込みの受付が中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ハ) 分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

ハ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

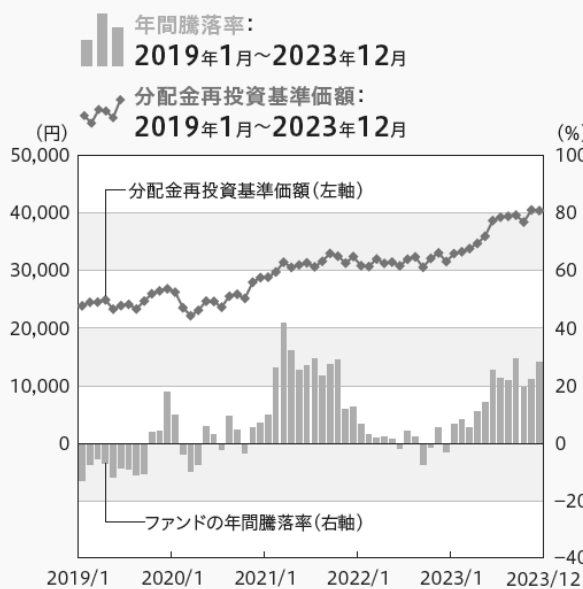
さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

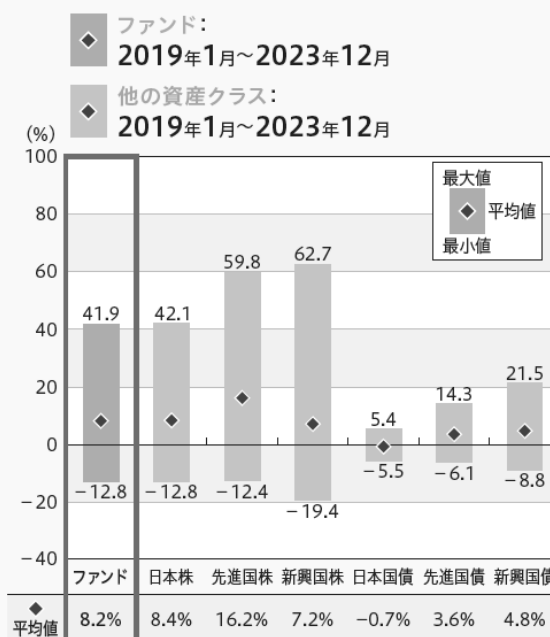
各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 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指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年 0.176%（税抜き 0.16%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

<信託報酬の配分（税抜き）>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年 0.07%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年 0.07%	交付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 0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

※委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
 - ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
 - ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。
- ※ 上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなるものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

※ 上記（1）～（4）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応

じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかか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）にあたります。
- (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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 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（収益分配金の課税について）を参照。）

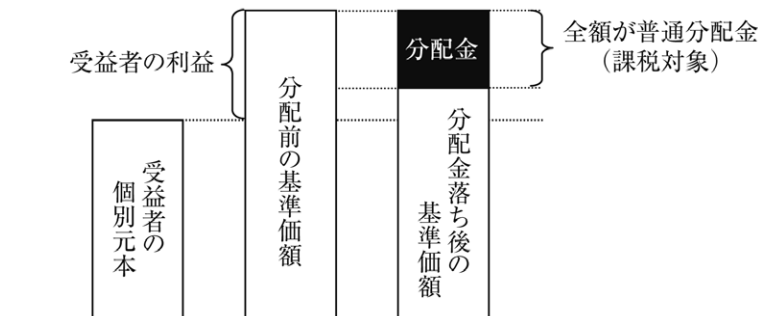
ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

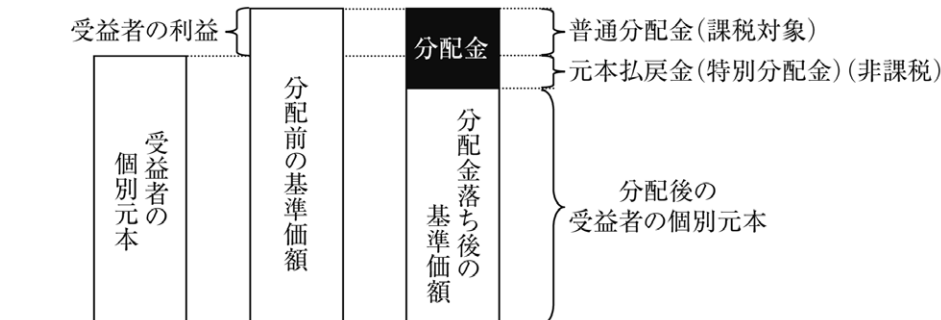
ハ 収益分配金の課税について

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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

- ①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また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（課税対象）となります。



- ②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。なお、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。



※上記①、②の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

ニ 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

i. 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

ii. 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税 15.315%および地方税 5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

(ロ) 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ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

※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。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等に確認されることをお勧めいたします。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に限りNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

※当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」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。

※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等から生じる配当所得およ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公募株式投資信託等を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年1月現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

(参考情報) 総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2022年12月1日～2023年11月30日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.18%	0.18%	0.01%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。

※当ファンドが上場投資信託(ETF)に投資している場合、当該ETFの管理費用等は含まれていません。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

運用報告書は、委託会社のホームページ(<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>)から検索いただけます。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	110,859,835,679	100.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	△15,432,354	△0.01
合計（純資産総額）		110,844,403,325	100.00

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式インデ ックス・マザー ファンド（B 号）	26,576,170,034	4.1796	111,078,078,972	4.1714	110,859,835,679	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

② 【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

年月日	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3期 (2014年12月1日)	1,199,235,666	1,199,235,666	20,086	20,086
第4期 (2015年11月30日)	1,883,008,758	1,883,008,758	22,695	22,695
第5期 (2016年11月30日)	3,038,772,746	3,038,772,746	21,507	21,507
第6期 (2017年11月30日)	9,561,101,750	9,561,101,750	26,725	26,725
第7期 (2018年11月30日)	19,432,679,965	19,432,679,965	25,384	25,384
第8期 (2019年12月2日)	31,181,061,155	31,181,061,155	26,719	26,719
第9期 (2020年11月30日)	42,720,919,455	42,720,919,455	27,977	27,977
第10期 (2021年11月30日)	58,388,361,857	58,388,361,857	31,333	31,333
第11期 (2022年11月30日)	74,957,313,399	74,957,313,399	33,080	33,080
第12期 (2023年11月30日)	109,683,446,932	109,683,446,932	40,507	40,507
2022年12月末日	72,756,107,334	-	31,565	-
2023年1月末日	77,272,175,183	-	32,954	-
2月末日	78,962,536,663	-	33,260	-
3月末日	81,881,022,450	-	33,819	-
4月末日	85,136,319,344	-	34,726	-
5月末日	89,361,175,621	-	35,974	-
6月末日	97,436,571,592	-	38,688	-
7月末日	100,308,309,962	-	39,262	-
8月末日	102,116,398,401	-	39,423	-
9月末日	104,163,205,456	-	39,624	-
10月末日	102,693,035,358	-	38,430	-
11月末日	109,683,446,932	-	40,507	-
12月末日	110,844,403,325	-	40,415	-

②【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第3期	2013年12月3日～2014年12月1日	0
第4期	2014年12月2日～2015年11月30日	0
第5期	2015年12月1日～2016年11月30日	0
第6期	2016年12月1日～2017年11月30日	0
第7期	2017年12月1日～2018年11月30日	0
第8期	2018年12月1日～2019年12月2日	0
第9期	2019年12月3日～2020年11月30日	0
第10期	2020年12月1日～2021年11月30日	0
第11期	2021年12月1日～2022年11月30日	0
第12期	2022年12月1日～2023年11月30日	0

③【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	収益率(%)
第3期	14.8
第4期	13.0
第5期	△5.2
第6期	24.3
第7期	△5.0
第8期	5.3
第9期	4.7
第10期	12.0
第11期	5.6
第12期	22.5

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

(4)【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	519,901,426	60,604,357
第4期	344,299,728	111,646,738
第5期	769,510,936	186,265,298
第6期	2,809,793,582	645,206,011
第7期	5,251,030,945	1,172,961,790
第8期	5,703,494,269	1,689,034,012
第9期	6,050,586,569	2,450,604,056

第10期	5,478,649,497	2,114,195,889
第11期	5,937,619,852	1,912,587,588
第12期	6,987,903,321	2,569,940,130

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	280,433,983,340	98.85
現金・預金・その他の資産 (負債控除後)	-	3,266,393,368	1.15
合計 (純資産総額)		283,700,376,708	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,217,760,000	1.13
合計	買建	-	3,217,760,000	1.13

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

イ 主要投資銘柄 (上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,583,400	2,791.74	12,795,649,500	2,590.50	11,873,297,700	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	590,900	12,827.42	7,579,724,000	13,410.00	7,923,969,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,031,400	1,255.00	6,314,407,000	1,211.50	6,095,541,100	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	83,500	63,342.53	5,289,101,300	62,120.00	5,187,020,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	758,200	5,223.19	3,960,224,600	5,917.00	4,486,269,400	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	177,000	24,049.01	4,256,674,800	25,255.00	4,470,135,000	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,885,900	173.09	4,307,379,800	172.30	4,287,840,570	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	405,600	10,283.19	4,170,862,400	10,170.00	4,124,952,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	584,500	7,252.48	4,239,076,000	6,880.00	4,021,360,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,749,900	2,294.28	4,014,762,400	2,253.50	3,943,399,650	1.39
日本	株式	任天堂	その他製	527,100	6,914.04	3,644,388,000	7,359.00	3,878,928,900	1.37

			品						
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	636,100	5,511.38	3,505,788,600	5,963.00	3,793,064,300	1.34
日本	株式	三井物産	卸売業	665,500	5,390.48	3,587,365,900	5,298.00	3,525,819,000	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	593,300	5,739.50	3,405,248,200	5,767.00	3,421,561,100	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	743,800	4,162.53	3,096,091,000	4,054.00	3,015,365,200	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,033,500	1,508.33	3,067,188,500	1,466.00	2,981,111,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	646,100	4,622.87	2,986,838,400	4,486.00	2,898,404,600	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	164,300	16,666.85	2,738,363,100	17,625.00	2,895,787,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	809,000	3,646.64	2,950,129,800	3,529.00	2,854,961,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	730,700	3,998.20	2,921,481,600	3,872.00	2,829,270,400	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,108,400	2,511.63	2,783,885,400	2,412.50	2,674,015,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	413,400	6,027.07	2,491,591,000	6,293.00	2,601,526,200	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	454,900	5,028.27	2,287,359,300	5,251.00	2,388,679,900	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,342,700	1,797.77	2,413,869,000	1,759.50	2,362,480,650	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	100,600	22,163.95	2,229,693,200	22,985.00	2,312,291,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	759,700	2,884.56	2,191,399,950	2,993.00	2,273,782,100	0.80
日本	株式	SMC	機械	25,200	74,450.00	1,876,140,000	75,760.00	1,909,152,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	939,100	2,009.42	1,887,044,600	1,999.00	1,877,260,900	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	499,800	3,800.12	1,899,298,200	3,645.00	1,821,771,000	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	304,400	5,496.38	1,673,098,000	5,595.00	1,703,118,000	0.60

ロ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式 (国内)	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.09
	食料品	3.33
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.12
	医薬品	4.57
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.95

非鉄金属	0.67
金属製品	0.52
機械	5.27
電気機器	17.35
輸送用機器	8.09
精密機器	2.34
その他製品	2.35
電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81
海運業	0.83
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.64
卸売業	6.92
小売業	4.25
銀行業	6.80
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.35
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.94
合 計	98.85

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2023年12月29日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	TOPIX先物 0603月 2024年3月	買建	136	日本・円	3,199,859,600	3,217,760,000	1.13

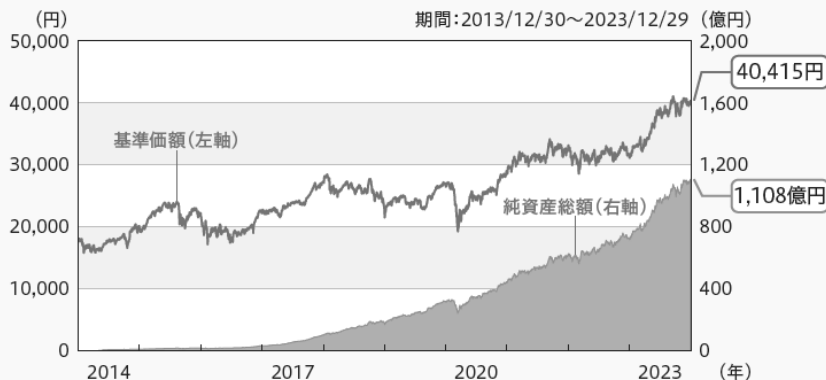
（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

《参考情報》

基準日:2023年12月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.01

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.15
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.13%

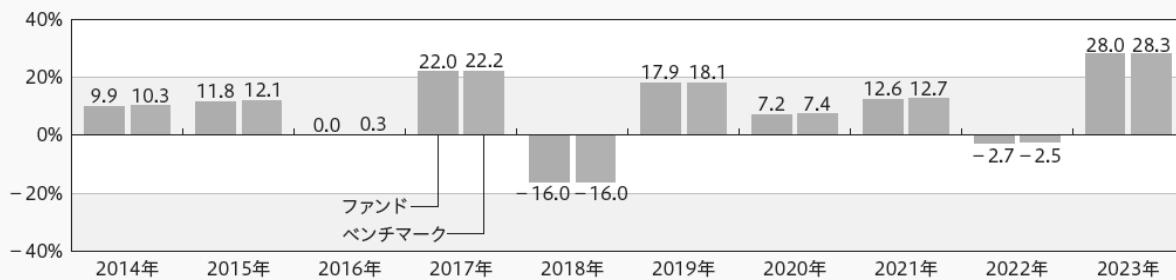
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.39

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時まで取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター※	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

※お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。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、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象の評価方法>

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

※国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC積N日株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター※	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

※お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2011年12月9日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、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会社は、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。
- b. 委託会社は、上記a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、書面決議の日ならびに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、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- c. 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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。
- d. 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。

- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が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、当ファンドのすべての受益者が書面また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、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、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。
分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払われます。

ハ 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（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。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ま

す。

- (ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、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ます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」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、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およ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、当ファンドの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。
- (ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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。
- (ニ) 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（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託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、当ファンドのすべての受益者が書面また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。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方とな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、併合を行うことはできません。

ニ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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）ならびに同規則第 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 12 期（2022 年 12 月 1 日から 2023 年 11 月 30 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友 DS アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドの2022年12月1日から2023年11月30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、三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドの2023年11月30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 DS 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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付で無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2022年11月30日現在)	第12期 (2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,661,760	2,383,753
コール・ローン	102,804,530	143,138,312
親投資信託受益証券	75,020,072,761	109,775,432,840
未収入金	8,548,963	30,767,572
流動資産合計	75,148,088,014	109,951,722,477
資産合計	75,148,088,014	109,951,722,477
負債の部		
流動負債		
未払解約金	127,997,290	176,241,258
未払受託者報酬	7,609,326	11,155,604
未払委託者報酬	53,265,460	78,089,566
その他未払費用	1,902,539	2,789,117
流動負債合計	190,774,615	268,275,545
負債合計	190,774,615	268,275,545
純資産の部		
元本等		
元本	22,659,528,886	27,077,492,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	52,297,784,513	82,605,954,855
(分配準備積立金)	11,913,881,505	28,630,569,451
元本等合計	74,957,313,399	109,683,446,932
純資産合計	74,957,313,399	109,683,446,932
負債純資産合計	75,148,088,014	109,951,722,477

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期		第12期	
	自	2021年12月1日	自	2022年12月1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
営業収益				
受取利息		756		1,597
有価証券売買等損益		3,990,123,220		18,909,827,460
営業収益合計		3,990,123,976		18,909,829,057
営業費用				
支払利息		24,664		52,256
受託者報酬		14,364,082		19,872,566
委託者報酬		100,549,025		139,108,579
その他費用		3,592,846		4,971,807
営業費用合計		118,530,617		164,005,208
営業利益又は営業損失(△)		3,871,593,359		18,745,823,849
経常利益又は経常損失(△)		3,871,593,359		18,745,823,849
当期純利益又は当期純損失(△)		3,871,593,359		18,745,823,849
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(△)		62,267,593		862,307,913
期首剰余金又は期首欠損金(△)		39,753,865,235		52,297,784,513
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,818,623,770		18,409,727,434
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,818,623,770		18,409,727,434
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,084,030,258		5,985,073,028
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,084,030,258		5,985,073,028
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		52,297,784,513		82,605,954,855

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第 12 期
	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第 11 期	第 12 期
	(2022 年 11 月 30 日現在)	(2023 年 11 月 30 日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	22,659,528,886 口	27,077,492,077 口
2. 1 単位当たり純資産の額	1 口当たり純資産額 3.3080 円 (1 万口当たりの純資産額 33,080 円)	1 口当たり純資産額 4.0507 円 (1 万口当たりの純資産額 40,507 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第 11 期	第 12 期
	自 2021 年 12 月 1 日 至 2022 年 11 月 30 日	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (1,654,706,135 円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 (2,154,619,631 円)、収益調整金 (40,383,903,008 円)、および分配準備積立金 (8,104,555,739 円) より、分配対象収益は 52,297,784,513 円 (1 万口当たり 23,079.82 円) でありますが、分配を行って</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (2,241,149,017 円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 (15,642,366,919 円)、収益調整金 (53,975,385,404 円)、および分配準備積立金 (10,747,053,515 円) より、分配対象収益は 82,605,954,855 円 (1 万口当たり 30,507.24 円) でありますが、分配を行って</p>

	おりません。
--	--------

(金融商品に関する注記)

I. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第 12 期 自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会</p>

	議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
--	--

II. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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る場合、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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第11期（自2021年12月1日至2022年11月30日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,973,839,310円
合計	3,973,839,310円

第12期（自2022年12月1日至2023年11月30日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	18,839,927,277円
合計	18,839,927,277円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期 自2022年12月1日 至2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな

いため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第 11 期	第 12 期
	(2022 年 11 月 30 日現在)	(2023 年 11 月 30 日現在)
期首元本額	18,634,496,622 円	22,659,528,886 円
期中追加設定元本額	5,937,619,852 円	6,987,903,321 円
期中一部解約元本額	1,912,587,588 円	2,569,940,130 円

(4) 【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファン ド (B号)	26,260,180,571	109,775,432,840	
	親投資信託受益証券 小計		109,775,432,840	
合 計			109,775,432,840	

②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)

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	456,457,514	57,867,611
コール・ローン	2,816,383,083	3,474,802,611
株式	218,143,627,430	277,901,462,330
派生商品評価勘定	205,303,100	134,548,100
未収入金	209,436,600	464,384,900
未収配当金	1,741,212,622	2,036,482,133
差入委託証拠金	186,390,000	228,352,524
流動資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209
資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,922,600
前受金	210,290,000	107,700,000
未払金	124,125,858	395,461,400
未払解約金	605,043,303	1,152,851,240
その他未払費用	10,581	6,886
流動負債合計	939,469,742	1,658,942,126
負債合計	939,469,742	1,658,942,126
純資産の部		
元本等		
元本	65,393,298,021	67,612,101,406
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	157,426,042,586	215,026,856,677
元本等合計	222,819,340,607	282,638,958,083
純資産合計	222,819,340,607	282,638,958,083
負債純資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2022年12月1日
----	--------------

	至 2023 年 11 月 30 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022 年 11 月 30 日現在)	(2023 年 11 月 30 日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,393,298,021 口	67,612,101,406 口
2. 1 単位当たり純資産の額	1 口当たり純資産額 3.4074 円 (1 万口当たりの純資産額 34,074 円)	1 口当たり純資産額 4.1803 円 (1 万口当たりの純資産額 41,803 円)

(金融商品に関する注記)

I. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスク</p>

	<p>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>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

II. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（株式）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該</p>

	帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412 月	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
	小計	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
合 計		4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0512 月	4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500
	小計	4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500
合 計		4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に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。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022 年 12 月 1 日 至 2023 年 11 月 30 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな

いため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,637,683,641円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,605,989,911円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,542,223円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,234,860円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	19,508,324円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	63,979,125円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	165,870,052円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	149,775,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	266,593,539円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,398,015,768円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	18,140,230円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,564,092,115円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	11,882,906円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	74,050,540円

SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	37,493,396円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	135,694,110円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	684,565,549円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	44,118,775円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	796,235,497円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	533,449,238円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,657,079,267円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	36,667,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,482,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,795,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,429,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	219,105,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	52,522,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,723,328円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,680,964円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	41,326,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	542,525,688円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	167,317,059円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	202,591,112円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	85,721,825円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	94,168,528円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	44,811,453円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	42,807,427円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	5,577,900円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	7,187,543円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	92,673,351円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合計	65,393,298,021円

(2023年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	65,393,298,021円
同期中における追加設定元本額	11,963,349,687円
同期中における一部解約元本額	9,744,546,302円
2023年11月30日現在の元本の内訳	

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,698,799,980円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,001,422,929円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,466,421,362円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,671,641,660円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	136,038,750円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,406,393円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	15,296,763円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	54,752,270円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	159,640,709円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	149,414,525円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	271,748,343円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,365,075,520円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	26,260,180,571円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	115,624,640円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	168,156,238円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	103,225,362円
イオン・バランス戦略ファンド	37,149,436円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	50,643,471円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	208,010,508円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	197,543,121円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	777,703,738円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	448,368,315円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	525,557,954円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	55,602,276円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,154,657,014円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	39,519,295円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	236,791,813円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	240,914,837円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,981,135円
日興FWS・日本株インデックス	1,902,897,918円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	68,065,303円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	691,428円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	482,039円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	427,244円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	135,914円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	230,889円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	554,713円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,852,953円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	34,809,759円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	20,073,130円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	8,796,845円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,397,731,905円
バランスファンドVA(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	7,994,782円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	47,143,831円

SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	965,486,618円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,166,398,533円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	4,510,477,578円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,416,152円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	108,603,049円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	590,105,352円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	35,412,893円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	195,641,630円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	641,083,284円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	414,428,470円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,267,607,584円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	314,855円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	27,021,199円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	29,338,861円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	25,915,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,447,235円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	67,115,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	173,003,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	37,568,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	32,445,682円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	30,702,488円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	411,103,933円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	156,608,259円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	157,255,373円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	65,272,266円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	50,839,821円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	29,597,543円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	50,954,848円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	28,238,310円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	45,469,182円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	85,247,790円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	15,940,785円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	29,029,528円
合計	67,612,101,406円

(3) 附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額	備考
----	----	-----	----

		単価	金額	
極洋	4,100	3,830.000	15,703,000	
ニッスイ	115,600	737.400	85,243,440	
マルハニチロ	17,100	2,840.000	48,564,000	
雪国まいたけ	11,400	950.000	10,830,000	
カネコ種苗	4,700	1,422.000	6,683,400	
サカタのタネ	13,200	3,985.000	52,602,000	
ホクト	10,100	1,754.000	17,715,400	
住石ホールディングス	14,400	772.000	11,116,800	
日鉄鉱業	4,500	5,650.000	25,425,000	
三井松島ホールディングス	5,500	2,818.000	15,499,000	
I N P E X	427,200	2,090.000	892,848,000	
石油資源開発	13,300	5,690.000	75,677,000	
K&Oエナジーグループ	5,500	2,189.000	12,039,500	
ショーボンドホールディングス	15,700	6,025.000	94,592,500	
ミライト・ワン	38,100	1,846.500	70,351,650	
タマホーム	7,300	3,480.000	25,404,000	
日本アクア	5,000	935.000	4,675,000	
安藤・間	66,300	1,092.000	72,399,600	
東急建設	32,300	788.000	25,452,400	
コムシスホールディングス	37,500	3,207.000	120,262,500	
ビーアールホールディングス	21,600	359.000	7,754,400	
高松コンストラクショングループ	7,200	2,637.000	18,986,400	
東建コーポレーション	3,200	8,100.000	25,920,000	
ヤマウラ	6,900	1,438.000	9,922,200	
オリエンタル白石	44,000	330.000	14,520,000	
大成建設	75,700	5,031.000	380,846,700	
大林組	288,900	1,247.500	360,402,750	
清水建設	233,600	971.600	226,965,760	
飛島建設	9,600	1,299.000	12,470,400	
長谷工コーポレーション	83,000	1,818.500	150,935,500	
松井建設	8,200	775.000	6,355,000	
銭高組	1,500	3,850.000	5,775,000	
鹿島建設	179,100	2,336.500	418,467,150	
不動テトラ	5,600	2,189.000	12,258,400	
鉄建建設	6,700	1,953.000	13,085,100	
西松建設	13,900	3,914.000	54,404,600	
三井住友建設	65,600	398.000	26,108,800	
大豊建設	3,600	3,650.000	13,140,000	
奥村組	12,900	4,515.000	58,243,500	
東鉄工業	10,900	2,902.000	31,631,800	
浅沼組	6,400	3,695.000	23,648,000	
戸田建設	99,900	844.300	84,345,570	
熊谷組	13,400	3,400.000	45,560,000	

北野建設	1,900	3,100.000	5,890,000
矢作建設工業	11,500	1,286.000	14,789,000
ピーエス三菱	10,900	941.000	10,256,900
日本ハウスホールディングス	19,500	326.000	6,357,000
新日本建設	11,500	1,111.000	12,776,500
東亜道路工業	3,400	6,690.000	22,746,000
日本道路	8,500	1,897.000	16,124,500
東亜建設工業	7,100	3,575.000	25,382,500
日本国土開発	24,300	589.000	14,312,700
若築建設	3,900	2,946.000	11,489,400
東洋建設	26,300	1,330.000	34,979,000
五洋建設	114,600	810.400	92,871,840
世紀東急工業	10,800	1,664.000	17,971,200
福田組	3,100	5,220.000	16,182,000
住友林業	69,700	3,774.000	263,047,800
日本基礎技術	7,500	450.000	3,375,000
巴コーポレーション	11,500	560.000	6,440,000
大和ハウス工業	223,500	4,199.000	938,476,500
ライト工業	14,400	1,980.000	28,512,000
積水ハウス	244,900	3,029.000	741,802,100
日特建設	8,200	1,028.000	8,429,600
ユアテック	17,800	1,003.000	17,853,400
日本リーテック	7,700	1,257.000	9,678,900
四電工	3,500	2,908.000	10,178,000
中電工	11,500	2,431.000	27,956,500
関電工	49,000	1,328.000	65,072,000
きんでん	56,500	2,219.500	125,401,750
東京エネシス	8,700	965.000	8,395,500
トーエネック	2,900	4,245.000	12,310,500
住友電設	7,400	2,557.000	18,921,800
日本電設工業	13,200	2,024.000	26,716,800
エクシオグループ	36,800	3,118.000	114,742,400
新日本空調	5,300	2,235.000	11,845,500
九電工	19,700	4,663.000	91,861,100
三機工業	16,900	1,750.000	29,575,000
日揮ホールディングス	80,000	1,661.500	132,920,000
中外炉工業	3,300	2,239.000	7,388,700
ヤマト	7,000	941.000	6,587,000
太平電業	5,000	3,875.000	19,375,000
高砂熱学工業	19,300	2,999.000	57,880,700
三晃金属工業	1,300	4,700.000	6,110,000
朝日工業社	4,000	2,798.000	11,192,000
明星工業	16,000	1,120.000	17,920,000
大気社	9,200	4,230.000	38,916,000

ダイダン	10,600	1,480.000	15,688,000
日比谷総合設備	6,900	2,358.000	16,270,200
テスホールディングス	18,200	442.000	8,044,400
インフロニア・ホールディングス	86,900	1,561.500	135,694,350
東洋エンジニアリング	11,300	706.000	7,977,800
レイズネクスト	11,400	1,388.000	15,823,200
ニッポン	21,400	2,274.000	48,663,600
日清製粉グループ本社	75,000	2,048.500	153,637,500
日東富士製粉	1,700	4,720.000	8,024,000
昭和産業	6,700	3,060.000	20,502,000
鳥越製粉	10,700	715.000	7,650,500
中部飼料	11,300	1,085.000	12,260,500
フィード・ワン	12,900	792.000	10,216,800
日本甜菜製糖	5,200	2,013.000	10,467,600
DM三井製糖ホールディングス	7,900	3,020.000	23,858,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,064.000	9,700,800
森永製菓	15,000	5,277.000	79,155,000
中村屋	2,800	3,070.000	8,596,000
江崎グリコ	23,200	4,079.000	94,632,800
井村屋グループ	4,800	2,319.000	11,131,200
不二家	5,700	2,501.000	14,255,700
山崎製パン	54,600	3,235.000	176,631,000
モロゾフ	2,800	3,885.000	10,878,000
亀田製菓	5,100	3,885.000	19,813,500
寿スピリッツ	43,000	2,348.000	100,964,000
カルビー	37,300	2,769.000	103,283,700
森永乳業	29,600	2,760.000	81,696,000
六甲バター	6,300	1,384.000	8,719,200
ヤクルト本社	116,200	3,303.000	383,808,600
明治ホールディングス	99,500	3,423.000	340,588,500
雪印メグミルク	19,500	2,163.000	42,178,500
プリマハム	10,600	2,250.000	23,850,000
日本ハム	31,700	4,394.000	139,289,800
丸大食品	8,400	1,617.000	13,582,800
S Foods	8,900	3,205.000	28,524,500
柿安本店	3,300	2,476.000	8,170,800
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	3,950.000	47,795,000
サッポロホールディングス	26,700	5,766.000	153,952,200
アサヒグループホールディングス	187,500	5,455.000	1,022,812,500
キリンホールディングス	338,300	2,087.000	706,032,100
宝ホールディングス	54,800	1,215.000	66,582,000
オエノンホールディングス	26,200	374.000	9,798,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	63,600	2,025.500	128,821,800

ライフドリンク カンパニー	1,700	3,870.000	6,579,000
サントリー食品インターナショナル	57,100	4,648.000	265,400,800
ダイドーグループホールディングス	4,500	5,980.000	26,910,000
伊藤園	27,500	4,495.000	123,612,500
キーコーヒー	8,400	2,068.000	17,371,200
日清オイリオグループ	11,300	4,185.000	47,290,500
不二製油グループ本社	18,900	2,322.000	43,885,800
かどや製油	1,800	3,560.000	6,408,000
J-オイルミルズ	8,300	1,973.000	16,375,900
キッコーマン	53,700	9,065.000	486,790,500
味の素	195,800	5,526.000	1,081,990,800
ブルドックソース	4,700	2,092.000	9,832,400
キューピー	43,600	2,580.000	112,488,000
ハウス食品グループ本社	24,800	3,229.000	80,079,200
カゴメ	36,400	3,177.000	115,642,800
アリアケジャパン	7,200	4,615.000	33,228,000
エバラ食品工業	2,800	2,834.000	7,935,200
ニチレイ	37,300	3,224.000	120,255,200
東洋水産	41,100	7,870.000	323,457,000
イトアンドホールディングス	4,100	2,045.000	8,384,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,114.000	6,461,200
日清食品ホールディングス	28,600	14,665.000	419,419,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,169.000	9,109,800
フジッコ	7,600	1,936.000	14,713,600
ロック・フィールド	9,100	1,591.000	14,478,100
日本たばこ産業	493,400	3,801.000	1,875,413,400
ケンコーマヨネーズ	6,300	1,615.000	10,174,500
わらべや日洋ホールディングス	6,200	3,485.000	21,607,000
なとり	5,400	2,035.000	10,989,000
ファーマフーズ	11,800	1,283.000	15,139,400
ユーグレナ	51,500	746.000	38,419,000
紀文食品	7,100	1,152.000	8,179,200
ピククルスホールディングス	5,200	1,207.000	6,276,400
ミヨシ油脂	5,200	1,465.000	7,618,000
理研ビタミン	7,200	2,253.000	16,221,600
片倉工業	9,000	1,677.000	15,093,000
グンゼ	5,900	4,800.000	28,320,000
東洋紡	36,100	1,052.000	37,977,200
ユニチカ	30,500	183.000	5,581,500
富士紡ホールディングス	3,500	3,690.000	12,915,000
倉敷紡績	6,600	2,557.000	16,876,200
シキボウ	6,100	1,093.000	6,667,300
日本毛織	21,800	1,295.000	28,231,000
帝国繊維	9,300	2,029.000	18,869,700

帝人	79,700	1,345.500	107,236,350
東レ	554,100	767.100	425,050,110
ダイニック	6,300	725.000	4,567,500
セーレン	16,000	2,320.000	37,120,000
小松マテーレ	13,300	780.000	10,374,000
ワコールホールディングス	15,300	3,255.000	49,801,500
ホギメディカル	11,200	3,425.000	38,360,000
T S I ホールディングス	28,500	774.000	22,059,000
ワールド	10,800	1,630.000	17,604,000
三陽商会	2,800	2,698.000	7,554,400
オンワードホールディングス	54,600	501.000	27,354,600
ルックホールディングス	2,600	2,483.000	6,455,800
ゴールドウイン	14,700	11,535.000	169,564,500
デサント	14,300	4,255.000	60,846,500
特種東海製紙	4,000	3,715.000	14,860,000
王子ホールディングス	344,400	549.200	189,144,480
日本製紙	43,600	1,337.000	58,293,200
北越コーポレーション	51,000	1,409.000	71,859,000
大王製紙	37,000	1,047.500	38,757,500
レンゴー	75,900	935.500	71,004,450
トーモク	5,400	2,174.000	11,739,600
ザ・パック	6,200	3,215.000	19,933,000
北の達人コーポレーション	37,700	208.000	7,841,600
クラレ	122,300	1,504.500	184,000,350
旭化成	531,900	1,026.500	545,995,350
レゾナック・ホールディングス	79,700	2,760.000	219,972,000
住友化学	611,800	377.500	230,954,500
住友精化	3,500	5,050.000	17,675,000
日産化学	38,900	5,393.000	209,787,700
ラサ工業	3,500	2,132.000	7,462,000
クレハ	6,800	8,650.000	58,820,000
多木化学	3,300	3,160.000	10,428,000
テイカ	5,900	1,325.000	7,817,500
石原産業	14,800	1,373.000	20,320,400
日本曹達	8,800	5,340.000	46,992,000
東ソー	110,000	1,967.000	216,370,000
トクヤマ	26,600	2,401.000	63,866,600
セントラル硝子	13,300	2,719.000	36,162,700
東亜合成	41,100	1,360.000	55,896,000
大阪ソーダ	5,100	9,720.000	49,572,000
関東電化工業	16,400	830.000	13,612,000
デンカ	30,100	2,645.000	79,614,500
信越化学工業	743,100	5,212.000	3,873,037,200
堺化学工業	6,300	1,885.000	11,875,500

第一稀元素化学工業	8,000	995.000	7,960,000
エア・ウォーター	78,000	1,941.500	151,437,000
日本酸素ホールディングス	80,000	3,883.000	310,640,000
日本化学工業	3,000	2,029.000	6,087,000
日本パーカラライジング	39,800	1,154.000	45,929,200
高压ガス工業	12,800	809.000	10,355,200
四国化成ホールディングス	11,000	1,747.000	19,217,000
戸田工業	2,100	1,632.000	3,427,200
ステラ ケミファ	5,000	3,245.000	16,225,000
保土谷化学工業	2,400	3,600.000	8,640,000
日本触媒	12,600	5,351.000	67,422,600
大日精化工業	5,800	2,217.000	12,858,600
カネカ	21,000	3,713.000	77,973,000
三菱瓦斯化学	63,000	2,337.500	147,262,500
三井化学	69,000	4,328.000	298,632,000
J S R	77,200	4,069.000	314,126,800
東京応化工業	13,300	9,163.000	121,867,900
大阪有機化学工業	6,800	2,669.000	18,149,200
三菱ケミカルグループ	582,500	968.500	564,151,250
KHネオケム	13,300	2,290.000	30,457,000
ダイセル	117,400	1,421.000	166,825,400
住友ベークライト	12,200	7,061.000	86,144,200
積水化学工業	167,000	2,100.500	350,783,500
日本ゼオン	56,000	1,374.000	76,944,000
アイカ工業	20,700	3,325.000	68,827,500
UBE	42,300	2,323.500	98,284,050
積水樹脂	11,300	2,506.000	28,317,800
タキロンシーアイ	18,900	589.000	11,132,100
旭有機材	5,500	4,240.000	23,320,000
ニチバン	5,700	1,758.000	10,020,600
リケンテクノス	18,200	868.000	15,797,600
大倉工業	4,000	2,818.000	11,272,000
群栄化学工業	2,100	3,085.000	6,478,500
ミライアル	2,700	1,519.000	4,101,300
ダイキョーニシカワ	18,600	770.000	14,322,000
森六ホールディングス	4,400	2,960.000	13,024,000
恵和	6,100	1,360.000	8,296,000
日本化薬	64,000	1,350.000	86,400,000
カーリットホールディングス	8,700	945.000	8,221,500
日本精化	4,800	2,675.000	12,840,000
扶桑化学工業	7,500	4,385.000	32,887,500
トリケミカル研究所	11,000	3,510.000	38,610,000
ADEKA	30,000	2,869.500	86,085,000
日油	25,500	6,845.000	174,547,500

新日本理化	15,600	195.000	3,042,000
ハリマ化成グループ	5,800	795.000	4,611,000
花王	186,900	5,696.000	1,064,582,400
第一工業製薬	3,300	1,874.000	6,184,200
石原ケミカル	4,200	1,981.000	8,320,200
三洋化成工業	4,800	4,285.000	20,568,000
大日本塗料	10,800	981.000	10,594,800
日本ペイントホールディングス	438,600	1,104.500	484,433,700
関西ペイント	81,000	2,252.000	182,412,000
中国塗料	13,800	1,541.000	21,265,800
日本特殊塗料	5,200	1,269.000	6,598,800
藤倉化成	12,900	446.000	5,753,400
太陽ホールディングス	12,300	2,990.000	36,777,000
D I C	33,000	2,433.500	80,305,500
サカタインクス	18,300	1,307.000	23,918,100
東洋インキSCホールディングス	17,200	2,667.000	45,872,400
富士フイルムホールディングス	156,400	8,660.000	1,354,424,000
資生堂	172,700	3,966.000	684,928,200
ライオン	108,600	1,294.000	140,528,400
高砂香料工業	5,600	3,515.000	19,684,000
マンダム	17,900	1,274.000	22,804,600
ミルボン	11,700	3,696.000	43,243,200
ファンケル	36,300	2,277.000	82,655,100
コーセー	16,800	10,465.000	175,812,000
コタ	8,000	1,572.000	12,576,000
ポーラ・オルビスホールディングス	42,600	1,558.500	66,392,100
ノエビアホールディングス	7,300	5,220.000	38,106,000
新日本製薬	5,000	1,575.000	7,875,000
I - n e	1,100	2,584.000	2,842,400
アクシージア	4,800	1,017.000	4,881,600
エステー	7,100	1,517.000	10,770,700
アグロ カネショウ	3,900	1,348.000	5,257,200
コニシ	13,700	2,582.000	35,373,400
長谷川香料	15,800	3,220.000	50,876,000
小林製薬	24,100	6,820.000	164,362,000
荒川化学工業	7,700	1,018.000	7,838,600
メック	6,700	4,045.000	27,101,500
日本高純度化学	2,400	2,500.000	6,000,000
タカラバイオ	22,200	1,222.000	27,128,400
J C U	9,200	3,950.000	36,340,000
新田ゼラチン	6,000	784.000	4,704,000
O A Tアグリオ	2,700	1,926.000	5,200,200
デクセリアルズ	23,000	4,633.000	106,559,000
アース製薬	7,400	4,780.000	35,372,000

北興化学工業	9,600	975.000	9,360,000
大成ラミック	3,500	2,934.000	10,269,000
クミアイ化学工業	33,100	1,089.000	36,045,900
日本農薬	15,900	598.000	9,508,200
アキレス	5,700	1,557.000	8,874,900
有沢製作所	14,400	1,095.000	15,768,000
日東電工	55,900	10,515.000	587,788,500
レック	12,800	994.000	12,723,200
三光合成	11,700	540.000	6,318,000
きもと	21,600	191.000	4,125,600
藤森工業	6,300	3,885.000	24,475,500
前澤化成工業	5,900	1,580.000	9,322,000
未来工業	3,200	3,145.000	10,064,000
J S P	6,000	1,783.000	10,698,000
エフピコ	15,900	2,791.000	44,376,900
天馬	6,400	2,336.000	14,950,400
信越ポリマー	14,800	1,429.000	21,149,200
東リ	20,000	338.000	6,760,000
ニフコ	29,800	3,612.000	107,637,600
バルカー	6,800	3,905.000	26,554,000
ユニ・チャーム	172,400	4,763.000	821,141,200
協和キリン	103,000	2,437.000	251,011,000
武田薬品工業	731,800	4,165.000	3,047,947,000
アステラス製薬	736,400	1,797.500	1,323,679,000
住友ファーマ	61,900	468.000	28,969,200
塩野義製薬	104,500	6,978.000	729,201,000
日本新薬	23,000	5,331.000	122,613,000
中外製薬	258,800	5,218.000	1,350,418,400
科研製薬	16,000	3,378.000	54,048,000
エーザイ	100,600	7,672.000	771,803,200
ロート製薬	82,000	3,090.000	253,380,000
小野薬品工業	177,000	2,721.000	481,617,000
久光製薬	19,500	4,618.000	90,051,000
持田製薬	11,000	3,355.000	36,905,000
参天製薬	155,000	1,399.000	216,845,000
扶桑薬品工業	4,000	1,907.000	7,628,000
ツムラ	28,000	2,795.000	78,260,000
キッセイ薬品工業	15,500	3,055.000	47,352,500
生化学工業	15,900	792.000	12,592,800
栄研化学	17,000	1,647.000	27,999,000
鳥居薬品	5,000	3,660.000	18,300,000
J C Rファーマ	28,500	1,324.000	37,734,000
東和薬品	12,700	2,470.000	31,369,000
富士製薬工業	7,900	1,560.000	12,324,000

ゼリア新薬工業	11,300	2,026.000	22,893,800
そーせいグループ	26,900	1,389.000	37,364,100
第一三共	720,400	4,000.000	2,881,600,000
杏林製薬	17,400	1,828.000	31,807,200
大幸薬品	18,100	301.000	5,448,100
ダイト	8,000	1,945.000	15,560,000
大塚ホールディングス	172,500	5,689.000	981,352,500
ペプチドリーム	45,000	1,266.500	56,992,500
あすか製薬ホールディングス	9,700	1,821.000	17,663,700
サワイグループホールディングス	20,000	4,918.000	98,360,000
日本コークス工業	83,300	122.000	10,162,600
ニチレキ	9,600	2,286.000	21,945,600
ユシロ化学工業	5,800	1,718.000	9,964,400
富士石油	22,100	365.000	8,066,500
出光興産	91,600	4,056.000	371,529,600
ENEOSホールディングス	1,317,100	584.400	769,713,240
コスモエネルギーホールディングス	25,000	5,635.000	140,875,000
横浜ゴム	42,200	3,289.000	138,795,800
TOYO TIRE	47,400	2,454.500	116,343,300
ブリヂストン	241,600	6,098.000	1,473,276,800
住友ゴム工業	81,100	1,709.500	138,640,450
オカモト	4,100	5,450.000	22,345,000
フコク	5,000	1,402.000	7,010,000
ニッタ	8,200	3,745.000	30,709,000
住友理工	13,800	1,034.000	14,269,200
三ツ星ベルト	11,300	4,465.000	50,454,500
バンドー化学	12,700	1,560.000	19,812,000
日東紡績	10,500	4,495.000	47,197,500
AGC	74,000	5,370.000	397,380,000
日本山村硝子	2,400	1,507.000	3,616,800
日本電気硝子	33,500	3,120.000	104,520,000
オハラ	5,300	1,314.000	6,964,200
住友大阪セメント	11,800	3,608.000	42,574,400
太平洋セメント	52,600	2,777.500	146,096,500
日本ヒューム	11,000	949.000	10,439,000
日本コンクリート工業	21,500	323.000	6,944,500
三谷セキサン	4,000	4,390.000	17,560,000
アジアパイルホールディングス	18,500	704.000	13,024,000
東海カーボン	76,300	1,094.000	83,472,200
日本カーボン	4,900	4,645.000	22,760,500
東洋炭素	6,100	4,590.000	27,999,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,800	6,940.000	33,312,000
TOTO	54,500	3,797.000	206,936,500
日本碍子	95,900	1,804.000	173,003,600

日本特殊陶業	65,200	3,433.000	223,831,600
ダントーホールディングス	5,000	959.000	4,795,000
MARUWA	3,200	29,770.000	95,264,000
品川リフラクトリーズ	13,000	1,705.000	22,165,000
黒崎播磨	2,000	11,230.000	22,460,000
ヨータイ	6,200	1,456.000	9,027,200
東京窯業	13,600	421.000	5,725,600
フジミインコーポレーテッド	22,000	2,929.000	64,438,000
ニチアス	22,000	3,155.000	69,410,000
ニチハ	10,500	2,776.000	29,148,000
日本製鉄	380,800	3,457.000	1,316,425,600
神戸製鋼所	171,000	1,731.500	296,086,500
中山製鋼所	18,000	843.000	15,174,000
合同製鐵	4,000	4,560.000	18,240,000
JFEホールディングス	237,000	2,180.000	516,660,000
東京製鐵	24,100	1,794.000	43,235,400
共英製鋼	9,600	2,080.000	19,968,000
大和工業	15,500	7,462.000	115,661,000
東京鐵鋼	4,300	3,960.000	17,028,000
大阪製鐵	5,300	1,907.000	10,107,100
淀川製鋼所	9,300	3,905.000	36,316,500
中部鋼鈑	7,300	1,964.000	14,337,200
丸一鋼管	25,700	3,821.000	98,199,700
モリ工業	2,000	4,185.000	8,370,000
大同特殊鋼	10,700	6,827.000	73,048,900
日本冶金工業	6,200	4,180.000	25,916,000
山陽特殊製鋼	8,200	2,616.000	21,451,200
愛知製鋼	5,100	3,435.000	17,518,500
日本金属	3,600	913.000	3,286,800
大平洋金属	6,300	1,234.000	7,774,200
新日本電工	50,900	303.000	15,422,700
栗本鐵工所	4,600	3,340.000	15,364,000
三菱製鋼	5,800	1,539.000	8,926,200
日本精線	1,300	4,705.000	6,116,500
新家工業	2,000	2,893.000	5,786,000
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,207.000	14,725,400
日本輕金属ホールディングス	23,900	1,689.000	40,367,100
三井金属鈹業	25,200	4,540.000	114,408,000
三菱マテリアル	61,800	2,434.000	150,421,200
住友金属鈹山	98,800	4,292.000	424,049,600
DOWAホールディングス	20,500	5,256.000	107,748,000
古河機械金属	12,900	1,872.000	24,148,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	2,902.000	41,788,800
東邦チタニウム	16,500	1,831.000	30,211,500

UACJ	12,000	3,465.000	41,580,000
CKサンエツ	2,400	3,695.000	8,868,000
古河電気工業	28,800	2,378.500	68,500,800
住友電気工業	319,000	1,834.000	585,046,000
フジクラ	99,100	1,138.500	112,825,350
SWCC	9,700	2,681.000	26,005,700
平河ヒューテック	5,500	1,364.000	7,502,000
リョービ	9,300	2,915.000	27,109,500
アーレスティ	8,500	817.000	6,944,500
AREホールディングス	34,600	1,909.000	66,051,400
稲葉製作所	6,200	1,486.000	9,213,200
宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,185.000	15,288,000
トーカロ	22,100	1,438.000	31,779,800
アルファ	4,200	1,483.000	6,228,600
SUMCO	151,100	2,216.500	334,913,150
川田テクノロジーズ	2,300	7,000.000	16,100,000
RS TECHNOLOGIES	5,900	2,862.000	16,885,800
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,040.000	2,448,000
信和	9,900	740.000	7,326,000
東洋製罐グループホールディングス	50,900	2,294.500	116,790,050
ホッカンホールディングス	5,500	1,575.000	8,662,500
横河ブリッジホールディングス	10,500	2,724.000	28,602,000
三和ホールディングス	80,400	2,121.000	170,528,400
文化シャッター	24,000	1,380.000	33,120,000
三協立山	10,700	818.000	8,752,600
アルインコ	7,600	1,022.000	7,767,200
LIXIL	130,300	1,805.500	235,256,650
ノーリツ	13,800	1,498.000	20,672,400
長府製作所	8,400	2,102.000	17,656,800
リンナイ	46,200	3,005.000	138,831,000
日東精工	13,700	564.000	7,726,800
岡部	16,500	703.000	11,599,500
ジーテクト	9,300	1,744.000	16,219,200
東プレ	14,900	2,002.000	29,829,800
高周波熱錬	14,000	1,003.000	14,042,000
東京製網	5,700	1,380.000	7,866,000
パイオラックス	11,600	2,265.000	26,274,000
エイチワン	9,600	768.000	7,372,800
日本発条	75,100	1,125.000	84,487,500
中央発條	4,000	722.000	2,888,000
立川ブラインド工業	4,600	1,484.000	6,826,400
三益半導体工業	6,400	2,776.000	17,766,400
日本製鋼所	22,900	2,553.500	58,475,150
三浦工業	34,600	2,866.000	99,163,600

タクマ	25,200	1,632.000	41,126,400
ツガミ	18,000	1,230.000	22,140,000
オークマ	8,100	6,194.000	50,171,400
芝浦機械	8,300	3,815.000	31,664,500
アマダ	131,500	1,482.500	194,948,750
アイダエンジニアリング	16,400	870.000	14,268,000
F U J I	35,800	2,506.000	89,714,800
牧野フライス製作所	9,100	5,800.000	52,780,000
オーエスジー	38,200	1,841.000	70,326,200
旭ダイヤモンド工業	23,100	919.000	21,228,900
DMG森精機	50,200	2,656.500	133,356,300
ソディック	22,400	751.000	16,822,400
ディスコ	40,100	32,090.000	1,286,809,000
日東工器	4,400	1,862.000	8,192,800
日進工具	7,100	1,030.000	7,313,000
豊和工業	5,500	775.000	4,262,500
石川製作所	3,100	1,203.000	3,729,300
リケンNPR	7,000	1,960.000	13,720,000
島精機製作所	13,500	1,534.000	20,709,000
オプトラン	13,700	1,627.000	22,289,900
NCホールディングス	2,000	1,902.000	3,804,000
イワキ	6,300	2,057.000	12,959,100
フリー	9,200	1,232.000	11,334,400
ヤマシンフィルタ	21,800	345.000	7,521,000
日阪製作所	8,800	957.000	8,421,600
やまびこ	13,300	1,486.000	19,763,800
野村マイクロ・サイエンス	2,800	11,430.000	32,004,000
平田機工	4,000	6,380.000	25,520,000
PEGASUS	11,000	478.000	5,258,000
マルマエ	4,300	1,826.000	7,851,800
タツモ	5,200	3,640.000	18,928,000
ナブテスコ	52,100	2,767.500	144,186,750
三井海洋開発	10,600	1,907.000	20,214,200
レオン自動機	9,100	1,562.000	14,214,200
SMC	25,200	74,450.000	1,876,140,000
ホソカワミクロン	5,700	4,250.000	24,225,000
ユニオンツール	3,600	3,385.000	12,186,000
瑞光	6,500	1,433.000	9,314,500
オイレス工業	11,100	1,954.000	21,689,400
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,985.000	16,949,000
サトーホールディングス	11,600	2,039.000	23,652,400
技研製作所	8,100	1,858.000	15,049,800
日本エアテック	5,100	1,400.000	7,140,000
日精樹脂工業	6,900	1,084.000	7,479,600

ワイエイシイホールディングス	2,700	2,530.000	6,831,000
小松製作所	390,000	3,772.000	1,471,080,000
住友重機械工業	48,900	3,529.000	172,568,100
日立建機	33,000	3,835.000	126,555,000
日工	12,800	673.000	8,614,400
巴工業	3,800	2,876.000	10,928,800
井関農機	8,400	1,106.000	9,290,400
TOWA	8,400	7,060.000	59,304,000
ローツェ	4,300	14,560.000	62,608,000
クボタ	436,600	2,119.000	925,155,400
荏原実業	4,500	2,952.000	13,284,000
三菱化工機	2,900	3,285.000	9,526,500
月島ホールディングス	11,500	1,328.000	15,272,000
帝国電機製作所	5,900	3,015.000	17,788,500
新東工業	16,700	1,087.000	18,152,900
澁谷工業	8,000	2,537.000	20,296,000
アイチコーポレーション	11,800	933.000	11,009,400
小森コーポレーション	19,300	1,169.000	22,561,700
鶴見製作所	6,300	3,565.000	22,459,500
酒井重工業	1,400	5,870.000	8,218,000
荏原製作所	34,000	8,371.000	284,614,000
西島製作所	7,600	2,197.000	16,697,200
北越工業	8,700	2,249.000	19,566,300
ダイキン工業	99,200	22,155.000	2,197,776,000
オルガノ	11,500	6,060.000	69,690,000
トーヨーカネツ	3,400	3,715.000	12,631,000
栗田工業	46,500	5,238.000	243,567,000
椿本チエイン	11,500	3,775.000	43,412,500
大同工業	6,300	737.000	4,643,100
木村化工機	8,700	716.000	6,229,200
アネスト岩田	14,100	1,094.000	15,425,400
ダイフク	134,800	2,783.000	375,148,400
サムコ	2,300	4,785.000	11,005,500
加藤製作所	4,300	1,247.000	5,362,100
タダノ	47,500	1,154.500	54,838,750
フジテック	24,600	3,429.000	84,353,400
CKD	23,900	2,409.000	57,575,100
平和	27,700	2,104.000	58,280,800
理想科学工業	7,200	2,761.000	19,879,200
SANKYO	19,200	6,388.000	122,649,600
日本金銭機械	9,900	1,121.000	11,097,900
マースグループホールディングス	5,100	2,383.000	12,153,300
フクシマガリレイ	6,100	4,900.000	29,890,000
ダイコク電機	4,700	3,455.000	16,238,500

竹内製作所	15,100	4,325.000	65,307,500
アマノ	23,600	3,147.000	74,269,200
JUKI	13,700	505.000	6,918,500
ジャノメ	9,400	717.000	6,739,800
マックス	10,500	2,814.000	29,547,000
グローリー	20,100	2,770.000	55,677,000
新晃工業	8,200	2,479.000	20,327,800
大和冷機工業	12,400	1,442.000	17,880,800
セガサミーホールディングス	70,300	2,147.500	150,969,250
TPR	9,300	1,729.000	16,079,700
ツバキ・ナカシマ	19,100	742.000	14,172,200
ホシザキ	49,700	4,709.000	234,037,300
大豊工業	8,300	873.000	7,245,900
日本精工	140,000	775.100	108,514,000
NTN	163,400	276.900	45,245,460
ジェイテクト	73,400	1,355.500	99,493,700
不二越	6,300	3,785.000	23,845,500
日本トムソン	20,600	590.000	12,154,000
THK	47,800	2,953.500	141,177,300
ユーシン精機	7,700	672.000	5,174,400
前澤給装工業	6,300	1,291.000	8,133,300
イーグル工業	9,300	1,657.000	15,410,100
前澤工業	5,600	979.000	5,482,400
日本ピラー工業	7,800	4,600.000	35,880,000
キッツ	30,000	1,143.000	34,290,000
マキタ	97,900	3,924.000	384,159,600
三井E&S	40,700	543.000	22,100,100
日立造船	68,100	901.000	61,358,100
三菱重工業	145,300	8,268.000	1,201,340,400
IHI	60,000	2,856.000	171,360,000
スター精密	15,100	1,877.000	28,342,700
日清紡ホールディングス	65,200	1,086.500	70,839,800
イビデン	43,700	7,071.000	309,002,700
コニカミノルタ	186,200	467.900	87,122,980
ブラザー工業	111,300	2,496.000	277,804,800
ミネベアミツミ	144,400	2,813.000	406,197,200
日立製作所	400,000	10,285.000	4,114,000,000
三菱電機	916,000	2,009.000	1,840,244,000
富士電機	50,600	6,201.000	313,770,600
東洋電機製造	5,000	936.000	4,680,000
安川電機	91,500	5,673.000	519,079,500
シンフォニアテクノロジー	10,000	2,064.000	20,640,000
明電舎	12,500	2,447.000	30,587,500
オリジン	3,500	1,216.000	4,256,000

山洋電気	3,600	6,090.000	21,924,000
デンヨー	6,900	2,160.000	14,904,000
PHCホールディングス	11,600	1,485.000	17,226,000
KOKUSAI ELECTRIC	32,000	3,315.000	106,080,000
ソシオネクスト	12,000	13,250.000	159,000,000
東芝テック	11,300	2,909.000	32,871,700
芝浦メカトロニクス	4,500	6,700.000	30,150,000
マブチモーター	20,700	4,648.000	96,213,600
ニデック	183,900	5,604.000	1,030,575,600
トレックス・セミコンダクター	4,100	2,004.000	8,216,400
東光高岳	5,300	2,069.000	10,965,700
ダブル・スコープ	24,100	920.000	22,172,000
ダイヘン	7,400	5,830.000	43,142,000
ヤーマン	15,200	1,061.000	16,127,200
JVCケンウッド	67,700	767.000	51,925,900
ミマキエンジニアリング	9,000	969.000	8,721,000
IPEX	6,200	1,824.000	11,308,800
大崎電気工業	21,500	657.000	14,125,500
オムロン	63,900	6,199.000	396,116,100
日東工業	11,200	3,590.000	40,208,000
IDEC	12,300	2,825.000	34,747,500
ジーエス・ユアサコーポレーション	27,300	2,173.500	59,336,550
メルコホールディングス	2,400	3,460.000	8,304,000
日本電気	110,100	8,240.000	907,224,000
富士通	76,600	21,120.000	1,617,792,000
沖電気工業	37,500	956.000	35,850,000
電気興業	3,700	2,418.000	8,946,600
サンケン電気	7,700	7,555.000	58,173,500
アイホン	4,900	2,768.000	13,563,200
ルネサスエレクトロニクス	543,000	2,603.500	1,413,700,500
セイコーエプソン	106,700	2,198.000	234,526,600
ワコム	63,400	688.000	43,619,200
アルバック	19,700	6,508.000	128,207,600
アクセル	2,800	2,110.000	5,908,000
EIZO	6,100	4,875.000	29,737,500
日本信号	19,000	957.000	18,183,000
京三製作所	19,500	476.000	9,282,000
能美防災	11,200	1,885.000	21,112,000
ホーチキ	6,700	1,653.000	11,075,100
エレコム	19,900	1,624.000	32,317,600
パナソニックホールディングス	983,700	1,530.000	1,505,061,000
シャープ	124,500	925.600	115,237,200
アンリツ	59,000	1,283.500	75,726,500
富士通ゼネラル	23,800	2,710.000	64,498,000

ソニーグループ	582,300	12,820.000	7,465,086,000
TDK	131,700	6,870.000	904,779,000
帝国通信工業	4,100	1,964.000	8,052,400
タムラ製作所	36,200	569.000	20,597,800
アルプスアルパイン	74,600	1,295.500	96,644,300
日本電波工業	10,800	1,250.000	13,500,000
鈴木	5,500	1,234.000	6,787,000
メイコー	9,100	4,355.000	39,630,500
日本トリム	2,200	3,105.000	6,831,000
ローランド ディー. ジー.	4,600	3,615.000	16,629,000
フォスター電機	8,700	1,112.000	9,674,400
SMK	2,500	2,516.000	6,290,000
ヨコオ	7,300	1,566.000	11,431,800
ホシデン	19,300	1,808.000	34,894,400
ヒロセ電機	12,700	16,550.000	210,185,000
日本航空電子工業	16,900	2,947.000	49,804,300
TOA	10,100	1,050.000	10,605,000
マクセル	17,400	1,658.000	28,849,200
古野電気	11,500	1,810.000	20,815,000
スミダコーポレーション	11,300	1,182.000	13,356,600
アイコム	3,600	3,260.000	11,736,000
リオン	3,800	2,229.000	8,470,200
横河電機	91,100	2,801.000	255,171,100
新電元工業	3,400	3,055.000	10,387,000
アズビル	57,600	4,772.000	274,867,200
東亜ディーケーケー	6,000	880.000	5,280,000
日本光電工業	36,700	3,712.000	136,230,400
チノー	4,000	2,066.000	8,264,000
日本電子材料	6,200	1,572.000	9,746,400
堀場製作所	16,100	9,957.000	160,307,700
アドバンテスト	236,300	4,681.000	1,106,120,300
エスペック	7,100	2,362.000	16,770,200
キーエンス	82,400	63,350.000	5,220,040,000
日置電機	4,100	6,560.000	26,896,000
シスメックス	71,000	8,181.000	580,851,000
日本マイクロニクス	14,800	3,835.000	56,758,000
メガチップス	6,800	4,230.000	28,764,000
OBARA GROUP	4,900	3,700.000	18,130,000
コーセル	10,600	1,264.000	13,398,400
イリソ電子工業	7,600	3,975.000	30,210,000
オブテックスグループ	15,100	1,712.000	25,851,200
千代田インテグレ	3,700	3,040.000	11,248,000
レーザーテック	37,800	33,040.000	1,248,912,000
スタンレー電気	56,500	2,736.000	154,584,000

ウシオ電機	41,800	1,905.000	79,629,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,300	500.000	3,150,000
日本セラミック	8,000	2,934.000	23,472,000
古河電池	6,500	892.000	5,798,000
山一電機	7,300	1,895.000	13,833,500
図研	7,200	4,240.000	30,528,000
日本電子	20,600	5,862.000	120,757,200
カシオ計算機	61,300	1,249.000	76,563,700
ファナック	402,100	4,114.000	1,654,239,400
日本シイエムケイ	19,800	751.000	14,869,800
エンプラス	2,500	13,340.000	33,350,000
大真空	10,800	848.000	9,158,400
ローム	152,400	2,825.500	430,606,200
浜松ホトニクス	66,000	5,856.000	386,496,000
三井ハイテック	7,400	7,399.000	54,752,600
新光電気工業	29,100	5,519.000	160,602,900
京セラ	128,000	8,190.000	1,048,320,000
太陽誘電	40,100	3,834.000	153,743,400
村田製作所	749,700	2,883.500	2,161,759,950
双葉電子工業	17,400	553.000	9,622,200
北陸電気工業	3,200	1,402.000	4,486,400
ニチコン	16,800	1,471.000	24,712,800
KOA	12,600	1,619.000	20,399,400
市光工業	15,900	539.000	8,570,100
小糸製作所	92,200	2,236.500	206,205,300
ミツバ	16,200	933.000	15,114,600
SCREENホールディングス	28,200	10,770.000	303,714,000
キヤノン電子	9,100	1,971.000	17,936,100
キヤノン	411,300	3,807.000	1,565,819,100
リコー	206,900	1,207.000	249,728,300
象印マホービン	23,500	1,556.000	36,566,000
東京エレクトロン	174,300	24,025.000	4,187,557,500
イノテック	6,100	1,729.000	10,546,900
トヨタ紡織	34,500	2,550.000	87,975,000
ユニプレス	15,100	990.000	14,949,000
豊田自動織機	68,400	12,715.000	869,706,000
モリタホールディングス	14,600	1,526.000	22,279,600
三櫻工業	14,000	873.000	12,222,000
デンソー	679,600	2,314.000	1,572,594,400
東海理化電機製作所	22,700	2,478.000	56,250,600
川崎重工業	64,000	3,363.000	215,232,000
名村造船所	16,000	1,029.000	16,464,000
日本車輛製造	5,000	2,094.000	10,470,000
三菱ロジスネクスト	14,000	1,324.000	18,536,000

日産自動車	1,171,200	582.900	682,692,480
いすゞ自動車	239,100	1,955.500	467,560,050
トヨタ自動車	4,527,000	2,794.500	12,650,701,500
日野自動車	106,900	477.400	51,034,060
三菱自動車工業	322,300	481.400	155,155,220
GMB	2,000	1,325.000	2,650,000
武蔵精密工業	19,800	1,614.000	31,957,200
日産車体	16,000	896.000	14,336,000
新明和工業	25,900	1,184.000	30,665,600
極東開発工業	13,300	1,900.000	25,270,000
トピー工業	7,100	2,763.000	19,617,300
ティラド	3,000	3,165.000	9,495,000
タチエス	13,200	1,760.000	23,232,000
NOK	32,200	1,885.000	60,697,000
フタバ産業	24,000	856.000	20,544,000
カヤバ	7,800	4,755.000	37,089,000
大同メタル工業	19,500	579.000	11,290,500
プレス工業	36,200	620.000	22,444,000
ミクニ	10,000	456.000	4,560,000
太平洋工業	18,400	1,397.000	25,704,800
アイシン	63,500	5,451.000	346,138,500
マツダ	272,500	1,578.500	430,141,250
今仙電機製作所	6,300	614.000	3,868,200
本田技研工業	2,010,000	1,509.000	3,033,090,000
スズキ	151,400	6,021.000	911,579,400
SUBARU	260,900	2,621.000	683,818,900
安永	4,400	708.000	3,115,200
ヤマハ発動機	118,500	3,777.000	447,574,500
エクセディ	13,000	2,548.000	33,124,000
豊田合成	23,800	2,958.000	70,400,400
愛三工業	14,000	1,312.000	18,368,000
日本プラスト	11,000	572.000	6,292,000
ヨロズ	10,000	902.000	9,020,000
エフ・シー・シー	14,200	1,828.000	25,957,600
シマノ	33,500	22,755.000	762,292,500
テイ・エス テック	37,500	1,826.000	68,475,000
ジャムコ	4,000	1,488.000	5,952,000
テルモ	232,800	4,718.000	1,098,350,400
日機装	19,100	1,006.000	19,214,600
日本エム・ディ・エム	5,400	703.000	3,796,200
島津製作所	102,200	3,835.000	391,937,000
長野計器	6,200	2,083.000	12,914,600
ブイ・テクノロジー	4,400	2,657.000	11,690,800
東京計器	6,900	1,762.000	12,157,800

愛知時計電機	3,800	2,352.000	8,937,600
インターアクション	4,500	1,016.000	4,572,000
オーバル	7,300	486.000	3,547,800
東京精密	17,800	8,577.000	152,670,600
マニー	33,200	2,193.000	72,807,600
ニコン	119,200	1,424.500	169,800,400
トプコン	43,500	1,517.000	65,989,500
オリンパス	507,600	2,166.000	1,099,461,600
理研計器	5,100	6,630.000	33,813,000
タムロン	5,400	4,415.000	23,841,000
HOYA	164,000	16,665.000	2,733,060,000
ノーリツ鋼機	7,900	2,993.000	23,644,700
A&Dホロンホールディングス	11,900	1,870.000	22,253,000
朝日インテック	92,100	2,866.500	264,004,650
シチズン時計	78,100	867.000	67,712,700
リズム	1,700	2,491.000	4,234,700
メニコン	28,400	2,154.000	61,173,600
松風	4,000	2,673.000	10,692,000
セイコーグループ	12,800	2,505.000	32,064,000
ニプロ	69,000	1,118.000	77,142,000
スノーピーク	12,300	1,012.000	12,447,600
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,763.000	52,220,700
トランザクション	5,200	2,112.000	10,982,400
ニホンフラッシュ	8,600	896.000	7,705,600
前田工織	7,000	2,959.000	20,713,000
永大産業	17,800	222.000	3,951,600
アートネイチャー	9,800	790.000	7,742,000
バンダイナムコホールディングス	225,400	2,943.000	663,352,200
SHOEI	18,700	1,985.000	37,119,500
フランスベッドホールディングス	10,500	1,251.000	13,135,500
パイロットコーポレーション	12,400	4,469.000	55,415,600
萩原工業	6,300	1,591.000	10,023,300
フジシールインターナショナル	16,700	1,675.000	27,972,500
タカラトミー	37,500	2,078.500	77,943,750
広済堂ホールディングス	18,000	635.000	11,430,000
プロネクサス	7,700	1,209.000	9,309,300
TOPPANホールディングス	101,200	3,464.000	350,556,800
大日本印刷	90,200	4,153.000	374,600,600
共同印刷	2,800	3,600.000	10,080,000
NISSHA	15,100	1,475.000	22,272,500
TAKARA & COMPANY	5,700	2,460.000	14,022,000
アシックス	70,200	5,290.000	371,358,000
ツツミ	2,000	2,144.000	4,288,000
ローランド	6,200	4,540.000	28,148,000

小松ウオール工業	3,300	2,927.000	9,659,100
ヤマハ	51,900	3,461.000	179,625,900
河合楽器製作所	2,400	3,155.000	7,572,000
クリナップ	10,500	696.000	7,308,000
ピジョン	53,000	1,659.000	87,927,000
キングジム	9,000	870.000	7,830,000
リンテック	16,300	2,494.000	40,652,200
イトーキ	17,100	1,320.000	22,572,000
任天堂	519,900	6,912.000	3,593,548,800
三菱鉛筆	11,800	1,888.000	22,278,400
タカラスタンダード	15,200	1,777.000	27,010,400
コクヨ	36,500	2,302.500	84,041,250
グローブライド	6,800	2,024.000	13,763,200
オカムラ	24,900	2,131.000	53,061,900
美津濃	8,300	4,045.000	33,573,500
東京電力ホールディングス	744,200	630.900	469,515,780
中部電力	303,000	1,827.000	553,581,000
関西電力	318,100	1,971.000	626,975,100
中国電力	143,200	976.400	139,820,480
北陸電力	83,400	722.300	60,239,820
東北電力	216,300	946.900	204,814,470
四国電力	75,300	1,023.000	77,031,900
九州電力	189,600	990.600	187,817,760
北海道電力	79,500	625.800	49,751,100
沖縄電力	20,600	1,084.000	22,330,400
電源開発	67,500	2,297.500	155,081,250
エフオン	8,600	476.000	4,093,600
イーレックス	15,100	659.000	9,950,900
レノバ	22,200	1,055.000	23,421,000
東京瓦斯	174,200	3,427.000	596,983,400
大阪瓦斯	166,700	2,880.000	480,096,000
東邦瓦斯	34,600	2,635.500	91,188,300
北海道瓦斯	5,100	2,261.000	11,531,100
広島ガス	19,100	374.000	7,143,400
西部ガスホールディングス	7,800	1,873.000	14,609,400
静岡ガス	18,000	1,020.000	18,360,000
メタウォーター	9,800	2,049.000	20,080,200
SBSホールディングス	7,200	2,507.000	18,050,400
東武鉄道	90,400	3,655.000	330,412,000
相鉄ホールディングス	27,300	2,682.500	73,232,250
東急	230,700	1,735.500	400,379,850
京浜急行電鉄	93,400	1,262.000	117,870,800
小田急電鉄	126,100	2,079.500	262,224,950
京王電鉄	43,600	4,263.000	185,866,800

京成電鉄	53,100	5,960.000	316,476,000
富士急行	10,200	4,330.000	44,166,000
東日本旅客鉄道	147,900	7,995.000	1,182,460,500
西日本旅客鉄道	102,300	5,847.000	598,148,100
東海旅客鉄道	317,500	3,550.000	1,127,125,000
西武ホールディングス	99,900	1,784.500	178,271,550
鴻池運輸	14,000	1,969.000	27,566,000
西日本鉄道	21,600	2,367.500	51,138,000
ハマキョウレックス	6,300	4,005.000	25,231,500
サカイ引越センター	7,800	2,612.000	20,373,600
近鉄グループホールディングス	82,100	4,146.000	340,386,600
阪急阪神ホールディングス	109,500	4,471.000	489,574,500
南海電気鉄道	39,300	2,802.500	110,138,250
京阪ホールディングス	45,400	3,692.000	167,616,800
神戸電鉄	2,800	2,938.000	8,226,400
名古屋鉄道	90,800	2,164.500	196,536,600
山陽電気鉄道	6,700	2,123.000	14,224,100
アルプス物流	6,700	1,613.000	10,807,100
ヤマトホールディングス	105,400	2,628.500	277,043,900
山九	20,900	5,039.000	105,315,100
丸全昭和運輸	5,000	3,740.000	18,700,000
センコーグループホールディングス	42,900	1,057.000	45,345,300
トナミホールディングス	1,900	4,630.000	8,797,000
ニッコンホールディングス	26,100	3,217.000	83,963,700
福山通運	6,200	3,665.000	22,723,000
セイノーホールディングス	47,100	2,083.000	98,109,300
神奈川中央交通	2,600	3,045.000	7,917,000
AZ-COM丸和ホールディングス	20,000	1,501.000	30,020,000
C&Fロジホールディングス	8,300	1,511.000	12,541,300
九州旅客鉄道	58,100	3,091.000	179,587,100
SGホールディングス	145,500	2,137.500	311,006,250
NIPPON EXPRESSホールディングス	28,300	8,071.000	228,409,300
日本郵船	233,400	3,974.000	927,531,600
商船三井	178,500	4,061.000	724,888,500
川崎汽船	69,400	5,189.000	360,116,600
NSユニテッド海運	4,600	4,865.000	22,379,000
明海グループ	7,400	692.000	5,120,800
飯野海運	30,600	1,223.000	37,423,800
乾汽船	11,600	1,214.000	14,082,400
日本航空	201,900	2,811.000	567,540,900
ANAホールディングス	224,600	3,052.000	685,479,200
トランコム	2,400	7,560.000	18,144,000
日新	6,500	2,510.000	16,315,000
三菱倉庫	20,000	4,431.000	88,620,000

三井倉庫ホールディングス	7,500	4,835.000	36,262,500
住友倉庫	21,500	2,439.000	52,438,500
澁澤倉庫	3,300	2,833.000	9,348,900
東陽倉庫	3,700	1,518.000	5,616,600
日本トランスシティ	16,800	622.000	10,449,600
川西倉庫	5,200	1,085.000	5,642,000
安田倉庫	6,500	1,125.000	7,312,500
上組	39,000	3,239.000	126,321,000
キムラユニティー	4,300	1,423.000	6,118,900
キューソー流通システム	6,300	902.000	5,682,600
エーアイティー	5,400	1,664.000	8,985,600
内外トランスライン	3,500	2,519.000	8,816,500
日本コンセプト	3,300	1,683.000	5,553,900
NEC ネットズエスアイ	27,300	2,159.000	58,940,700
クロスキャット	5,200	1,127.000	5,860,400
システナ	138,200	296.000	40,907,200
デジタルアーツ	5,200	4,815.000	25,038,000
日鉄ソリューションズ	14,000	4,645.000	65,030,000
キューブシステム	5,600	1,112.000	6,227,200
コア	4,400	1,779.000	7,827,600
手間いらず	1,500	2,496.000	3,744,000
ラクーンホールディングス	8,100	681.000	5,516,100
ソリトンシステムズ	4,800	1,276.000	6,124,800
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	1,695.000	12,034,500
T I S	90,400	3,127.000	282,680,800
グリー	23,300	568.000	13,234,400
コーエーテクモホールディングス	51,800	1,810.500	93,783,900
三菱総合研究所	3,900	4,805.000	18,739,500
ファインデックス	8,200	952.000	7,806,400
ブレインパッド	6,600	1,024.000	6,758,400
K L a b	18,400	278.000	5,115,200
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	535.000	8,025,000
ネクソン	184,500	3,198.000	590,031,000
アイスタイル	26,400	438.000	11,563,200
エムアップホールディングス	10,800	1,018.000	10,994,400
エイチーム	6,700	684.000	4,582,800
エニグモ	12,700	383.000	4,864,100
コロプラ	31,500	609.000	19,183,500
ブロードリーフ	42,900	566.000	24,281,400
クロス・マーケティンググループ	5,000	567.000	2,835,000
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,000.000	5,700,000
メディアドゥ	3,700	1,516.000	5,609,200
じげん	24,900	538.000	13,396,200
フィックスターズ	9,800	1,356.000	13,288,800

CARTA HOLDINGS	4,400	1,312.000	5,772,800
オプティム	7,200	846.000	6,091,200
セレス	3,800	915.000	3,477,000
SHIFT	5,500	34,440.000	189,420,000
ティーガイア	9,000	1,835.000	16,515,000
テクマトリックス	15,200	1,735.000	26,372,000
プロシップ	4,300	1,321.000	5,680,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,292.000	50,424,000
GMOペイメントゲートウェイ	16,500	8,707.000	143,665,500
システムリサーチ	2,800	3,590.000	10,052,000
インターネットイニシアティブ	41,600	2,657.000	110,531,200
さくらインターネット	9,600	1,791.000	17,193,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,491.000	6,725,700
SRAホールディングス	4,400	3,595.000	15,818,000
朝日ネット	9,600	627.000	6,019,200
eBASE	12,200	806.000	9,833,200
アバントグループ	10,700	1,488.000	15,921,600
アドソル日進	3,800	1,606.000	6,102,800
フリービット	5,100	1,189.000	6,063,900
コムチュア	11,000	2,015.000	22,165,000
アイル	4,000	3,570.000	14,280,000
マークライنز	4,700	2,765.000	12,995,500
メディカル・データ・ビジョン	12,600	694.000	8,744,400
gumi	13,100	416.000	5,449,600
テラスカイ	3,900	1,566.000	6,107,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,200	1,636.000	8,507,200
PR TIMES	2,700	1,716.000	4,633,200
ラクス	39,000	2,665.000	103,935,000
ダブルスタンダード	3,700	1,504.000	5,564,800
オープンドア	6,300	723.000	4,554,900
アカツキ	4,400	2,312.000	10,172,800
UBICOMホールディングス	3,100	1,709.000	5,297,900
カナミックネットワーク	12,600	388.000	4,888,800
チェンジホールディングス	19,600	1,560.000	30,576,000
オークネット	4,500	1,841.000	8,284,500
マクロミル	17,000	792.000	13,464,000
オロ	3,700	2,494.000	9,227,800
ユーザーローカル	3,200	1,722.000	5,510,400
マネーフォワード	18,500	4,542.000	84,027,000
SUN ASTERISK	6,200	997.000	6,181,400
プラスアルファ・コンサルティング	4,900	2,719.000	13,323,100
電算システムホールディングス	4,200	2,779.000	11,671,800
APPIER GROUP	28,400	1,640.000	46,576,000
プロトコーポレーション	10,500	1,340.000	14,070,000

野村総合研究所	177,300	4,152.000	736,149,600
日本システム技術	2,800	2,708.000	7,582,400
インテージホールディングス	9,500	1,640.000	15,580,000
インフォコム	10,600	2,452.000	25,991,200
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,620.000	35,370,000
HEROZ	3,000	1,379.000	4,137,000
ラクスル	20,100	1,430.000	28,743,000
メルカリ	50,100	2,829.500	141,757,950
I P S	3,000	2,016.000	6,048,000
システムサポート	3,400	1,885.000	6,409,000
イーソル	7,500	608.000	4,560,000
ウイングアーク1st	8,700	3,285.000	28,579,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,363.000	3,543,800
サーバーワークス	1,900	3,555.000	6,754,500
S a n s a n	27,300	1,546.000	42,205,800
ギフティ	7,600	1,899.000	14,432,400
メドレー	11,100	4,425.000	49,117,500
ベース	3,100	3,330.000	10,323,000
JMDC	13,700	4,314.000	59,101,800
フォーカスシステムズ	6,800	991.000	6,738,800
クレスコ	7,000	1,910.000	13,370,000
フジ・メディア・ホールディングス	79,500	1,524.000	121,158,000
オービック	27,600	22,695.000	626,382,000
ジャストシステム	11,900	3,330.000	39,627,000
TDCソフト	7,200	2,099.000	15,112,800
L I N E ヤフー	1,160,000	430.600	499,496,000
トレンドマイクロ	39,100	7,514.000	293,797,400
I Dホールディングス	6,100	1,531.000	9,339,100
日本オラクル	15,900	11,435.000	181,816,500
アルファシステムズ	3,000	2,794.000	8,382,000
フューチャー	18,500	1,804.000	33,374,000
C A C H O L D I N G S	5,300	1,788.000	9,476,400
S Bテクノロジー	3,700	2,494.000	9,227,800
オービックビジネスコンサルタント	12,300	6,759.000	83,135,700
アイティフォー	11,500	1,164.000	13,386,000
東計電算	1,400	7,050.000	9,870,000
大塚商会	40,800	6,035.000	246,228,000
サイボウズ	11,600	2,082.000	24,151,200
電通国際情報サービス	10,000	4,920.000	49,200,000
A C C E S S	10,400	731.000	7,602,400
デジタルガレージ	14,700	3,095.000	45,496,500
イーエムシステムズ	14,500	711.000	10,309,500
ウェザーニューズ	2,500	5,870.000	14,675,000
C I J	14,700	618.000	9,084,600

ビジネスエンジニアリング	1,500	4,420.000	6,630,000
WOWOW	7,000	1,089.000	7,623,000
スカラ	8,700	765.000	6,655,500
ANYCOLOR	3,000	3,850.000	11,550,000
IMAGICA GROUP	8,000	627.000	5,016,000
ネットワンシステムズ	30,900	2,056.000	63,530,400
アルゴグラフィックス	7,500	3,735.000	28,012,500
マーベラス	14,200	697.000	9,897,400
エイベックス	14,200	1,392.000	19,766,400
BIPROGY	27,000	4,273.000	115,371,000
都築電気	4,500	2,093.000	9,418,500
TBSホールディングス	42,300	2,746.500	116,176,950
日本テレビホールディングス	72,900	1,441.000	105,048,900
朝日放送グループホールディングス	9,600	643.000	6,172,800
テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,675.000	33,332,500
スカパーJ SATホールディングス	73,700	678.000	49,968,600
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,990.000	17,940,000
日本BS放送	6,500	887.000	5,765,500
ビジョン	12,600	1,162.000	14,641,200
USEN-NEXT HOLDINGS	9,300	3,775.000	35,107,500
日本通信	78,500	227.000	17,819,500
日本電信電話	24,550,000	173.100	4,249,605,000
KDDI	637,000	4,625.000	2,946,125,000
ソフトバンク	1,326,000	1,798.500	2,384,811,000
光通信	8,900	22,990.000	204,611,000
エムティーアイ	8,200	602.000	4,936,400
GMOインターネットグループ	30,600	2,376.500	72,720,900
ファイバーゲート	5,000	961.000	4,805,000
KADOKAWA	43,600	2,664.000	116,150,400
学研ホールディングス	14,400	977.000	14,068,800
ゼンリン	14,500	894.000	12,963,000
アイネット	5,700	1,900.000	10,830,000
松竹	4,700	9,378.000	44,076,600
東宝	46,000	5,131.000	236,026,000
東映	2,300	17,720.000	40,756,000
NTTデータグループ	222,500	1,797.000	399,832,500
ピー・シー・エー	5,200	1,173.000	6,099,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	2,138.000	8,338,200
DTS	17,200	3,515.000	60,458,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,200	5,132.000	201,174,400
シーイーシー	11,700	1,795.000	21,001,500
カブコン	74,500	4,983.000	371,233,500
アイ・エス・ビー	4,600	1,503.000	6,913,800
ジャステック	5,500	1,463.000	8,046,500

SCSK	58,000	2,724.000	157,992,000
NSW	3,300	2,935.000	9,685,500
アイネス	6,300	1,666.000	10,495,800
TKC	12,700	3,540.000	44,958,000
富士ソフト	17,200	5,990.000	103,028,000
NSD	29,000	2,800.000	81,200,000
コナミグループ	32,100	7,315.000	234,811,500
福井コンピュータホールディングス	6,500	2,643.000	17,179,500
JBCホールディングス	6,200	3,175.000	19,685,000
ミロク情報サービス	7,900	1,737.000	13,722,300
ソフトバンクグループ	406,000	6,020.000	2,444,120,000
高千穂交易	2,700	3,400.000	9,180,000
伊藤忠食品	2,000	7,160.000	14,320,000
エレマテック	8,000	1,767.000	14,136,000
あらた	6,600	6,250.000	41,250,000
トーマンデバイス	1,400	5,300.000	7,420,000
東京エレクトロン デバイス	9,600	4,875.000	46,800,000
円谷フィールズホールディングス	15,100	1,126.000	17,002,600
双日	96,400	3,293.000	317,445,200
アルフレッサ ホールディングス	87,600	2,377.500	208,269,000
横浜冷凍	24,300	1,109.000	26,948,700
ラサ商事	5,000	1,509.000	7,545,000
アルコニックス	12,000	1,320.000	15,840,000
神戸物産	67,500	3,904.000	263,520,000
あい ホールディングス	13,800	2,472.000	34,113,600
ダイワボウホールディングス	36,800	2,909.500	107,069,600
マクニカホールディングス	20,600	7,313.000	150,647,800
ラクト・ジャパン	3,800	1,951.000	7,413,800
グリムス	3,800	2,106.000	8,002,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,071.000	14,351,400
八洲電機	7,700	1,271.000	9,786,700
メディアスホールディングス	7,000	772.000	5,404,000
レスターホールディングス	8,000	2,683.000	21,464,000
ジオリーブグループ	3,000	1,245.000	3,735,000
大光	8,900	638.000	5,678,200
TOKAIホールディングス	42,300	941.000	39,804,300
三洋貿易	10,100	1,313.000	13,261,300
ビューティガレージ	3,000	2,520.000	7,560,000
ウイン・パートナーズ	6,800	1,192.000	8,105,600
シップヘルスケアホールディングス	31,500	2,087.500	65,756,250
コメダホールディングス	21,600	2,767.000	59,767,200
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,700.000	22,410,000
ヤマエグループホールディングス	5,000	3,465.000	17,325,000
小野建	8,700	1,687.000	14,676,900

南陽	2,500	2,058.000	5,145,000
佐島電機	4,600	1,964.000	9,034,400
伯東	5,000	5,470.000	27,350,000
コンドーテック	7,600	1,169.000	8,884,400
ナガイレーベン	11,000	2,272.000	24,992,000
三菱食品	8,300	4,860.000	40,338,000
松田産業	6,800	2,557.000	17,387,600
第一興商	33,800	2,235.000	75,543,000
メディパルホールディングス	88,100	2,340.000	206,154,000
S P K	4,400	1,829.000	8,047,600
萩原電気ホールディングス	4,500	4,940.000	22,230,000
アズワン	12,400	5,072.000	62,892,800
スズデン	3,800	2,283.000	8,675,400
尾家産業	2,500	1,890.000	4,725,000
シモジマ	6,700	1,262.000	8,455,400
ドウシシャ	9,000	2,110.000	18,990,000
高速	6,000	2,039.000	12,234,000
たけびし	3,700	1,888.000	6,985,600
リックス	2,000	3,280.000	6,560,000
丸文	8,300	1,508.000	12,516,400
ハピネット	7,900	2,577.000	20,358,300
日本ライフライン	25,700	1,164.000	29,914,800
タカショー	9,600	550.000	5,280,000
I D O M	26,800	922.000	24,709,600
進和	5,800	2,499.000	14,494,200
ダイトロン	3,600	2,964.000	10,670,400
シークス	12,300	1,518.000	18,671,400
オーハシテクニカ	4,700	1,748.000	8,215,600
白銅	3,400	2,299.000	7,816,600
伊藤忠商事	584,000	5,738.000	3,350,992,000
丸紅	721,900	2,307.000	1,665,423,300
長瀬産業	39,500	2,323.500	91,778,250
蝶理	6,000	2,785.000	16,710,000
豊田通商	76,300	8,190.000	624,897,000
三共生興	14,600	742.000	10,833,200
兼松	33,700	2,054.000	69,219,800
三井物産	654,400	5,392.000	3,528,524,800
日本紙パルプ商事	4,600	4,995.000	22,977,000
カメイ	9,500	1,705.000	16,197,500
O U Gホールディングス	1,000	2,390.000	2,390,000
スターゼン	6,600	2,463.000	16,255,800
山善	22,400	1,200.000	26,880,000
椿本興業	2,500	6,040.000	15,100,000
住友商事	527,700	3,100.000	1,635,870,000

内田洋行	3,500	7,200.000	25,200,000
三菱商事	574,000	6,886.000	3,952,564,000
第一実業	9,300	1,916.000	17,818,800
キャノンマーケティングジャパン	20,200	3,731.000	75,366,200
西華産業	4,000	2,677.000	10,708,000
佐藤商事	6,300	1,524.000	9,601,200
菱洋エレクトロ	7,500	3,710.000	27,825,000
東京産業	8,900	869.000	7,734,100
ユアサ商事	7,500	4,430.000	33,225,000
神鋼商事	2,300	5,710.000	13,133,000
阪和興業	15,500	4,560.000	70,680,000
正栄食品工業	5,800	4,515.000	26,187,000
カナデン	6,700	1,473.000	9,869,100
RYODEN	7,100	2,606.000	18,502,600
岩谷産業	19,900	7,106.000	141,409,400
ナイス	2,600	1,619.000	4,209,400
極東貿易	5,900	1,888.000	11,139,200
アステナホールディングス	18,300	497.000	9,095,100
三愛オブリ	22,900	1,617.000	37,029,300
稲畑産業	16,900	3,165.000	53,488,500
G S Iクレオス	5,400	2,052.000	11,080,800
明和産業	12,500	659.000	8,237,500
ワキタ	16,100	1,485.000	23,908,500
東邦ホールディングス	22,800	3,230.000	73,644,000
サンゲツ	22,000	2,868.000	63,096,000
ミツウロコグループホールディングス	11,900	1,312.000	15,612,800
シナネンホールディングス	3,000	4,065.000	12,195,000
伊藤忠エネクス	21,100	1,528.000	32,240,800
サンリオ	24,800	6,069.000	150,511,200
サンワ テクノス	4,600	2,233.000	10,271,800
リョーサン	9,300	4,945.000	45,988,500
新光商事	12,300	1,208.000	14,858,400
トーヨー	4,000	3,095.000	12,380,000
三信電気	3,900	2,296.000	8,954,400
東陽テクニカ	9,200	1,388.000	12,769,600
モスフードサービス	12,600	3,335.000	42,021,000
加賀電子	7,000	6,630.000	46,410,000
ソーダニッカ	8,000	1,034.000	8,272,000
立花エレテック	6,400	2,905.000	18,592,000
PALTAC	13,800	4,755.000	65,619,000
三谷産業	18,600	334.000	6,212,400
太平洋興発	6,400	795.000	5,088,000
西本Wismettacホールディングス	2,300	6,190.000	14,237,000
KPPグループホールディングス	25,000	709.000	17,725,000

ヤマタネ	4,500	2,248.000	10,116,000
泉州電業	4,800	3,395.000	16,296,000
トラスコ中山	18,200	2,377.000	43,261,400
オートバックスセブン	30,100	1,545.500	46,519,550
モリト	7,300	1,295.000	9,453,500
加藤産業	10,600	4,680.000	49,608,000
イエローハット	15,000	1,778.000	26,670,000
J Kホールディングス	7,200	967.000	6,962,400
日伝	6,500	2,651.000	17,231,500
杉本商事	5,000	2,246.000	11,230,000
因幡電機産業	21,900	3,280.000	71,832,000
東テク	3,000	4,745.000	14,235,000
ミスミグループ本社	131,500	2,400.000	315,600,000
タキヒヨー	2,900	1,018.000	2,952,200
スズケン	32,500	5,043.000	163,897,500
ジェコス	6,100	1,060.000	6,466,000
ローソン	19,100	7,321.000	139,831,100
サンエー	6,600	4,600.000	30,360,000
カワチ薬品	7,000	2,551.000	17,857,000
エービーシー・マート	37,800	2,440.500	92,250,900
ハードオフコーポレーション	3,800	1,530.000	5,814,000
アスクル	18,200	2,159.000	39,293,800
ゲオホールディングス	9,000	2,347.000	21,123,000
アダストリア	10,600	3,800.000	40,280,000
くら寿司	10,300	3,675.000	37,852,500
キャンドゥ	4,200	2,619.000	10,999,800
パルグループホールディングス	17,000	2,336.000	39,712,000
エディオン	34,700	1,485.000	51,529,500
サーラコーポレーション	18,900	711.000	13,437,900
ハローズ	4,000	4,145.000	16,580,000
フジオフードグループ本社	10,600	1,444.000	15,306,400
あみやき亭	2,400	3,660.000	8,784,000
大黒天物産	2,700	6,160.000	16,632,000
ハニーズホールディングス	7,200	1,672.000	12,038,400
アルペン	7,300	1,950.000	14,235,000
クオールホールディングス	12,200	1,706.000	20,813,200
ジinzホールディングス	5,300	4,695.000	24,883,500
ビックカメラ	46,200	1,221.000	56,410,200
DCMホールディングス	50,000	1,279.000	63,950,000
MonotaRO	123,700	1,493.000	184,684,100
DDグループ	1,500	1,333.000	1,999,500
J. フロント リテイリング	104,200	1,354.500	141,138,900
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,195.000	33,803,000
マツキヨココカラ&カンパニー	158,700	2,553.500	405,240,450

ブロンコビリー	5,200	3,160.000	16,432,000
ZOZO	57,700	3,125.000	180,312,500
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,263.000	5,304,600
物語コーポレーション	14,600	3,880.000	56,648,000
三越伊勢丹ホールディングス	147,000	1,671.000	245,637,000
ウエルシアホールディングス	45,400	2,584.000	117,313,600
クリエイトSDホールディングス	14,100	3,060.000	43,146,000
チムニー	3,500	1,387.000	4,854,500
シュッピン	7,200	1,238.000	8,913,600
オイシックス・ラ・大地	11,800	1,393.000	16,437,400
ネクステージ	20,000	2,289.000	45,780,000
ジョイフル本田	25,000	1,792.000	44,800,000
鳥貴族ホールディングス	3,700	2,838.000	10,500,600
ホットランド	7,100	1,972.000	14,001,200
すかいらくホールディングス	119,200	2,180.500	259,915,600
SFPホールディングス	4,600	2,233.000	10,271,800
綿半ホールディングス	7,100	1,370.000	9,727,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,300	1,011.000	29,622,300
BEENOS	3,800	1,495.000	5,681,000
あさひ	7,600	1,317.000	10,009,200
日本調剤	6,400	1,288.000	8,243,200
コスモス薬品	8,700	15,650.000	136,155,000
セブン&アイ・ホールディングス	300,400	5,495.000	1,650,698,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	59,700	1,045.000	62,386,500
ツルハホールディングス	18,300	12,440.000	227,652,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,998.000	14,585,400
フェリシモ	4,000	913.000	3,652,000
トリドールホールディングス	21,600	4,151.000	89,661,600
TOKYO BASE	10,400	271.000	2,818,400
JMホールディングス	6,900	2,077.000	14,331,300
アレンザホールディングス	7,300	1,014.000	7,402,200
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,625.000	6,175,000
クスリのアオキホールディングス	23,400	3,422.000	80,074,800
力の源ホールディングス	3,800	1,568.000	5,958,400
FOOD & LIFE COMPANIES	46,600	2,863.000	133,415,800
ノジマ	28,300	1,396.000	39,506,800
カッパ・クリエイト	13,700	1,654.000	22,659,800
良品計画	95,400	2,336.500	222,902,100
アドヴァングループ	10,500	1,039.000	10,909,500
アルビス	3,100	2,581.000	8,001,100
G-7ホールディングス	9,600	1,203.000	11,548,800
イオン北海道	15,200	892.000	13,558,400
コジマ	15,600	723.000	11,278,800

コーナン商事	11,800	3,700.000	43,660,000
エコス	3,700	2,227.000	8,239,900
ワタミ	10,300	1,040.000	10,712,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	176,200	3,204.000	564,544,800
西松屋チェーン	17,500	2,157.000	37,747,500
ゼンショーホールディングス	43,200	8,214.000	354,844,800
サイゼリヤ	13,000	5,740.000	74,620,000
V Tホールディングス	34,500	524.000	18,078,000
フジ・コーポレーション	3,800	1,600.000	6,080,000
ユナイテッドアローズ	9,400	1,959.000	18,414,600
ハイデイ日高	13,100	2,749.000	36,011,900
コロワイド	39,700	2,234.000	88,689,800
壱番屋	6,800	5,330.000	36,244,000
スギホールディングス	17,600	6,414.000	112,886,400
薬王堂ホールディングス	4,600	2,711.000	12,470,600
スクロール	13,200	925.000	12,210,000
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,955.000	15,053,500
木曽路	12,800	2,491.000	31,884,800
S R Sホールディングス	15,700	1,037.000	16,280,900
リテールパートナーズ	12,900	1,778.000	22,936,200
上新電機	7,600	2,313.000	17,578,800
日本瓦斯	46,500	2,237.000	104,020,500
ロイヤルホールディングス	16,500	2,676.000	44,154,000
いなげや	8,600	1,501.000	12,908,600
チョダ	9,500	843.000	8,008,500
ライフコーポレーション	7,700	3,405.000	26,218,500
リンガーハット	11,100	2,312.000	25,663,200
Mr M a x HD	13,200	628.000	8,289,600
AOK Iホールディングス	16,900	1,183.000	19,992,700
オークワ	14,700	830.000	12,201,000
コメリ	13,400	3,155.000	42,277,000
青山商事	18,900	1,581.000	29,880,900
しまむら	10,200	16,555.000	168,861,000
高島屋	64,100	1,992.500	127,719,250
松屋	15,300	859.000	13,142,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	41,600	1,646.000	68,473,600
近鉄百貨店	4,800	2,643.000	12,686,400
丸井グループ	60,400	2,364.500	142,815,800
アクシアル リテイリング	5,900	3,895.000	22,980,500
イオン	295,700	3,061.000	905,137,700
イズミ	13,200	3,534.000	46,648,800
平和堂	14,800	2,322.000	34,365,600
フジ	13,200	1,875.000	24,750,000

ヤオコー	9,800	8,067.000	79,056,600
ゼビオホールディングス	12,200	944.000	11,516,800
ケーズホールディングス	61,500	1,259.500	77,459,250
OLYMPICグループ	5,200	511.000	2,657,200
シルバーライフ	2,500	1,034.000	2,585,000
Genky DrugStores	3,700	5,100.000	18,870,000
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,085.000	5,750,500
ギフトホールディングス	3,900	2,032.000	7,924,800
アインホールディングス	12,100	4,500.000	54,450,000
元気寿司	6,000	3,190.000	19,140,000
ヤマダホールディングス	289,700	428.500	124,136,450
アークランズ	27,100	1,648.000	44,660,800
ニトリホールディングス	31,700	17,060.000	540,802,000
グルメ杵屋	8,300	1,060.000	8,798,000
ケーユーホールディングス	5,900	1,126.000	6,643,400
吉野家ホールディングス	34,000	3,270.000	111,180,000
松屋フーズホールディングス	4,100	5,000.000	20,500,000
サガミホールディングス	13,800	1,380.000	19,044,000
関西フードマーケット	7,700	1,415.000	10,895,500
王将フードサービス	5,800	8,010.000	46,458,000
ミニストップ	6,700	1,512.000	10,130,400
アークス	16,100	2,718.000	43,759,800
バローホールディングス	16,900	2,371.000	40,069,900
ベルク	4,300	6,370.000	27,391,000
大庄	5,000	1,261.000	6,305,000
ファーストリテイリング	39,200	37,490.000	1,469,608,000
サンドラッグ	30,500	4,475.000	136,487,500
サックスパーホールディングス	7,700	895.000	6,891,500
やまや	2,000	3,040.000	6,080,000
ベルーナ	21,200	626.000	13,271,200
いよぎんホールディングス	97,100	955.800	92,808,180
しずおかフィナンシャルグループ	180,800	1,196.000	216,236,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	68,300	1,059.000	72,329,700
楽天銀行	27,700	2,558.000	70,856,600
京都フィナンシャルグループ	25,700	8,849.000	227,419,300
島根銀行	4,000	514.000	2,056,000
じもとホールディングス	7,000	557.000	3,899,000
めぶきフィナンシャルグループ	403,700	445.000	179,646,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,300.000	45,150,000
九州フィナンシャルグループ	142,300	832.800	118,507,440
ゆうちょ銀行	875,000	1,459.500	1,277,062,500
富山第一銀行	25,000	787.000	19,675,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	436,200	693.900	302,679,180
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	1,633.000	82,629,800

三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,868.000	14,010,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	3,940.000	49,644,000
ひろぎんホールディングス	105,700	927.000	97,983,900
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,398.000	16,546,200
十六フィナンシャルグループ	10,500	3,830.000	40,215,000
北國フィナンシャルホールディングス	8,500	4,530.000	38,505,000
プロクレアホールディングス	10,100	1,897.000	19,159,700
あいちフィナンシャルグループ	11,400	2,345.000	26,733,000
あおぞら銀行	50,900	3,040.000	154,736,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,084,900	1,255.000	6,381,549,500
りそなホールディングス	970,600	768.500	745,906,100
三井住友トラスト・ホールディングス	145,800	5,559.000	810,502,200
三井住友フィナンシャルグループ	577,000	7,258.000	4,187,866,000
千葉銀行	226,400	1,106.500	250,511,600
群馬銀行	157,700	747.800	117,928,060
武蔵野銀行	10,200	2,856.000	29,131,200
千葉興業銀行	13,000	830.000	10,790,000
筑波銀行	32,000	267.000	8,544,000
七十七銀行	26,000	3,430.000	89,180,000
秋田銀行	4,800	1,977.000	9,489,600
山形銀行	9,000	1,059.000	9,531,000
岩手銀行	5,800	2,475.000	14,355,000
東邦銀行	60,000	291.000	17,460,000
東北銀行	3,000	1,163.000	3,489,000
ふくおかフィナンシャルグループ	64,800	3,433.000	222,458,400
スルガ銀行	72,600	751.000	54,522,600
八十二銀行	170,800	801.100	136,827,880
山梨中央銀行	7,900	1,794.000	14,172,600
大垣共立銀行	15,400	1,897.000	29,213,800
福井銀行	7,500	1,554.000	11,655,000
清水銀行	3,600	1,532.000	5,515,200
富山銀行	1,500	1,707.000	2,560,500
滋賀銀行	13,600	3,745.000	50,932,000
南都銀行	12,300	2,486.000	30,577,800
百五銀行	76,000	541.000	41,116,000
紀陽銀行	28,900	1,591.000	45,979,900
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,568.000	80,595,200
山陰合同銀行	50,500	958.000	48,379,000
鳥取銀行	2,500	1,325.000	3,312,500
百十四銀行	7,600	2,597.000	19,737,200
四国銀行	13,300	1,001.000	13,313,300
阿波銀行	11,500	2,495.000	28,692,500
大分銀行	5,100	2,642.000	13,474,200
宮崎銀行	5,200	2,646.000	13,759,200

佐賀銀行	5,100	1,875.000	9,562,500
琉球銀行	19,200	1,119.000	21,484,800
セブン銀行	292,900	300.300	87,957,870
みずほフィナンシャルグループ	1,105,300	2,512.000	2,776,513,600
高知銀行	2,500	964.000	2,410,000
山口フィナンシャルグループ	79,000	1,298.500	102,581,500
名古屋銀行	5,300	5,560.000	29,468,000
北洋銀行	123,000	365.000	44,895,000
大光銀行	2,500	1,308.000	3,270,000
愛媛銀行	11,600	1,008.000	11,692,800
トマト銀行	2,500	1,145.000	2,862,500
京葉銀行	37,400	701.000	26,217,400
栃木銀行	39,200	318.000	12,465,600
北日本銀行	2,600	2,116.000	5,501,600
東和銀行	15,200	622.000	9,454,400
大東銀行	3,000	766.000	2,298,000
トモニホールディングス	65,700	490.000	32,193,000
フィデアホールディングス	8,500	1,468.000	12,478,000
池田泉州ホールディングス	100,000	342.000	34,200,000
F P G	27,600	1,628.000	44,932,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	1,579.000	10,737,200
マーキュリアホールディングス	5,700	807.000	4,599,900
S B I ホールディングス	117,400	3,207.000	376,501,800
ジャフコ グループ	27,500	1,703.000	46,832,500
大和証券グループ本社	597,200	955.400	570,564,880
野村ホールディングス	1,395,500	607.300	847,487,150
岡三証券グループ	72,600	714.000	51,836,400
丸三証券	28,000	849.000	23,772,000
東洋証券	29,400	299.000	8,790,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87,000	553.000	48,111,000
水戸証券	23,800	436.000	10,376,800
いちよし証券	14,800	732.000	10,833,600
松井証券	47,900	742.000	35,541,800
マネックスグループ	83,500	661.000	55,193,500
極東証券	10,900	1,033.000	11,259,700
岩井コスモホールディングス	9,400	1,760.000	16,544,000
アイザワ証券グループ	12,200	1,198.000	14,615,600
スパークス・グループ	9,200	1,489.000	13,698,800
かんぽ生命保険	90,200	2,765.000	249,403,000
F P パートナー	1,300	5,000.000	6,500,000
S O M P O ホールディングス	132,300	6,757.000	893,951,100
アニコム ホールディングス	28,500	603.000	17,185,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	176,700	5,533.000	977,681,100

第一生命ホールディングス	396,700	3,081.000	1,222,232,700
東京海上ホールディングス	802,400	3,648.000	2,927,155,200
T&Dホールディングス	226,700	2,186.500	495,679,550
アドバンスクリエイト	6,300	1,002.000	6,312,600
全国保証	21,400	4,997.000	106,935,800
あんしん保証	1,700	250.000	425,000
ジェイリース	2,400	1,867.000	4,480,800
日本モーゲージサービス	7,500	527.000	3,952,500
アルヒ	11,000	837.000	9,207,000
プレミアグループ	13,900	1,769.000	24,589,100
ネットプロテクションズホールディングス	17,200	243.000	4,179,600
クレディセゾン	51,400	2,490.500	128,011,700
芙蓉総合リース	7,400	12,000.000	88,800,000
みずほリース	11,900	4,960.000	59,024,000
東京センチュリー	15,100	5,892.000	88,969,200
日本証券金融	30,100	1,559.000	46,925,900
アイフル	135,400	379.000	51,316,600
リコーリース	7,600	4,640.000	35,264,000
イオンフィナンシャルサービス	46,500	1,267.000	58,915,500
アコム	148,500	348.500	51,752,250
ジャックス	8,600	5,370.000	46,182,000
オリエントコーポレーション	21,300	1,082.000	23,046,600
オリックス	501,500	2,698.500	1,353,297,750
三菱HCキャピタル	334,000	964.400	322,109,600
九州リースサービス	5,600	940.000	5,264,000
日本取引所グループ	214,800	3,019.000	648,481,200
イー・ギャランティ	13,700	1,942.000	26,605,400
アサックス	5,400	698.000	3,769,200
NECキャピタルソリューション	3,900	3,365.000	13,123,500
Robot Home	25,800	180.000	4,644,000
大東建託	29,700	16,300.000	484,110,000
いちご	100,700	351.000	35,345,700
日本駐車場開発	94,300	204.000	19,237,200
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	607.000	6,677,000
SREホールディングス	4,200	2,774.000	11,650,800
ヒューリック	188,500	1,468.000	276,718,000
野村不動産ホールディングス	50,500	3,604.000	182,002,000
三重交通グループホールディングス	19,100	572.000	10,925,200
サムティ	10,100	2,342.000	23,654,200
ディア・ライフ	15,000	876.000	13,140,000
地主	7,100	2,306.000	16,372,600
プレサンスコーポレーション	13,900	1,504.000	20,905,600
JPMC	5,600	1,123.000	6,288,800
フージャースホールディングス	13,400	1,058.000	14,177,200

オープンハウスグループ	29,700	4,128.000	122,601,600
東急不動産ホールディングス	243,300	914.000	222,376,200
飯田グループホールディングス	77,000	2,210.000	170,170,000
シーアールイー	5,300	1,576.000	8,352,800
ケイアイスター不動産	4,200	3,490.000	14,658,000
グッドコムアセット	8,900	1,009.000	8,980,100
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,561.000	11,268,400
ロードスターキャピタル	5,900	2,200.000	12,980,000
パーク24	53,500	1,802.500	96,433,750
パラカ	3,900	1,934.000	7,542,600
宮越ホールディングス	4,600	1,246.000	5,731,600
三井不動産	368,000	3,472.000	1,277,696,000
三菱地所	517,900	1,996.500	1,033,987,350
平和不動産	13,900	4,035.000	56,086,500
東京建物	72,700	2,101.500	152,779,050
京阪神ビルディング	15,700	1,418.000	22,262,600
住友不動産	123,700	4,174.000	516,323,800
テーオーシー	17,700	600.000	10,620,000
東京楽天地	1,800	4,300.000	7,740,000
レオパレス21	92,500	472.000	43,660,000
スターツコーポレーション	12,600	2,789.000	35,141,400
フジ住宅	12,700	715.000	9,080,500
空港施設	12,000	565.000	6,780,000
ゴールドクレスト	8,200	2,007.000	16,457,400
エスリード	4,200	3,180.000	13,356,000
日神グループホールディングス	15,200	495.000	7,524,000
日本エスコン	19,600	915.000	17,934,000
MIRARTHホールディングス	47,200	466.000	21,995,200
イオンモール	41,900	1,719.500	72,047,050
毎日コムネット	6,300	743.000	4,680,900
カチタス	22,400	2,150.000	48,160,000
トーセイ	14,600	1,801.000	26,294,600
穴吹興産	2,900	2,022.000	5,863,800
サンフロンティア不動産	15,500	1,560.000	24,180,000
FJネクストホールディングス	9,600	1,146.000	11,001,600
日本空港ビルデング	28,800	6,500.000	187,200,000
LIFULL	32,400	196.000	6,350,400
MIXI	19,100	2,417.000	46,164,700
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	2,661.000	19,957,500
日本M&Aセンターホールディングス	136,300	685.200	93,392,760
メンバーズ	3,100	1,100.000	3,410,000
UTグループ	12,300	2,215.000	27,244,500
アイティメディア	3,500	972.000	3,402,000
E・Jホールディングス	5,400	1,605.000	8,667,000

オープンアップグループ	25,200	2,159.000	54,406,800
コシダカホールディングス	25,600	1,043.000	26,700,800
アルトナー	2,000	1,807.000	3,614,000
パソナグループ	10,200	2,345.000	23,919,000
リンクアンドモチベーション	26,100	586.000	15,294,600
エス・エム・エス	30,700	2,810.000	86,267,000
パーソルホールディングス	884,400	254.800	225,345,120
リニカル	6,300	530.000	3,339,000
学情	4,500	2,021.000	9,094,500
スタジオアリス	4,800	2,064.000	9,907,200
N J S	1,500	2,827.000	4,240,500
総合警備保障	150,300	856.800	128,777,040
カカクコム	57,600	1,677.500	96,624,000
アイロムグループ	3,500	2,031.000	7,108,500
セントケア・ホールディング	5,600	936.000	5,241,600
ルネサンス	6,600	865.000	5,709,000
ディップ	13,500	3,170.000	42,795,000
デジタルホールディングス	5,500	1,265.000	6,957,500
新日本科学	7,700	1,647.000	12,681,900
キャリアデザインセンター	1,400	2,015.000	2,821,000
ベネフィット・ワン	31,000	1,515.000	46,965,000
エムスリー	169,000	2,445.500	413,289,500
アウトソーシング	54,400	1,200.000	65,280,000
ウェルネット	5,500	565.000	3,107,500
ワールドホールディングス	3,900	2,711.000	10,572,900
ディー・エヌ・エー	33,800	1,504.000	50,835,200
博報堂D Yホールディングス	107,800	1,115.500	120,250,900
タカミヤ	14,000	456.000	6,384,000
ファンコミュニケーションズ	15,000	417.000	6,255,000
ライク	3,800	1,364.000	5,183,200
エスプール	25,600	397.000	10,163,200
WDBホールディングス	4,500	2,313.000	10,408,500
アドウェイズ	12,200	551.000	6,722,200
バリューコマース	7,900	1,386.000	10,949,400
インフォマート	88,100	441.000	38,852,100
J Pホールディングス	27,100	391.000	10,596,100
プレステージ・インターナショナル	42,000	651.000	27,342,000
アミューズ	5,000	1,509.000	7,545,000
ドリームインキュベータ	2,800	3,230.000	9,044,000
クイック	5,800	2,257.000	13,090,600
電通グループ	83,200	3,985.000	331,552,000
ぴあ	3,100	3,315.000	10,276,500
イオンファンタジー	3,500	2,602.000	9,107,000
シーティーエス	10,600	667.000	7,070,200

H. U. グループホールディングス	24,800	2,569.000	63,711,200
アルプス技研	7,800	2,726.000	21,262,800
日本空調サービス	10,200	801.000	8,170,200
オリエンタルランド	449,000	5,025.000	2,256,225,000
ダスキン	21,000	3,258.000	68,418,000
明光ネットワークジャパン	13,800	717.000	9,894,600
ファルコホールディングス	4,300	2,117.000	9,103,100
ラウンドワン	78,000	590.000	46,020,000
リゾートトラスト	39,000	2,250.500	87,769,500
ビー・エム・エル	10,200	2,933.000	29,916,600
リソー教育	41,900	241.000	10,097,900
早稲田アカデミー	5,500	1,584.000	8,712,000
ユー・エス・エス	97,000	2,893.000	280,621,000
東京個別指導学院	12,400	480.000	5,952,000
サイバーエージェント	187,500	894.600	167,737,500
楽天グループ	725,600	585.700	424,983,920
クリーク・アンド・リバー社	5,100	2,093.000	10,674,300
S B I グローバルアセットマネジメント	15,800	557.000	8,800,600
テー・オー・ダブリュー	19,300	324.000	6,253,200
山田コンサルティンググループ	3,100	1,850.000	5,735,000
セントラルスポーツ	3,700	2,454.000	9,079,800
フルキャストホールディングス	8,000	1,917.000	15,336,000
エン・ジャパン	15,200	2,588.000	39,337,600
テクノプロ・ホールディングス	50,100	3,434.000	172,043,400
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	1,565.000	7,355,500
K e e P e r 技研	5,000	5,880.000	29,400,000
G u n o s y	8,100	696.000	5,637,600
イー・ガーディアン	3,700	1,539.000	5,694,300
ジャパンマテリアル	26,000	2,597.000	67,522,000
ベクトル	11,700	1,093.000	12,788,100
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,199.000	8,872,600
キャリアリンク	3,200	2,188.000	7,001,600
I B J	7,100	739.000	5,246,900
アサンテ	5,200	1,616.000	8,403,200
バリューHR	8,000	1,498.000	11,984,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,900	2,267.000	15,642,300
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,017.000	4,271,400
E R I ホールディングス	1,900	1,723.000	3,273,700
アビスト	500	3,040.000	1,520,000
シグマクシス・ホールディングス	11,300	1,326.000	14,983,800
ウィルグループ	7,000	1,119.000	7,833,000
メドピア	7,700	768.000	5,913,600
リクルートホールディングス	628,000	5,505.000	3,457,140,000
エラン	11,500	1,019.000	11,718,500

日本郵政	999,800	1,304.500	1,304,239,100
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,664.000	19,302,400
鎌倉新書	7,400	583.000	4,314,200
エアトリ	6,500	1,571.000	10,211,500
アトラエ	5,900	717.000	4,230,300
ストライク	3,800	3,880.000	14,744,000
ソラスト	23,700	587.000	13,911,900
セラク	2,900	1,339.000	3,883,100
インソース	18,500	955.000	17,667,500
ベिकाレント・コンサルティング	62,200	4,976.000	309,507,200
アイモバイル	14,100	459.000	6,471,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	27,300	2,350.000	64,155,000
グリーンズ	2,400	1,941.000	4,658,400
ウェルビー	5,400	745.000	4,023,000
エル・ティー・エス	1,300	3,885.000	5,050,500
ミダックホールディングス	5,300	1,752.000	9,285,600
キュービーネットホールディングス	4,700	1,521.000	7,148,700
RPAホールディングス	13,400	302.000	4,046,800
マネジメントソリューションズ	3,800	2,919.000	11,092,200
フロンティア・マネジメント	2,300	1,565.000	3,599,500
アンビスホールディングス	8,600	2,875.000	24,725,000
カーブスホールディングス	23,200	667.000	15,474,400
フォーラムエンジニアリング	10,200	795.000	8,109,000
FAST FITNESS JAPAN	3,400	1,115.000	3,791,000
ダイレクトマーケティングミックス	10,900	461.000	5,024,900
LITALICO	6,700	2,141.000	14,344,700
リログループ	45,700	1,553.000	70,972,100
東祥	6,900	816.000	5,630,400
ID&Eホールディングス	5,100	3,275.000	16,702,500
ビーウィズ	2,400	2,271.000	5,450,400
TREホールディングス	17,900	1,122.000	20,083,800
人・夢・技術グループ	3,600	1,854.000	6,674,400
NISSOホールディングス	6,800	786.000	5,344,800
大栄環境	15,500	2,321.000	35,975,500
日本管財ホールディングス	8,400	2,488.000	20,899,200
M&A総研ホールディングス	4,000	3,800.000	15,200,000
エイチ・アイ・エス	24,700	1,722.000	42,533,400
ラックランド	4,100	2,735.000	11,213,500
共立メンテナンス	14,300	5,739.000	82,067,700
イチネンホールディングス	9,100	1,543.000	14,041,300
建設技術研究所	4,400	4,855.000	21,362,000
スペース	7,100	907.000	6,439,700
燦ホールディングス	7,600	1,104.000	8,390,400
スバル興業	500	13,230.000	6,615,000

東京テアトル	5,000	1,092.000	5,460,000
タナベコンサルティンググループ	1,500	1,040.000	1,560,000
ナガワ	2,900	6,690.000	19,401,000
東京都競馬	7,200	4,410.000	31,752,000
カナモト	14,400	2,580.000	37,152,000
ニシオホールディングス	7,600	3,640.000	27,664,000
トランス・コスモス	10,400	3,100.000	32,240,000
乃村工藝社	36,600	840.000	30,744,000
藤田観光	3,800	3,970.000	15,086,000
KNT-CTホールディングス	2,000	1,245.000	2,490,000
トーカイ	7,500	1,915.000	14,362,500
セコム	86,200	10,295.000	887,429,000
セントラル警備保障	4,700	2,454.000	11,533,800
丹青社	17,000	890.000	15,130,000
メイテックグループホールディングス	32,500	2,867.500	93,193,750
応用地質	7,800	2,091.000	16,309,800
船井総研ホールディングス	17,600	2,521.000	44,369,600
いであ	2,500	1,756.000	4,390,000
学究社	4,200	1,934.000	8,122,800
イオンディライト	9,200	3,515.000	32,338,000
ダイセキ	17,300	3,920.000	67,816,000
ステップ	3,200	1,875.000	6,000,000
合 計	123,739,300		277,901,462,330

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

② 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）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

2023年12月29日現在

I 資産総額	111,019,554,566 円
II 負債総額	175,151,241 円
III 純資産総額 (I - II)	110,844,403,325 円
IV 発行済口数	27,426,687,144 口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	4.0415 円
(1万口当たり純資産額)	(40,415 円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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また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は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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たときまた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。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金およ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】

イ 資本金の額および株式数

	2023年12月29日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

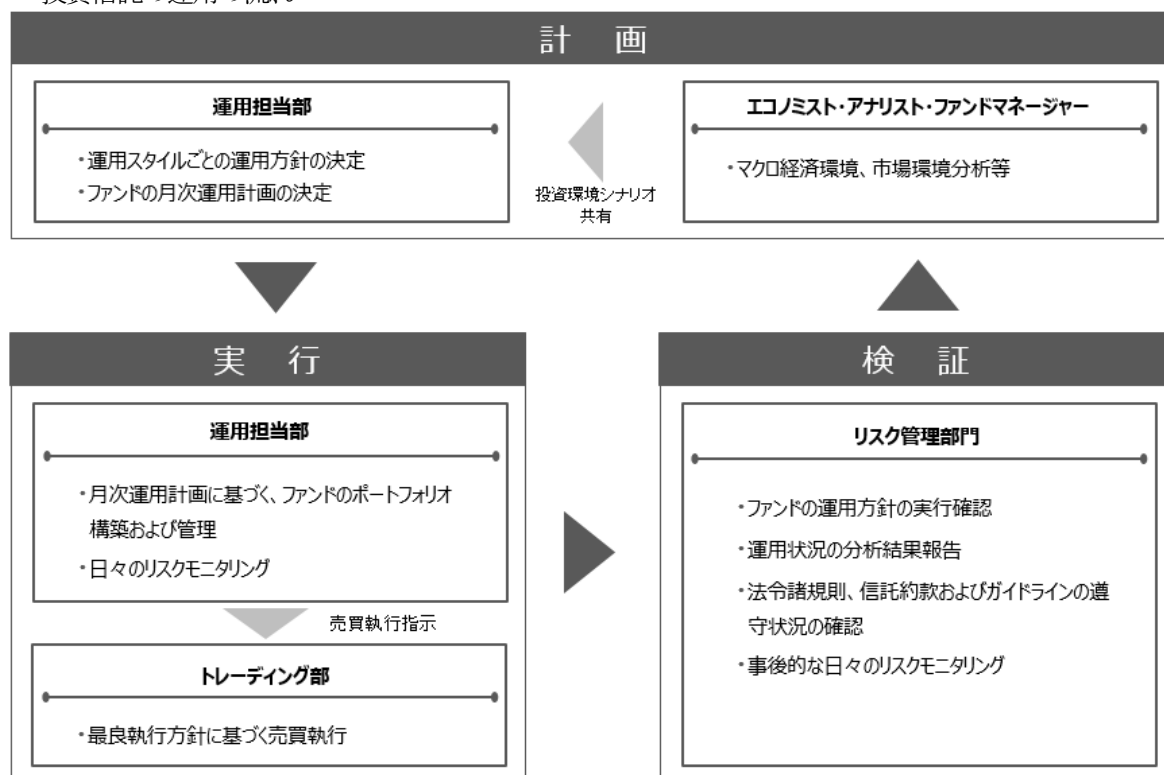
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

ニ 投資信託の運用の流れ



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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2023年12月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	691	11,388,930
単位型株式投資信託	98	672,908
追加型公社債投資信託	1	25,097
単位型公社債投資信託	159	257,300
合計	949	12,344,237

3 【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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 条の規定により、「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）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定により、「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）に基づいて作成しております。
なお、当中間会計期間（2023 年 4 月 1 日から 2023 年 9 月 30 日まで）は、改正府令附則第 3 条第 1 項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

- 2 当社は、第 38 期（2022 年 4 月 1 日から 2023 年 3 月 31 日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第 39 期中間会計期間（2023 年 4 月 1 日から 2023 年 9 月 30 日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年6月15日

三井住友DS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

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

佐藤 栄裕

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DSアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第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DSアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月17日

三井住友DS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

佐藤 栄裕

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

深井 康治

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DS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39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、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. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423
流動資産合計	64,893,375	65,762,982
固定資産		
有形固定資産 ※1		
建物	1,433,442	1,361,305
器具備品	653,985	559,057
土地	710	710
リース資産	7,357	4,114
建設仮勘定	5,500	81,240
有形固定資産合計	2,100,996	2,006,427
無形固定資産		
ソフトウェア	2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定	100,616	508,956
のれん	3,349,950	3,045,409
顧客関連資産	13,558,615	11,445,340
電話加入権	12,716	12,706
商標権	42	36
無形固定資産合計	19,788,417	17,426,744
投資その他の資産		
投資有価証券	14,212,354	9,222,276
関係会社株式	11,246,398	11,850,598
長期差入保証金	1,414,646	1,388,987
長期前払費用	77,936	80,207
会員権	90,479	90,479
貸倒引当金	△20,750	△20,750
投資その他の資産合計	27,021,065	22,611,799
固定資産合計	48,910,479	42,044,971
資産合計	113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
未払金		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	△ 142,558
評価・換算差額等合計	297,138	△ 142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支援手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492
交際費	12,301	27,713
寄付金	29,273	25,518
事務委託費	1,422,189	1,727,189
旅費交通費	16,863	99,733
租税公課	476,729	352,030
不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033
投資有価証券売却益	911,268	25,848
為替差益	4,673	5,816
雑収入	81,640	91,814
営業外収益合計	1,436,686	248,443
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	454,339
投資有価証券償還損	146,219	83,598
投資有価証券売却損	81,384	152,691
雑損失	2,866	-
営業外費用合計	230,470	690,629
経常利益	7,041,212	3,347,770
特別損失		
固定資産除却損	※1 83,651	13,203
システム統合関連費用	※2 375,636	-
早期退職費用	※3 260,075	126,832
支払補償費	※4 -	30,075
その他特別損失	67,000	-
特別損失合計	786,362	170,111
税引前当期純利益	6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税	3,101,482	1,622,064
法人税等調整額	△965,673	△541,433
法人税等合計	2,135,809	1,080,631
当期純利益	4,119,040	2,097,028

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	△10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			△8,460,037	△8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の取崩						△60,000	△1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	—	—	△8,460,037	△8,460,037	—	△60,000	△1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	—	—	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	△8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	—			—
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	—	—			—
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			△652,227	△652,227	△652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	△652,227	△652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当期変動額						
剰余金の配当						△ 2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	—	—	—	—	—	△ 443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
剰余金の配当	△ 2,540,254	△ 2,540,254			△ 2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			△ 439,697	△ 439,697	△ 439,697
当期変動額合計	△ 443,225	△ 443,225	△ 439,697	△ 439,697	△ 882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	△ 142,558	△ 142,558	87,629,201

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

① 子会社株式

移動平均法による原価法

② その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

(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)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託：時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第 31 号 2021 年 6 月 17 日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第 27-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針 27-3 項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」注記については記載していません。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)
建物	210,548 千円	301,463 千円
器具備品	1,309,352 千円	1,499,284 千円
リース資産	6,073 千円	7,493 千円

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行 1 行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)
当座借越極度額の総額	10,000,000 千円	10,000,000 千円
借入実行残高	— 千円	— 千円
差引額	10,000,000 千円	10,000,000 千円

3 保証債務

当社は、子会社である Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc. における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023 年 6 月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	57,356 千円	12,514 千円

(損益計算書関係)

※1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
建物	一千円	2,482 千円
器具備品	0 千円	4,273 千円
リース資産	一千円	532 千円
ソフトウェア	83,651 千円	5,915 千円

※2 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

※3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

※4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

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

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060 株	—	—	33,870,060 株

2. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

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

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060 株	—	—	33,870,060 株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかか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、投資信託保有残高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。

なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。

また、資金調達を行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

①信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

金銭の信託、投資有価証券及び子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

②市場リスクの管理

金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（注1 参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	—	—	—
(2) 投資有価証券			
① その他有価証券	14,172,545	14,172,545	—
資産計	14,172,545	14,172,545	—

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	12,645,575	12,645,575	—
(2) 投資有価証券			
① その他有価証券	9,182,466	9,182,466	—
資産計	21,828,042	21,828,042	—

（注1）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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。なお、時価算定会計基準適用指針 27-3 項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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又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。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	12,645,575	—	12,645,575
(2) 投資有価証券				
① その他有価証券	—	9,182,466	—	9,182,466
資産計	—	21,828,042	—	21,828,042

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

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券① その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 関係会社株式 11,246,398 千円) は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)

子会社株式 (貸借対照表計上額 関係会社株式 11,850,598 千円) は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,873,482	5,039,817	△166,335
小計	4,873,482	5,039,817	△166,335
合計	14,172,544	13,712,543	460,001

(注) 非上場株式等 (貸借対照表計上額 39,809 千円) については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,038,462	6,295,278	△256,815
小計	6,038,462	6,295,278	△256,815
合計	9,182,466	9,349,645	△167,178

(注) 非上場株式等 (貸借対照表計上額 39,809 千円) については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

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

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,675,637	25,848	152,691

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	5,258,448	5,084,506
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の発生額	△34,553	△12,781
退職給付の支払額	△595,013	△479,583
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	5,084,506	5,027,832

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (2023 年 3 月 31 日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
未認識数理計算上の差異	—	—
未認識過去勤務費用	—	—
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の費用処理額	△34,553	△12,781
その他	211,487	201,641
確定給付制度に係る退職給付費用	632,559	624,551

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎 (加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
割引率	0.130%	0.230%

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 237,296 千円、当事業年度 241,556 千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
(単位：千円)		
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	△189,102	△193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	△1,279,409	△550,493

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	—	△1.3
その他	0.3	△1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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)

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

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	—	投資の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,727,024	未払手数料	1,098,966
親会社の子会社	SMBG 日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	—	投資の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	8,397,864	未払手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ (東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

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

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	—	投資の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	5,279,199	未払手数料	1,265,651
親会社の子会社	SMBG 日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	—	投資の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	7,030,381	未払手数料	1,288,749

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ (東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益 (千円)	4,119,040	2,097,028
普通株主に帰属しない金額 (千円)	—	—
普通株式に係る当期純利益 (千円)	4,119,040	2,097,028
期中平均株式数 (株)	33,870,060	33,870,060

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		71,777,366
金銭の信託		12,836,073
顧客分別金信託		300,049
前払費用		544,624
未収委託者報酬		13,133,566
未収運用受託報酬		2,879,922
未収投資助言報酬		463,644
未収収益		67,881
その他		193,812
流動資産合計		102,196,941
固定資産		
有形固定資産	※1	1,897,269
無形固定資産		
のれん		2,893,139
顧客関連資産		10,388,702
その他		2,893,330
無形固定資産合計		16,175,172
投資その他の資産		
投資有価証券		9,623,355
関係会社株式		1,927,221
繰延税金資産		128,142
その他		1,543,634
貸倒引当金		△ 20,750
投資その他の資産合計		13,201,604
固定資産合計		31,274,046
資産合計		133,470,988
負債の部		
流動負債		
リース債務		2,070
顧客からの預り金		11,882
その他の預り金		161,963
未払金		6,019,407
未払費用		6,744,050
未払法人税等		3,908,872
前受収益		21,118
賞与引当金		2,110,575
資産除去債務		13,940
その他	※2	623,468
流動負債合計		19,617,350
固定負債		

リース債務	1, 172
退職給付引当金	5, 235, 679
固定負債合計	<u>5, 236, 852</u>
負債合計	<u>24, 854, 202</u>
純資産の部	
株主資本	
資本金	2, 000, 000
資本剰余金	
資本準備金	8, 628, 984
その他資本剰余金	73, 466, 962
資本剰余金合計	<u>82, 095, 946</u>
利益剰余金	
利益準備金	284, 245
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	24, 226, 602
利益剰余金合計	<u>24, 510, 847</u>
株主資本合計	<u>108, 606, 793</u>
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	9, 992
評価・換算差額等合計	<u>9, 992</u>
純資産合計	<u>108, 616, 786</u>
負債純資産合計	<u>133, 470, 988</u>

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
営業収益			
委託者報酬			33,390,366
運用受託報酬			4,611,539
投資助言報酬			646,058
その他の営業収益			137,072
営業収益計			<u>38,785,036</u>
営業費用			26,393,207
一般管理費	※1		10,162,729
営業利益			<u>2,229,099</u>
営業外収益	※2		11,280,120
営業外費用	※3		51,894
経常利益			<u>13,457,325</u>
特別利益	※4		14,096,622
特別損失	※5		358
税引前中間純利益			<u>27,553,589</u>
法人税、住民税及び事業税			5,843,255
法人税等調整額			△ 716,591
法人税等合計			<u>5,126,663</u>
中間純利益			<u>22,426,926</u>

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金
						繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						△1,591,892
中間純利益						22,426,926
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	—	—	—	—	—	20,835,033
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	24,226,602

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,675,814	87,771,760	△142,558	△142,558	87,629,201
当中間期変動額					
剰余金の配当	△1,591,892	△1,591,892			△1,591,892
中間純利益	22,426,926	22,426,926			22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額 (純額)			152,551	152,551	152,551
当中間期変動額合計	20,835,033	20,835,033	152,551	152,551	20,987,584
当中間期末残高	24,510,847	108,606,793	9,992	9,992	108,616,786

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

① 子会社株式

移動平均法による原価法

② その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(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)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

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。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
※1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,963,152 千円
※2. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	
※3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。 当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000 千円
借入実行残高	—
差引額	10,000,000 千円

(中間損益計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
※1. 一般管理費のうち主要なもの のれん償却費 減価償却実施額 有形固定資産 無形固定資産	152,270 千円 155,138 千円 1,475,775 千円
※2. 営業外収益のうち主要なもの 受取配当金 投資有価証券売却益 金銭の信託運用益	11,020,394 千円 2,513 千円 190,497 千円
※3. 営業外費用のうち主要なもの 為替差損 投資有価証券償還損 投資有価証券売却損	1,978 千円 883 千円 48,575 千円
※4. 特別利益のうち主要なもの 子会社株式売却益	14,096,622 千円
※5. 特別損失のうち主要なもの 固定資産除却損	358 千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060 株	—	—	33,870,060 株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

(リース取引関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料 (解約不能のもの)	
1年以内	1,161,545 千円
1年超	580,772 千円
合 計	1,742,317 千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注1)参照)。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	12,836,073	12,836,073	—
(2) 投資有価証券			
① その他有価証券	9,582,998	9,582,998	—
資産計	22,419,071	22,419,071	—

(注1) 市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	40,356
合計	40,356
子会社株式	
非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、1. 金融商品の時価等に関する事項及び2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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又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。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	—	12,836,073	—	12,836,073
(2) 投資有価証券				
① その他有価証券	—	9,582,998	—	9,582,998
資産計	—	22,419,071	—	22,419,071

(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

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券①その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	3,341,749	3,156,408	185,340
小計	3,341,749	3,156,408	185,340
(2) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託等	6,241,249	6,403,283	△162,034
小計	6,241,249	6,403,283	△162,034
合計	9,582,998	9,559,692	23,306

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 40,356千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14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、潜在株式が存在しないため記載していません。

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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の実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。)または子法人等(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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

追加型証券投資信託
三井住友・DCつみたてNISA・
日本株インデックスファンド
約款

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〕

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通りとします。

1. 基本方針

この投資信託は、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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指して運用を行う国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（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。

(2) 投資態度

- ① マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、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指して運用を行います。
- 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。
- ③ 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。
- ④ 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- ⑤ 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。

(3) 投資制限

- ① 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- ③ 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。
- 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ととします。
- ⑤ 有価証券先物取引等は、約款第22条の範囲内で行います。
- ⑥ スワップ取引は、約款第23条の範囲内で行います。
- ⑦ 金利先渡取引は、約款第24条の範囲内で行います。
- ⑧ 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、価格変動リスクおよび金利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。

3. 収益分配方針

年1回（原則として毎年11月30日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- 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。
- ② 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により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定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
『三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド』
【信託約款】

【信託の種類、委託者および受託者】

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三井住友DS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。以下この条、第18条第1項および第2項、第28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。

【信託の目的および金額】

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けません。

【信託金の限度額】

第4条 委託者は、受託者と合意の上、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、受託者と合意の上、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、信託契約締結日から第46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50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 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

【当初の受益者】

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第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。

【受益権の分割および再分割】

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第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、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

【追加信託の価額および口数、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、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第27条に規定する借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た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。

【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 この信託のすべての受益権は、社振法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。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機

関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- ③ 委託者は、第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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

【受益権の設定にかかる受託者の通知】

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、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かかる信託を設定した旨の通知を行います。

【受益権の申込単位および価額】

第13条 委託者および指定販売会社(委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。)は、第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、委託者および当該指定販売会社がそれぞれ別に定める単位をもって取得申込みに応じることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は、委託者または指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者(第42条の2に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。)および指定販売会社は、当該取得申込みの代金(第3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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、委託者および指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みにかかる受益権の価額は、1口につき1円に、指定販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
- ④ 前項の規定にかかわらず、受益者が第42条第2項または第3項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36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、委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよび既に受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。
- ⑥ この約款において取引所とは金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場およ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をいいます。

【受益権の譲渡にかかる記載または記録】

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または記録されている振替口座簿にかか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、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、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。)に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを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または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

【投資の対象とする資産の種類】

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利
 - ハ. 約束手形
- ニ. 金銭債権
2. 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産
 - 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、三井住友DSアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券または次の有価証券（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きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の

受益証券に限ります。)

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

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第17条の2 委託者は、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。

【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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、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。）および受託者の利害関係人、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資等ならびに第21条から第27条まで、および第31条から第33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、受託者また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ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役およ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項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資等ならびに第21条から第27条まで、および第31条から第33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、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第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、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。

【投資する株式等の範囲】

第20条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

【信用取引の指図】

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とし、
- ③ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ④ 信託財産の一部解約等の事由により、第2項の売付けにかかる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売付けの一部を決済するための指図をするものとし、

【先物取引等の指図】

第22条 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとし、（以下同じ。）、

- ② 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

【スワップ取引の指図】

第23条 委託者は、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（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとし、
- ④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとし、
- ⑤ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

【金利先渡取引の指図】

第24条 委託者は、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- ⑤ 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑥ 本条において「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

【有価証券の貸付けの指図】

- 第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - ③ 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

【有価証券の空売りの指図】

- 第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または第27条の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
 - ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

【有価証券の借入れの指図】

- 第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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するものとします。
- ② 前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
 - ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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項の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【信託業務の委託等】

第28条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合する者（受託者の利害関係人を含みません。）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かかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行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2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存にかかる業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
 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29条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第2条第9項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した、外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第30条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 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または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【一部解約の請求および有価証券の売却等の指図】

第31条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

【再投資の指図】

第32条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【資金の借入れ】

第33条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当て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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入れ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てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または

償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ③ 収益分配金の再投資にかかる借入期間は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 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【損益の帰属】

第34条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

【受託者による資金の立替え】

第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第36条 この信託の計算期間は、毎年12月1日から翌年11月30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23年12月9日から平成24年11月30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。

【信託財産に関する報告等】

第37条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、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、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項に定める書類また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およ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項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

【信託事務等の諸費用】

第38条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査費用等（消費税等相当額を含みます。）、受託者の立て替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 委託者は、前項に定める信託財産の財務諸表の監査費用等の支払いを信託財産のために行い、その支弁を信託財産から受けます。また、委託者は、金額をあらかじめ合理的に見積もった上、実際の費用額にかかわらず一定率または一定金額にて信託財産中から支弁します。
- ③ 委託者は、前項において一定の率または一定の金額を定める場合、信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。
- ④ 信託財産の財務諸表の監査費用等については、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、固定率または固定金額にて計算した額を、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

【信託報酬等の額】

第39条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の16の率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ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに、信託財産中から支弁します。

【収益の処理方法】

第40条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品賃料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかか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、信託報酬および当該信託報酬にかか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てんした後、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、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

【収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責】

第41条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第42条第5項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第42条第6項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

【収益分配金、償還金および一部解約金の支払いならびに収益分配金の再投資】

第42条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかか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かかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかか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委託者または指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める「累積投資約款」に従った契約（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、その場合は、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部もしくは一部について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じたものとします。当該受益権の取得申込みに応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④ 委託者は、前項の受益者が有する受益権の全部の口数について第44条第2項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、前項の規定にかかわらず、そのつど受益者に支払います。
- ⑤ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等

の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかか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委託者または指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)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、当該償還にかか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または記録が行われます。

- ⑥ 一部解約金は、第44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5営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑦ 前各項(第2項および第3項を除きます。)に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとし、ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは委託者において行うものとし、
- ⑧ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

【委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関】

第42条の2 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

【収益分配金および償還金の時効】

第43条 受益者が、収益分配金については第42条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第42条第5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。

【信託契約の一部解約】

第44条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前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かかるこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約にかか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または記録が行われます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。
- ④ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、
- ⑤ 委託者は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付け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けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止前に行った実行されていない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、当該受付け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3項の規定に準じて算出した価額とします。

【質権口記載または記録の受益権の取扱い】

第45条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

【信託契約の解約】

第46条 委託者は、信託期間中において、この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、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、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、書面決議の日ならびに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、この信託契約にかか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（委託者およびこの信託の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かか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 第2項から前項までの規定は、委託者が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、この信託契約にかかるすべての受益者が書面また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、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第47条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、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信託約款を変更しようとするときは、第51条の規定に従います。

【委託者の登録取消等に伴う取扱い】

第48条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この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51条第2項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および承継に伴う取扱い】

第49条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第50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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第51条の規定に従い、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、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

【信託約款の変更等】

第51条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することまた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、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この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「重大な信託約款の変更等」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、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およ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、この信託約款にかか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(委託者およびこの信託の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かか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、この信託のすべ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、委託者が重大な信託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、この信託約款にかかるすべての受益者が書面また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つても、当該併合にかかる一また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。

【反対受益者の受益権買取請求の不適用】

第52条 この信託は、受益者が第44条の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第46条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

【他の受益者の氏名等の開示の請求の制限】

第53条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、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. 他の受益者の氏名または名称および住所
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53条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

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

【公告】

第54条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.smd-am.co.jp>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第55条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成23年12月9日（信託契約締結日）

委託者 東京都港区愛宕二丁目5番1号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役 前田 良治

受託者 大阪府大阪市中央区北浜四丁目5番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長 常陰 均

親投資信託
国内株式インデックス・マザーファンド（B号）
約款

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〕

約款第12条に基づき委託者の定める方針は、次の通りとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 運用方針

- ① 主としてT O P I X（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資を行い、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ② 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、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。
- ③ 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(3) 投資制限

- ① 外貨建資産への投資は行いません。
- ② 株式への投資割合には制限を設けません。
- ③ 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。
- ④ 有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲内で行います。
- ⑤ 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、価格変動リスクおよび金利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。

親投資信託
『国内株式インデックス・マザーファンド（B号）』
〔約款〕

【信託の種類、委託者および受託者】

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、三井住友DS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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

【信託事務の委託】

第1条の2 受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

【信託の目的および金額】

第2条 委託者は、金300億円を上限として、もしくは自らが委託者として設定する他の証券投資信託（信託の元本および収益の管理および運用に関する事項（投資対象とする資産の種類を含みます。）がこの信託と同一性を有するものに限り、以下同じ。）の信託財産に属する有価証券（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則に規定するものに限り、以下「信託適格有価証券」といいます。）を金300億円相当を上限として、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。

- ② 前項に規定する信託適格有価証券とは、次の各号の有価証券および金融商品取引法第2条第1項第20号に掲げる有価証券（次の各号の有価証券に該当するものを除きます。）であって次の各号の有価証券に係る権利を表示するものをいいます。

1. 取引所に上場されている有価証券

2. 店頭売買有価証券（金融商品取引法第2条第8項第10号ハに規定する店頭売買有価証券をいいます。以下同じ。）

3. 第1号および第2号に掲げる有価証券以外の有価証券で次に掲げるもの。

イ. 金融商品取引法第2条第1項第1号から第5号までに掲げる有価証券（同項第17号に掲げる有価証券であって、これらの有価証券の性質を有するものを含みます。ロ. において同じ。）

ロ. 金融商品取引法第2条第1項第9号に掲げる有価証券のうち、その価格が認可金融商品取引業協会（同条第13項に規定する認可金融商品取引業協会をいいます。以下同じ。）又は外国において設立されているこれと類似の性質を有する団体の定める規則に基づいて公表されているもの。

ハ. 金融商品取引法第2条第1項第10号、第11号および第19号に掲げる有価証券

- ③ この約款において取引所とは金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場およ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をいいます。

【信託金の限度額】

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円もしくは5,000億円相当の信託適格有価証券を限度として信託金もしくは信託適格有価証券を追加することができます。

- ② 追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

【信託適格有価証券での信託の方法】

第4条 他の証券投資信託が、この信託の受益権を信託適格有価証券により取得する場合は、当該信託適格有価証券について前日の公表されている最終価格に基づき算出された価格又はこれに準ずるものとして合理的な方法により算出した価格をもって、それに相当する口数のこの信託にかかる受益証券の取得をするものとします。

【信託期間】

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第37条第1項および第2項、第38条第1項、第39条第1項および第41条第2項の規定による信託終了の日までとします。

【受益証券の取得申込みの勧誘の種類】

第6条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項で定める適格機関投資家私募により行われます。

【受益者】

第7条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする三井住友D S アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

【受益権の分割および再分割】

第8条 委託者は、第2条の信託により生じた受益権については300億口を上限とした口数に、追加信託によって生じた受益権についてはこれを追加信託のつど第10条の追加口数に、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ます。

【信託日時の異なる受益権の内容】

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

【追加信託金の計算方法】

第10条 追加信託金もしくは、追加信託に係る信託適格有価証券の価額の総額は、追加信託を行う日の前営業日の信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会の定めるところにしたがい時価評価して得た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。）を受益権総口数で除した金額に、当該金額に0.08%の率を乗じて得た額を追加信託時の信託財産留保額として加算した金額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

【受益証券の発行、種類および受託者による認証】

第11条 委託者は、第8条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

② 委託者は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券を発行します。

③ 委託者は、受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

④ 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

⑤ 受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

【運用の基本方針】

第12条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

【投資の対象とする資産の種類】

第13条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、本約款第16条に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

【運用の指図範囲等】

第14条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券（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き、かつ本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

5. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といい、第2号および第3号の証券を以下「公社債」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2

条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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

- 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には、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をすることができます。

【デリバティブ取引等にかかる投資制限】

第14条の2 委託者は、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。

【投資する株式の範囲】

第15条 委託者が投資することを指図する株式は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図できるものとし、

【先物取引等の運用指図、目的、範囲】

第16条 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、

【有価証券の貸付の指図および範囲】

第17条 委託者は、信託財産に属する株式および公社債を、次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとし、
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとし、

- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとし、

- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、

【保管業務の委任】

第18条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

【有価証券の保管】

第19条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

【混蔵寄託】

第20条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第2条第9項に規定するものをいいます。本条においては、外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者を含みます。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとし、

【一括登録】

第21条 （削 除）

【信託財産の登記等および記載等の留保等】

第22条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 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または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

【有価証券の売却等の指図】

第23条 委託者は、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24条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

【損益の帰属】

第25条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

【資金の借入れ】

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用および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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から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信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

【受託者による資金の立替え】

第27条 信託財産に属する有価証券等について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券等に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

【信託の計算期間】

第28条 この信託の計算期間は、毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則とします。ただし、第1期の計算期間は平成15年2月17日から平成15年11月30日までとします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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。

【信託財産に関する報告】

第29条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、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、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

【信託事務の諸費用】

第30条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

【信託報酬】

第31条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

【利益の留保】

第32条 信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、収益の分配は行いません。

【追加信託金および一部解約金の計理処理】

第33条 追加信託金（追加信託に係る信託適格有価証券の価額を含みます。）または信託の一部解約金は当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

【償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責】

第34条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額に償還口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

【償還金の支払い】

第35条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

【一部解約】

第36条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、信託の一部を解約します。

- ② 解約金は、一部解約を行う日の前営業日の信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額から、当該金額に0.08%の率を乗じて得た額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約に係る受益権の口数を乗じた額とします。

【信託契約の解約】

第37条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、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、この信託の受益証券を投資対象とする全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- ④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- ⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

【信託契約に関する監督官庁の命令】

第38条 委託者は、監督官庁よりこの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、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信託約款を変更しようとするときは、第42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39条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、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42条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

【委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い】

第40条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

【受託者の辞任および解任に伴う取扱い】

第41条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第42条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

【信託約款の変更】

第42条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

【反対者の買取請求権】

第43条 第37条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第37条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

【利益相反のおそれがある場合の受益者への書面交付】

第44条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

【運用報告書】

第45条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

【公告】

第46条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.smd-am.co.jp>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は日本経済新聞に掲載します。

【信託約款に関する疑義の取扱い】

第47条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日平成15年2月17日

委託者 東京都港区愛宕二丁目5番1号
三井住友アセットマネジメント株式会社
代表取締役 井上 恵介

受託者 大阪府中央区北浜四丁目5番33号
住友信託銀行株式会社
取締役社長 高橋 温