

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DC日本株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックス・オープン

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2021年 7月 1日から2021年12月28日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔 月) 年12回 (毎 月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニ ア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投 資 信 託 証 券 (株 式 一 般))		アフリカ 中近東 (中 東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円ででの為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをい

う。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

[決算頻度による属性区分]

(1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

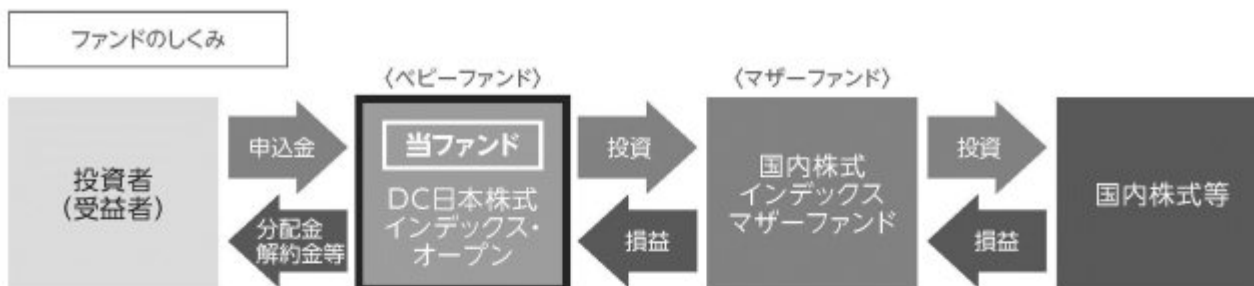
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

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



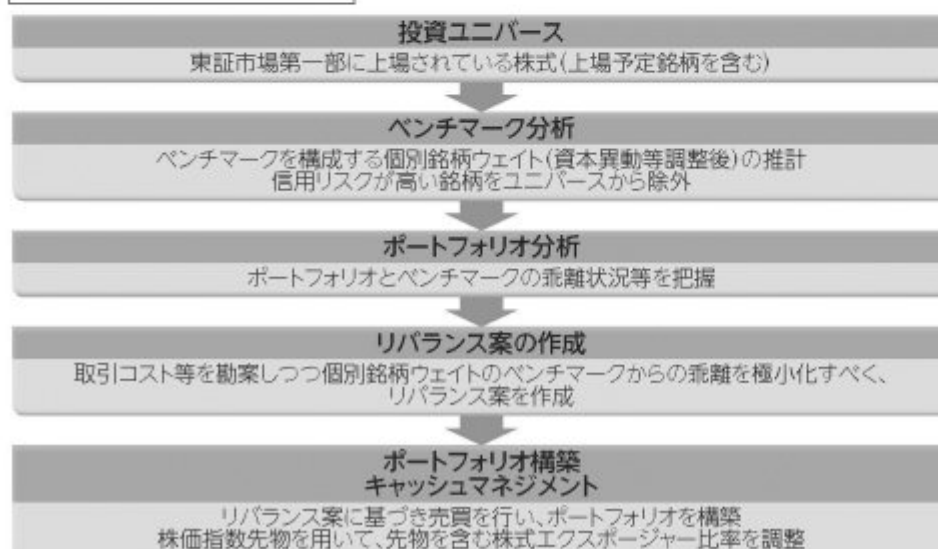
? ファミリーファンド方式とは

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

〈マザーファンドの概要〉

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

? TOPIX(東証株価指数)とは

株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

TOPIX(東証株価指数)の著作権等について

- TOPIX(東証株価指数)の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有し

ています。

- 2．東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- 3．東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 4．東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- 5．当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
- 6．東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 7．東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 8．以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

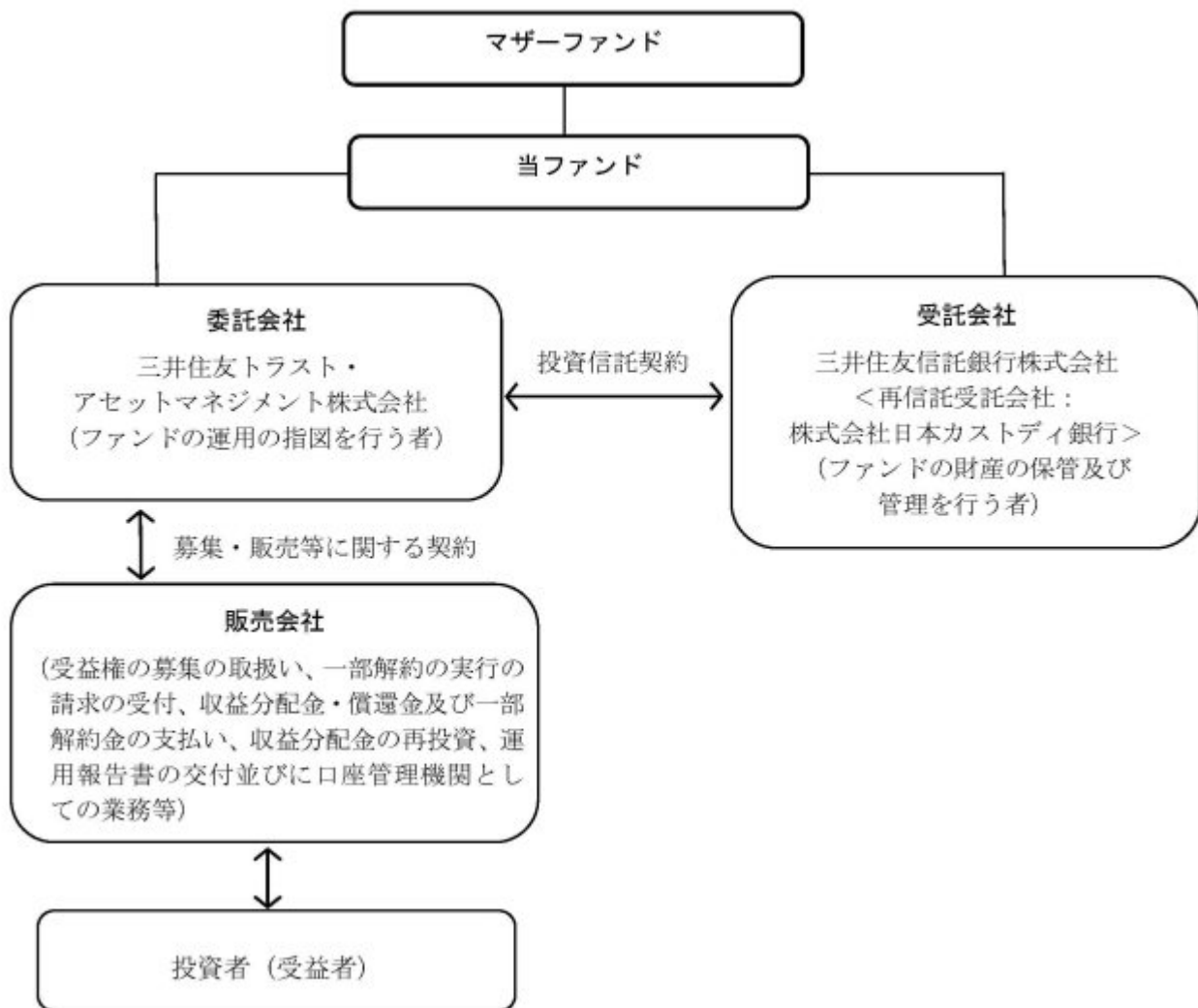
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2001年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月 1日	本ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープン」から「DC日本株式インデックス・オープン」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 4月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

（ロ）運用方法

投資対象

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1.株券または新株引受権証書

2.国債証券

3.地方債証券

4.特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で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号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- (八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- (二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融

商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

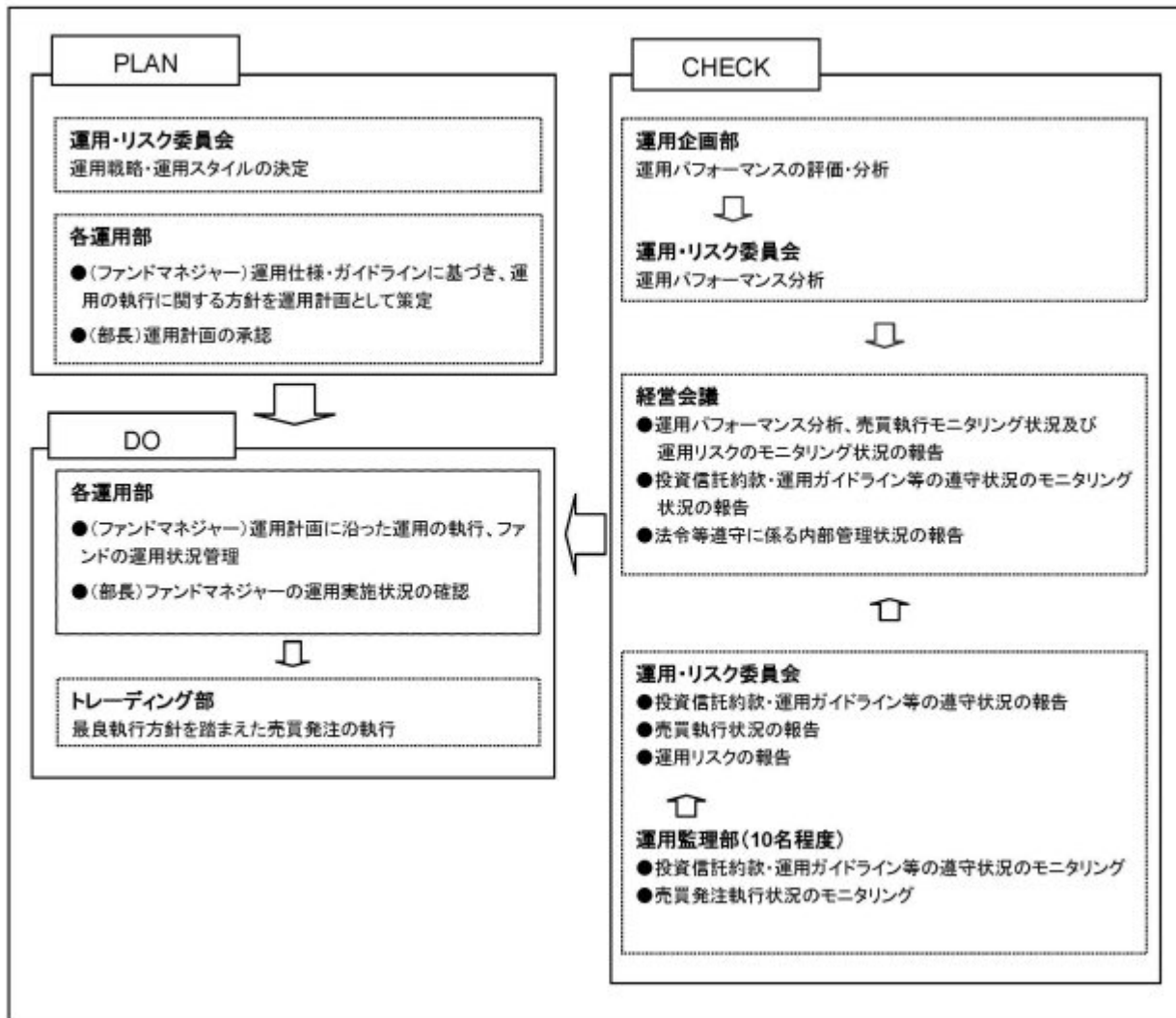
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

・ 留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

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

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを

回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（投資信託約款第23条）

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

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第32条）

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

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

前記 および から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 および から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

ることを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

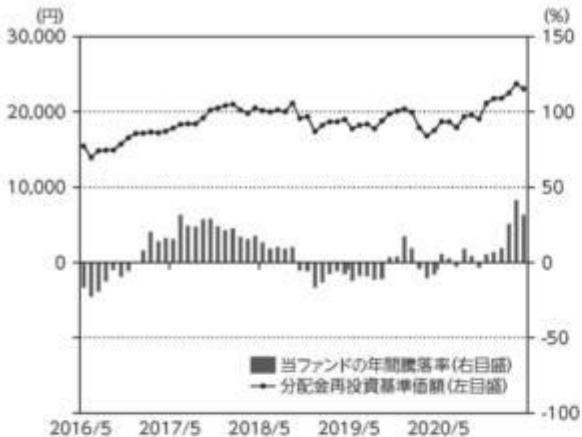
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

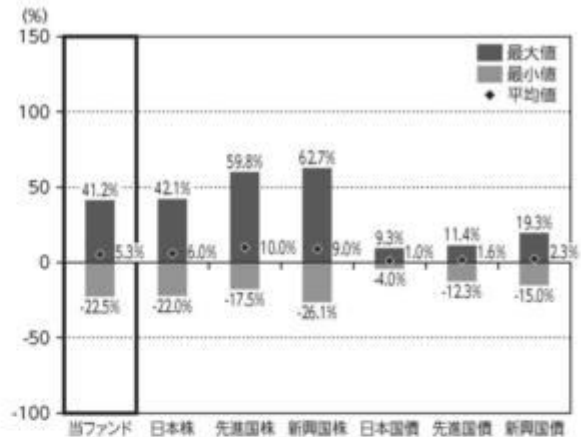
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2016年5月～2021年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index-Emerging Market (グローバル・ディバースified円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.66%（税抜 0.6%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.231% (税抜 0.21%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.374% (税抜 0.34%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

(4) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2021年4月30日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年4月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	10,560,661,889	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,312,113	0.05
合計（純資産総額）		10,565,974,002	100.00

（注1）国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	5,771,168,856	1.5586	8,994,943,779	1.8299	10,560,661,889	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第10期計算期間末 (2011年 9月30日)	1,914,318,968	1,914,318,968	8,006	8,006
第11期計算期間末 (2012年10月 1日)	2,099,913,529	2,099,913,529	7,832	7,832
第12期計算期間末 (2013年 9月30日)	3,797,442,442	3,797,442,442	12,935	12,935
第13期計算期間末 (2014年 9月30日)	4,477,408,779	4,477,408,779	14,558	14,558
第14期計算期間末 (2015年 9月30日)	5,422,952,362	5,422,952,362	15,686	15,686
第15期計算期間末 (2016年 9月30日)	5,729,227,131	5,729,227,131	14,927	14,927
第16期計算期間末 (2017年10月 2日)	7,330,898,749	7,330,898,749	19,167	19,167
第17期計算期間末 (2018年10月 1日)	8,669,330,919	8,669,330,919	21,134	21,134
第18期計算期間末 (2019年 9月30日)	8,364,659,058	8,364,659,058	18,809	18,809
第19期計算期間末 (2020年 9月30日)	9,080,247,496	9,080,247,496	19,598	19,598
2020年 4月末日	8,015,133,386		17,528	
5月末日	8,654,198,047		18,710	
6月末日	8,578,666,987		18,669	
7月末日	8,245,438,835		17,908	

8月末日	8,904,797,804		19,358
9月末日	9,080,247,496		19,598
10月末日	8,877,488,643		19,033
11月末日	9,735,793,885		21,144
12月末日	10,000,976,629		21,761
2021年 1月末日	9,912,247,154		21,798
2月末日	10,268,851,277		22,465
3月末日	10,880,291,118		23,732
4月末日	10,565,974,002		23,049

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	6.6
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	2.2
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	65.2
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	12.5
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	7.7
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	4.8
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	28.4
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	10.3
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	11.0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	4.2
第20期中間計算期間	2020年10月 1日～2021年 3月31日	21.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	646,054,246	311,558,408	2,391,183,182
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	766,520,228	476,640,765	2,681,062,645
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1,221,033,540	966,324,863	2,935,771,322
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	1,073,391,560	933,574,251	3,075,588,631
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,497,444,507	1,115,886,709	3,457,146,429
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,215,333,947	834,369,525	3,838,110,851
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,128,218,267	1,141,666,812	3,824,662,306
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,122,120,183	844,769,825	4,102,012,664
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	1,105,861,467	760,666,529	4,447,207,602
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	1,310,633,921	1,124,605,757	4,633,235,766
第20期中間計算期間	2020年10月 1日～2021年 3月31日	525,351,383	573,874,872	4,584,712,277

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	447,990,773,450	98.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,965,632,416	1.53
合計(純資産総額)		454,956,405,866	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	7,016,535,000	1.54

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,740,500	7,023.83	12,224,992,510	8,127.00	14,145,043,500	3.11
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,337,700	5,875.50	7,859,665,532	9,885.00	13,223,164,500	2.91
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,076,300	8,011.88	8,623,188,556	10,900.00	11,731,670,000	2.58
日本	株式	キーエンス	電気機器	168,700	47,686.20	8,044,662,132	52,520.00	8,860,124,000	1.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,591,700	458.88	5,319,266,952	578.00	6,700,002,600	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	98,300	48,509.46	4,768,480,700	62,690.00	6,162,427,000	1.35
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,176,100	3,993.30	4,696,526,999	4,939.00	5,808,757,900	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	311,200	14,143.07	4,401,326,118	18,450.00	5,741,640,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,972,000	2,503.31	4,936,543,361	2,755.00	5,432,860,000	1.19
日本	株式	日本電産	電気機器	413,600	8,355.40	3,455,794,212	12,655.00	5,234,108,000	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,429,500	4,052.52	5,793,087,504	3,635.00	5,196,232,500	1.14
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	100,600	25,795.22	2,594,999,878	48,320.00	4,860,992,000	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	218,900	17,684.81	3,871,205,201	21,930.00	4,800,477,000	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,352,100	3,165.71	4,280,368,794	3,306.00	4,470,042,600	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,172,700	3,209.20	3,763,433,057	3,802.00	4,458,605,400	0.98
日本	株式	日立製作所	電気機器	826,100	3,771.42	3,115,570,352	5,381.00	4,445,244,100	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	504,800	6,779.82	3,422,456,446	8,703.00	4,393,274,400	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,352,700	2,825.77	3,822,421,717	3,232.00	4,371,926,400	0.96
日本	株式	HOYA	精密機器	338,100	10,777.87	3,644,000,166	12,435.00	4,204,273,500	0.92
日本	株式	第一三共	医薬品	1,475,000	3,313.27	4,887,085,706	2,787.00	4,110,825,000	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,183,600	2,500.34	2,959,403,730	3,408.00	4,033,708,800	0.89
日本	株式	ファナック	電気機器	150,800	21,021.73	3,170,078,224	25,175.00	3,796,390,000	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,302,600	1,385.63	3,190,573,440	1,535.00	3,534,491,000	0.78
日本	株式	S M C	機械	50,300	56,727.81	2,853,408,884	63,450.00	3,191,535,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	1,373,900	1,729.07	2,375,571,061	2,303.50	3,164,778,650	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,030,300	2,576.38	2,654,450,292	3,020.00	3,111,506,000	0.68
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	662,000	3,772.60	2,497,464,710	4,699.00	3,110,738,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	558,100	4,855.66	2,709,946,072	5,230.00	2,918,863,000	0.64
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,718,200	1,481.44	2,545,410,971	1,682.00	2,890,012,400	0.64
日本	株式	花王	化学	411,400	8,382.24	3,448,455,208	7,007.00	2,882,679,800	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.35
		食料品	3.24
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.29
		医薬品	5.12
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.63
		機械	5.63
		電気機器	17.70
		輸送用機器	7.00
		精密機器	2.52
		その他製品	2.40
		電気・ガス業	1.26
		陸運業	3.31
		海運業	0.27
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.41
		卸売業	4.70
		小売業	4.57
		銀行業	4.96
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	1.83
		その他金融業	1.08
不動産業	1.95		
サービス業	5.44		
	小計	98.47	
合計		98.47	

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	369	円	7,225,240,500	7,016,535,000	1.54

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

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

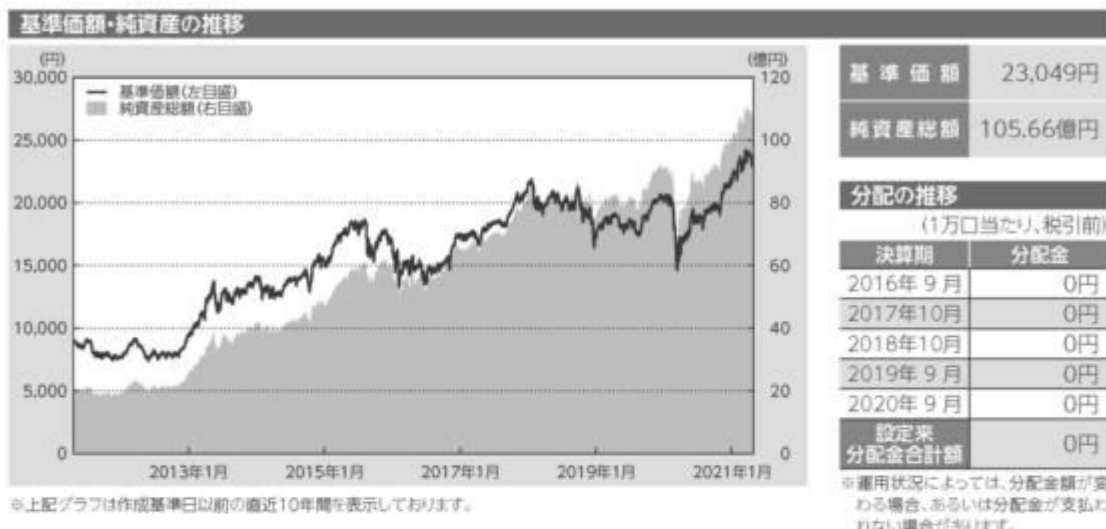
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2001年10月1日

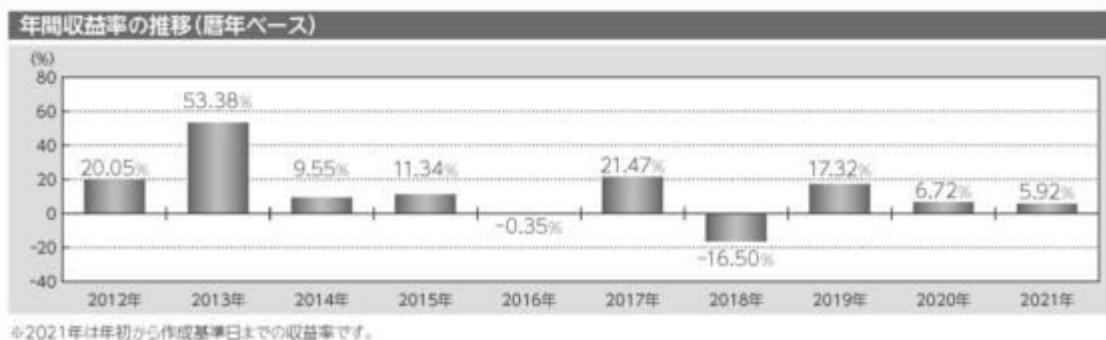
作成基準日：2021年4月30日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.1%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.9%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.6%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.5%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.3%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.3%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.2%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠ることとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

ができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2001年10月1日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務

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

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

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、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(2019年10月1日から2020年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックス・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期 (2020年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,952,817	39,098,175
親投資信託受益証券	8,360,433,831	9,075,616,403
未収入金	4,089,336	2,292,003
流動資産合計	8,405,475,984	9,117,006,581
資産合計	8,405,475,984	9,117,006,581
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,389,970	8,332,589
未払受託者報酬	2,166,360	2,329,715
未払委託者報酬	23,829,912	25,626,820
未払利息	99	90
その他未払費用	430,585	469,871
流動負債合計	40,816,926	36,759,085
負債合計	40,816,926	36,759,085
純資産の部		
元本等		
元本	4,447,207,602	4,633,235,766
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,917,451,456	4,447,011,730
(分配準備積立金)	1,715,858,472	1,337,260,318
元本等合計	8,364,659,058	9,080,247,496
純資産合計	8,364,659,058	9,080,247,496
負債純資産合計	8,405,475,984	9,117,006,581

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自 2018年10月2日 至 2019年9月30日		自 2019年10月1日 至 2020年9月30日	
営業収益				
受取利息		8		106
有価証券売買等損益		883,239,806		465,704,890
営業収益合計		883,239,798		465,704,996
営業費用				
支払利息		19,084		15,182
受託者報酬		4,306,962		4,699,849
委託者報酬		47,376,433		51,698,215
その他費用		431,575		469,929
営業費用合計		52,134,054		56,883,175
営業利益又は営業損失（ ）		935,373,852		408,821,821
経常利益又は経常損失（ ）		935,373,852		408,821,821
当期純利益又は当期純損失（ ）		935,373,852		408,821,821
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（ ）		168,072,440		2,217,332
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,567,318,255		3,917,451,456
剰余金増加額又は欠損金減少額		940,365,002		1,110,955,249
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		940,365,002		1,110,955,249
剰余金減少額又は欠損金増加額		822,930,389		987,999,464
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		822,930,389		987,999,464
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,917,451,456		4,447,011,730

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期 (2020年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,447,207,602口	4,633,235,766口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8809円 (18,809円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9598円 (19,598円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日			第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	4,604,677,026円	収益調整金額	C	5,247,664,086円
分配準備積立金額	D	1,715,858,472円	分配準備積立金額	D	1,337,260,318円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,320,535,498円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,584,924,404円
当ファンドの期末残存口数	F	4,447,207,602口	当ファンドの期末残存口数	F	4,633,235,766口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,212円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,212円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第19期 (2020年 9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第18期	第19期
	自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日	自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,102,012,664円	4,447,207,602円
期中追加設定元本額	1,105,861,467円	1,310,633,921円
期中一部解約元本額	760,666,529円	1,124,605,757円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期	第19期
	(2019年 9月30日現在)	(2020年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	802,375,309	456,181,776
合計	802,375,309	456,181,776

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	5,855,992,001	9,075,616,403	
合計		5,855,992,001	9,075,616,403	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,507,313,955
株式	350,000,638,400
派生商品評価勘定	25,007,550
未収入金	82,228,001
未収配当金	3,038,322,579
前払金	32,857,800
差入委託証拠金	130,822,300
流動資産合計	356,817,190,585
資産合計	356,817,190,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,874,700
未払金	17,681,367
未払解約金	479,085,377
未払利息	8,103
流動負債合計	554,649,547
負債合計	554,649,547
純資産の部	
元本等	
元本	229,881,049,283
剰余金	
剰余金又は欠損金()	126,381,491,755
元本等合計	356,262,541,038
純資産合計	356,262,541,038
負債純資産合計	356,817,190,585

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	229,881,049,283口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5498円 (1万口当たり純資産額) (15,498円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 9月30日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	207,951,200,444円
期中追加設定元本額	66,314,677,581円
期中一部解約元本額	44,384,828,742円
期末元本額	229,881,049,283円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	523,183,117円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,098,005,229円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,344,896円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,398,303,108円
世界経済インデックスファンド	2,374,241,929円
日本株式インデックス・オープン	4,016,443,827円
D C マイセレクション 2 5	6,937,388,520円
D C マイセレクション 5 0	19,586,419,026円
D C マイセレクション 7 5	18,119,850,660円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,855,992,001円
D C マイセレクション S 2 5	2,983,209,103円
D C マイセレクション S 5 0	8,354,836,848円
D C マイセレクション S 7 5	5,417,385,993円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,228,253,640円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	311,603,506円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	698,127,851円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	479,038,187円
D C 世界経済インデックスファンド	3,022,934,188円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,776,512,825円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,312,268円

区分	2020年 9月30日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	34,076,346円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,422,250円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	247,712,189円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,628,611円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	65,129,861円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	224,174,249円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	50,913,407円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	226,094,043円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,451,703,899円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	627,972,542円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,682,628,080円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	616,415,281円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	37,860,266円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	685,477,630円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	390,606,570円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	494,006,980円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	47,613,679円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	828,534,716円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,431,058,451円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,949,640,706円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,132,578,799円
分散投資コア戦略ファンドA	3,723,001,730円
分散投資コア戦略ファンドS	11,522,375,395円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	348,696,584円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	359,959,550円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,476,493,092円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,135,167円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,681,987円
SMT インデックスバランス・オープン	65,532,256円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,580,315,052円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	26,572,587円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,547,073円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	15,002,678円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,291,627円
グローバル経済コア	255,506,794円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,330,235円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	46,695,034円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,522,288円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,199,222,599円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	117,182,858円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	325,015円

区分	2020年 9月30日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	389,446円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	205,560円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	209,288円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	49,582,735,556円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,785,055,699円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	76,455,795円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,902,376円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,890,953円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	12,030,514,732	
合計	12,030,514,732	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,258,522,800	-	6,225,665,000	32,857,800
合計		6,258,522,800	-	6,225,665,000	32,857,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

	評価額

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	7,300	2,798.00	20,425,400	
日本水産	208,600	447.00	93,244,200	
マルハニチロ	30,100	2,412.00	72,601,200	
カネコ種苗	6,300	1,622.00	10,218,600	
サカタのタネ	24,900	3,770.00	93,873,000	
ホクト	15,900	2,243.00	35,663,700	
ホクリヨウ	3,200	709.00	2,268,800	
住石ホールディングス	42,100	123.00	5,178,300	
日鉄鉱業	4,800	4,635.00	22,248,000	
三井松島ホールディングス	8,100	737.00	5,969,700	
国際石油開発帝石	767,300	563.50	432,373,550	
石油資源開発	27,300	1,631.00	44,526,300	
K&Oエナジーグループ	10,100	1,499.00	15,139,900	
ヒノキヤグループ	5,200	1,964.00	10,212,800	
ショーボンドホールディングス	32,500	5,220.00	169,650,000	
ミライト・ホールディングス	62,000	1,608.00	99,696,000	
タマホーム	11,200	1,381.00	15,467,200	
サンヨーホームズ	1,800	665.00	1,197,000	
日本アクア	8,300	703.00	5,834,900	
ファーストコーポレーション	6,400	691.00	4,422,400	
ベステラ	3,600	1,279.00	4,604,400	
T A T E R U	38,700	195.00	7,546,500	
キャンディル	3,500	677.00	2,369,500	
スペースバリューホールディングス	25,400	505.00	12,827,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,000	708.00	2,832,000	
第一カッター興業	2,600	2,258.00	5,870,800	
明豊ファシリティワークス	6,700	649.00	4,348,300	
安藤・間	124,200	726.00	90,169,200	
東急建設	61,100	459.00	28,044,900	
コムシスホールディングス	74,000	2,921.00	216,154,000	
ピーアールホールディングス	22,700	780.00	17,706,000	
高松コンストラクショングループ	13,000	2,302.00	29,926,000	
東建コーポレーション	6,400	7,770.00	49,728,000	
ソネック	2,100	890.00	1,869,000	
ヤマウラ	9,100	908.00	8,262,800	
大成建設	160,700	3,550.00	570,485,000	
大林組	481,800	955.00	460,119,000	
清水建設	489,000	789.00	385,821,000	
飛鳥建設	13,800	1,088.00	15,014,400	
長谷工コーポレーション	186,500	1,380.00	257,370,000	
松井建設	19,000	720.00	13,680,000	

銭高組	2,100	4,765.00	10,006,500	
鹿島建設	378,300	1,262.00	477,414,600	
不動テトラ	12,600	1,521.00	19,164,600	
大末建設	5,600	940.00	5,264,000	
鉄建建設	10,500	2,104.00	22,092,000	
西松建設	37,100	2,087.00	77,427,700	
三井住友建設	116,400	427.00	49,702,800	
大豊建設	10,800	3,005.00	32,454,000	
前田建設工業	120,700	769.00	92,818,300	
佐田建設	10,400	466.00	4,846,400	
ナカノフドー建設	13,200	410.00	5,412,000	
奥村組	22,700	2,638.00	59,882,600	
東鉄工業	20,700	2,834.00	58,663,800	
イチケン	3,500	1,677.00	5,869,500	
富士ピー・エス	7,100	647.00	4,593,700	
浅沼組	5,400	4,105.00	22,167,000	
戸田建設	200,100	720.00	144,072,000	
熊谷組	22,300	2,711.00	60,455,300	
北野建設	2,900	2,771.00	8,035,900	
植木組	2,100	2,938.00	6,169,800	
矢作建設工業	21,300	929.00	19,787,700	
ピーエス三菱	15,900	606.00	9,635,400	
日本ハウスホールディングス	32,900	281.00	9,244,900	
大東建託	52,600	9,320.00	490,232,000	
新日本建設	20,500	916.00	18,778,000	
N I P P O	39,900	2,904.00	115,869,600	
東亜道路工業	3,000	3,625.00	10,875,000	
前田道路	42,500	1,921.00	81,642,500	
日本道路	4,700	7,690.00	36,143,000	
東亜建設工業	15,000	1,681.00	25,215,000	
日本国土開発	46,900	619.00	29,031,100	
若築建設	8,700	1,204.00	10,474,800	
東洋建設	54,000	410.00	22,140,000	
五洋建設	191,000	687.00	131,217,000	
世紀東急工業	23,100	800.00	18,480,000	
福田組	5,600	5,110.00	28,616,000	
住友林業	122,000	1,670.00	203,740,000	
日本基礎技術	16,200	476.00	7,711,200	
巴コーポレーション	21,400	395.00	8,453,000	
大和ハウス工業	476,700	2,697.50	1,285,898,250	
ライト工業	27,600	1,578.00	43,552,800	
積水ハウス	522,600	1,857.50	970,729,500	

日特建設	12,600	774.00	9,752,400
北陸電気工事	8,300	1,201.00	9,968,300
ユアテック	27,600	645.00	17,802,000
日本リーテック	10,100	2,919.00	29,481,900
四電工	2,600	2,396.00	6,229,600
中電工	19,400	2,298.00	44,581,200
関電工	68,500	860.00	58,910,000
きんでん	114,500	1,853.00	212,168,500
東京エネシス	16,000	747.00	11,952,000
トーエネック	4,800	3,570.00	17,136,000
住友電設	13,600	2,460.00	33,456,000
日本電設工業	26,400	2,198.00	58,027,200
協和エクシオ	73,100	2,742.00	200,440,200
新日本空調	12,700	2,294.00	29,133,800
九電工	33,800	3,035.00	102,583,000
三機工業	34,700	1,152.00	39,974,400
日揮ホールディングス	148,300	1,088.00	161,350,400
中外炉工業	5,200	1,520.00	7,904,000
ヤマト	15,400	704.00	10,841,600
太平電業	11,600	2,349.00	27,248,400
高砂熱学工業	40,500	1,509.00	61,114,500
三晃金属工業	2,100	2,660.00	5,586,000
朝日工業社	3,200	3,070.00	9,824,000
明星工業	31,200	853.00	26,613,600
大気社	23,400	2,902.00	67,906,800
ダイダン	11,500	2,769.00	31,843,500
日比谷総合設備	15,500	1,790.00	27,745,000
フィル・カンパニー	2,800	1,792.00	5,017,600
OSJBホールディングス	76,000	245.00	18,620,000
東洋エンジニアリング	20,200	339.00	6,847,800
レイズネクスト	25,800	1,313.00	33,875,400
日本製粉	45,100	1,733.00	78,158,300
日清製粉グループ本社	174,200	1,667.00	290,391,400
日東富士製粉	1,100	6,490.00	7,139,000
昭和産業	14,200	3,510.00	49,842,000
鳥越製粉	13,700	1,059.00	14,508,300
中部飼料	18,800	1,768.00	33,238,400
フィード・ワン	20,720	930.00	19,269,600
東洋精糖	2,600	1,282.00	3,333,200
日本甜菜製糖	8,000	1,860.00	14,880,000
三井製糖	13,500	1,951.00	26,338,500
塩水港精糖	16,700	230.00	3,841,000

日新製糖	7,300	1,877.00	13,702,100
森永製菓	36,200	4,145.00	150,049,000
中村屋	4,000	4,200.00	16,800,000
江崎グリコ	42,500	4,715.00	200,387,500
名糖産業	7,400	1,560.00	11,544,000
井村屋グループ	8,700	2,538.00	22,080,600
不二家	9,800	2,407.00	23,588,600
山崎製パン	115,600	1,839.00	212,588,400
第一屋製パン	3,000	995.00	2,985,000
モロゾフ	2,600	6,190.00	16,094,000
亀田製菓	8,800	5,400.00	47,520,000
寿スピリッツ	14,800	5,390.00	79,772,000
カルビー	70,300	3,465.00	243,589,500
森永乳業	28,500	5,540.00	157,890,000
六甲バター	10,200	1,884.00	19,216,800
ヤクルト本社	106,100	5,850.00	620,685,000
明治ホールディングス	102,000	8,040.00	820,080,000
雪印メグミルク	37,100	2,549.00	94,567,900
プリマハム	24,100	3,235.00	77,963,500
日本ハム	58,900	4,690.00	276,241,000
林兼産業	5,100	603.00	3,075,300
丸大食品	16,400	1,739.00	28,519,600
S Foods	12,300	2,930.00	36,039,000
柿安本店	5,300	2,603.00	13,795,900
伊藤ハム米久ホールディングス	99,300	753.00	74,772,900
サッポロホールディングス	52,600	1,887.00	99,256,200
アサヒグループホールディングス	336,900	3,656.00	1,231,706,400
キリンホールディングス	654,000	1,973.50	1,290,669,000
宝ホールディングス	114,300	1,166.00	133,273,800
オエノンホールディングス	43,800	459.00	20,104,200
養命酒製造	4,700	1,867.00	8,774,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	118,100	1,759.00	207,737,900
サントリー食品インターナショナル	103,200	3,950.00	407,640,000
ダイトーグループホールディングス	7,900	5,340.00	42,186,000
伊藤園	46,800	7,510.00	351,468,000
キーコーヒー	15,200	2,216.00	33,683,200
ユニカフェ	4,600	1,053.00	4,843,800
ジャパンフーズ	2,200	1,300.00	2,860,000
日清オイリオグループ	19,800	3,175.00	62,865,000
不二製油グループ本社	37,600	3,310.00	124,456,000
かどや製油	1,700	3,985.00	6,774,500
J - オイルミルズ	8,000	3,950.00	31,600,000

キッコーマン	111,000	5,820.00	646,020,000
味の素	340,500	2,159.00	735,139,500
キューピー	85,900	2,166.00	186,059,400
ハウス食品グループ本社	57,700	3,740.00	215,798,000
カゴメ	63,000	3,680.00	231,840,000
焼津水産化学工業	7,500	1,030.00	7,725,000
アリアケジャパン	14,100	7,130.00	100,533,000
ピエトロ	2,000	1,746.00	3,492,000
エバラ食品工業	3,700	2,457.00	9,090,900
やまみ	1,300	2,252.00	2,927,600
ニチレイ	73,400	2,783.00	204,272,200
東洋水産	79,300	5,560.00	440,908,000
イトアンド	5,300	1,971.00	10,446,300
大冷	2,000	2,245.00	4,490,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	1,033.00	8,883,800
日清食品ホールディングス	65,500	9,900.00	648,450,000
永谷園ホールディングス	7,500	2,480.00	18,600,000
一正蒲鉾	6,000	1,210.00	7,260,000
フジッコ	16,700	2,083.00	34,786,100
ロック・フィールド	16,600	1,475.00	24,485,000
日本たばこ産業	826,800	1,920.00	1,587,456,000
ケンコーマヨネーズ	8,600	1,840.00	15,824,000
わらべや日洋ホールディングス	10,100	1,560.00	15,756,000
なとり	8,600	2,111.00	18,154,600
イフジ産業	2,700	995.00	2,686,500
ピククルスコーポレーション	3,400	3,280.00	11,152,000
北の達人コーポレーション	53,800	543.00	29,213,400
ユーグレナ	66,700	880.00	58,696,000
ミヨシ油脂	5,400	1,174.00	6,339,600
理研ビタミン	14,600	2,147.00	31,346,200
片倉工業	20,500	1,231.00	25,235,500
ゲンゼ	11,200	3,925.00	43,960,000
東洋紡	59,800	1,447.00	86,530,600
ユニチカ	45,400	358.00	16,253,200
富士紡ホールディングス	7,400	3,660.00	27,084,000
倉敷紡績	15,200	1,928.00	29,305,600
シキボウ	7,900	980.00	7,742,000
日本毛織	50,000	1,015.00	50,750,000
トーア紡コーポレーション	6,000	507.00	3,042,000
帝国繊維	17,100	2,664.00	45,554,400
帝人	123,000	1,629.00	200,367,000
東レ	1,090,500	479.30	522,676,650

サカイオーベックス	4,200	2,115.00	8,883,000
住江織物	3,300	2,194.00	7,240,200
日本フェルト	9,500	496.00	4,712,000
イチカワ	2,500	1,534.00	3,835,000
日東製網	1,700	1,484.00	2,522,800
アツギ	12,800	568.00	7,270,400
ダイニック	5,700	876.00	4,993,200
セーレン	37,300	1,547.00	57,703,100
ソトー	6,200	951.00	5,896,200
東海染工	2,300	1,145.00	2,633,500
小松マテーレ	24,900	892.00	22,210,800
ワコールホールディングス	37,600	1,987.00	74,711,200
ホギメディカル	17,200	3,605.00	62,006,000
T S Iホールディングス	46,300	324.00	15,001,200
マツオカコーポレーション	4,400	2,297.00	10,106,800
ワールド	21,500	1,418.00	30,487,000
三陽商会	7,800	601.00	4,687,800
ナイガイ	6,000	400.00	2,400,000
オンワードホールディングス	91,200	272.00	24,806,400
ルックホールディングス	5,400	827.00	4,465,800
ゴールドウイン	27,300	8,340.00	227,682,000
デサント	29,500	1,713.00	50,533,500
キング	7,400	578.00	4,277,200
ヤマトインターナショナル	13,800	350.00	4,830,000
特種東海製紙	9,200	4,990.00	45,908,000
王子ホールディングス	629,000	482.00	303,178,000
日本製紙	66,500	1,303.00	86,649,500
三菱製紙	17,100	347.00	5,933,700
北越コーポレーション	89,700	361.00	32,381,700
中越パルプ工業	6,400	1,522.00	9,740,800
巴川製紙所	4,500	992.00	4,464,000
大王製紙	66,400	1,502.00	99,732,800
阿波製紙	3,900	510.00	1,989,000
レンゴー	142,200	794.00	112,906,800
トーモク	9,200	1,675.00	15,410,000
ザ・パック	11,400	3,095.00	35,283,000
クラレ	237,000	1,018.00	241,266,000
旭化成	997,400	914.70	912,321,780
共和レザー	8,200	649.00	5,321,800
昭和電工	114,300	1,922.00	219,684,600
住友化学	1,105,500	347.00	383,608,500
住友精化	6,700	3,400.00	22,780,000

日産化学	83,600	5,600.00	468,160,000
ラサ工業	5,300	2,084.00	11,045,200
クレハ	12,900	4,550.00	58,695,000
多木化学	5,900	7,230.00	42,657,000
テイカ	11,000	1,441.00	15,851,000
石原産業	27,000	721.00	19,467,000
片倉コープアグリ	3,900	1,300.00	5,070,000
日本曹達	22,300	3,010.00	67,123,000
東ソー	232,600	1,705.00	396,583,000
トクヤマ	43,400	2,524.00	109,541,600
セントラル硝子	30,700	2,183.00	67,018,100
東亜合成	94,400	1,127.00	106,388,800
大阪ソーダ	15,300	2,559.00	39,152,700
関東電化工業	35,700	723.00	25,811,100
デンカ	54,900	3,195.00	175,405,500
信越化学工業	258,400	13,685.00	3,536,204,000
日本カーバイド工業	5,300	1,279.00	6,778,700
堺化学工業	9,700	2,051.00	19,894,700
第一稀元素化学工業	16,300	726.00	11,833,800
エア・ウォーター	140,000	1,420.00	198,800,000
大陽日酸	144,600	1,615.00	233,529,000
日本化学工業	4,700	2,308.00	10,847,600
東邦アセチレン	2,300	1,258.00	2,893,400
日本パーカライズニング	75,900	1,029.00	78,101,100
高压ガス工業	23,900	839.00	20,052,100
チタン工業	1,900	1,764.00	3,351,600
四国化成工業	22,000	1,165.00	25,630,000
戸田工業	3,500	2,413.00	8,445,500
ステラ ケミファ	8,200	2,971.00	24,362,200
保土谷化学工業	5,600	4,810.00	26,936,000
日本触媒	23,400	5,600.00	131,040,000
大日精化工業	13,300	2,252.00	29,951,600
カネカ	38,900	2,945.00	114,560,500
三菱瓦斯化学	140,000	1,946.00	272,440,000
三井化学	139,600	2,536.00	354,025,600
J S R	140,200	2,489.00	348,957,800
東京応化工業	25,800	5,430.00	140,094,000
大阪有機化学工業	13,900	2,788.00	38,753,200
三菱ケミカルホールディングス	1,005,900	605.70	609,273,630
K Hネオケム	24,800	2,460.00	61,008,000
ダイセル	195,900	757.00	148,296,300
住友ベークライト	23,700	2,882.00	68,303,400

積水化学工業	318,200	1,677.00	533,621,400
日本ゼオン	135,700	1,101.00	149,405,700
アイカ工業	45,100	3,730.00	168,223,000
宇部興産	76,000	1,771.00	134,596,000
積水樹脂	27,100	2,197.00	59,538,700
タキロンシーアイ	32,600	698.00	22,754,800
旭有機材	8,500	1,356.00	11,526,000
ニチバン	7,900	1,644.00	12,987,600
リケンテクノス	37,800	422.00	15,951,600
大倉工業	7,100	1,586.00	11,260,600
積水化成成品工業	20,200	607.00	12,261,400
群栄化学工業	3,400	2,795.00	9,503,000
タイガースポリマー	7,900	430.00	3,397,000
ミライアル	5,300	1,155.00	6,121,500
ダイキアクシス	5,300	897.00	4,754,100
ダイキョーニシカワ	31,700	556.00	17,625,200
竹本容器	5,400	1,067.00	5,761,800
森六ホールディングス	8,100	1,816.00	14,709,600
日本化薬	93,100	928.00	86,396,800
カーリットホールディングス	16,100	556.00	8,951,600
日本精化	12,100	1,687.00	20,412,700
扶桑化学工業	15,200	3,725.00	56,620,000
トリケミカル研究所	3,400	12,170.00	41,378,000
A D E K A	69,300	1,511.00	104,712,300
日油	56,700	4,140.00	234,738,000
新日本理化	24,900	169.00	4,208,100
ハリマ化成グループ	12,400	1,106.00	13,714,400
花王	367,900	7,887.00	2,901,627,300
第一工業製薬	5,600	4,270.00	23,912,000
石原ケミカル	4,100	2,373.00	9,729,300
日華化学	5,100	985.00	5,023,500
ニイタカ	3,100	3,385.00	10,493,500
三洋化成工業	9,000	4,900.00	44,100,000
有機合成薬品工業	11,500	354.00	4,071,000
大日本塗料	17,000	993.00	16,881,000
日本ペイントホールディングス	124,200	10,810.00	1,342,602,000
関西ペイント	169,100	2,608.00	441,012,800
神東塗料	11,800	179.00	2,112,200
中国塗料	42,800	993.00	42,500,400
日本特殊塗料	11,300	978.00	11,051,400
藤倉化成	20,300	518.00	10,515,400
太陽ホールディングス	11,100	5,500.00	61,050,000

D I C	63,500	2,618.00	166,243,000
サカタインクス	32,800	1,051.00	34,472,800
東洋インキＳＣホールディングス	31,800	2,010.00	63,918,000
T & K T O K A	11,700	885.00	10,354,500
富士フイルムホールディングス	294,600	5,185.00	1,527,501,000
資生堂	305,300	6,035.00	1,842,485,500
ライオン	199,800	2,163.00	432,167,400
高砂香料工業	9,600	2,178.00	20,908,800
マンダム	34,500	1,765.00	60,892,500
ミルボン	20,500	5,580.00	114,390,000
ファンケル	62,200	3,425.00	213,035,000
コーセー	28,900	12,850.00	371,365,000
コタ	8,900	1,398.00	12,442,200
シーボン	2,000	2,014.00	4,028,000
ポーラ・オルビスホールディングス	65,600	1,983.00	130,084,800
ノエビアホールディングス	13,000	4,920.00	63,960,000
アジュバンコスメジャパン	3,400	1,011.00	3,437,400
エステー	9,900	2,264.00	22,413,600
アグロ カネショウ	5,800	1,808.00	10,486,400
コニシ	25,200	1,540.00	38,808,000
長谷川香料	26,500	2,113.00	55,994,500
星光P M C	8,800	700.00	6,160,000
小林製薬	43,100	10,170.00	438,327,000
荒川化学工業	13,800	1,266.00	17,470,800
メック	10,500	1,954.00	20,517,000
日本高純度化学	4,200	2,721.00	11,428,200
タカラバイオ	40,200	2,856.00	114,811,200
J C U	18,600	3,460.00	64,356,000
新田ゼラチン	9,600	726.00	6,969,600
O A T アグリオ	2,900	1,336.00	3,874,400
デクセリアルズ	39,700	1,104.00	43,828,800
アース製薬	10,600	7,830.00	82,998,000
北興化学工業	14,300	711.00	10,167,300
大成ラミック	5,000	2,813.00	14,065,000
クミアイ化学工業	63,500	1,058.00	67,183,000
日本農薬	27,400	512.00	14,028,800
アキレス	10,600	1,757.00	18,624,200
有沢製作所	24,300	964.00	23,425,200
日東電工	106,000	6,840.00	725,040,000
レック	16,400	1,677.00	27,502,800
三光合成	17,600	293.00	5,156,800
きもと	26,100	169.00	4,410,900

藤森工業	13,800	4,340.00	59,892,000	
前澤化成工業	9,800	976.00	9,564,800	
未来工業	8,200	2,008.00	16,465,600	
ウェーブロックホールディングス	5,300	754.00	3,996,200	
J S P	9,000	1,607.00	14,463,000	
エフピコ	33,800	4,430.00	149,734,000	
天馬	10,200	1,774.00	18,094,800	
信越ポリマー	27,600	894.00	24,674,400	
東リ	38,300	276.00	10,570,800	
ニフコ	56,400	2,862.00	161,416,800	
バルカー	12,500	1,897.00	23,712,500	
ユニ・チャーム	325,800	4,712.00	1,535,169,600	
ショーエイコーポレーション	2,300	1,245.00	2,863,500	
協和キリン	154,500	2,986.00	461,337,000	
武田薬品工業	1,278,300	3,744.00	4,785,955,200	
アステラス製薬	1,332,100	1,567.00	2,087,400,700	
大日本住友製薬	113,900	1,383.00	157,523,700	
塩野義製薬	193,200	5,629.00	1,087,522,800	
わかもと製薬	18,300	277.00	5,069,100	
あすか製薬	17,500	1,417.00	24,797,500	
日本新薬	40,200	8,640.00	347,328,000	
バイオフェルミン製薬	2,600	2,549.00	6,627,400	
中外製薬	480,600	4,715.00	2,266,029,000	
科研製薬	26,300	4,820.00	126,766,000	
エーザイ	183,900	9,584.00	1,762,497,600	
ロート製薬	78,900	3,455.00	272,599,500	
小野薬品工業	352,800	3,304.00	1,165,651,200	
久光製薬	40,600	5,370.00	218,022,000	
持田製薬	21,300	4,155.00	88,501,500	
参天製薬	286,300	2,149.00	615,258,700	
扶桑薬品工業	5,400	2,909.00	15,708,600	
日本ケミファ	2,000	2,639.00	5,278,000	
ツムラ	47,600	3,275.00	155,890,000	
日医工	43,500	1,195.00	51,982,500	
キッセイ薬品工業	27,200	2,371.00	64,491,200	
生化学工業	29,800	1,105.00	32,929,000	
栄研化学	27,000	2,116.00	57,132,000	
日水製薬	6,500	1,141.00	7,416,500	
鳥居薬品	9,600	2,978.00	28,588,800	
J C R ファーマ	43,200	3,070.00	132,624,000	
東和薬品	19,700	2,109.00	41,547,300	
富士製薬工業	10,400	1,249.00	12,989,600	

沢井製薬	31,500	5,310.00	167,265,000
ゼリア新薬工業	27,900	2,010.00	56,079,000
第一三共	1,319,100	3,229.00	4,259,373,900
キョーリン製薬ホールディングス	33,900	2,132.00	72,274,800
大幸薬品	18,900	2,252.00	42,562,800
ダイト	9,600	3,535.00	33,936,000
大塚ホールディングス	319,300	4,448.00	1,420,246,400
大正製薬ホールディングス	32,500	6,920.00	224,900,000
ペプチドリーム	78,100	4,920.00	384,252,000
日本コークス工業	129,800	62.00	8,047,600
ニチレキ	18,100	1,699.00	30,751,900
ユシロ化学工業	8,600	1,326.00	11,403,600
ビーピー・カストロール	5,500	1,225.00	6,737,500
富士石油	41,000	178.00	7,298,000
MORESCO	5,600	1,002.00	5,611,200
出光興産	170,500	2,242.00	382,261,000
Eneosホールディングス	2,311,300	375.00	866,737,500
コスモエネルギーホールディングス	44,500	1,501.00	66,794,500
横浜ゴム	89,000	1,491.00	132,699,000
TOYO TIRE	80,900	1,692.00	136,882,800
ブリヂストン	408,500	3,317.00	1,354,994,500
住友ゴム工業	138,000	973.00	134,274,000
藤倉コンポジット	13,400	370.00	4,958,000
オカモト	9,300	4,105.00	38,176,500
フコク	6,700	705.00	4,723,500
ニッタ	17,300	2,328.00	40,274,400
住友理工	29,800	560.00	16,688,000
三ツ星ベルト	20,200	1,707.00	34,481,400
バンドー化学	27,000	601.00	16,227,000
日東紡績	22,900	4,475.00	102,477,500
AGC	141,100	3,070.00	433,177,000
日本板硝子	73,500	380.00	27,930,000
石塚硝子	2,800	2,012.00	5,633,600
日本山村硝子	6,600	906.00	5,979,600
日本電気硝子	57,100	1,958.00	111,801,800
オハラ	6,200	1,311.00	8,128,200
住友大阪セメント	29,100	3,395.00	98,794,500
太平洋セメント	97,100	2,674.00	259,645,400
日本ヒューム	15,600	799.00	12,464,400
日本コンクリート工業	33,600	340.00	11,424,000
三谷セキサン	7,200	6,080.00	43,776,000
アジアパイルホールディングス	22,200	489.00	10,855,800

東海カーボン	150,400	1,122.00	168,748,800
日本カーボン	8,500	3,730.00	31,705,000
東洋炭素	9,100	1,768.00	16,088,800
ノリタケカンパニーリミテド	8,500	3,305.00	28,092,500
TOTO	109,800	4,825.00	529,785,000
日本碍子	184,600	1,495.00	275,977,000
日本特殊陶業	117,000	1,830.00	214,110,000
MARUWA	5,900	9,720.00	57,348,000
品川リフラクトリーズ	4,100	2,444.00	10,020,400
黒崎播磨	3,100	2,984.00	9,250,400
ヨータイ	12,400	793.00	9,833,200
イソライト工業	8,300	472.00	3,917,600
東京窯業	20,100	341.00	6,854,100
ニッカトー	7,200	755.00	5,436,000
フジミインコーポレーテッド	13,700	3,655.00	50,073,500
クニミネ工業	6,400	1,073.00	6,867,200
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,071.00	2,784,600
ニチアス	42,100	2,482.00	104,492,200
ニチハ	21,400	3,160.00	67,624,000
日本製鉄	680,000	989.50	672,860,000
神戸製鋼所	278,300	399.00	111,041,700
中山製鋼所	21,300	356.00	7,582,800
合同製鐵	8,200	2,013.00	16,506,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	410,400	732.00	300,412,800
東京製鐵	74,100	715.00	52,981,500
共英製鋼	17,200	1,347.00	23,168,400
大和工業	32,300	2,565.00	82,849,500
東京鐵鋼	6,300	1,767.00	11,132,100
大阪製鐵	8,100	1,052.00	8,521,200
淀川製鋼所	20,600	1,879.00	38,707,400
丸一鋼管	49,300	2,626.00	129,461,800
モリ工業	4,600	2,539.00	11,679,400
大同特殊鋼	24,900	3,260.00	81,174,000
日本高周波鋼業	5,800	374.00	2,169,200
日本冶金工業	12,600	1,553.00	19,567,800
山陽特殊製鋼	10,500	1,002.00	10,521,000
愛知製鋼	8,600	2,599.00	22,351,400
日立金属	163,700	1,615.00	264,375,500
日本金属	3,500	598.00	2,093,000
大平洋金属	10,300	1,565.00	16,119,500
新日本電工	98,300	212.00	20,839,600
栗本鐵工所	7,500	1,903.00	14,272,500

虹技	2,300	1,400.00	3,220,000
三菱製鋼	11,400	574.00	6,543,600
日亜鋼業	22,400	311.00	6,966,400
日本精線	2,500	3,455.00	8,637,500
エンビプロ・ホールディングス	6,600	578.00	3,814,800
シンニッタン	23,900	228.00	5,449,200
新家工業	3,500	1,160.00	4,060,000
大紀アルミニウム工業所	25,200	559.00	14,086,800
日本軽金属ホールディングス	38,520	1,663.00	64,058,760
三井金属鉱業	41,100	2,545.00	104,599,500
東邦亜鉛	7,900	2,008.00	15,863,200
三菱マテリアル	100,400	2,070.00	207,828,000
住友金属鉱山	194,300	3,245.00	630,503,500
D O W A ホールディングス	38,500	3,080.00	118,580,000
古河機械金属	27,100	1,135.00	30,758,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,000	891.00	14,256,000
東邦チタニウム	27,400	673.00	18,440,200
U A C J	23,100	1,728.00	39,916,800
C K サンエツ	3,200	3,385.00	10,832,000
古河電気工業	47,200	2,502.00	118,094,400
住友電気工業	568,200	1,179.00	669,907,800
フジクラ	183,500	290.00	53,215,000
昭和電線ホールディングス	17,800	1,212.00	21,573,600
東京特殊電線	2,300	2,494.00	5,736,200
タツタ電線	30,400	612.00	18,604,800
カナレ電気	2,600	1,779.00	4,625,400
平河ヒューテック	7,700	1,033.00	7,954,100
リョービ	18,800	1,178.00	22,146,400
アーレスティ	20,300	332.00	6,739,600
アサヒホールディングス	26,700	3,400.00	90,780,000
稲葉製作所	8,500	1,368.00	11,628,000
宮地エンジニアリンググループ	4,600	1,650.00	7,590,000
トーカロ	42,200	1,105.00	46,631,000
アルファC o	5,400	1,047.00	5,653,800
S U M C O	194,500	1,475.00	286,887,500
川田テクノロジーズ	3,100	4,850.00	15,035,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,900	3,345.00	16,390,500
信和	8,700	708.00	6,159,600
東洋製罐グループホールディングス	96,800	1,042.00	100,865,600
ホッカンホールディングス	8,400	1,439.00	12,087,600
コロナ	8,400	987.00	8,290,800
横河ブリッジホールディングス	28,300	1,950.00	55,185,000

駒井ハルテック	2,800	1,619.00	4,533,200
高田機工	1,400	2,525.00	3,535,000
三和ホールディングス	143,200	1,111.00	159,095,200
文化シャッター	44,800	833.00	37,318,400
三協立山	19,600	983.00	19,266,800
アルインコ	11,000	971.00	10,681,000
東洋シャッター	3,700	786.00	2,908,200
LIXILグループ	224,200	2,110.00	473,062,000
日本フィルコン	10,600	597.00	6,328,200
ノーリツ	31,500	1,512.00	47,628,000
長府製作所	15,400	2,199.00	33,864,600
リンナイ	29,500	10,250.00	302,375,000
ダイニチ工業	8,200	780.00	6,396,000
日東精工	19,100	492.00	9,397,200
三洋工業	2,000	2,018.00	4,036,000
岡部	30,800	813.00	25,040,400
ジーテクト	18,900	1,194.00	22,566,600
東プレ	28,300	1,130.00	31,979,000
高周波熱錬	29,200	532.00	15,534,400
東京製綱	10,900	520.00	5,668,000
サンコール	11,400	468.00	5,335,200
モリテック スチール	11,800	313.00	3,693,400
パイオラックス	22,500	1,560.00	35,100,000
エイチワン	14,900	563.00	8,388,700
日本発條	163,000	671.00	109,373,000
中央発條	1,800	3,165.00	5,697,000
アドバネクス	2,200	1,427.00	3,139,400
立川ブラインド工業	6,700	1,309.00	8,770,300
三益半導体工業	11,900	2,401.00	28,571,900
日本ドライケミカル	3,800	1,513.00	5,749,400
日本製鋼所	46,200	1,840.00	85,008,000
三浦工業	65,800	5,140.00	338,212,000
タクマ	51,600	1,792.00	92,467,200
ツガミ	31,600	1,227.00	38,773,200
オークマ	17,700	4,915.00	86,995,500
芝浦機械	17,200	2,176.00	37,427,200
アマダ	188,600	982.00	185,205,200
アイダエンジニアリング	40,000	722.00	28,880,000
滝澤鉄工所	4,800	1,061.00	5,092,800
F U J I	65,400	2,077.00	135,835,800
牧野フライス製作所	17,900	3,680.00	65,872,000
オーエスジー	75,000	1,685.00	126,375,000

ダイジェット工業	1,800	1,475.00	2,655,000
旭ダイヤモンド工業	40,200	487.00	19,577,400
D M G 森精機	96,200	1,452.00	139,682,400
ソディック	33,200	738.00	24,501,600
ディスコ	20,600	25,410.00	523,446,000
日東工器	8,400	2,083.00	17,497,200
日進工具	6,000	2,283.00	13,698,000
パンチ工業	13,900	416.00	5,782,400
富士ダイス	6,800	670.00	4,556,000
豊和工業	8,600	856.00	7,361,600
O K K	6,200	388.00	2,405,600
東洋機械金属	11,000	435.00	4,785,000
津田駒工業	2,900	904.00	2,621,600
エンシュウ	3,800	991.00	3,765,800
島精機製作所	24,000	1,656.00	39,744,000
オプトラン	19,100	2,123.00	40,549,300
N C ホールディングス	4,700	666.00	3,130,200
イワキポンプ	9,700	950.00	9,215,000
フリュー	14,900	1,193.00	17,775,700
ヤマシンフィルタ	33,100	1,074.00	35,549,400
日阪製作所	18,800	894.00	16,807,200
やまびこ	29,500	1,283.00	37,848,500
平田機工	7,200	6,280.00	45,216,000
ペガサスミシン製造	15,700	295.00	4,631,500
マルマエ	5,700	966.00	5,506,200
タツモ	6,500	1,462.00	9,503,000
ナプテスコ	89,600	3,815.00	341,824,000
三井海洋開発	16,200	1,633.00	26,454,600
レオン自動機	15,000	1,132.00	16,980,000
S M C	48,200	58,460.00	2,817,772,000
ホソカワミクロン	5,400	5,460.00	29,484,000
ユニオンツール	5,700	3,210.00	18,297,000
オイレス工業	19,700	1,528.00	30,101,600
日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,250.00	18,700,000
サトーホールディングス	21,700	2,237.00	48,542,900
技研製作所	13,400	4,030.00	54,002,000
日本エアーテック	5,000	1,405.00	7,025,000
カワタ	4,600	938.00	4,314,800
日精樹脂工業	12,900	908.00	11,713,200
オカダアイヨン	4,900	1,027.00	5,032,300
ワイエイシイホールディングス	6,500	644.00	4,186,000
小松製作所	696,000	2,310.00	1,607,760,000

住友重機械工業	88,000	2,442.00	214,896,000
日立建機	61,600	3,800.00	234,080,000
日工	21,200	697.00	14,776,400
巴工業	6,100	2,101.00	12,816,100
井関農機	15,500	1,414.00	21,917,000
TOWA	15,600	1,154.00	18,002,400
丸山製作所	3,200	1,398.00	4,473,600
北川鉄工所	7,000	1,456.00	10,192,000
ローツェ	6,700	4,955.00	33,198,500
タカキタ	5,500	713.00	3,921,500
クボタ	815,200	1,877.50	1,530,538,000
荏原実業	3,900	3,120.00	12,168,000
三菱化工機	5,400	1,888.00	10,195,200
月島機械	28,400	1,272.00	36,124,800
帝国電機製作所	12,700	1,086.00	13,792,200
新東工業	36,700	705.00	25,873,500
澁谷工業	13,500	3,635.00	49,072,500
アイチ コーポレーション	26,700	878.00	23,442,600
小森コーポレーション	39,200	734.00	28,772,800
鶴見製作所	11,900	1,819.00	21,646,100
住友精密工業	2,300	2,199.00	5,057,700
日本ギア工業	6,400	297.00	1,900,800
酒井重工業	2,900	2,401.00	6,962,900
荏原製作所	63,700	2,843.00	181,099,100
石井鐵工所	2,000	2,851.00	5,702,000
西島製作所	15,700	816.00	12,811,200
北越工業	15,900	1,116.00	17,744,400
ダイキン工業	195,700	19,300.00	3,777,010,000
オルガノ	5,600	5,700.00	31,920,000
トーヨーカネツ	6,700	2,269.00	15,202,300
栗田工業	83,200	3,460.00	287,872,000
椿本チエイン	22,000	2,469.00	54,318,000
大同工業	7,600	633.00	4,810,800
木村化工機	13,200	426.00	5,623,200
アネスト岩田	24,000	863.00	20,712,000
ダイフク	78,500	10,580.00	830,530,000
サムコ	3,900	2,689.00	10,487,100
加藤製作所	8,600	1,120.00	9,632,000
油研工業	2,700	1,528.00	4,125,600
タダノ	74,300	864.00	64,195,200
フジテック	55,900	2,245.00	125,495,500
C K D	42,200	1,714.00	72,330,800

キトー	11,700	1,231.00	14,402,700
平和	42,900	1,730.00	74,217,000
理想科学工業	13,600	1,453.00	19,760,800
SANKYO	34,200	2,755.00	94,221,000
日本金銭機械	17,100	591.00	10,106,100
マースグループホールディングス	9,800	1,774.00	17,385,200
フクシマガリレイ	9,500	3,910.00	37,145,000
オーイズミ	6,600	410.00	2,706,000
ダイコク電機	7,100	1,011.00	7,178,100
竹内製作所	25,700	2,082.00	53,507,400
アマノ	40,300	2,445.00	98,533,500
JUKI	21,400	454.00	9,715,600
蛇の目ミシン工業	14,100	612.00	8,629,200
マックス	23,500	1,576.00	37,036,000
グローリー	39,500	2,348.00	92,746,000
新晃工業	14,300	1,465.00	20,949,500
大和冷機工業	24,800	943.00	23,386,400
セガサミーホールディングス	152,400	1,278.00	194,767,200
日本ピストンリング	5,700	1,031.00	5,876,700
リケン	7,100	2,697.00	19,148,700
T P R	20,700	1,275.00	26,392,500
ツバキ・ナカシマ	29,500	796.00	23,482,000
ホシザキ	48,400	8,380.00	405,592,000
大豊工業	12,700	562.00	7,137,400
日本精工	289,300	801.00	231,729,300
NTN	355,600	197.00	70,053,200
ジェイテクト	147,500	820.00	120,950,000
不二越	14,300	3,690.00	52,767,000
日本トムソン	45,800	373.00	17,083,400
THK	95,800	2,629.00	251,858,200
ユーシン精機	12,000	698.00	8,376,000
前澤給装工業	5,600	2,300.00	12,880,000
イーグル工業	19,100	791.00	15,108,100
前澤工業	10,400	496.00	5,158,400
日本ピラー工業	15,600	1,594.00	24,866,400
キッツ	62,400	598.00	37,315,200
マキタ	200,400	5,020.00	1,006,008,000
日立造船	122,200	444.00	54,256,800
三菱重工業	257,500	2,330.50	600,103,750
I H I	110,800	1,395.00	154,566,000
スター精密	23,700	1,392.00	32,990,400
日清紡ホールディングス	94,100	715.00	67,281,500

イビデン	94,300	3,550.00	334,765,000
コニカミノルタ	338,100	296.00	100,077,600
ブラザー工業	188,100	1,666.00	313,374,600
ミネベアミツミ	285,600	1,990.00	568,344,000
日立製作所	738,300	3,543.00	2,615,796,900
三菱電機	1,536,400	1,421.50	2,183,992,600
富士電機	92,600	3,310.00	306,506,000
東洋電機製造	5,700	1,148.00	6,543,600
安川電機	165,400	4,095.00	677,313,000
シンフォニアテクノロジー	20,000	1,196.00	23,920,000
明電舎	28,300	1,615.00	45,704,500
オリジン	4,200	1,411.00	5,926,200
山洋電気	7,600	4,790.00	36,404,000
デンヨー	13,100	2,468.00	32,330,800
東芝テック	19,300	4,395.00	84,823,500
芝浦メカトロニクス	3,000	3,110.00	9,330,000
マブチモーター	42,700	4,075.00	174,002,500
日本電産	369,800	9,805.00	3,625,889,000
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,279.00	12,022,600
東光高岳	9,200	1,069.00	9,834,800
ダイヘン	16,800	4,255.00	71,484,000
ヤーマン	25,500	1,567.00	39,958,500
JVCケンウッド	130,000	146.00	18,980,000
ミマキエンジニアリング	15,300	529.00	8,093,700
I - P E X	7,500	2,169.00	16,267,500
日新電機	36,100	1,117.00	40,323,700
大崎電気工業	30,800	611.00	18,818,800
オムロン	137,700	8,180.00	1,126,386,000
日東工業	22,600	2,085.00	47,121,000
I D E C	22,300	1,904.00	42,459,200
正興電機製作所	4,300	1,150.00	4,945,000
不二電機工業	3,100	1,328.00	4,116,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	51,700	1,808.00	93,473,600
サクサホールディングス	3,700	1,211.00	4,480,700
メルコホールディングス	5,600	2,388.00	13,372,800
テクノメディカ	3,800	1,681.00	6,387,800
日本電気	186,400	6,140.00	1,144,496,000
富士通	148,100	14,340.00	2,123,754,000
沖電気工業	62,500	1,130.00	70,625,000
岩崎通信機	6,700	850.00	5,695,000
電気興業	7,400	2,606.00	19,284,400
サンケン電気	16,800	2,454.00	41,227,200

ナカヨ	3,100	1,513.00	4,690,300
アイホン	8,800	1,518.00	13,358,400
ルネサスエレクトロニクス	657,700	765.00	503,140,500
セイコーエプソン	190,700	1,205.00	229,793,500
ワコム	104,300	691.00	72,071,300
アルバック	28,300	3,805.00	107,681,500
アクセル	7,200	888.00	6,393,600
E I Z O	12,000	4,095.00	49,140,000
日本信号	39,200	1,036.00	40,611,200
京三製作所	36,200	483.00	17,484,600
能美防災	20,600	2,403.00	49,501,800
ホーチキ	11,700	1,282.00	14,999,400
星和電機	8,800	621.00	5,464,800
エレコム	17,500	5,160.00	90,300,000
パナソニック	1,755,400	888.80	1,560,199,520
シャープ	177,900	1,298.00	230,914,200
アンリツ	99,000	2,393.00	236,907,000
富士通ゼネラル	41,700	3,050.00	127,185,000
ソニー	962,500	8,032.00	7,730,800,000
T D K	74,200	11,410.00	846,622,000
帝国通信工業	7,400	1,200.00	8,880,000
タムラ製作所	51,600	532.00	27,451,200
アルプスアルパイン	136,500	1,408.00	192,192,000
池上通信機	4,900	866.00	4,243,400
鈴木	8,600	685.00	5,891,000
日本トリム	2,300	3,795.00	8,728,500
ローランド ディー . ジー .	9,600	1,364.00	13,094,400
フォスター電機	16,200	1,127.00	18,257,400
S M K	4,000	2,841.00	11,364,000
ヨコオ	10,200	2,747.00	28,019,400
ホシデン	42,700	946.00	40,394,200
ヒロセ電機	23,700	13,530.00	320,661,000
日本航空電子工業	35,300	1,442.00	50,902,600
T O A	16,600	853.00	14,159,800
マクセルホールディングス	33,700	1,085.00	36,564,500
古野電気	20,500	997.00	20,438,500
ユニデンホールディングス	4,300	1,750.00	7,525,000
スミダコーポレーション	14,100	738.00	10,405,800
アイコム	8,500	2,750.00	23,375,000
リオン	6,800	2,403.00	16,340,400
本多通信工業	14,600	538.00	7,854,800
横河電機	141,000	1,665.00	234,765,000

新電元工業	5,500	2,003.00	11,016,500	
アズビル	97,000	3,920.00	380,240,000	
東亜ディーケーケー	8,400	906.00	7,610,400	
日本光電工業	63,700	3,460.00	220,402,000	
チノー	5,400	1,400.00	7,560,000	
共和電業	16,300	440.00	7,172,000	
日本電子材料	6,100	1,916.00	11,687,600	
堀場製作所	30,500	5,480.00	167,140,000	
アドバンテスト	114,300	5,090.00	581,787,000	
小野測器	7,800	551.00	4,297,800	
エスベック	14,000	1,870.00	26,180,000	
キーエンス	139,200	48,980.00	6,818,016,000	
日置電機	7,500	4,130.00	30,975,000	
シスメックス	109,900	10,030.00	1,102,297,000	
日本マイクロニクス	27,400	1,099.00	30,112,600	
メガチップス	14,600	2,870.00	41,902,000	
O B A R A G R O U P	9,200	3,535.00	32,522,000	
澤藤電機	2,200	1,932.00	4,250,400	
原田工業	8,000	918.00	7,344,000	
コーセル	21,100	1,074.00	22,661,400	
イリソ電子工業	13,100	4,240.00	55,544,000	
オブテックスグループ	25,700	1,689.00	43,407,300	
千代田インテグレ	6,900	1,629.00	11,240,100	
アイ・オー・データ機器	5,600	1,076.00	6,025,600	
レーザーテック	67,500	8,610.00	581,175,000	
スタンレー電気	108,000	3,015.00	325,620,000	
岩崎電気	6,500	1,434.00	9,321,000	
ウシオ電機	85,400	1,336.00	114,094,400	
岡谷電機産業	14,000	381.00	5,334,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	16,400	362.00	5,936,800	
エノモト	5,300	1,086.00	5,755,800	
日本セラミック	15,900	2,622.00	41,689,800	
遠藤照明	8,800	679.00	5,975,200	
古河電池	11,700	1,057.00	12,366,900	
双信電機	9,100	460.00	4,186,000	
山一電機	11,700	1,286.00	15,046,200	
函研	10,200	2,828.00	28,845,600	
日本電子	30,500	3,615.00	110,257,500	
カシオ計算機	136,000	1,694.00	230,384,000	
ファナック	144,500	20,120.00	2,907,340,000	
日本シイエムケイ	37,600	482.00	18,123,200	
エンプラス	8,200	2,240.00	18,368,000	

大真空	6,000	1,895.00	11,370,000
ローム	64,000	8,100.00	518,400,000
浜松ホトニクス	110,300	5,290.00	583,487,000
三井ハイテック	17,300	2,091.00	36,174,300
新光電気工業	52,000	1,835.00	95,420,000
京セラ	216,300	5,997.00	1,297,151,100
太陽誘電	68,500	3,290.00	225,365,000
村田製作所	451,400	6,773.00	3,057,332,200
双葉電子工業	25,000	938.00	23,450,000
北陸電気工業	6,900	1,024.00	7,065,600
ニチコン	53,000	803.00	42,559,000
日本ケミコン	11,700	1,408.00	16,473,600
K O A	23,800	1,130.00	26,894,000
市光工業	24,500	460.00	11,270,000
小糸製作所	92,200	5,350.00	493,270,000
ミツバ	28,300	366.00	10,357,800
S C R E E Nホールディングス	26,700	5,570.00	148,719,000
キャノン電子	14,600	1,469.00	21,447,400
キャノン	763,500	1,746.50	1,333,452,750
リコー	391,000	706.00	276,046,000
象印マホービン	42,000	1,741.00	73,122,000
M U T O Hホールディングス	2,400	1,525.00	3,660,000
東京エレクトロン	97,500	27,330.00	2,664,675,000
トヨタ紡織	44,800	1,485.00	66,528,000
芦森工業	3,300	888.00	2,930,400
ユニプレス	29,900	856.00	25,594,400
豊田自動織機	124,400	6,640.00	826,016,000
モリタホールディングス	26,900	2,051.00	55,171,900
三櫻工業	19,600	569.00	11,152,400
デンソー	338,300	4,597.00	1,555,165,100
東海理化電機製作所	40,500	1,565.00	63,382,500
三井E & Sホールディングス	55,500	377.00	20,923,500
川崎重工業	119,500	1,417.00	169,331,500
名村造船所	49,400	160.00	7,904,000
日本車輛製造	5,600	2,805.00	15,708,000
三菱ロジスネクスト	20,300	951.00	19,305,300
近畿車輛	2,300	1,369.00	3,148,700
日産自動車	1,812,000	371.80	673,701,600
いすゞ自動車	445,200	917.40	408,426,480
トヨタ自動車	1,714,300	6,932.00	11,883,527,600
日野自動車	191,900	679.00	130,300,100
三菱自動車工業	568,700	231.00	131,369,700

エフテック	10,900	502.00	5,471,800
レシップホールディングス	6,000	607.00	3,642,000
G M B	2,900	681.00	1,974,900
ファルテック	2,800	622.00	1,741,600
武蔵精密工業	34,300	1,105.00	37,901,500
日産車体	30,000	920.00	27,600,000
新明和工業	41,400	905.00	37,467,000
極東開発工業	28,500	1,394.00	39,729,000
日信工業	31,300	2,243.00	70,205,900
トピー工業	12,700	1,142.00	14,503,400
ティラド	5,600	1,313.00	7,352,800
曙ブレーキ工業	84,300	147.00	12,392,100
タチエス	25,300	970.00	24,541,000
N O K	82,700	1,091.00	90,225,700
フタバ産業	42,900	533.00	22,865,700
K Y B	17,200	2,171.00	37,341,200
大同メタル工業	29,600	510.00	15,096,000
プレス工業	76,400	298.00	22,767,200
ミクニ	19,800	286.00	5,662,800
太平洋工業	32,300	962.00	31,072,600
ケーヒン	35,300	2,591.00	91,462,300
河西工業	21,000	354.00	7,434,000
アイシン精機	126,500	3,350.00	423,775,000
マツダ	452,100	611.00	276,233,100
今仙電機製作所	14,400	685.00	9,864,000
本田技研工業	1,209,700	2,473.50	2,992,192,950
スズキ	304,500	4,483.00	1,365,073,500
S U B A R U	477,000	2,032.00	969,264,000
安永	7,500	1,283.00	9,622,500
ヤマハ発動機	217,100	1,522.00	330,426,200
ショーワ	36,500	2,292.00	83,658,000
T B K	18,400	500.00	9,200,000
エクセディ	20,900	1,366.00	28,549,400
豊田合成	49,600	2,405.00	119,288,000
愛三工業	24,200	468.00	11,325,600
盟和産業	2,400	1,002.00	2,404,800
日本プラスト	12,200	429.00	5,233,800
ヨロズ	14,400	1,048.00	15,091,200
エフ・シー・シー	25,200	1,932.00	48,686,400
シマノ	57,500	20,720.00	1,191,400,000
テイ・エス テック	35,700	2,963.00	105,779,100
ジャムコ	7,800	664.00	5,179,200

テルモ	434,800	4,180.00	1,817,464,000
クリエートメディック	5,100	1,088.00	5,548,800
日機装	49,600	1,066.00	52,873,600
日本エム・ディ・エム	8,900	2,161.00	19,232,900
島津製作所	183,600	3,190.00	585,684,000
JMS	13,000	913.00	11,869,000
長野計器	11,200	850.00	9,520,000
ブイ・テクノロジー	7,200	4,415.00	31,788,000
東京計器	9,800	938.00	9,192,400
愛知時計電機	2,000	4,565.00	9,130,000
インターアクション	8,300	1,940.00	16,102,000
オーバル	13,900	239.00	3,322,100
東京精密	27,900	3,330.00	92,907,000
マニー	61,200	2,867.00	175,460,400
ニコン	234,700	708.00	166,167,600
トプコン	77,400	959.00	74,226,600
オリンパス	850,100	2,182.00	1,854,918,200
理研計器	13,600	2,902.00	39,467,200
タムロン	12,400	1,658.00	20,559,200
HOYA	304,800	11,860.00	3,614,928,000
シード	6,600	745.00	4,917,000
ノーリツ鋼機	10,400	1,624.00	16,889,600
エー・アンド・デイ	14,100	650.00	9,165,000
朝日インテック	174,000	3,300.00	574,200,000
シチズン時計	180,100	294.00	52,949,400
リズム時計工業	4,900	666.00	3,263,400
大研医器	10,700	545.00	5,831,500
メニコン	21,800	7,020.00	153,036,000
シンシア	1,700	415.00	705,500
松風	6,900	1,428.00	9,853,200
セイコーホールディングス	21,800	1,417.00	30,890,600
ニプロ	106,400	1,225.00	130,340,000
中本パックス	3,900	1,628.00	6,349,200
スノーピーク	9,100	1,845.00	16,789,500
パラマウントベッドホールディングス	16,200	4,340.00	70,308,000
トランザクション	8,400	1,170.00	9,828,000
粧美堂	4,500	390.00	1,755,000
ニホンフラッシュ	14,300	1,390.00	19,877,000
前田工織	16,900	2,735.00	46,221,500
永大産業	20,100	323.00	6,492,300
アートネイチャー	16,400	668.00	10,955,200
バンダイナムコホールディングス	158,800	7,689.00	1,221,013,200

アイフィスジャパン	3,900	780.00	3,042,000	
共立印刷	25,700	139.00	3,572,300	
S H O E I	13,400	3,490.00	46,766,000	
フランスベッドホールディングス	21,700	883.00	19,161,100	
パイロットコーポレーション	27,200	3,090.00	84,048,000	
萩原工業	8,500	1,604.00	13,634,000	
トッパン・フォームズ	32,900	1,000.00	32,900,000	
フジシールインターナショナル	34,400	2,023.00	69,591,200	
タカラトミー	68,900	905.00	62,354,500	
廣濟堂	10,700	666.00	7,126,200	
エステールホールディングス	4,100	682.00	2,796,200	
タカノ	6,000	602.00	3,612,000	
プロネクサス	13,200	1,243.00	16,407,600	
ホクシン	9,500	119.00	1,130,500	
ウッドワン	5,200	1,290.00	6,708,000	
大建工業	10,300	1,833.00	18,879,900	
凸版印刷	216,900	1,478.00	320,578,200	
大日本印刷	201,100	2,126.00	427,538,600	
共同印刷	4,700	2,640.00	12,408,000	
N I S S H A	31,500	1,307.00	41,170,500	
光村印刷	1,300	1,827.00	2,375,100	
T A K A R A & C O M P A N Y	7,400	2,205.00	16,317,000	
アシックス	135,900	1,464.00	198,957,600	
ツツミ	4,800	2,508.00	12,038,400	
小松ウオール工業	4,700	1,795.00	8,436,500	
ヤマハ	91,400	5,020.00	458,828,000	
河合楽器製作所	4,700	2,730.00	12,831,000	
クリナップ	14,300	513.00	7,335,900	
ビジョン	98,600	4,700.00	463,420,000	
オリバー	3,200	2,829.00	9,052,800	
兼松サステック	1,000	1,602.00	1,602,000	
キングジム	12,800	906.00	11,596,800	
リンテック	36,500	2,444.00	89,206,000	
イトーキ	30,500	361.00	11,010,500	
任天堂	94,200	59,660.00	5,619,972,000	
三菱鉛筆	25,300	1,371.00	34,686,300	
タカラスタANDARD	31,700	1,413.00	44,792,100	
コクヨ	73,700	1,320.00	97,284,000	
ナカバヤシ	15,100	666.00	10,056,600	
グローブライド	6,900	3,095.00	21,355,500	
オカムラ	53,600	741.00	39,717,600	
美津濃	13,900	1,896.00	26,354,400	

東京電力ホールディングス	1,226,500	289.00	354,458,500	
中部電力	470,000	1,281.00	602,070,000	
関西電力	582,100	1,020.00	593,742,000	
中国電力	221,600	1,319.00	292,290,400	
北陸電力	140,500	789.00	110,854,500	
東北電力	383,800	1,056.00	405,292,800	
四国電力	138,300	804.00	111,193,200	
九州電力	316,700	957.00	303,081,900	
北海道電力	143,800	450.00	64,710,000	
沖縄電力	29,900	1,648.00	49,275,200	
電源開発	122,200	1,623.00	198,330,600	
エフオン	8,300	644.00	5,345,200	
イーレックス	21,900	1,090.00	23,871,000	
レノバ	25,700	1,121.00	28,809,700	
東京瓦斯	295,500	2,406.00	710,973,000	
大阪瓦斯	298,100	2,050.00	611,105,000	
東邦瓦斯	75,600	5,220.00	394,632,000	
北海道瓦斯	8,200	1,544.00	12,660,800	
広島ガス	31,600	379.00	11,976,400	
西部瓦斯	17,300	2,642.00	45,706,600	
静岡ガス	43,600	934.00	40,722,400	
メタウォーター	14,800	2,293.00	33,936,400	
SBSホールディングス	11,400	2,189.00	24,954,600	
東武鉄道	160,100	3,245.00	519,524,500	
相鉄ホールディングス	49,200	2,835.00	139,482,000	
東急	387,500	1,363.00	528,162,500	
京浜急行電鉄	197,300	1,614.00	318,442,200	
小田急電鉄	228,500	2,644.00	604,154,000	
京王電鉄	79,700	6,500.00	518,050,000	
京成電鉄	106,900	2,969.00	317,386,100	
富士急行	20,900	3,930.00	82,137,000	
新京成電鉄	3,900	2,430.00	9,477,000	
東日本旅客鉄道	270,400	6,480.00	1,752,192,000	
西日本旅客鉄道	136,900	5,191.00	710,647,900	
東海旅客鉄道	127,700	15,090.00	1,926,993,000	
西武ホールディングス	200,600	1,130.00	226,678,000	
鴻池運輸	24,400	1,156.00	28,206,400	
西日本鉄道	42,600	3,045.00	129,717,000	
ハマキョウレックス	11,800	3,185.00	37,583,000	
サカイ引越センター	8,100	5,130.00	41,553,000	
近鉄グループホールディングス	145,500	4,485.00	652,567,500	
阪急阪神ホールディングス	194,100	3,380.00	656,058,000	

南海電気鉄道	69,000	2,330.00	160,770,000
京阪ホールディングス	64,800	4,360.00	282,528,000
神戸電鉄	3,500	3,755.00	13,142,500
名古屋鉄道	119,600	2,882.00	344,687,200
山陽電気鉄道	10,400	2,203.00	22,911,200
日本通運	50,400	6,140.00	309,456,000
ヤマトホールディングス	255,100	2,761.00	704,331,100
山九	40,400	4,135.00	167,054,000
丸運	8,300	274.00	2,274,200
丸全昭和運輸	11,800	3,585.00	42,303,000
センコーグループホールディングス	80,200	980.00	78,596,000
トナミホールディングス	3,500	6,510.00	22,785,000
ニッコンホールディングス	52,100	2,279.00	118,735,900
日本石油輸送	1,600	2,700.00	4,320,000
福山通運	18,600	5,110.00	95,046,000
セイノーホールディングス	109,000	1,526.00	166,334,000
エスライン	4,400	1,004.00	4,417,600
神奈川中央交通	3,600	4,000.00	14,400,000
日立物流	26,700	3,325.00	88,777,500
丸和運輸機関	15,300	4,155.00	63,571,500
C & F ロジホールディングス	14,700	1,775.00	26,092,500
九州旅客鉄道	127,600	2,247.00	286,717,200
S Gホールディングス	152,700	5,450.00	832,215,000
日本郵船	122,300	1,817.00	222,219,100
商船三井	92,600	2,058.00	190,570,800
川崎汽船	44,800	1,168.00	52,326,400
N S ユナイテッド海運	8,800	1,441.00	12,680,800
飯野海運	71,800	374.00	26,853,200
共栄タンカー	4,000	772.00	3,088,000
乾汽船	8,400	876.00	7,358,400
日本航空	257,300	1,966.00	505,851,800
A N Aホールディングス	266,000	2,430.00	646,380,000
パスコ	2,800	1,413.00	3,956,400
トランコム	4,100	7,580.00	31,078,000
日新	12,600	1,589.00	20,021,400
三菱倉庫	46,200	2,988.00	138,045,600
三井倉庫ホールディングス	16,600	1,831.00	30,394,600
住友倉庫	52,300	1,330.00	69,559,000
澁澤倉庫	8,000	2,346.00	18,768,000
東陽倉庫	26,300	352.00	9,257,600
日本トランスシティ	32,000	584.00	18,688,000
ケイヒン	2,800	1,418.00	3,970,400

中央倉庫	8,900	1,250.00	11,125,000
川西倉庫	2,700	1,151.00	3,107,700
安田倉庫	11,900	943.00	11,221,700
ファイズホールディングス	3,100	1,222.00	3,788,200
東洋埠頭	4,400	1,519.00	6,683,600
宇徳	12,400	520.00	6,448,000
上組	81,200	2,068.00	167,921,600
サンリツ	3,400	631.00	2,145,400
キムラユニティー	3,900	1,085.00	4,231,500
キューソー流通システム	3,600	1,586.00	5,709,600
近鉄エクスプレス	30,900	2,228.00	68,845,200
東海運	8,300	311.00	2,581,300
エーアイティー	10,300	1,123.00	11,566,900
内外トランスライン	5,100	1,287.00	6,563,700
日本コンセプト	4,600	1,469.00	6,757,400
NEC ネットエスアイ	42,900	2,013.00	86,357,700
クロスキャット	4,200	1,530.00	6,426,000
システナ	54,000	1,824.00	98,496,000
デジタルアーツ	7,500	8,570.00	64,275,000
日鉄ソリューションズ	22,700	3,240.00	73,548,000
キューブシステム	8,300	1,403.00	11,644,900
エイジア	2,900	2,380.00	6,902,000
コア	6,600	1,413.00	9,325,800
ラクーンホールディングス	7,200	2,102.00	15,134,400
ソリトンシステムズ	7,700	2,132.00	16,416,400
ソフトクリエイティブホールディングス	6,700	3,330.00	22,311,000
T I S	150,900	2,228.00	336,205,200
J N S ホールディングス	6,000	744.00	4,464,000
電算システム	5,400	3,675.00	19,845,000
グリー	93,300	510.00	47,583,000
コーエーテクモホールディングス	30,900	5,060.00	156,354,000
三菱総合研究所	6,600	4,430.00	29,238,000
電算	1,800	2,437.00	4,386,600
A G S	8,900	941.00	8,374,900
ファインデックス	13,000	1,344.00	17,472,000
ブレインパッド	4,000	4,255.00	17,020,000
K L a b	27,400	940.00	25,756,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,600	946.00	17,595,600
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	3,455.00	7,946,500
ネクソン	380,000	2,622.00	996,360,000
アイスタイル	43,500	320.00	13,920,000
エムアップホールディングス	4,500	3,055.00	13,747,500

エイチーム	10,900	785.00	8,556,500
エニグモ	14,500	1,670.00	24,215,000
テクノスジャパン	12,100	931.00	11,265,100
コロプラ	49,900	898.00	44,810,200
ブロードリーフ	75,400	545.00	41,093,000
クロス・マーケティンググループ	7,700	360.00	2,772,000
デジタルハーツホールディングス	8,300	1,090.00	9,047,000
システム情報	11,600	1,386.00	16,077,600
メディアドゥ	4,800	7,610.00	36,528,000
じげん	38,500	344.00	13,244,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,700	881.00	3,259,700
サイバーリンクス	2,600	2,820.00	7,332,000
フィックスターズ	16,400	1,130.00	18,532,000
CARTA HOLDINGS	6,400	1,302.00	8,332,800
オブティム	8,000	3,190.00	25,520,000
セレス	5,100	2,133.00	10,878,300
SHIFT	6,100	15,760.00	96,136,000
ティーガイア	13,600	1,972.00	26,819,200
セック	2,300	3,145.00	7,233,500
日本アジアグループ	15,900	298.00	4,738,200
テクマトリックス	21,400	2,285.00	48,899,000
プロシップ	4,600	1,597.00	7,346,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,500	2,257.00	82,380,500
GMOペイメントゲートウェイ	31,900	11,240.00	358,556,000
ザッパラス	7,400	477.00	3,529,800
システムリサーチ	4,200	1,908.00	8,013,600
インターネットイニシアティブ	22,400	4,720.00	105,728,000
さくらインターネット	16,600	789.00	13,097,400
ヴィンクス	4,500	1,269.00	5,710,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	10,040.00	34,136,000
SRAホールディングス	8,200	2,412.00	19,778,400
システムインテグレータ	5,300	721.00	3,821,300
朝日ネット	11,100	951.00	10,556,100
eBASE	18,300	1,369.00	25,052,700
アバント	14,700	1,043.00	15,332,100
アドソル日進	5,500	2,685.00	14,767,500
フリービット	8,200	951.00	7,798,200
コムチュア	17,100	2,631.00	44,990,100
サイバーコム	2,900	1,860.00	5,394,000
アステリア	9,700	832.00	8,070,400
アイル	8,600	1,546.00	13,295,600
マークライنز	6,500	2,364.00	15,366,000

メディカル・データ・ビジョン	17,400	2,170.00	37,758,000
ショーケース	3,600	991.00	3,567,600
モバイルファクトリー	3,700	1,272.00	4,706,400
テラスカイ	5,500	5,020.00	27,610,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,200	1,333.00	8,264,600
P C Iホールディングス	6,000	1,216.00	7,296,000
パイプドHD	2,100	1,803.00	3,786,300
アイビーシー	2,800	1,140.00	3,192,000
ネオジャパン	3,000	2,290.00	6,870,000
P R T I M E S	2,700	2,818.00	7,608,600
ランドコンピュータ	2,700	1,176.00	3,175,200
ダブルスタンダード	2,000	5,070.00	10,140,000
オープンドア	7,800	1,363.00	10,631,400
マイネット	4,900	1,490.00	7,301,000
アカツキ	5,400	4,620.00	24,948,000
ベネフィットジャパン	1,300	1,888.00	2,454,400
U b i c o mホールディングス	3,500	2,644.00	9,254,000
L I N E	34,700	5,360.00	185,992,000
カナミックネットワーク	14,300	808.00	11,554,400
ノムラシステムコーポレーション	7,500	426.00	3,195,000
チェンジ	10,600	8,380.00	88,828,000
シンクロ・フード	7,600	338.00	2,568,800
オークネット	8,300	1,465.00	12,159,500
セグエグループ	4,100	1,611.00	6,605,100
エイトレッド	2,700	2,781.00	7,508,700
A O I T Y O H o l d i n g s	16,200	418.00	6,771,600
マクロミル	31,300	755.00	23,631,500
ビーグリー	3,200	1,874.00	5,996,800
オロ	4,900	3,485.00	17,076,500
ユーザーローカル	1,600	4,430.00	7,088,000
テモナ	3,500	1,359.00	4,756,500
ニーズウェル	3,300	985.00	3,250,500
サインポスト	3,400	1,367.00	4,647,800
ソルクシーズ	6,100	1,091.00	6,655,100
フェイス	5,700	995.00	5,671,500
プロトコーポレーション	13,800	1,269.00	17,512,200
ハイマックス	3,800	1,315.00	4,997,000
野村総合研究所	213,800	3,095.00	661,711,000
サイバネットシステム	11,200	884.00	9,900,800
C Eホールディングス	8,500	670.00	5,695,000
日本システム技術	2,600	1,859.00	4,833,400
インテージホールディングス	19,200	994.00	19,084,800

東邦システムサイエンス	4,400	977.00	4,298,800
ソースネクスト	72,700	317.00	23,045,900
インフォコム	16,600	4,040.00	67,064,000
HEROZ	2,200	3,540.00	7,788,000
ラクスル	12,200	4,290.00	52,338,000
FIG	17,800	278.00	4,948,400
システムサポート	3,700	1,707.00	6,315,900
イーソル	8,500	1,221.00	10,378,500
アルテリア・ネットワークス	16,900	1,825.00	30,842,500
東海ソフト	1,300	1,379.00	1,792,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,374.00	3,984,600
東名	1,100	1,427.00	1,569,700
ヴィッツ	700	3,330.00	2,331,000
トピラシステムズ	1,700	1,976.00	3,359,200
Link-U	1,200	2,055.00	2,466,000
フォーカスシステムズ	9,700	1,016.00	9,855,200
クレスコ	9,500	1,373.00	13,043,500
フジ・メディア・ホールディングス	145,600	1,011.00	147,201,600
オービック	52,300	18,440.00	964,412,000
ジャストシステム	24,600	7,430.00	182,778,000
TDCソフト	13,500	1,067.00	14,404,500
Zホールディングス	2,071,000	699.00	1,447,629,000
トレンドマイクロ	80,500	6,410.00	516,005,000
IDホールディングス	6,000	1,485.00	8,910,000
日本オラクル	30,600	11,320.00	346,392,000
アルファシステムズ	4,800	3,640.00	17,472,000
フューチャー	18,400	2,180.00	40,112,000
CAC Holdings	10,100	1,400.00	14,140,000
S Bテクノロジー	5,500	3,680.00	20,240,000
トーセ	4,500	963.00	4,333,500
オービックビジネスコンサルタント	15,500	6,100.00	94,550,000
伊藤忠テクノソリューションズ	68,800	3,985.00	274,168,000
アイティフォー	18,700	904.00	16,904,800
東計電算	2,300	4,890.00	11,247,000
エクスネット	2,800	1,115.00	3,122,000
大塚商会	81,600	5,380.00	439,008,000
サイボウズ	17,700	3,310.00	58,587,000
ソフトブレーン	12,300	868.00	10,676,400
電通国際情報サービス	9,400	6,620.00	62,228,000
ACCESS	14,500	887.00	12,861,500
デジタルガレージ	27,300	3,570.00	97,461,000
EMシステムズ	21,800	866.00	18,878,800

ウェザーニューズ	5,100	5,970.00	30,447,000
C I J	10,700	930.00	9,951,000
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,665.00	6,597,000
日本エンタープライズ	16,700	290.00	4,843,000
WOWOW	7,400	2,791.00	20,653,400
スカラ	10,500	1,061.00	11,140,500
インテリジェント ウェイブ	9,300	830.00	7,719,000
I M A G I C A G R O U P	13,800	400.00	5,520,000
ネットワンシステムズ	57,500	4,780.00	274,850,000
システムソフト	36,400	103.00	3,749,200
アルゴグラフィックス	12,900	3,605.00	46,504,500
マーベラス	23,500	800.00	18,800,000
エイベックス	26,300	981.00	25,800,300
日本ユニシス	47,200	3,300.00	155,760,000
兼松エレクトロニクス	8,300	4,260.00	35,358,000
都築電気	5,000	1,658.00	8,290,000
東京放送ホールディングス	91,900	1,806.00	165,971,400
日本テレビホールディングス	126,200	1,129.00	142,479,800
朝日放送グループホールディングス	15,500	713.00	11,051,500
テレビ朝日ホールディングス	41,600	1,666.00	69,305,600
スカパーJ S A Tホールディングス	100,000	459.00	45,900,000
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,401.00	30,012,500
日本BS放送	5,400	1,166.00	6,296,400
ビジョン	19,200	815.00	15,648,000
スマートバリュー	4,300	1,085.00	4,665,500
ワイヤレスゲート	6,600	762.00	5,029,200
コネクシオ	8,900	1,176.00	10,466,400
クロップス	3,300	756.00	2,494,800
日本電信電話	2,015,400	2,150.00	4,333,110,000
K D D I	1,099,200	2,656.00	2,919,475,200
ソフトバンク	1,370,400	1,177.50	1,613,646,000
光通信	15,600	24,980.00	389,688,000
N T T ドコモ	1,078,200	3,885.00	4,188,807,000
エムティーアイ	15,000	882.00	13,230,000
G M O インターネット	54,200	2,741.00	148,562,200
ファイバーゲート	5,100	1,869.00	9,531,900
アйдママーケティングコミュニケーション	5,400	422.00	2,278,800
K A D O K A W A	40,700	2,772.00	112,820,400
学研ホールディングス	20,500	1,624.00	33,292,000
ゼンリン	30,400	1,125.00	34,200,000
昭文社ホールディングス	7,700	503.00	3,873,100
インプレスホールディングス	12,500	182.00	2,275,000

アイネット	8,000	1,669.00	13,352,000
松竹	10,000	15,370.00	153,700,000
東宝	89,000	4,335.00	385,815,000
東映	5,700	17,490.00	99,693,000
エヌ・ティ・ティ・データ	401,700	1,342.00	539,081,400
ピー・シー・エー	2,700	4,760.00	12,852,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,400	1,515.00	8,181,000
D T S	33,900	2,235.00	75,766,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,400	6,960.00	448,224,000
シーイーシー	16,400	1,623.00	26,617,200
カブコン	71,100	5,860.00	416,646,000
アイ・エス・ピー	3,600	2,732.00	9,835,200
ジャステック	9,900	1,405.00	13,909,500
S C S K	34,900	5,870.00	204,863,000
日本システムウエア	5,200	2,035.00	10,582,000
アイネス	15,100	1,630.00	24,613,000
T K C	12,800	6,810.00	87,168,000
富士ソフト	16,200	5,410.00	87,642,000
N S D	48,600	2,058.00	100,018,800
コナミホールディングス	54,800	4,540.00	248,792,000
福井コンピュータホールディングス	6,100	3,065.00	18,696,500
J B C Cホールディングス	10,400	1,696.00	17,638,400
ミロク情報サービス	13,500	2,192.00	29,592,000
ソフトバンクグループ	1,196,300	6,469.00	7,738,864,700
ハウスイ	1,200	911.00	1,093,200
高千穂交易	5,900	1,028.00	6,065,200
カワニシホールディングス	1,800	1,449.00	2,608,200
伊藤忠食品	3,700	5,650.00	20,905,000
エレマテック	14,200	991.00	14,072,200
J A L U X	4,300	1,554.00	6,682,200
あらた	12,000	5,250.00	63,000,000
トーメンデバイス	2,300	4,070.00	9,361,000
東京エレクトロン デバイス	5,500	3,140.00	17,270,000
フィールズ	11,600	338.00	3,920,800
双日	835,800	238.00	198,920,400
アルフレッサ ホールディングス	168,200	2,298.00	386,523,600
横浜冷凍	39,600	913.00	36,154,800
ラサ商事	8,000	927.00	7,416,000
アルコニックス	16,100	1,521.00	24,488,100
神戸物産	52,200	5,780.00	301,716,000
ハイパー	2,300	572.00	1,315,600
あい ホールディングス	21,600	1,933.00	41,752,800

ディーブイエックス	5,400	1,037.00	5,599,800	
ダイワボウホールディングス	12,900	6,770.00	87,333,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	36,100	1,915.00	69,131,500	
ラクト・ジャパン	6,600	3,830.00	25,278,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,089.00	31,036,500	
八洲電機	11,700	968.00	11,325,600	
メディアスホールディングス	8,600	930.00	7,998,000	
レスターホールディングス	15,800	2,162.00	34,159,600	
ジュテックホールディングス	3,500	1,040.00	3,640,000	
大光	6,500	700.00	4,550,000	
OCHIホールディングス	4,400	1,892.00	8,324,800	
TOKAIホールディングス	80,000	1,036.00	82,880,000	
黒谷	4,200	522.00	2,192,400	
Cominix	2,700	732.00	1,976,400	
三洋貿易	15,300	994.00	15,208,200	
ビューティガレージ	2,400	2,928.00	7,027,200	
ウイン・パートナーズ	10,900	1,029.00	11,216,100	
ミタチ産業	4,600	628.00	2,888,800	
シップヘルスケアホールディングス	24,300	5,130.00	124,659,000	
明治電機工業	4,800	1,414.00	6,787,200	
デリカフーズホールディングス	5,400	643.00	3,472,200	
スターティアホールディングス	3,500	716.00	2,506,000	
コメダホールディングス	33,000	1,964.00	64,812,000	
ピーバンドットコム	1,500	971.00	1,456,500	
アセンテック	3,200	2,299.00	7,356,800	
富士興産	4,600	716.00	3,293,600	
協栄産業	1,700	1,431.00	2,432,700	
小野建	13,600	1,120.00	15,232,000	
南陽	3,300	1,764.00	5,821,200	
佐島電機	10,300	853.00	8,785,900	
エコートレーディング	3,500	652.00	2,282,000	
伯東	9,200	1,121.00	10,313,200	
コンドーテック	11,700	1,219.00	14,262,300	
中山福	8,700	509.00	4,428,300	
ナガイレーベン	20,100	2,974.00	59,777,400	
三菱食品	16,600	2,771.00	45,998,600	
松田産業	11,100	1,541.00	17,105,100	
第一興商	22,500	3,375.00	75,937,500	
メディバルホールディングス	163,300	2,105.00	343,746,500	
S P K	6,500	1,530.00	9,945,000	
萩原電気ホールディングス	5,600	2,282.00	12,779,200	
アズワン	9,900	15,090.00	149,391,000	

スズデン	5,300	1,234.00	6,540,200
尾家産業	4,400	1,654.00	7,277,600
シモジマ	9,300	1,412.00	13,131,600
ドウシシャ	14,300	2,113.00	30,215,900
小津産業	3,300	1,883.00	6,213,900
高速	9,000	1,711.00	15,399,000
たけびし	5,300	1,595.00	8,453,500
リックス	3,400	1,690.00	5,746,000
丸文	13,400	530.00	7,102,000
ハピネット	12,600	1,416.00	17,841,600
橋本総業ホールディングス	3,100	2,534.00	7,855,400
日本ライフライン	44,800	1,391.00	62,316,800
タカショー	9,900	671.00	6,642,900
マルカ	4,900	2,282.00	11,181,800
I D O M	40,800	633.00	25,826,400
進和	9,000	2,231.00	20,079,000
エスケイジャパン	3,300	349.00	1,151,700
ダイトロン	6,400	1,528.00	9,779,200
シークス	19,300	1,234.00	23,816,200
田中商事	4,700	722.00	3,393,400
オーハシテクニカ	7,800	1,463.00	11,411,400
白銅	5,400	1,348.00	7,279,200
ダイコー通産	1,000	1,435.00	1,435,000
伊藤忠商事	1,058,400	2,685.00	2,841,804,000
丸紅	1,575,100	594.50	936,396,950
高島	2,400	1,936.00	4,646,400
長瀬産業	85,100	1,468.00	124,926,800
蝶理	9,700	1,612.00	15,636,400
豊田通商	168,900	2,942.00	496,903,800
三共生興	23,000	450.00	10,350,000
兼松	56,400	1,285.00	72,474,000
ツカモトコーポレーション	2,700	1,340.00	3,618,000
三井物産	1,310,200	1,803.00	2,362,290,600
日本紙パルプ商事	8,600	3,730.00	32,078,000
カメイ	19,800	1,090.00	21,582,000
東都水産	1,900	3,575.00	6,792,500
O U G ホールディングス	2,400	2,763.00	6,631,200
スターゼン	5,600	4,155.00	23,268,000
山善	59,100	1,061.00	62,705,100
椿本興業	2,800	3,690.00	10,332,000
住友商事	954,700	1,258.50	1,201,489,950
内田洋行	6,000	5,210.00	31,260,000

三菱商事	992,200	2,512.50	2,492,902,500
第一実業	7,400	3,705.00	27,417,000
キヤノンマーケティングジャパン	37,500	2,102.00	78,825,000
西華産業	8,600	1,478.00	12,710,800
佐藤商事	12,500	1,049.00	13,112,500
菱洋エレクトロ	15,400	2,921.00	44,983,400
東京産業	13,700	568.00	7,781,600
ユアサ商事	14,400	3,270.00	47,088,000
神鋼商事	3,800	1,788.00	6,794,400
トルク	9,100	324.00	2,948,400
阪和興業	28,300	2,100.00	59,430,000
正栄食品工業	9,800	4,350.00	42,630,000
カナデン	12,300	1,493.00	18,363,900
菱電商事	10,900	1,533.00	16,709,700
フルサト工業	8,400	1,480.00	12,432,000
岩谷産業	33,800	3,945.00	133,341,000
ナイス	6,400	1,470.00	9,408,000
昭光通商	4,800	637.00	3,057,600
ニチモウ	2,400	2,019.00	4,845,600
極東貿易	4,400	1,498.00	6,591,200
イワキ	19,900	507.00	10,089,300
三愛石油	37,300	1,002.00	37,374,600
稲畑産業	33,300	1,339.00	44,588,700
G S Iクレオス	3,700	1,763.00	6,523,100
明和産業	14,000	445.00	6,230,000
クワザワ	5,400	549.00	2,964,600
ヤマエ久野	11,000	1,231.00	13,541,000
ワキタ	32,300	1,052.00	33,979,600
東邦ホールディングス	48,500	2,262.00	109,707,000
サンゲツ	40,900	1,615.00	66,053,500
ミツウロコグループホールディングス	22,300	1,351.00	30,127,300
シナネンホールディングス	6,200	3,185.00	19,747,000
伊藤忠エネクス	33,500	968.00	32,428,000
サンリオ	42,500	1,894.00	80,495,000
サンワテクノス	10,700	885.00	9,469,500
リョーサン	16,700	2,105.00	35,153,500
新光商事	23,700	913.00	21,638,100
トーホー	6,800	2,101.00	14,286,800
三信電気	8,100	2,034.00	16,475,400
東陽テクニカ	16,200	997.00	16,151,400
モスフードサービス	19,900	2,905.00	57,809,500
加賀電子	15,100	2,234.00	33,733,400

ソーダニッカ	15,700	576.00	9,043,200
立花エレテック	11,200	1,885.00	21,112,000
フォーバル	6,600	1,031.00	6,804,600
PALTAC	24,300	5,310.00	129,033,000
三谷産業	20,000	387.00	7,740,000
西本Wismettacホールディングス	3,400	1,878.00	6,385,200
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	1,485.00	2,079,000
コア商事ホールディングス	1,400	2,471.00	3,459,400
国際紙パルプ商事	35,900	305.00	10,949,500
ヤマタネ	7,600	1,333.00	10,130,800
丸紅建材リース	1,500	1,780.00	2,670,000
日鉄物産	10,800	2,995.00	32,346,000
泉州電業	4,300	3,250.00	13,975,000
トラスコ中山	34,600	2,658.00	91,966,800
オートバックスセブン	56,200	1,366.00	76,769,200
モリト	11,100	713.00	7,914,300
加藤産業	21,800	3,770.00	82,186,000
北恵	3,800	1,198.00	4,552,400
イノテック	7,900	1,052.00	8,310,800
イエローハット	28,600	1,757.00	50,250,200
JKホールディングス	13,700	875.00	11,987,500
日伝	13,700	2,311.00	31,660,700
北沢産業	11,500	292.00	3,358,000
杉本商事	8,200	1,962.00	16,088,400
因幡電機産業	43,100	2,629.00	113,309,900
東テク	5,000	2,555.00	12,775,000
ミスミグループ本社	189,700	2,935.00	556,769,500
アルテック	11,200	264.00	2,956,800
タキヒヨー	4,600	1,903.00	8,753,800
蔵王産業	2,900	1,478.00	4,286,200
スズケン	64,100	4,005.00	256,720,500
ジェコス	10,500	939.00	9,859,500
グローセル	15,200	424.00	6,444,800
ローソン	38,300	5,020.00	192,266,000
サンエー	12,600	4,635.00	58,401,000
カワチ薬品	11,800	2,920.00	34,456,000
エービーシー・マート	23,700	5,470.00	129,639,000
ハードオフコーポレーション	6,400	704.00	4,505,600
アスクル	15,900	4,285.00	68,131,500
ゲオホールディングス	27,400	1,667.00	45,675,800
アダストリア	21,100	1,652.00	34,857,200
ジーフット	9,100	537.00	4,886,700

くら寿司	8,900	5,720.00	50,908,000
キャンドウ	7,300	2,172.00	15,855,600
パルグループホールディングス	15,700	1,117.00	17,536,900
エディオン	69,700	1,100.00	76,670,000
サーラコーポレーション	31,200	593.00	18,501,600
ワッツ	6,900	937.00	6,465,300
ハローズ	5,700	4,155.00	23,683,500
フジオフードグループ本社	12,800	1,419.00	18,163,200
あみやき亭	3,400	2,931.00	9,965,400
ひらまつ	27,800	199.00	5,532,200
大黒天物産	3,700	5,870.00	21,719,000
ハニーズホールディングス	13,600	1,025.00	13,940,000
ファーマライズホールディングス	4,000	830.00	3,320,000
アルペン	11,700	1,983.00	23,201,100
ハブ	4,700	695.00	3,266,500
クオールホールディングス	22,500	1,205.00	27,112,500
ジinzホールディングス	8,000	8,280.00	66,240,000
ビックカメラ	90,000	1,165.00	104,850,000
D C Mホールディングス	87,600	1,448.00	126,844,800
Monotaro	107,600	5,220.00	561,672,000
東京一番フーズ	4,300	586.00	2,519,800
きちりホールディングス	4,400	664.00	2,921,600
アーランドサービスホールディングス	12,800	2,113.00	27,046,400
J．フロント リテイリング	181,100	758.00	137,273,800
ドトール・日レスホールディングス	21,900	1,600.00	35,040,000
マツモトキヨシホールディングス	62,600	3,840.00	240,384,000
ブロンコビリー	8,000	2,403.00	19,224,000
Z O Z O	104,100	2,928.00	304,804,800
トレジャー・ファクトリー	4,800	786.00	3,772,800
物語コーポレーション	4,100	10,370.00	42,517,000
ココカラファイン	15,800	6,800.00	107,440,000
三越伊勢丹ホールディングス	265,100	556.00	147,395,600
Hamee	5,500	2,471.00	13,590,500
ウエルシアホールディングス	90,100	4,625.00	416,712,500
クリエイトSDホールディングス	25,600	3,685.00	94,336,000
丸善CHIホールディングス	17,700	381.00	6,743,700
ティーライフ	2,400	1,271.00	3,050,400
チムニー	4,800	1,373.00	6,590,400
シュッピン	10,600	816.00	8,649,600
オイシックス・ラ・大地	15,000	3,395.00	50,925,000
ネクステージ	25,600	1,144.00	29,286,400
ジョイフル本田	44,500	1,714.00	76,273,000

鳥貴族	4,600	1,477.00	6,794,200
キリン堂ホールディングス	6,000	3,500.00	21,000,000
ホットランド	11,500	1,189.00	13,673,500
すかいらーくホールディングス	169,700	1,500.00	254,550,000
SFPホールディングス	8,800	1,366.00	12,020,800
綿半ホールディングス	11,400	1,608.00	18,331,200
ヨシックス	2,600	1,700.00	4,420,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,200	1,268.00	56,045,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	703.00	5,764,600
B E E N O S	7,100	1,797.00	12,758,700
あさひ	11,400	1,847.00	21,055,800
日本調剤	9,300	1,701.00	15,819,300
コスモス薬品	13,400	18,350.00	245,890,000
トーエル	7,600	855.00	6,498,000
オンリー	3,100	526.00	1,630,600
セブン&アイ・ホールディングス	592,000	3,250.00	1,924,000,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	81,300	604.00	49,105,200
ツルハホールディングス	33,000	14,910.00	492,030,000
サンマルクホールディングス	12,100	1,543.00	18,670,300
フェリシモ	3,600	1,157.00	4,165,200
トリドールホールディングス	37,600	1,424.00	53,542,400
T O K Y O B A S E	14,300	395.00	5,648,500
ウイルプラスホールディングス	2,300	554.00	1,274,200
J Mホールディングス	11,500	2,815.00	32,372,500
サツドラホールディングス	2,400	2,071.00	4,970,400
アレンザホールディングス	7,700	1,724.00	13,274,800
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,736.00	7,117,600
パロックジャパンリミテッド	10,900	634.00	6,910,600
クスリのアオキホールディングス	13,600	8,580.00	116,688,000
力の源ホールディングス	6,900	645.00	4,450,500
スシローグローバルホールディングス	83,100	2,648.00	220,048,800
メディカルシステムネットワーク	15,200	462.00	7,022,400
はるやまホールディングス	7,400	756.00	5,594,400
ノジマ	27,000	2,830.00	76,410,000
カッパ・クリエイト	21,200	1,568.00	33,241,600
ライトオン	11,300	565.00	6,384,500
良品計画	201,000	1,740.00	349,740,000
三城ホールディングス	16,900	294.00	4,968,600
アドヴァン	23,300	1,321.00	30,779,300
アルビス	5,800	2,808.00	16,286,400
コナカ	18,700	287.00	5,366,900

ハウス オブ ローゼ	2,000	1,661.00	3,322,000	
G - 7ホールディングス	9,000	2,562.00	23,058,000	
イオン北海道	20,100	875.00	17,587,500	
コジマ	26,500	550.00	14,575,000	
ヒマラヤ	5,600	976.00	5,465,600	
コーナン商事	21,600	4,090.00	88,344,000	
エコス	5,700	2,264.00	12,904,800	
ワタミ	18,100	994.00	17,991,400	
マルシェ	4,400	576.00	2,534,400	
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	332,700	2,450.00	815,115,000	
西松屋チェーン	33,400	1,428.00	47,695,200	
ゼンショーホールディングス	72,600	2,481.00	180,120,600	
幸楽苑ホールディングス	9,600	1,843.00	17,692,800	
ハークスレイ	3,400	987.00	3,355,800	
サイゼリヤ	22,600	2,141.00	48,386,600	
V Tホールディングス	63,300	406.00	25,699,800	
魚力	4,300	1,701.00	7,314,300	
フジ・コーポレーション	4,100	2,307.00	9,458,700	
ユナイテッドアローズ	16,000	1,521.00	24,336,000	
ハイデイ日高	22,000	1,914.00	42,108,000	
京都きもの友禅	10,700	244.00	2,610,800	
コロワイド	50,300	1,787.00	89,886,100	
ピーシーデポコーポレーション	20,500	690.00	14,145,000	
壱番屋	10,700	5,620.00	60,134,000	
P L A N T	4,200	864.00	3,628,800	
スギホールディングス	30,200	7,440.00	224,688,000	
薬王堂ホールディングス	6,700	2,633.00	17,641,100	
スクロール	23,500	912.00	21,432,000	
ヨンドシーホールディングス	15,500	1,757.00	27,233,500	
ファミリーマート	121,000	2,370.00	286,770,000	
木曽路	19,900	2,540.00	50,546,000	
S R Sホールディングス	18,100	919.00	16,633,900	
タカキュー	11,700	162.00	1,895,400	
リテールパートナーズ	20,200	1,755.00	35,451,000	
ケーヨー	31,200	877.00	27,362,400	
上新電機	17,900	2,619.00	46,880,100	
日本瓦斯	24,000	5,330.00	127,920,000	
ロイヤルホールディングス	26,400	1,818.00	47,995,200	
いなげや	18,800	1,977.00	37,167,600	
島忠	28,500	3,555.00	101,317,500	
チヨダ	16,100	980.00	15,778,000	
ライフコーポレーション	11,500	4,845.00	55,717,500	

リンガーハット	18,700	2,581.00	48,264,700
MrMaxHD	21,100	954.00	20,129,400
テンアライド	13,900	391.00	5,434,900
AOKIホールディングス	30,700	526.00	16,148,200
オークワ	23,800	1,502.00	35,747,600
コメリ	23,400	3,315.00	77,571,000
青山商事	31,700	551.00	17,466,700
しまむら	17,600	10,230.00	180,048,000
はせがわ	8,800	322.00	2,833,600
高島屋	110,400	831.00	91,742,400
松屋	30,700	751.00	23,055,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	71,900	683.00	49,107,700
近鉄百貨店	5,900	3,260.00	19,234,000
丸井グループ	138,800	2,011.00	279,126,800
アクシアル リテイリング	12,600	4,935.00	62,181,000
イオン	582,300	2,826.00	1,645,579,800
イズミ	30,800	3,825.00	117,810,000
平和堂	30,800	2,267.00	69,823,600
フジ	18,400	1,894.00	34,849,600
ヤオコー	17,200	7,810.00	134,332,000
ゼビオホールディングス	18,600	760.00	14,136,000
ケーズホールディングス	146,200	1,420.00	207,604,000
Olympicグループ	8,100	1,065.00	8,626,500
日産東京販売ホールディングス	23,200	256.00	5,939,200
シルバーライフ	2,200	1,996.00	4,391,200
Genky DrugStores	6,700	3,760.00	25,192,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	586.00	2,226,800
ブックオフグループホールディングス	8,800	899.00	7,911,200
アインホールディングス	18,600	7,360.00	136,896,000
元気寿司	3,900	2,380.00	9,282,000
ヤマダ電機	461,500	524.00	241,826,000
アークランドサカモト	23,800	2,151.00	51,193,800
ニトリホールディングス	65,500	21,850.00	1,431,175,000
グルメ杵屋	11,000	1,002.00	11,022,000
愛眼	12,100	233.00	2,819,300
ケーユーホールディングス	8,200	903.00	7,404,600
吉野家ホールディングス	49,800	1,970.00	98,106,000
松屋フーズホールディングス	7,300	3,650.00	26,645,000
サガミホールディングス	20,400	1,336.00	27,254,400
関西スーパーマーケット	12,800	1,359.00	17,395,200
王将フードサービス	11,100	5,940.00	65,934,000
プレナス	17,100	1,818.00	31,087,800

ミニストップ	11,300	1,478.00	16,701,400
アークス	31,000	2,694.00	83,514,000
パローホールディングス	33,600	2,906.00	97,641,600
ベルク	7,500	7,770.00	58,275,000
大庄	8,300	1,251.00	10,383,300
ファーストリテイリング	20,200	65,860.00	1,330,372,000
サンドラッグ	57,000	3,965.00	226,005,000
サクスパー ホールディングス	13,300	577.00	7,674,100
ヤマザワ	3,700	1,817.00	6,722,900
やまや	3,100	2,118.00	6,565,800
ペルーナ	32,700	952.00	31,130,400
島根銀行	4,000	702.00	2,808,000
じもとホールディングス	10,240	1,132.00	11,591,680
めぶきフィナンシャルグループ	787,400	238.00	187,401,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,500	1,131.00	23,185,500
九州フィナンシャルグループ	331,500	493.00	163,429,500
ゆうちょ銀行	429,300	821.00	352,455,300
富山第一銀行	36,100	311.00	11,227,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	865,500	365.00	315,907,500
西日本フィナンシャルホールディングス	100,800	732.00	73,785,600
関西みらいフィナンシャルグループ	88,900	431.00	38,315,900
三十三フィナンシャルグループ	14,000	1,372.00	19,208,000
第四北越フィナンシャルグループ	26,300	2,171.00	57,097,300
新生銀行	111,200	1,294.00	143,892,800
あおぞら銀行	90,300	1,743.00	157,392,900
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,365,900	416.10	4,313,250,990
りそなホールディングス	1,647,500	357.60	589,146,000
三井住友トラスト・ホールディングス	286,400	2,792.50	799,772,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,053,900	2,917.50	3,074,753,250
千葉銀行	505,700	579.00	292,800,300
群馬銀行	291,100	350.00	101,885,000
武蔵野銀行	22,600	1,565.00	35,369,000
千葉興業銀行	41,600	249.00	10,358,400
筑波銀行	63,000	201.00	12,663,000
七十七銀行	51,200	1,620.00	82,944,000
青森銀行	11,700	2,501.00	29,261,700
秋田銀行	9,700	1,581.00	15,335,700
山形銀行	17,000	1,361.00	23,137,000
岩手銀行	9,900	2,534.00	25,086,600
東邦銀行	135,500	231.00	31,300,500
東北銀行	7,300	1,212.00	8,847,600
みちのく銀行	9,700	1,350.00	13,095,000

ふくおかフィナンシャルグループ	127,600	1,764.00	225,086,400	
静岡銀行	369,000	726.00	267,894,000	
十六銀行	19,000	2,002.00	38,038,000	
スルガ銀行	155,000	379.00	58,745,000	
八十二銀行	365,700	413.00	151,034,100	
山梨中央銀行	17,600	824.00	14,502,400	
大垣共立銀行	29,900	2,379.00	71,132,100	
福井銀行	13,000	1,771.00	23,023,000	
北國銀行	15,100	3,085.00	46,583,500	
清水銀行	6,200	1,890.00	11,718,000	
富山銀行	2,900	3,550.00	10,295,000	
滋賀銀行	30,400	2,462.00	74,844,800	
南都銀行	25,200	1,945.00	49,014,000	
百五銀行	136,400	329.00	44,875,600	
京都銀行	54,300	5,070.00	275,301,000	
紀陽銀行	53,700	1,621.00	87,047,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	100,900	1,057.00	106,651,300	
広島銀行	223,700	600.00	134,220,000	
山陰合同銀行	89,900	565.00	50,793,500	
中国銀行	130,400	1,007.00	131,312,800	
鳥取銀行	5,200	1,280.00	6,656,000	
伊予銀行	216,200	696.00	150,475,200	
百十四銀行	16,100	1,780.00	28,658,000	
四国銀行	23,000	743.00	17,089,000	
阿波銀行	24,800	2,585.00	64,108,000	
大分銀行	8,700	2,435.00	21,184,500	
宮崎銀行	10,100	2,400.00	24,240,000	
佐賀銀行	9,200	1,307.00	12,024,400	
沖縄銀行	13,900	3,140.00	43,646,000	
琉球銀行	35,000	912.00	31,920,000	
セブン銀行	506,300	255.00	129,106,500	
みずほフィナンシャルグループ	2,059,100	1,310.50	2,698,450,550	
高知銀行	5,500	861.00	4,735,500	
山口フィナンシャルグループ	189,100	683.00	129,155,300	
長野銀行	5,000	1,458.00	7,290,000	
名古屋銀行	11,300	2,553.00	28,848,900	
北洋銀行	228,400	229.00	52,303,600	
愛知銀行	5,500	3,035.00	16,692,500	
中京銀行	6,200	2,120.00	13,144,000	
大光銀行	5,200	1,582.00	8,226,400	
愛媛銀行	21,200	1,180.00	25,016,000	
トマト銀行	5,800	1,222.00	7,087,600	

京葉銀行	64,600	486.00	31,395,600
栃木銀行	73,200	182.00	13,322,400
北日本銀行	4,700	2,059.00	9,677,300
東和銀行	26,600	722.00	19,205,200
福島銀行	14,300	244.00	3,489,200
大東銀行	7,900	677.00	5,348,300
トモニホールディングス	117,100	340.00	39,814,000
フィデアホールディングス	147,100	110.00	16,181,000
池田泉州ホールディングス	174,300	175.00	30,502,500
F P G	47,100	532.00	25,057,200
マーキュリアインベストメント	6,200	664.00	4,116,800
S B Iホールディングス	169,300	2,713.00	459,310,900
ジャフコ	23,300	4,415.00	102,869,500
大和証券グループ本社	1,216,400	440.70	536,067,480
野村ホールディングス	2,666,700	478.60	1,276,282,620
岡三証券グループ	129,700	346.00	44,876,200
丸三証券	45,500	450.00	20,475,000
東洋証券	56,000	115.00	6,440,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	174,800	272.00	47,545,600
光世証券	4,000	676.00	2,704,000
水戸証券	44,800	212.00	9,497,600
いちよし証券	28,800	469.00	13,507,200
松井証券	86,800	942.00	81,765,600
マネックスグループ	112,000	265.00	29,680,000
極東証券	20,700	608.00	12,585,600
岩井コスモホールディングス	14,500	1,284.00	18,618,000
藍澤證券	27,500	691.00	19,002,500
マネーパートナーズグループ	17,100	212.00	3,625,200
スパークス・グループ	71,000	225.00	15,975,000
かんぽ生命保険	53,700	1,651.00	88,658,700
S O M P Oホールディングス	284,900	3,629.00	1,033,902,100
アニコム ホールディングス	50,400	1,068.00	53,827,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	396,200	2,824.00	1,118,868,800
第一生命ホールディングス	857,500	1,477.00	1,266,527,500
東京海上ホールディングス	535,800	4,600.00	2,464,680,000
T & Dホールディングス	452,900	1,032.00	467,392,800
アドバンスクリエイト	3,100	2,135.00	6,618,500
全国保証	42,700	4,135.00	176,564,500
イントラスト	5,400	902.00	4,870,800
日本モーゲージサービス	6,200	1,119.00	6,937,800
C a s a	5,400	1,225.00	6,615,000
アルヒ	24,100	1,840.00	44,344,000

プレミアグループ	8,300	2,104.00	17,463,200
クレディセゾン	106,200	1,112.00	118,094,400
芙蓉総合リース	15,900	6,500.00	103,350,000
みずほリース	23,400	2,702.00	63,226,800
東京センチュリー	30,500	5,710.00	174,155,000
日本証券金融	66,900	510.00	34,119,000
アイフル	231,500	271.00	62,736,500
リコーリース	12,000	2,842.00	34,104,000
イオンフィナンシャルサービス	92,800	953.00	88,438,400
アコム	304,800	455.00	138,684,000
ジャックス	16,800	1,700.00	28,560,000
オリエントコーポレーション	410,700	113.00	46,409,100
日立キャピタル	35,800	2,463.00	88,175,400
アプラスフィナンシャル	73,900	76.00	5,616,400
オリックス	940,200	1,305.00	1,226,961,000
三菱UFJリース	384,800	485.00	186,628,000
九州リースサービス	7,600	661.00	5,023,600
日本取引所グループ	435,000	2,938.00	1,278,030,000
イー・ギャランティ	16,600	2,395.00	39,757,000
アサックス	8,000	782.00	6,256,000
NECキャピタルソリューション	6,200	1,876.00	11,631,200
いちご	199,800	305.00	60,939,000
日本駐車場開発	165,500	131.00	21,680,500
スター・マイカ・ホールディングス	9,500	1,335.00	12,682,500
ADワークスグループ	28,100	158.00	4,439,800
ヒューリック	323,600	984.00	318,422,400
三栄建築設計	7,500	1,483.00	11,122,500
野村不動産ホールディングス	93,100	1,994.00	185,641,400
三重交通グループホールディングス	35,100	440.00	15,444,000
サムティ	22,900	1,579.00	36,159,100
ディア・ライフ	25,900	417.00	10,800,300
日本商業開発	10,800	1,680.00	18,144,000
ハウスコム	4,200	1,310.00	5,502,000
日本管理センター	9,700	1,427.00	13,841,900
サンセイランディック	7,300	763.00	5,569,900
フージャースホールディングス	30,200	659.00	19,901,800
オープンハウス	48,300	3,800.00	183,540,000
東急不動産ホールディングス	416,600	451.00	187,886,600
飯田グループホールディングス	127,400	2,123.00	270,470,200
イーランド	5,100	794.00	4,049,400
ムゲンエステート	13,700	483.00	6,617,100
ハウズドゥ	7,400	1,140.00	8,436,000

シーアールイー	5,400	1,389.00	7,500,600
グッドコムアセット	4,500	2,623.00	11,803,500
ジェイ・エス・ビー	3,500	2,954.00	10,339,000
テンポイノベーション	6,300	770.00	4,851,000
パーク24	82,500	1,697.00	140,002,500
パラカ	5,100	1,630.00	8,313,000
三井不動産	737,600	1,826.50	1,347,226,400
三菱地所	1,063,000	1,587.00	1,686,981,000
平和不動産	28,500	2,900.00	82,650,000
東京建物	151,300	1,283.00	194,117,900
ダイビル	40,800	1,220.00	49,776,000
京阪神ビルディング	25,500	1,707.00	43,528,500
住友不動産	341,300	3,102.00	1,058,712,600
テオーシー	32,900	651.00	21,417,900
東京楽天地	3,000	4,660.00	13,980,000
スターツコーポレーション	21,500	2,306.00	49,579,000
フジ住宅	21,500	535.00	11,502,500
空港施設	19,700	464.00	9,140,800
明和地所	12,600	502.00	6,325,200
ゴールドクレスト	13,400	1,375.00	18,425,000
エスリード	7,400	1,354.00	10,019,600
日神グループホールディングス	27,500	417.00	11,467,500
日本エスコン	27,400	867.00	23,755,800
タカラレーベン	69,300	311.00	21,552,300
A V A N T I A	11,200	808.00	9,049,600
イオンモール	77,400	1,476.00	114,242,400
毎日コムネット	6,500	817.00	5,310,500
ファースト住建	8,500	1,107.00	9,409,500
カチタス	38,300	2,971.00	113,789,300
トーセイ	23,100	978.00	22,591,800
穴吹興産	4,600	1,593.00	7,327,800
サンフロンティア不動産	23,400	879.00	20,568,600
エフ・ジェー・ネクスト	15,600	895.00	13,962,000
インテリックス	4,300	490.00	2,107,000
ランドビジネス	5,100	363.00	1,851,300
サンネクスタグループ	6,900	1,026.00	7,079,400
グランディハウス	17,300	373.00	6,452,900
日本空港ビルデング	48,800	4,630.00	225,944,000
日本工営	10,000	2,848.00	28,480,000
L I F U L L	51,900	443.00	22,991,700
ミクシィ	28,100	2,830.00	79,523,000
ジェイエシーリクルートメント	10,100	1,312.00	13,251,200

日本M & Aセンター	112,400	5,980.00	672,152,000
メンバーズ	4,500	1,723.00	7,753,500
中広	2,600	495.00	1,287,000
UTグループ	23,200	3,560.00	82,592,000
アイティメディア	6,000	2,792.00	16,752,000
タケエイ	16,400	1,005.00	16,482,000
E・Jホールディングス	2,700	2,638.00	7,122,600
ビーネックスグループ	18,700	1,131.00	21,149,700
コシダカホールディングス	36,000	430.00	15,480,000
アルトナー	3,900	904.00	3,525,600
パソナグループ	16,100	1,599.00	25,743,900
CDS	3,900	1,388.00	5,413,200
リンクアンドモチベーション	27,000	394.00	10,638,000
GCA	19,300	671.00	12,950,300
エス・エム・エス	45,800	3,040.00	139,232,000
サニーサイドアップグループ	5,500	716.00	3,938,000
パーソルホールディングス	147,000	1,703.00	250,341,000
リニカル	7,400	845.00	6,253,000
クックパッド	46,900	372.00	17,446,800
アイ・ケイ・ケイ	7,600	618.00	4,696,800
学情	5,500	1,112.00	6,116,000
スタジオアリス	7,600	1,680.00	12,768,000
シミックホールディングス	7,400	1,350.00	9,990,000
エプロ	3,900	1,006.00	3,923,400
NJS	3,800	1,934.00	7,349,200
総合警備保障	58,500	5,000.00	292,500,000
カカクコム	108,600	2,767.00	300,496,200
アイロムグループ	5,300	2,025.00	10,732,500
セントケア・ホールディング	9,900	809.00	8,009,100
サイネックス	2,800	923.00	2,584,400
ルネサンス	8,500	942.00	8,007,000
ディップ	20,200	2,154.00	43,510,800
デジタルホールディングス	10,500	1,412.00	14,826,000
ツクイ	35,100	587.00	20,603,700
キャリアデザインセンター	3,700	964.00	3,566,800
ベネフィット・ワン	53,500	2,652.00	141,882,000
エムスリー	323,800	6,500.00	2,104,700,000
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	274.00	3,205,800
アウトソーシング	84,400	968.00	81,699,200
ウェルネット	15,300	598.00	9,149,400
ワールドホールディングス	5,200	2,091.00	10,873,200
ディー・エヌ・エー	62,300	1,932.00	120,363,600

博報堂D Yホールディングス	204,400	1,355.00	276,962,000
ぐるなび	26,000	720.00	18,720,000
タカミヤ	16,100	614.00	9,885,400
ジャパンベストレスキューシステム	11,600	1,045.00	12,122,000
ファンコミュニケーションズ	41,000	482.00	19,762,000
ライク	5,000	2,007.00	10,035,000
ビジネス・ブレークスルー	6,900	392.00	2,704,800
エスプール	38,100	837.00	31,889,700
WDBホールディングス	6,800	3,065.00	20,842,000
手間いらず	1,000	5,590.00	5,590,000
ティア	9,200	437.00	4,020,400
C D G	1,700	1,669.00	2,837,300
バリューコマース	10,000	3,515.00	35,150,000
インフォマート	148,800	930.00	138,384,000
J Pホールディングス	47,000	315.00	14,805,000
エコナックホールディングス	29,700	99.00	2,940,300
E P Sホールディングス	20,200	1,040.00	21,008,000
レッグス	3,900	1,150.00	4,485,000
プレステージ・インターナショナル	55,300	952.00	52,645,600
アミューズ	8,100	2,421.00	19,610,100
ドリームインキュベータ	4,700	1,500.00	7,050,000
クイック	9,400	1,235.00	11,609,000
T A C	10,200	225.00	2,295,000
ケネディクス	126,800	552.00	69,993,600
電通グループ	165,200	3,095.00	511,294,000
イオンファンタジー	5,800	1,637.00	9,494,600
シーティーエス	16,900	954.00	16,122,600
ネクシィーズグループ	4,700	1,074.00	5,047,800
H . U . グループホールディングス	41,200	2,812.00	115,854,400
アルプス技研	13,100	2,047.00	26,815,700
ダイオーズ	3,200	990.00	3,168,000
日本空調サービス	15,800	740.00	11,692,000
オリエンタルランド	156,200	14,740.00	2,302,388,000
ダスキン	36,600	2,868.00	104,968,800
明光ネットワークジャパン	19,000	735.00	13,965,000
ファルコホールディングス	8,300	1,562.00	12,964,600
ラウンドワン	41,400	846.00	35,024,400
リゾートトラスト	67,500	1,602.00	108,135,000
ビー・エム・エル	19,000	3,165.00	60,135,000
りらいあコミュニケーションズ	26,700	1,323.00	35,324,100
リソー教育	68,100	288.00	19,612,800
早稲田アカデミー	6,700	1,007.00	6,746,900

ユー・エス・エス	164,500	1,879.00	309,095,500
東京個別指導学院	5,700	579.00	3,300,300
サイバーエージェント	90,500	6,470.00	585,535,000
楽天	684,500	1,132.00	774,854,000
クリーク・アンド・リバー社	7,900	1,407.00	11,115,300
テー・オー・ダブリュー	24,300	328.00	7,970,400
山田コンサルティンググループ	9,700	1,208.00	11,717,600
セントラルスポーツ	5,600	2,386.00	13,361,600
フルキャストホールディングス	13,000	1,711.00	22,243,000
エン・ジャパン	26,200	2,641.00	69,194,200
リソルホールディングス	1,700	3,900.00	6,630,000
テクノプロ・ホールディングス	29,400	6,520.00	191,688,000
アトラ	3,400	274.00	931,600
インターワークス	3,700	339.00	1,254,300
アイ・アールジャパンホールディングス	6,000	13,220.00	79,320,000
Keepers 技研	11,000	1,328.00	14,608,000
ファーストロジック	3,200	805.00	2,576,000
三機サービス	3,100	1,127.00	3,493,700
Gunosy	9,400	925.00	8,695,000
デザインワン・ジャパン	5,400	274.00	1,479,600
イー・ガーディアン	6,500	3,305.00	21,482,500
リブセンス	9,100	290.00	2,639,000
ジャパンマテリアル	45,300	1,467.00	66,455,100
ベクトル	18,600	1,064.00	19,790,400
ウチヤマホールディングス	8,200	323.00	2,648,600
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,191.00	15,125,700
キャリアリンク	5,100	1,749.00	8,919,900
I B J	12,300	1,085.00	13,345,500
アサンテ	6,100	1,605.00	9,790,500
N・フィールド	10,500	699.00	7,339,500
バリューHR	6,000	1,750.00	10,500,000
M&Aキャピタルパートナーズ	12,000	4,910.00	58,920,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	2,590.00	14,763,000
E R Iホールディングス	4,600	671.00	3,086,600
アビスト	2,400	2,982.00	7,156,800
シグマクシス	10,200	1,725.00	17,595,000
ウィルグループ	9,900	858.00	8,494,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,600	347.00	7,842,200
リクルートホールディングス	1,051,700	4,160.00	4,375,072,000
エラン	10,200	2,605.00	26,571,000
土木管理総合試験所	7,900	390.00	3,081,000
ネットマーケティング	6,100	635.00	3,873,500

日本郵政	1,203,700	715.80	861,608,460
ベルシステム24ホールディングス	24,800	1,767.00	43,821,600
鎌倉新書	11,400	920.00	10,488,000
S MN	3,400	946.00	3,216,400
L I T A L I C O	5,200	2,897.00	15,064,400
グローバルキッズCOMPANY	3,000	920.00	2,760,000
エアトリ	7,700	1,402.00	10,795,400
ハイアス・アンド・カンパニー	9,200	222.00	2,042,400
アトラエ	4,500	3,075.00	13,837,500
ストライク	5,600	6,150.00	34,440,000
ソラスト	40,700	1,374.00	55,921,800
セラク	4,700	2,095.00	9,846,500
インソース	6,200	2,989.00	18,531,800
ベikalレント・コンサルティング	8,900	14,600.00	129,940,000
Orchestra Holdings	3,200	2,276.00	7,283,200
アイモバイル	5,400	1,326.00	7,160,400
キャリアインデックス	6,500	577.00	3,750,500
MS - Japan	5,100	838.00	4,273,800
船場	3,200	959.00	3,068,800
グレイステクノロジー	6,800	5,280.00	35,904,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	16,500	3,655.00	60,307,500
フルテック	2,300	1,449.00	3,332,700
グリーンズ	3,700	517.00	1,912,900
GameWith	4,800	638.00	3,062,400
ソウルドアウト	3,700	1,560.00	5,772,000
MS&Consulting	3,200	714.00	2,284,800
エル・ティー・エス	1,100	5,220.00	5,742,000
ミダック	2,000	2,194.00	4,388,000
日総工産	10,200	802.00	8,180,400
キュービーネットホールディングス	6,200	1,851.00	11,476,200
RPAホールディングス	11,500	846.00	9,729,000
スプリックス	4,500	818.00	3,681,000
マネジメントソリューションズ	7,300	1,634.00	11,928,200
プロレド・パートナーズ	2,000	6,060.00	12,120,000
and factory	1,400	1,085.00	1,519,000
ピアラ	900	2,660.00	2,394,000
ギークス	1,700	1,324.00	2,250,800
カーブスホールディングス	40,700	675.00	27,472,500
フォーラムエンジニアリング	8,000	803.00	6,424,000
アドバンテッジリスクマネジメント	7,800	767.00	5,982,600
リログループ	80,400	2,516.00	202,286,400
東祥	9,400	1,295.00	12,173,000

エイチ・アイ・エス	22,900	1,851.00	42,387,900	
ラックランド	4,300	2,333.00	10,031,900	
共立メンテナンス	24,400	3,895.00	95,038,000	
イチネンホールディングス	16,700	1,259.00	21,025,300	
建設技術研究所	9,600	2,017.00	19,363,200	
スペース	9,900	845.00	8,365,500	
長大	6,100	1,316.00	8,027,600	
燦ホールディングス	6,600	1,293.00	8,533,800	
スバル興業	900	7,800.00	7,020,000	
東京テアトル	6,000	1,283.00	7,698,000	
タナベ経営	3,000	1,490.00	4,470,000	
ナガワ	4,700	8,540.00	40,138,000	
よみうりランド	3,300	4,205.00	13,876,500	
東京都競馬	9,700	5,330.00	51,701,000	
カナモト	26,000	2,393.00	62,218,000	
東京ドーム	59,800	756.00	45,208,800	
西尾レントオール	13,700	2,233.00	30,592,100	
トランス・コスモス	14,100	2,856.00	40,269,600	
乃村工藝社	63,300	779.00	49,310,700	
藤田観光	5,800	1,567.00	9,088,600	
KNT-CTホールディングス	9,100	1,113.00	10,128,300	
日本管財	15,900	1,992.00	31,672,800	
トーカイ	14,300	2,078.00	29,715,400	
セコム	155,800	9,606.00	1,496,614,800	
セントラル警備保障	7,200	3,550.00	25,560,000	
丹青社	28,100	708.00	19,894,800	
メイテック	18,000	5,350.00	96,300,000	
応用地質	17,300	1,244.00	21,521,200	
船井総研ホールディングス	30,500	2,476.00	75,518,000	
進学会ホールディングス	6,400	464.00	2,969,600	
オオバ	10,800	860.00	9,288,000	
いであ	3,700	1,938.00	7,170,600	
学究社	4,500	1,097.00	4,936,500	
ベネッセホールディングス	49,000	2,705.00	132,545,000	
イオンディライト	18,200	2,911.00	52,980,200	
ナック	8,400	1,029.00	8,643,600	
ダイセキ	24,700	2,621.00	64,738,700	
ステップ	5,600	1,594.00	8,926,400	
合 計	161,800,380		350,000,638,400	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期中間計算期間(2020年10月1日から2021年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックス・オープン】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2020年 9月30日現在)	第20期中間計算期間 (2021年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,098,175	53,354,081
親投資信託受益証券	9,075,616,403	10,874,784,685
未収入金	2,292,003	-
流動資産合計	9,117,006,581	10,928,138,766
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,332,589	14,776,509
未払受託者報酬	2,329,715	2,733,150
未払委託者報酬	25,626,820	30,064,611
未払利息	90	123
その他未払費用	469,871	273,255
流動負債合計	36,759,085	47,847,648
負債合計	36,759,085	47,847,648
純資産の部		
元本等		
元本	4,633,235,766	4,584,712,277
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,447,011,730	6,295,578,841
(分配準備積立金)	1,337,260,318	1,180,222,783
元本等合計	9,080,247,496	10,880,291,118
純資産合計	9,080,247,496	10,880,291,118
負債純資産合計	9,117,006,581	10,928,138,766

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自 2019年10月 1日 至 2020年 3月31日	第20期中間計算期間 自 2020年10月 1日 至 2021年 3月31日
営業収益		
受取利息	28	75
有価証券売買等損益	847,683,838	1,935,999,460
営業収益合計	847,683,810	1,935,999,535
営業費用		
支払利息	7,748	4,990
受託者報酬	2,370,134	2,733,150
委託者報酬	26,071,395	30,064,611
その他費用	236,959	273,255
営業費用合計	28,686,236	33,076,006
営業利益又は営業損失（ ）	876,370,046	1,902,923,529
経常利益又は経常損失（ ）	876,370,046	1,902,923,529
中間純利益又は中間純損失（ ）	876,370,046	1,902,923,529
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	6,088,963	120,218,862
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,917,451,456	4,447,011,730
剰余金増加額又は欠損金減少額	593,157,722	620,540,924
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	593,157,722	620,540,924
剰余金減少額又は欠損金増加額	551,836,330	554,678,480
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	551,836,330	554,678,480
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,076,313,839	6,295,578,841

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2020年 9月30日現在)	第20期中間計算期間 (2021年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,633,235,766口	4,584,712,277口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9598円 (19,598円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3732円 (23,732円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第20期中間計算期間 (2021年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第20期中間計算期間 (2021年 3月31日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第19期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日	第20期中間計算期間 自 2020年10月 1日 至 2021年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,447,207,602円	4,633,235,766円
期中追加設定元本額	1,310,633,921円	525,351,383円
期中一部解約元本額	1,124,605,757円	573,874,872円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,293,613,342
株式	463,280,295,000

	2021年 3月31日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	52,044,150
未収入金	50,072,120
未収配当金	4,238,146,790
前払金	6,114,200
差入委託証拠金	269,613,700
流動資産合計	471,189,899,302
資産合計	471,189,899,302
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,183,100
未払金	116,852,070
未払解約金	147,117,345
未払利息	7,640
流動負債合計	322,160,155
負債合計	322,160,155
純資産の部	
元本等	
元本	250,048,587,254
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	220,819,151,893
元本等合計	470,867,739,147
純資産合計	470,867,739,147
負債純資産合計	471,189,899,302

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
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>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2021年 3月31日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	250,048,587,254口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8831円 (1万口当たり純資産額) (18,831円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年10月 1日
期首元本額	229,881,049,283円
期中追加設定元本額	53,767,336,092円
期中一部解約元本額	33,599,798,121円
期末元本額	250,048,587,254円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	429,185,699円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,829,714,073円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,657,333円
S M T T O P I X インデックス・オープン	10,036,225,211円
世界経済インデックスファンド	2,537,973,268円
日本株式インデックス・オープン	3,627,657,938円
D C マイセレクション 2 5	6,035,021,335円
D C マイセレクション 5 0	17,702,170,199円
D C マイセレクション 7 5	17,673,422,762円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,774,937,436円
D C マイセレクション S 2 5	2,727,241,221円
D C マイセレクション S 5 0	8,052,555,325円
D C マイセレクション S 7 5	5,488,719,625円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,349,465,012円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	245,632,985円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	636,342,814円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	452,778,076円
D C 世界経済インデックスファンド	3,126,989,942円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,546,078,733円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,430,296円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	26,591,874円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	202,199,753円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,282,962円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	179,476,549円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	34,163,672円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	96,286,762円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,212,337,002円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	502,577,066円

区分	2021年 3月31日現在
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,276,561,465円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	365,049,590円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,268,087円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	575,413,922円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	325,927,634円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	407,587,131円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	42,081,893円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	673,739,105円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,731,672,493円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,271,856円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,744,221,511円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,307,380,599円
分散投資コア戦略ファンドA	2,126,539,021円
分散投資コア戦略ファンドS	7,382,008,244円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	374,376,396円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	375,554,901円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,994,971,448円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	199,343,073円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,422,328円
SMT インデックスバランス・オープン	59,852,966円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	25,605,294,409円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	623,662,329円
SMT 世界経済インデックス・オープン	31,585,743円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	100,743,471円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	17,619,261円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,413,359円
グローバル経済コア	236,427,215円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,895,471円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	48,978,707円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,655,741円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,149,454,517円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	109,263,877円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	583,565円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	592,614円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	257,165円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	550,865円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,456,075,284円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,244,491,542円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	156,566,672円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,756,838円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	389,859,927円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,328,416,589円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2021年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,353,154,200	-	7,347,040,000	6,114,200
	合計	7,353,154,200	-	7,347,040,000	6,114,200

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

(2021年 4月30日現在)

資産総額	10,591,175,248円
負債総額	25,201,246円
純資産総額（ - ）	10,565,974,002円
発行済口数	4,584,144,530口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3049円
（1万口当たり純資産額）	（23,049円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2021年 4月30日現在)

資産総額	457,078,130,037円
負債総額	2,121,724,171円
純資産総額（ - ）	454,956,405,866円
発行済口数	248,622,188,295口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8299円
（1万口当たり純資産額）	（18,299円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年 4月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2021年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	520	14,438,941
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	286,876
単位型公社債投資信託	45	290,117
合計	644	15,015,935

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
固定負債		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			

当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等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

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(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		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 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(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 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(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

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、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位: 百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度(2020年3月31日)

(単位: 百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2019年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度(2020年3月31日)

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. 其他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位: 百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
	ユーロ	2	-	0	0
合計	1,346	-	7	7	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

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19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
別途積立金		繰越利益剰余金			
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
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	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>
7. ヘッジ会計の会計処理	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p>

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(7)デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

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、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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、当該帳簿価額によっております。

(5)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6)未払金

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、当該帳簿価額によっております。

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引 売建				
米ドル	1,861	-	2	2
英ポンド	105	-	0	0
カナダドル	19	-	0	0
スイスフラン	50	-	0	0
香港ドル	178	-	0	0
ユーロ	306	-	3	3
合計	2,521	-	1	1

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

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

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注)1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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。

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

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DC日本株式インデックス・オープンの2019年10月1日から2020年9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、DC日本株式インデックス・オープンの2020年9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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L 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

2020年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020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（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R Lデータは中間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

2021年5月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2020年10月1日から2021年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2021年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年10月1日から2021年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。