

【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】	2019年3月25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 橋詰 廣志
【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】	日本株式インデックス・オープン（SMA専用）
【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】

日本株式インデックス・オープン（SMA専用）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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】

2019年 3月26日から2019年 9月25日までとします。

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

（ 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：http://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 >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、わが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）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	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株	年2回	日本			TOPIX	条件付運用型
債券 一般	年4回	北米	ファンド・ オブ・ファ ンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型
公債 社債 その他債券	年6回 (隔月)	欧州				
クレジット属 性 ()	年12回 (毎月)	アジア				その他 ()
不動産投信	日々	オセアニア				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))	その他 ()	中南米				
資産複合 ()		アフリカ				
資産配分 固定型 資産配分 変更型		中近東 (中東)				
		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 (<http://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]

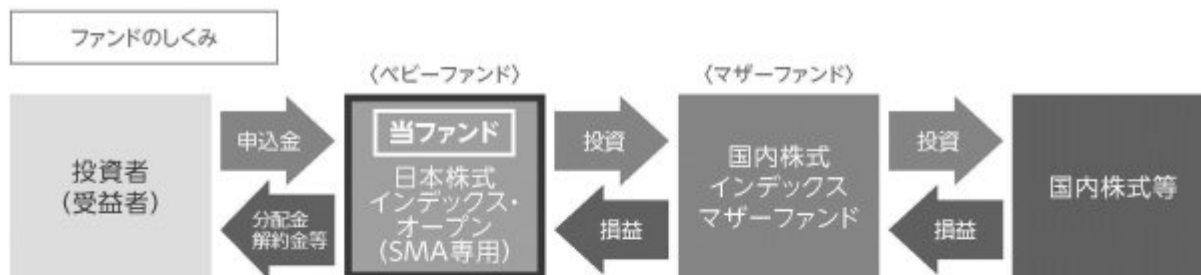
- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[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。



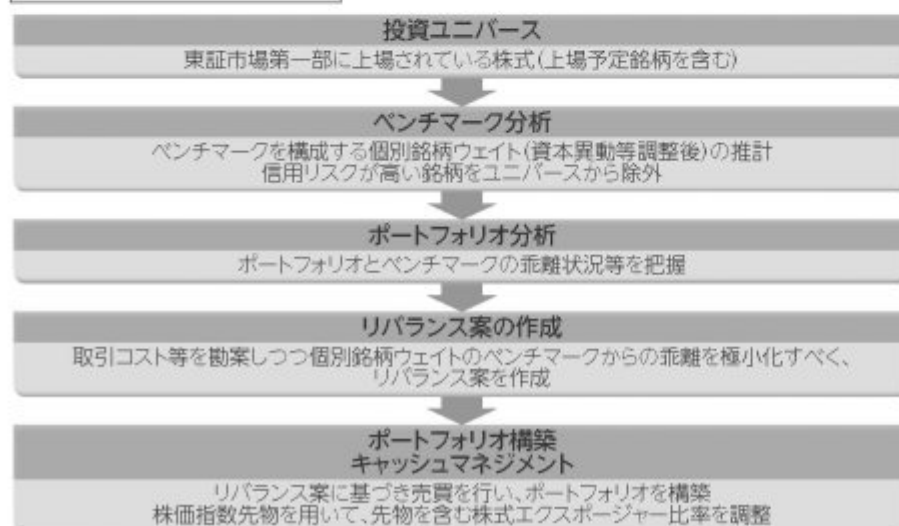
? ファミリーファンド方式とは

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

インデックスの概要 (2019年1月末現在)		東証一部時価総額上位10銘柄		
構成国	1カ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,126銘柄	1	トヨタ自動車	119,793
時価総額	約361兆円	2	三菱UFJフィナンシャルグループ	64,558
※上記時価総額は浮動株ベース		3	ソニー	59,049
		4	ソフトバンクグループ	56,305
		5	日本電信電話	50,487
		6	三井住友フィナンシャルグループ	45,285
		7	武田薬品工業	44,805
		8	キーエンス	44,153
		9	本田技研工業	44,140
		10	みずほフィナンシャルグループ	38,721
		※上記時価総額は浮動株ベース		
(出所)株式会社東京証券取引所のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成				
※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

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

（ロ）運用方法

投資対象

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

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)株式以外の資産（他の投資信託受益証券（振替投資信託受益権を含む）を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- 5)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 6)国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1.株券または新株引受権証書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第11号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で第21号の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

（二）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、

委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記（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。

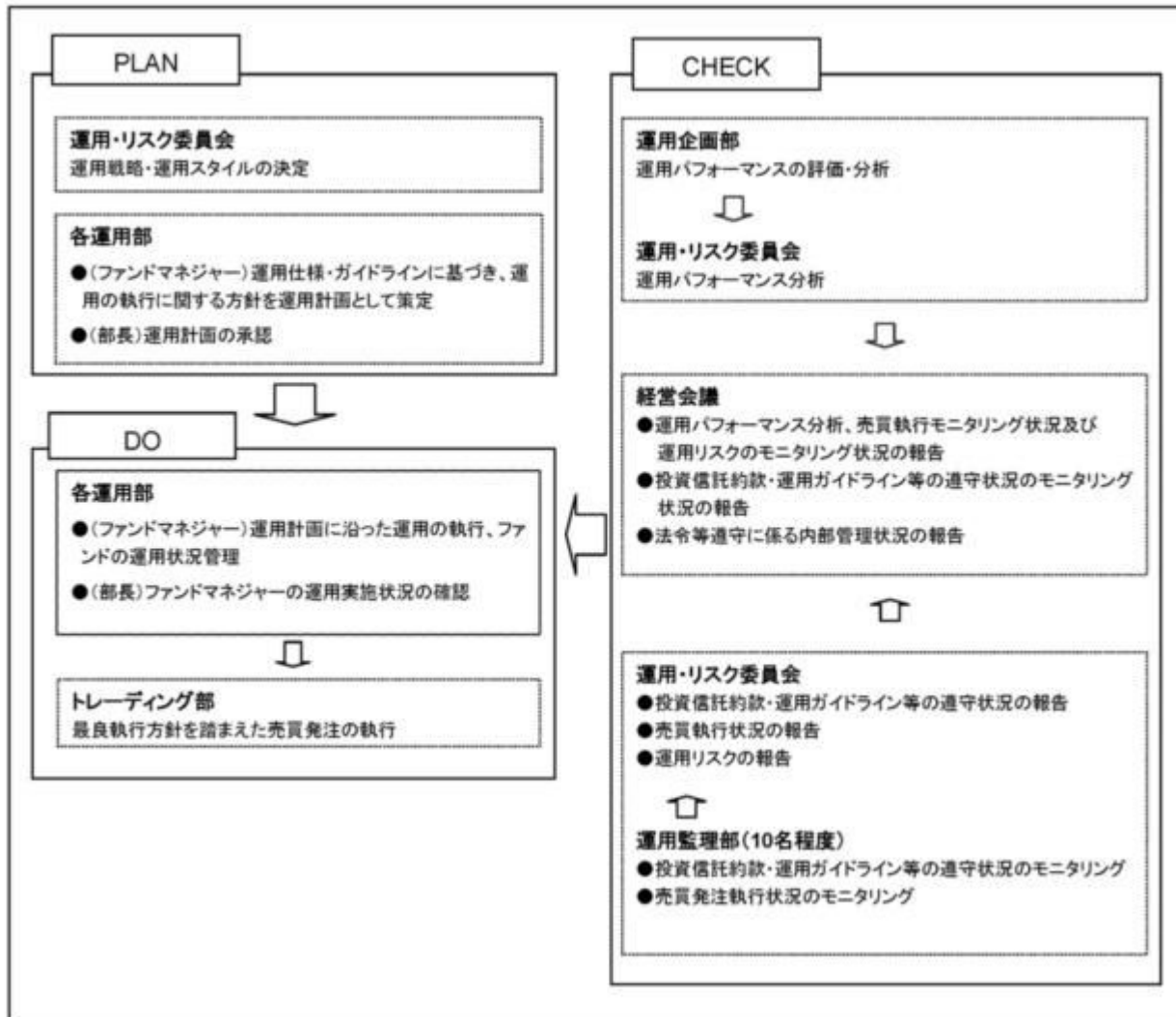
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

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」）

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

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

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

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

に投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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

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

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の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31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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

前記 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の受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を

乗じて得た額をいいます。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

(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】

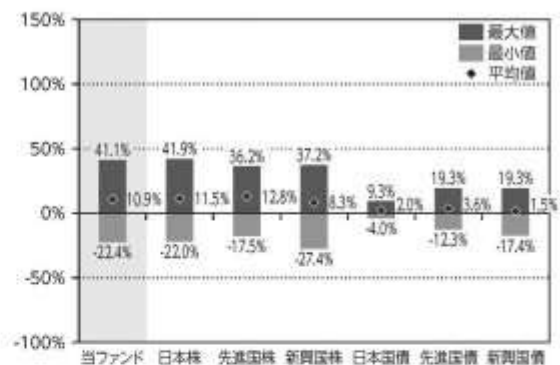
当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



*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



*2014年2月～2019年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX (東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株…… MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)^{※2}

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)^{※3}

日本国債…… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債…… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債…… JPMorganガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)^{※6}

(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。

※1 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。「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。

※2 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。

※3 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。

※4 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・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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。

※6 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されています。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.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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0.3996%（税抜 0.37%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1296% (税抜 0.12%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.1944% (税抜 0.18%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0756% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込

手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)に当たりま

す。

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

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

上記は、2019年1月31日現在のもので、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、2019年1月31日現在の状況について記載してあります。

【日本株式インデックス・オープン(SMA専用)】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,609,357,402	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		796,489	0.05
合計(純資産総額)		1,610,153,891	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	1,129,135,903	1.4728	1,662,991,358	1.4253	1,609,357,402	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3期計算期間末 (2009年 6月25日)	851,492,132	851,492,132	5,357	5,357
第4期計算期間末 (2010年 6月25日)	2,089,239,493	2,089,239,493	5,129	5,129
第5期計算期間末 (2011年 6月27日)	2,734,140,661	2,734,140,661	4,971	4,971
第6期計算期間末 (2012年 6月25日)	3,928,359,394	3,928,359,394	4,569	4,569
第7期計算期間末 (2013年 6月25日)	324,037,180	324,037,180	6,721	6,721
第8期計算期間末 (2014年 6月25日)	421,829,003	421,829,003	7,970	7,970
第9期計算期間末 (2015年 6月25日)	462,803,071	462,803,071	10,698	10,698
第10期計算期間末 (2016年 6月27日)	399,546,072	399,546,072	7,968	7,968
第11期計算期間末 (2017年 6月26日)	473,027,168	473,027,168	10,666	10,666
第12期計算期間末 (2018年 6月25日)	600,485,748	600,485,748	11,635	11,635
2018年 1月末日	534,566,269		12,257	
2月末日	564,710,686		11,801	
3月末日	563,825,875		11,557	
4月末日	597,678,104		11,966	
5月末日	594,332,041		11,767	

6月末日	654,486,473		11,666
7月末日	712,761,667		11,813
8月末日	701,045,577		11,692
9月末日	728,573,102		12,338
10月末日	771,714,478		11,174
11月末日	836,972,825		11,319
12月末日	805,118,266		10,157
2019年 1月末日	1,610,153,891		10,652

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2008年 6月26日～2009年 6月25日	0
第4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	0
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	0
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	0
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	0
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	0
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	0
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	0
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	0
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第3期計算期間	2008年 6月26日～2009年 6月25日	30.6
第4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	4.3
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	3.1
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	8.1
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	47.1
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	18.6
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	34.2
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	25.5
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	33.9
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	9.1
第13期中間計算期間	2018年 6月26日～2018年12月25日	17.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2008年 6月26日～2009年 6月25日	1,021,413,036	258,383,435	1,589,491,832
第4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	3,433,528,187	949,503,267	4,073,516,752
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	5,210,186,878	3,783,565,360	5,500,138,270
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	6,367,958,848	3,270,880,713	8,597,216,405
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	833,004,843	8,948,125,655	482,095,593
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	240,217,610	193,049,580	529,263,623
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	267,031,202	363,702,679	432,592,146
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	168,629,406	99,774,600	501,446,952
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	105,855,663	163,810,500	443,492,115
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	205,570,147	132,941,629	516,120,633
第13期中間計算期間	2018年 6月26日～2018年12月25日	287,539,546	36,733,894	766,926,285

(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	265,505,604,820	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,585,478,708	1.33
合計(純資産総額)		269,091,083,528	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,622,080,000	1.35

(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	1,321,400	6,885.78	9,098,869,692	6,675.00	8,820,345,000	3.28
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,145,200	662.71	5,397,905,492	583.60	4,753,538,720	1.77
日本	株式	ソニー	電気機器	795,400	5,357.91	4,261,681,614	5,467.00	4,348,451,800	1.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	486,300	7,991.79	3,886,407,477	8,526.00	4,146,193,800	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	795,900	5,006.37	3,984,569,883	4,671.00	3,717,648,900	1.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	824,300	4,410.27	3,635,385,561	4,045.00	3,334,293,500	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	751,700	4,455.42	3,349,144,564	4,389.00	3,299,211,300	1.23
日本	株式	キーエンス	電気機器	58,200	63,201.91	3,678,351,162	55,860.00	3,251,052,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,000,300	3,398.93	3,399,949,679	3,249.00	3,249,974,700	1.21
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	15,892,400	190.25	3,023,529,100	179.40	2,851,096,560	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,025,500	2,892.90	2,966,668,950	2,723.00	2,792,436,500	1.04
日本	株式	三菱商事	卸売業	819,600	3,068.17	2,514,672,132	3,181.00	2,607,147,600	0.97
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	106,200	22,534.91	2,393,207,442	23,490.00	2,494,638,000	0.93
日本	株式	任天堂	その他製品	73,000	39,738.07	2,900,879,110	33,830.00	2,469,590,000	0.92
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	811,700	2,986.47	2,424,117,699	2,912.50	2,364,076,250	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	489,500	4,851.52	2,374,819,040	4,739.00	2,319,740,500	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	423,900	5,282.96	2,239,446,744	5,312.00	2,251,756,800	0.84
日本	株式	花王	化学	287,900	8,277.84	2,383,190,136	7,672.00	2,208,768,800	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	835,600	2,776.61	2,320,135,316	2,605.50	2,177,155,800	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	210,900	10,472.37	2,208,622,833	10,080.00	2,125,872,000	0.79
日本	株式	ファナック	電気機器	112,700	22,117.94	2,492,691,838	18,360.00	2,069,172,000	0.77
日本	株式	キヤノン	電気機器	638,500	3,597.21	2,296,818,585	3,114.00	1,988,289,000	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	124,400	16,102.18	2,003,111,192	15,420.00	1,918,248,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	161,900	12,680.67	2,053,000,473	11,765.00	1,904,753,500	0.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	687,200	2,902.41	1,994,536,152	2,750.00	1,889,800,000	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	204,700	10,427.57	2,134,523,579	9,176.00	1,878,327,200	0.70
日本	株式	日本電産	電気機器	142,700	16,084.28	2,295,226,756	13,030.00	1,859,381,000	0.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	533,900	3,846.08	2,053,422,112	3,413.00	1,822,200,700	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,093,300	1,674.48	1,830,708,984	1,609.50	1,759,666,350	0.65
日本	株式	三井物産	卸売業	962,200	1,868.88	1,798,236,336	1,772.50	1,705,499,500	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	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	2.94
		食料品	4.27
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.08
		医薬品	5.28
		石油・石炭製品	0.69
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.58
		機械	4.86
		電気機器	12.69
		輸送用機器	8.18
		精密機器	1.88
		その他製品	2.08
		電気・ガス業	1.95
		陸運業	4.69
		海運業	0.17
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.03
		卸売業	5.00
		小売業	4.84
		銀行業	6.46
		証券、商品先物取引業	0.84
		保険業	2.26
		その他金融業	1.15
		不動産業	2.43
		サービス業	4.72
	小計	98.67	
合計		98.67	

(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	231	円	3,542,776,780	3,622,080,000	1.35

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2007年2月16日
作成基準日：2019年1月31日

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,652円
純資産総額	16.10億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2014年6月	2015年6月	2016年6月	2017年6月	2018年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.3%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.8%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.6%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.2%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.2%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.2%
本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	1.2%
みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一

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：<http://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>

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（<http://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：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2007年 2月16日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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ち、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5億口を下回る事となった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任し

た場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

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、）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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2017年6月27日から2018年6月25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】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2017年 6月26日現在）	第12期 （2018年 6月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	867,581	1,442,208
親投資信託受益証券	473,003,911	600,182,639
未収入金	20,966	19,187
流動資産合計	473,892,458	601,644,034
資産合計	473,892,458	601,644,034
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	159,408	213,826
未払委託者報酬	683,130	916,348
未払利息	1	3
その他未払費用	22,751	28,109
流動負債合計	865,290	1,158,286
負債合計	865,290	1,158,286
純資産の部		
元本等		
元本	443,492,115	516,120,633
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,535,053	84,365,115
（分配準備積立金）	100,919,114	105,618,481
元本等合計	473,027,168	600,485,748
純資産合計	473,027,168	600,485,748
負債純資産合計	473,892,458	601,644,034

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2016年 6月28日 至 2017年 6月26日	自	2017年 6月27日 至 2018年 6月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		122,482,865		42,758,123
営業収益合計		122,482,865		42,758,123
営業費用				
支払利息		180		421
受託者報酬		320,238		395,238
委託者報酬		1,372,359		1,693,779
その他費用		22,752		28,116
営業費用合計		1,715,529		2,117,554
営業利益又は営業損失（ ）		120,767,336		40,640,569
経常利益又は経常損失（ ）		120,767,336		40,640,569
当期純利益又は当期純損失（ ）		120,767,336		40,640,569
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（ ）		21,579,458		10,005,947
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		101,900,880		29,535,053
剰余金増加額又は欠損金減少額		32,635,403		35,025,348
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		32,635,403		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		35,025,348
剰余金減少額又は欠損金増加額		387,348		10,829,908
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		10,829,908
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		387,348		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,535,053		84,365,115

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は2017年 6月27日から2018年 6月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (2017年 6月26日現在)	第12期 (2018年 6月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	443,492,115口	516,120,633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) 1.0666円 (10,666円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1635円 (11,635円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2016年 6月28日 至 2017年 6月26日			第12期 自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25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	8,857,135円	費用控除後の配当等収益額	A	9,964,741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	7,194,012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	20,669,881円
収益調整金額	C	147,294,030円	収益調整金額	C	213,932,398円
分配準備積立金額	D	84,867,967円	分配準備積立金額	D	74,983,859円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	248,213,144円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	319,550,879円
当ファンドの期末残存口数	F	443,492,115口	当ファンドの期末残存口数	F	516,120,633口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,596円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,191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12期 自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25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コンプライアンス・リスク統括部が、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12期 (2018年 6月25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11期	第12期
	自 2016年 6月28日 至 2017年 6月26日	自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	501,446,952円	443,492,115円
期中追加設定元本額	105,855,663円	205,570,147円
期中一部解約元本額	163,810,500円	132,941,629円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2017年 6月26日現在)	第12期 (2018年 6月25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	101,238,847	33,311,275
合計	101,238,847	33,311,275

（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	386,441,723	600,182,639	
合計		386,441,723	600,182,639	

(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

	2018年 6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,953,380,515
株式	203,990,078,740
未収入金	13,642,000
未収配当金	883,027,922
前払金	70,471,100
差入委託証拠金	80,008,800
流動資産合計	208,990,609,077
資産合計	208,990,609,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,490,540
未払金	1,510,411,570
未払解約金	267,414,429
未払利息	10,540
その他未払費用	21,175
流動負債合計	1,848,348,254
負債合計	1,848,348,254
純資産の部	
元本等	
元本	133,374,481,612
剰余金	

	2018年 6月25日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	73,767,779,211
元本等合計	207,142,260,823
純資産合計	207,142,260,823
負債純資産合計	208,990,609,077

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2018年 6月25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>

(貸借対照表に関する注記)

	2018年 6月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,374,481,612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 1.5531円 (1万口当たり純資産額) (15,531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

	2018年 6月25日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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。
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コンプライアンス・リスク統括部が、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。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2018年 6月25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。

2018年 6月25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	<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	2018年 6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年 6月27日
期首元本額	116,876,628,250円
期中追加設定元本額	34,802,007,791円
期中一部解約元本額	18,304,154,429円
期末元本額	133,374,481,612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）	648,949,169円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,579,361,336円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,730,689円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,141,764,880円
世界経済インデックスファンド	1,930,005,753円
日本株式インデックス・オープン	5,947,861,494円
DCマイセレクション25	5,691,282,643円
DCマイセレクション50	16,611,327,930円
DCマイセレクション75	15,703,398,075円
DC日本株式インデックス・オープン	5,149,687,131円

区分	2018年 6月25日現在
DCマイセレクションS25	2,258,943,029円
DCマイセレクションS50	6,673,401,429円
DCマイセレクションS75	4,490,669,559円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,288,167,889円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	372,115,631円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	558,033,636円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	350,950,096円
DC世界経済インデックスファンド	1,481,744,972円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	386,441,723円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	23,987,825円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	76,645,452円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,258,357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)	360,416,986円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,635,767円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	135,176,388円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	482,524,313円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	74,342,672円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	642,905,470円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,038,949,490円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	777,271,241円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,418,695,350円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	664,287,833円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	64,969,201円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	869,107,894円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	899,781,483円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	505,519,500円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	633,064,951円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	59,719,761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)	990,566,770円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,488,469,859円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	162,735,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	199,517,219円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	229,109,648円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,423,344円
SMT インデックスバランス・オープン	85,565,724円
SMT 世界経済インデックス・オープン	3,192,065円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	43,130,365円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,877,930円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	768,211円
グローバル経済コア	323,109,909円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,432,749円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	34,521,793円

区分	2018年 6月25日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2055	149,100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）	25,904,817,924円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年 6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	3,971,894,962	
合計	3,971,894,962	

(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

（2018年 6月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,195,455,540	-	3,124,965,000	70,490,540
合計		3,195,455,540	-	3,124,965,000	70,490,540

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	3,600	3,590.00	12,924,000	
日本水産	104,100	540.00	56,214,000	
マルハニチロ	17,500	4,265.00	74,637,500	
カネコ種苗	3,200	1,645.00	5,264,000	
サカタのタネ	13,600	4,045.00	55,012,000	
ホクト	9,400	1,926.00	18,104,400	

ホクリヨウ	1,500	845.00	1,267,500
住石ホールディングス	29,800	147.00	4,380,600
日鉄鉱業	2,700	5,140.00	13,878,000
三井松島産業	5,200	1,549.00	8,054,800
国際石油開発帝石	450,400	1,129.50	508,726,800
石油資源開発	14,900	2,676.00	39,872,400
K&Oエナジーグループ	5,900	1,849.00	10,909,100
ヒノキヤグループ	2,300	2,907.00	6,686,100
ショーボンドホールディングス	8,700	7,540.00	65,598,000
ミライト・ホールディングス	28,500	1,711.00	48,763,500
タマホーム	6,800	1,015.00	6,902,000
サンヨーホームズ	1,500	1,338.00	2,007,000
日本アクア	2,600	352.00	915,200
ファーストコーポレーション	3,100	1,082.00	3,354,200
ベステラ	1,700	1,266.00	2,152,200
TATERU	8,800	1,970.00	17,336,000
ダイセキ環境ソリューション	2,100	1,107.00	2,324,700
第一カッター興業	1,200	2,743.00	3,291,600
安藤・間	72,000	972.00	69,984,000
東急建設	35,600	1,030.00	36,668,000
コムシスホールディングス	32,500	2,955.00	96,037,500
ミサワホーム	7,700	931.00	7,168,700
ピーアールホールディングス	9,100	488.00	4,440,800
高松コンストラクショングループ	6,000	3,150.00	18,900,000
東建コーポレーション	3,500	9,770.00	34,195,000
ソネック	1,100	890.00	979,000
ヤマウラ	4,400	894.00	3,933,600
大成建設	92,100	6,000.00	552,600,000
大林組	277,500	1,133.00	314,407,500
清水建設	283,000	1,106.00	312,998,000
飛島建設	84,100	192.00	16,147,200
長谷工コーポレーション	108,000	1,494.00	161,352,000
松井建設	10,200	931.00	9,496,200
銭高組	1,300	5,660.00	7,358,000
鹿島建設	407,000	851.00	346,357,000
不動テトラ	69,800	204.00	14,239,200
大末建設	3,000	1,393.00	4,179,000
鉄建建設	5,600	2,950.00	16,520,000
西松建設	21,400	3,125.00	66,875,000
三井住友建設	65,200	765.00	49,878,000
大豊建設	34,000	644.00	21,896,000
前田建設工業	66,000	1,283.00	84,678,000

佐田建設	6,100	480.00	2,928,000	
ナカノフドー建設	7,100	642.00	4,558,200	
奥村組	15,200	3,600.00	54,720,000	
東鉄工業	11,100	3,420.00	37,962,000	
イチケン	1,700	2,554.00	4,341,800	
浅沼組	33,000	373.00	12,309,000	
戸田建設	108,000	950.00	102,600,000	
熊谷組	14,500	3,850.00	55,825,000	
青木あすなろ建設	6,100	972.00	5,929,200	
北野建設	19,000	428.00	8,132,000	
植木組	1,200	2,628.00	3,153,600	
三井ホーム	12,000	691.00	8,292,000	
矢作建設工業	12,500	878.00	10,975,000	
ピーエス三菱	11,000	583.00	6,413,000	
日本ハウスホールディングス	17,600	541.00	9,521,600	
大東建託	33,000	18,095.00	597,135,000	
新日本建設	11,100	1,271.00	14,108,100	
N I P P O	21,400	1,990.00	42,586,000	
東亜道路工業	1,900	3,790.00	7,201,000	
前田道路	29,000	2,089.00	60,581,000	
日本道路	2,500	5,620.00	14,050,000	
東亜建設工業	7,300	2,870.00	20,951,000	
若築建設	5,000	1,643.00	8,215,000	
東洋建設	28,800	471.00	13,564,800	
五洋建設	110,000	718.00	78,980,000	
世紀東急工業	12,300	713.00	8,769,900	
福田組	3,000	6,670.00	20,010,000	
住友林業	59,200	1,627.00	96,318,400	
日本基礎技術	10,100	376.00	3,797,600	
日成ビルド工業	13,700	1,125.00	15,412,500	
巴コーポレーション	11,400	453.00	5,164,200	
大和ハウス工業	273,300	3,694.00	1,009,570,200	
ライト工業	17,700	1,137.00	20,124,900	
積水ハウス	301,000	1,911.50	575,361,500	
日特建設	7,800	663.00	5,171,400	
北陸電気工事	5,100	1,169.00	5,961,900	
ユアテック	13,900	917.00	12,746,300	
西部電気工業	1,500	3,815.00	5,722,500	
四電工	1,400	2,661.00	3,725,400	
中電工	11,900	2,784.00	33,129,600	
関電工	36,700	1,197.00	43,929,900	
きんでん	61,500	1,773.00	109,039,500	

東京エネシス	10,500	1,246.00	13,083,000
トーエネック	2,600	3,285.00	8,541,000
住友電設	7,300	2,010.00	14,673,000
日本電設工業	14,200	2,426.00	34,449,200
協和エクシオ	33,200	2,999.00	99,566,800
新日本空調	7,200	1,713.00	12,333,600
N D S	1,500	6,030.00	9,045,000
九電工	18,200	5,370.00	97,734,000
三機工業	19,600	1,054.00	20,658,400
日揮	79,700	2,172.00	173,108,400
中外炉工業	2,800	2,632.00	7,369,600
ヤマト	7,600	688.00	5,228,800
太平電業	6,300	2,778.00	17,501,400
高砂熱学工業	25,500	2,080.00	53,040,000
三晃金属工業	1,000	3,455.00	3,455,000
朝日工業社	1,900	3,430.00	6,517,000
明星工業	16,600	815.00	13,529,000
大気社	11,700	3,390.00	39,663,000
ダイダン	6,200	2,448.00	15,177,600
日比谷総合設備	10,300	2,188.00	22,536,400
東芝プラントシステム	20,000	2,539.00	50,780,000
O S J Bホールディングス	40,700	272.00	11,070,400
東洋エンジニアリング	10,100	755.00	7,625,500
千代田化工建設	60,100	945.00	56,794,500
新興プランテック	17,800	1,036.00	18,440,800
日本製粉	27,500	1,918.00	52,745,000
日清製粉グループ本社	101,400	2,342.00	237,478,800
日東富士製粉	600	5,060.00	3,036,000
昭和産業	7,600	2,925.00	22,230,000
鳥越製粉	7,200	995.00	7,164,000
中部飼料	10,100	2,004.00	20,240,400
フィード・ワン	55,400	213.00	11,800,200
東洋精糖	1,400	1,224.00	1,713,600
日本甜菜製糖	4,700	2,286.00	10,744,200
三井製糖	6,500	3,410.00	22,165,000
塩水港精糖	9,800	260.00	2,548,000
日新製糖	3,900	2,154.00	8,400,600
森永製菓	19,400	5,260.00	102,044,000
中村屋	2,100	4,785.00	10,048,500
江崎グリコ	23,100	5,260.00	121,506,000
名糖産業	4,000	1,773.00	7,092,000
井村屋グループ	3,300	3,330.00	10,989,000

不二家	5,300	2,493.00	13,212,900
山崎製パン	67,800	2,774.00	188,077,200
第一屋製パン	1,400	1,167.00	1,633,800
モロゾフ	1,400	6,730.00	9,422,000
亀田製菓	5,100	6,020.00	30,702,000
寿スピリッツ	8,000	5,740.00	45,920,000
カルビー	37,800	4,110.00	155,358,000
森永乳業	16,600	4,075.00	67,645,000
六甲バター	5,500	2,314.00	12,727,000
ヤクルト本社	48,200	7,230.00	348,486,000
明治ホールディングス	54,800	9,310.00	510,188,000
雪印メグミルク	19,900	2,900.00	57,710,000
プリマハム	58,000	618.00	35,844,000
日本ハム	35,800	4,395.00	157,341,000
林兼産業	3,000	787.00	2,361,000
丸大食品	44,000	495.00	21,780,000
S Foods	5,800	4,300.00	24,940,000
伊藤ハム米久ホールディングス	53,400	937.00	50,035,800
サッポロホールディングス	30,300	2,771.00	83,961,300
アサヒグループホールディングス	173,500	5,546.00	962,231,000
キリンホールディングス	398,300	2,938.50	1,170,404,550
宝ホールディングス	62,000	1,470.00	91,140,000
オエノンホールディングス	23,500	410.00	9,635,000
養命酒製造	2,500	2,470.00	6,175,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	58,200	4,230.00	246,186,000
サントリー食品インターナショナル	63,400	4,685.00	297,029,000
ダイトーグループホールディングス	4,200	6,370.00	26,754,000
伊藤園	27,400	5,190.00	142,206,000
キーコーヒー	8,100	2,184.00	17,690,400
ユニカフェ	2,500	1,195.00	2,987,500
ジャパンフーズ	1,200	1,471.00	1,765,200
日清オイリオグループ	9,800	3,140.00	30,772,000
不二製油グループ本社	22,400	3,820.00	85,568,000
かどや製油	900	6,100.00	5,490,000
J - オイルミルズ	4,300	3,945.00	16,963,500
キッコーマン	64,700	5,660.00	366,202,000
味の素	190,600	2,062.50	393,112,500
キューピー	46,100	2,805.00	129,310,500
ハウス食品グループ本社	31,600	3,810.00	120,396,000
カゴメ	33,200	3,705.00	123,006,000
焼津水産化学工業	4,000	1,246.00	4,984,000
アリアケジャパン	7,600	9,310.00	70,756,000

ピエトロ	1,100	1,646.00	1,810,600
エバラ食品工業	1,800	2,220.00	3,996,000
ニチレイ	39,500	2,786.00	110,047,000
東洋水産	45,500	3,875.00	176,312,500
イトアンド	2,300	2,092.00	4,811,600
大冷	900	1,994.00	1,794,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,192.00	2,026,400
日清食品ホールディングス	36,100	8,130.00	293,493,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,496.00	13,464,000
一正蒲鉾	3,200	1,331.00	4,259,200
フジッコ	9,000	2,882.00	25,938,000
ロック・フィールド	8,900	1,917.00	17,061,300
日本たばこ産業	512,700	3,211.00	1,646,279,700
ケンコーマヨネーズ	5,500	4,090.00	22,495,000
わらべや日洋ホールディングス	5,400	2,510.00	13,554,000
なとり	4,600	1,888.00	8,684,800
イフジ産業	1,400	779.00	1,090,600
ピクルスコーポレーション	1,600	2,210.00	3,536,000
北の達人コーポレーション	25,200	790.00	19,908,000
ユーグレナ	32,900	848.00	27,899,200
ミヨシ油脂	3,200	1,370.00	4,384,000
理研ビタミン	3,100	4,505.00	13,965,500
片倉工業	10,000	1,295.00	12,950,000
ゲンゼ	6,500	6,810.00	44,265,000
東洋紡	32,000	1,813.00	58,016,000
ユニチカ	25,300	620.00	15,686,000
富士紡ホールディングス	4,800	3,545.00	17,016,000
倉敷紡績	87,000	356.00	30,972,000
シキボウ	4,200	1,273.00	5,346,600
日本毛織	24,400	1,021.00	24,912,400
トーア紡コーポレーション	3,500	561.00	1,963,500
ガイドーリミテッド	9,700	447.00	4,335,900
帝国繊維	9,100	2,296.00	20,893,600
帝人	71,100	1,998.00	142,057,800
東レ	627,400	861.20	540,316,880
サカイオーベックス	2,200	2,245.00	4,939,000
住江織物	2,200	2,703.00	5,946,600
日本フェルト	4,500	516.00	2,322,000
イチカワ	6,000	351.00	2,106,000
日東製網	900	1,820.00	1,638,000
アツギ	5,800	1,169.00	6,780,200
ダイニック	3,300	1,019.00	3,362,700

セーレン	19,900	1,722.00	34,267,800
ソトー	3,300	1,028.00	3,392,400
東海染工	1,300	1,429.00	1,857,700
小松精練	13,300	950.00	12,635,000
ワコールホールディングス	23,900	3,145.00	75,165,500
ホギメディカル	10,900	4,765.00	51,938,500
レナウン	23,100	147.00	3,395,700
クラウドシアホールディングス	2,300	591.00	1,359,300
T S Iホールディングス	30,700	784.00	24,068,800
マツオカコーポレーション	2,100	3,755.00	7,885,500
三陽商会	4,600	2,266.00	10,423,600
ナイガイ	3,200	551.00	1,763,200
オンワードホールディングス	50,600	830.00	41,998,000
ルックホールディングス	15,000	283.00	4,245,000
ゴールドウイン	4,900	9,750.00	47,775,000
デサント	19,800	1,952.00	38,649,600
キング	4,400	516.00	2,270,400
ヤマトインターナショナル	5,800	609.00	3,532,200
特種東海製紙	4,700	4,380.00	20,586,000
王子ホールディングス	364,000	662.00	240,968,000
日本製紙	38,700	1,760.00	68,112,000
三菱製紙	12,300	630.00	7,749,000
北越紀州製紙	48,100	557.00	26,791,700
中越パルプ工業	3,400	1,657.00	5,633,800
巴川製紙所	13,000	253.00	3,289,000
大王製紙	34,500	1,559.00	53,785,500
阿波製紙	2,000	641.00	1,282,000
レンゴー	83,400	953.00	79,480,200
トーモク	5,000	2,061.00	10,305,000
ザ・パック	6,100	3,595.00	21,929,500
クラレ	145,500	1,539.00	223,924,500
旭化成	539,300	1,396.50	753,132,450
共和レザー	5,000	1,009.00	5,045,000
昭和電工	57,600	4,730.00	272,448,000
住友化学	636,000	616.00	391,776,000
住友精化	3,600	5,590.00	20,124,000
日産化学工業	50,300	5,220.00	262,566,000
ラサ工業	3,100	2,837.00	8,794,700
クレハ	7,500	7,620.00	57,150,000
多木化学	1,200	4,915.00	5,898,000
テイカ	6,600	2,219.00	14,645,400
石原産業	15,400	1,002.00	15,430,800

片倉コープアグリ	2,100	1,201.00	2,522,100	
日東エフシー	5,100	748.00	3,814,800	
日本曹達	60,000	592.00	35,520,000	
東ソー	125,000	1,690.00	211,250,000	
トクヤマ	25,100	3,415.00	85,716,500	
セントラル硝子	17,600	2,267.00	39,899,200	
東亜合成	50,800	1,323.00	67,208,400	
大阪ソーダ	8,400	3,150.00	26,460,000	
関東電化工業	20,600	953.00	19,631,800	
デンカ	31,800	3,660.00	116,388,000	
信越化学工業	144,000	9,800.00	1,411,200,000	
日本カーバイド工業	2,700	1,890.00	5,103,000	
堺化学工業	5,900	2,909.00	17,163,100	
エア・ウォーター	71,300	1,967.00	140,247,100	
大陽日酸	66,600	1,591.00	105,960,600	
日本化学工業	3,200	4,735.00	15,152,000	
東邦アセチレン	1,200	1,513.00	1,815,600	
日本パーカラライジング	44,200	1,572.00	69,482,400	
高压ガス工業	12,700	1,009.00	12,814,300	
チタン工業	900	2,443.00	2,198,700	
四国化成工業	12,500	1,525.00	19,062,500	
戸田工業	1,700	2,771.00	4,710,700	
ステラ ケミファ	4,400	3,730.00	16,412,000	
保土谷化学工業	2,800	3,315.00	9,282,000	
日本触媒	13,600	7,860.00	106,896,000	
大日精化工業	6,700	3,375.00	22,612,500	
カネカ	117,000	1,001.00	117,117,000	
三菱瓦斯化学	71,300	2,468.00	175,968,400	
三井化学	78,600	2,877.00	226,132,200	
J S R	86,900	1,831.00	159,113,900	
東京応化工業	15,000	4,130.00	61,950,000	
大阪有機化学工業	7,500	1,497.00	11,227,500	
三菱ケミカルホールディングス	579,200	904.20	523,712,640	
K Hネオケム	13,200	3,365.00	44,418,000	
ダイセル	116,600	1,179.00	137,471,400	
住友ベークライト	70,000	1,028.00	71,960,000	
積水化学工業	179,600	1,798.00	322,920,800	
日本ゼオン	72,900	1,288.00	93,895,200	
アイカ工業	24,300	3,840.00	93,312,000	
宇部興産	43,600	2,840.00	123,824,000	
積水樹脂	13,300	2,333.00	31,028,900	
タキロンシーアイ	17,400	597.00	10,387,800	

旭有機材	5,100	2,292.00	11,689,200
日立化成	42,700	2,162.00	92,317,400
ニチバン	4,300	3,050.00	13,115,000
リケンテクノス	18,400	550.00	10,120,000
大倉工業	21,000	522.00	10,962,000
積水化成成品工業	10,800	1,142.00	12,333,600
群栄化学工業	2,100	3,505.00	7,360,500
タイガースポリマー	4,300	770.00	3,311,000
ミライアル	2,900	1,245.00	3,610,500
ダイキアクシス	2,900	1,323.00	3,836,700
ダイキョーニシカワ	17,100	1,643.00	28,095,300
竹本容器	1,300	3,000.00	3,900,000
森六ホールディングス	4,400	3,060.00	13,464,000
日本化薬	56,100	1,212.00	67,993,200
カーリットホールディングス	8,100	971.00	7,865,100
日本精化	7,200	1,244.00	8,956,800
扶桑化学工業	8,200	2,819.00	23,115,800
トリケミカル研究所	2,000	4,340.00	8,680,000
A D E K A	37,200	1,776.00	66,067,200
日油	33,400	3,610.00	120,574,000
ハリマ化成グループ	6,600	865.00	5,709,000
花王	203,000	8,514.00	1,728,342,000
第一工業製薬	17,000	730.00	12,410,000
石原ケミカル	2,100	2,181.00	4,580,100
日華化学	2,800	1,178.00	3,298,400
ニイタカ	1,300	1,721.00	2,237,300
三洋化成工業	5,400	4,795.00	25,893,000
有機合成薬品工業	5,500	277.00	1,523,500
大日本塗料	9,900	1,453.00	14,384,700
日本ペイントホールディングス	66,700	4,575.00	305,152,500
関西ペイント	90,800	2,253.00	204,572,400
神東塗料	6,200	227.00	1,407,400
中国塗料	24,800	1,065.00	26,412,000
日本特殊塗料	5,400	2,400.00	12,960,000
藤倉化成	10,800	640.00	6,912,000
太陽ホールディングス	6,600	4,490.00	29,634,000
D I C	34,100	3,455.00	117,815,500
サカタインクス	17,700	1,450.00	25,665,000
東洋インキ S C ホールディングス	85,000	574.00	48,790,000
T & K T O K A	5,800	1,187.00	6,884,600
富士フィルムホールディングス	171,500	4,222.00	724,073,000
資生堂	153,800	8,774.00	1,349,441,200

ライオン	115,000	1,998.00	229,770,000
高砂香料工業	5,200	3,565.00	18,538,000
マンダム	16,100	3,255.00	52,405,500
ミルボン	11,000	4,920.00	54,120,000
ファンケル	20,100	5,390.00	108,339,000
コーセー	14,000	24,660.00	345,240,000
コタ	4,000	1,501.00	6,004,000
シーズ・ホールディングス	10,000	5,100.00	51,000,000
シーボン	1,000	3,000.00	3,000,000
ポーラ・オルビスホールディングス	35,300	4,870.00	171,911,000
ノエビアホールディングス	5,300	7,780.00	41,234,000
アジュバンコスメジャパン	1,800	1,050.00	1,890,000
エステー	5,900	3,135.00	18,496,500
アグロ カネショウ	3,400	2,743.00	9,326,200
コニシ	13,600	1,819.00	24,738,400
長谷川香料	10,500	2,188.00	22,974,000
星光PMC	4,800	1,033.00	4,958,400
小林製薬	23,100	9,520.00	219,912,000
荒川化学工業	7,400	1,818.00	13,453,200
メック	5,700	2,057.00	11,724,900
日本高純度化学	2,300	2,439.00	5,609,700
タカラバイオ	21,600	2,330.00	50,328,000
JCU	10,000	2,686.00	26,860,000
新田ゼラチン	5,700	815.00	4,645,500
OATアグリオ	1,300	3,295.00	4,283,500
デクセリアルズ	21,200	1,047.00	22,196,400
アース製薬	6,200	5,730.00	35,526,000
北興化学工業	8,500	617.00	5,244,500
大成ラミック	2,500	3,130.00	7,825,000
クミアイ化学工業	37,600	813.00	30,568,800
日本農薬	20,600	648.00	13,348,800
アキレス	6,300	2,196.00	13,834,800
有沢製作所	13,800	1,120.00	15,456,000
日東電工	62,400	8,221.00	512,990,400
レック	4,900	4,575.00	22,417,500
きもと	14,000	299.00	4,186,000
藤森工業	6,900	3,570.00	24,633,000
前澤化成工業	5,600	1,210.00	6,776,000
ウェーブロックホールディングス	2,100	1,077.00	2,261,700
JSP	4,800	3,340.00	16,032,000
エフピコ	6,800	6,040.00	41,072,000
天馬	6,400	1,939.00	12,409,600

信越ポリマー	16,800	1,037.00	17,421,600
東リ	20,700	338.00	6,996,600
ニフコ	30,300	3,485.00	105,595,500
日本バルカー工業	6,700	3,125.00	20,937,500
ユニ・チャーム	175,100	3,303.00	578,355,300
協和発酵キリン	103,400	2,274.00	235,131,600
武田薬品工業	304,200	4,526.00	1,376,809,200
アステラス製薬	848,500	1,740.00	1,476,390,000
大日本住友製薬	61,200	2,313.00	141,555,600
塩野義製薬	116,300	5,610.00	652,443,000
田辺三菱製薬	100,700	1,898.00	191,128,600
わかもと製薬	9,800	294.00	2,881,200
あすか製薬	9,400	1,386.00	13,028,400
日本新薬	21,600	6,360.00	137,376,000
ピオフェルミン製薬	1,400	2,869.00	4,016,600
中外製薬	86,100	5,900.00	507,990,000
科研製薬	14,900	5,810.00	86,569,000
エーザイ	98,800	7,856.00	776,172,800
ロート製薬	45,300	3,440.00	155,832,000
小野薬品工業	195,000	2,688.00	524,160,000
久光製薬	24,400	9,800.00	239,120,000
持田製薬	5,700	8,050.00	45,885,000
参天製薬	156,400	1,930.00	301,852,000
扶桑薬品工業	2,900	2,934.00	8,508,600
日本ケミファ	1,100	4,765.00	5,241,500
ツムラ	29,500	3,665.00	108,117,500
日医工	21,800	1,679.00	36,602,200
キッセイ薬品工業	14,700	3,020.00	44,394,000
生化学工業	16,000	1,490.00	23,840,000
栄研化学	13,400	2,480.00	33,232,000
日水製薬	3,500	1,386.00	4,851,000
鳥居薬品	5,200	2,716.00	14,123,200
JCRファーマ	5,800	7,040.00	40,832,000
東和薬品	4,000	5,900.00	23,600,000
富士製薬工業	2,800	4,015.00	11,242,000
沢井製薬	16,600	4,980.00	82,668,000
ゼリア新薬工業	17,700	2,330.00	41,241,000
第一三共	236,300	4,270.00	1,009,001,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,100	2,339.00	54,030,900
大幸薬品	4,400	2,046.00	9,002,400
ダイト	4,800	3,455.00	16,584,000
大塚ホールディングス	171,600	5,527.00	948,433,200

大正製薬ホールディングス	18,500	12,950.00	239,575,000
ペプチドリーム	37,700	4,665.00	175,870,500
日本コークス工業	69,200	119.00	8,234,800
昭和シェル石油	77,300	1,633.00	126,230,900
ニチレキ	10,600	1,276.00	13,525,600
ユシロ化学工業	4,600	1,726.00	7,939,600
ビーピー・カストロール	3,500	1,618.00	5,663,000
富士石油	19,900	378.00	7,522,200
MORESCO	3,000	1,749.00	5,247,000
出光興産	69,300	3,565.00	247,054,500
JXTGホールディングス	1,317,600	748.30	985,960,080
コスモエネルギーホールディングス	23,900	3,680.00	87,952,000
横浜ゴム	47,800	2,343.00	111,995,400
東洋ゴム工業	48,900	1,643.00	80,342,700
ブリヂストン	273,300	4,377.00	1,196,234,100
住友ゴム工業	85,000	1,790.00	152,150,000
藤倉ゴム工業	7,100	624.00	4,430,400
オカモト	29,000	1,285.00	37,265,000
フコク	3,600	968.00	3,484,800
ニッタ	8,500	4,370.00	37,145,000
住友理工	15,900	1,127.00	17,919,300
三ツ星ベルト	20,000	1,350.00	27,000,000
バンドー化学	15,700	1,241.00	19,483,700
日東紡績	12,300	2,617.00	32,189,100
旭硝子	83,300	4,295.00	357,773,500
日本板硝子	40,800	1,081.00	44,104,800
石塚硝子	1,100	2,383.00	2,621,300
日本山村硝子	34,000	183.00	6,222,000
日本電気硝子	35,700	2,994.00	106,885,800
オハラ	3,300	3,085.00	10,180,500
住友大阪セメント	161,000	509.00	81,949,000
太平洋セメント	52,200	3,755.00	196,011,000
日本ヒューム	8,300	895.00	7,428,500
日本コンクリート工業	17,800	331.00	5,891,800
三谷セキサン	4,300	2,614.00	11,240,200
アジアパイルホールディングス	10,600	708.00	7,504,800
東海カーボン	75,000	1,924.00	144,300,000
日本カーボン	4,300	6,130.00	26,359,000
東洋炭素	5,400	3,175.00	17,145,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,700	6,010.00	28,247,000
TOTO	63,500	5,320.00	337,820,000
日本碍子	100,800	1,949.00	196,459,200

日本特殊陶業	70,800	3,060.00	216,648,000
MARUWA	2,900	8,560.00	24,824,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,520.00	7,744,000
黒崎播磨	1,600	6,230.00	9,968,000
ヨータイ	6,500	675.00	4,387,500
イソライト工業	4,300	640.00	2,752,000
東京窯業	10,400	372.00	3,868,800
ニッカトー	3,800	1,299.00	4,936,200
フジインコーポレーテッド	7,400	2,440.00	18,056,000
クニミネ工業	2,200	1,074.00	2,362,800
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,204.00	2,167,200
ニチアス	45,000	1,410.00	63,450,000
ニチハ	12,400	4,085.00	50,654,000
新日鐵住金	365,400	2,174.50	794,562,300
神戸製鋼所	149,400	1,026.00	153,284,400
中山製鋼所	11,200	698.00	7,817,600
合同製鐵	4,400	2,173.00	9,561,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	220,500	2,118.00	467,019,000
日新製鋼	22,500	1,528.00	34,380,000
東京製鐵	43,600	998.00	43,512,800
共英製鋼	9,200	2,132.00	19,614,400
大和工業	17,300	3,325.00	57,522,500
東京鐵鋼	3,400	1,611.00	5,477,400
大阪製鐵	5,400	2,031.00	10,967,400
淀川製鋼所	11,900	2,780.00	33,082,000
丸一鋼管	28,900	3,760.00	108,664,000
モリ工業	2,600	3,030.00	7,878,000
大同特殊鋼	14,500	5,210.00	75,545,000
日本高周波鋼業	2,900	824.00	2,389,600
日本冶金工業	67,500	319.00	21,532,500
山陽特殊製鋼	9,400	2,608.00	24,515,200
愛知製鋼	4,600	4,265.00	19,619,000
日立金属	88,000	1,122.00	98,736,000
日本金属	2,100	1,883.00	3,954,300
大太平洋金属	5,000	3,895.00	19,475,000
新日本電工	48,700	317.00	15,437,900
栗本鐵工所	4,100	1,968.00	8,068,800
虹技	1,200	1,899.00	2,278,800
日本鑄鉄管	8,000	164.00	1,312,000
三菱製鋼	6,000	2,155.00	12,930,000
日亜鋼業	11,800	346.00	4,082,800
日本精線	1,300	4,245.00	5,518,500

シンニッタン	12,700	450.00	5,715,000
新家工業	1,900	2,080.00	3,952,000
大紀アルミニウム工業所	13,600	699.00	9,506,400
日本軽金属ホールディングス	238,900	245.00	58,530,500
三井金属鉱業	22,100	4,625.00	102,212,500
東邦亜鉛	4,600	4,080.00	18,768,000
三菱マテリアル	54,000	3,040.00	164,160,000
住友金属鉱山	104,400	4,238.00	442,447,200
D O W Aホールディングス	20,700	3,430.00	71,001,000
古河機械金属	13,600	1,574.00	21,406,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,600	1,595.00	13,717,000
東邦チタニウム	14,700	958.00	14,082,600
U A C J	12,400	2,407.00	29,846,800
C Kサンエツ	1,600	3,585.00	5,736,000
古河電気工業	27,200	3,800.00	103,360,000
住友電気工業	305,300	1,626.00	496,417,800
フジクラ	98,800	688.00	67,974,400
昭和電線ホールディングス	10,200	720.00	7,344,000
東京特殊電線	1,100	2,567.00	2,823,700
タツタ電線	16,300	558.00	9,095,400
カナレ電気	1,400	2,378.00	3,329,200
平河ヒューテック	4,200	1,450.00	6,090,000
リョービ	10,100	3,555.00	35,905,500
アーレスティ	10,100	1,018.00	10,281,800
アサヒホールディングス	14,000	2,164.00	30,296,000
稲葉製作所	4,600	1,447.00	6,656,200
宮地エンジニアリンググループ	2,300	1,992.00	4,581,600
トーカロ	22,600	1,182.00	26,713,200
アルファC o	2,900	1,558.00	4,518,200
S U M C O	75,200	2,160.00	162,432,000
川田テクノロジーズ	1,700	7,520.00	12,784,000
R S Technologies	1,300	5,440.00	7,072,000
東洋製罐グループホールディングス	55,800	1,875.00	104,625,000
ホッカンホールディングス	21,000	372.00	7,812,000
コロナ	4,500	1,208.00	5,436,000
横河ブリッジホールディングス	15,200	2,583.00	39,261,600
駒井ハルテック	1,800	2,258.00	4,064,400
高田機工	800	3,140.00	2,512,000
三和ホールディングス	78,300	1,170.00	91,611,000
文化シャッター	24,100	937.00	22,581,700
三協立山	11,300	1,487.00	16,803,100
アルインコ	5,900	1,070.00	6,313,000

東洋シャッター	2,200	667.00	1,467,400
LIXILグループ	120,400	2,150.00	258,860,000
日本フィルコン	6,200	613.00	3,800,600
ノーリツ	18,200	1,809.00	32,923,800
長府製作所	9,200	2,383.00	21,923,600
リンナイ	14,600	9,900.00	144,540,000
ダイニチ工業	4,400	793.00	3,489,200
日東精工	11,300	712.00	8,045,600
三洋工業	1,000	2,166.00	2,166,000
岡部	16,500	1,004.00	16,566,000
ジーテクト	9,000	1,931.00	17,379,000
東プレ	15,200	2,705.00	41,116,000
高周波熱錬	15,600	956.00	14,913,600
東京製綱	5,800	1,867.00	10,828,600
サンコール	4,600	715.00	3,289,000
モリテック スチール	6,400	587.00	3,756,800
パイオラックス	12,100	2,558.00	30,951,800
エイチワン	8,000	1,197.00	9,576,000
日本発條	81,300	1,071.00	87,072,300
中央発條	1,000	3,735.00	3,735,000
アドバネクス	1,300	2,062.00	2,680,600
立川ブラインド工業	3,600	1,450.00	5,220,000
三益半導体工業	6,700	1,770.00	11,859,000
日本ドライケミカル	1,100	2,333.00	2,566,300
日本製鋼所	26,700	2,791.00	74,519,700
三浦工業	35,400	2,705.00	95,757,000
タクマ	27,800	1,402.00	38,975,600
ツガミ	22,000	986.00	21,692,000
オークマ	9,600	5,750.00	55,200,000
東芝機械	47,000	523.00	24,581,000
アマダホールディングス	126,200	1,079.00	136,169,800
アイダエンジニアリング	21,000	1,061.00	22,281,000
滝澤鉄工所	2,500	1,768.00	4,420,000
F U J I	24,400	1,924.00	46,945,600
牧野フライス製作所	42,000	859.00	36,078,000
オーエスジー	37,700	2,239.00	84,410,300
ダイジェット工業	1,100	1,742.00	1,916,200
旭ダイヤモンド工業	24,600	787.00	19,360,200
D M G 森精機	45,300	1,561.00	70,713,300
ソディック	17,800	1,006.00	17,906,800
ディスコ	11,100	18,780.00	208,458,000
日東工器	5,000	2,615.00	13,075,000

日進工具	2,200	2,556.00	5,623,200
パンチ工業	6,800	1,015.00	6,902,000
富士ダイス	4,100	859.00	3,521,900
豊和工業	4,700	968.00	4,549,600
OKK	3,300	1,156.00	3,814,800
東洋機械金属	6,300	683.00	4,302,900
島精機製作所	10,400	5,280.00	54,912,000
オプトラン	8,000	4,010.00	32,080,000
NCホールディングス	2,500	764.00	1,910,000
フリー	5,700	985.00	5,614,500
ヤマシンフィルタ	12,300	1,026.00	12,619,800
日阪製作所	11,600	1,017.00	11,797,200
やまびこ	15,800	1,283.00	20,271,400
平田機工	3,000	7,790.00	23,370,000
ペガサスミシン製造	7,500	1,032.00	7,740,000
ナブテスコ	45,000	3,400.00	153,000,000
三井海洋開発	8,700	2,902.00	25,247,400
レオン自動機	7,300	2,019.00	14,738,700
S M C	25,900	41,960.00	1,086,764,000
新川	5,900	906.00	5,345,400
ホソカワミクロン	3,000	6,930.00	20,790,000
ユニオンツール	3,700	3,540.00	13,098,000
オイレス工業	10,600	2,118.00	22,450,800
日精エー・エス・ビー機械	2,600	5,730.00	14,898,000
サトーホールディングス	10,700	3,205.00	34,293,500
技研製作所	5,600	2,532.00	14,179,200
日本エアーテック	2,700	844.00	2,278,800
カワタ	1,700	1,595.00	2,711,500
日精樹脂工業	7,000	1,195.00	8,365,000
オカダアイヨン	2,700	1,684.00	4,546,800
ワイエイシイホールディングス	2,600	874.00	2,272,400
小松製作所	398,700	3,101.00	1,236,368,700
住友重機械工業	47,300	3,685.00	174,300,500
日立建機	38,700	3,535.00	136,804,500
日工	2,400	2,513.00	6,031,200
巴工業	3,500	2,296.00	8,036,000
井関農機	8,400	1,948.00	16,363,200
T O W A	6,400	1,124.00	7,193,600
丸山製作所	1,900	1,823.00	3,463,700
北川鉄工所	4,100	2,627.00	10,770,700
ローツェ	4,100	2,088.00	8,560,800
タカキタ	2,900	771.00	2,235,900

クボタ	443,000	1,806.00	800,058,000
荏原実業	2,500	2,279.00	5,697,500
三菱化工機	3,000	2,021.00	6,063,000
月島機械	16,500	1,628.00	26,862,000
帝国電機製作所	5,800	1,345.00	7,801,000
新東工業	19,800	973.00	19,265,400
澁谷工業	7,300	3,315.00	24,199,500
アイチ コーポレーション	14,600	654.00	9,548,400
小森コーポレーション	20,900	1,275.00	26,647,500
鶴見製作所	7,100	1,818.00	12,907,800
住友精密工業	14,000	361.00	5,054,000
酒井重工業	1,600	3,550.00	5,680,000
荏原製作所	34,000	3,300.00	112,200,000
石井鐵工所	1,400	1,991.00	2,787,400
西島製作所	8,700	1,038.00	9,030,600
北越工業	9,300	1,075.00	9,997,500
ダイキン工業	112,700	13,435.00	1,514,124,500
オルガノ	3,100	3,095.00	9,594,500
トーヨーカネツ	3,500	3,945.00	13,807,500
栗田工業	44,800	3,010.00	134,848,000
椿本チエイン	49,000	861.00	42,189,000
大同工業	3,300	1,451.00	4,788,300
木村化工機	7,400	419.00	3,100,600
アネスト岩田	13,900	1,161.00	16,137,900
ダイフク	42,100	4,940.00	207,974,000
サムコ	2,300	1,175.00	2,702,500
加藤製作所	4,000	2,745.00	10,980,000
油研工業	1,700	2,620.00	4,454,000
タダノ	40,000	1,379.00	55,160,000
フジテック	26,400	1,347.00	35,560,800
C K D	23,000	1,806.00	41,538,000
キトー	6,200	2,200.00	13,640,000
平和	25,600	2,622.00	67,123,200
理想科学工業	8,200	2,221.00	18,212,200
S A N K Y O	20,700	4,385.00	90,769,500
日本金銭機械	7,600	1,224.00	9,302,400
マースエンジニアリング	5,200	2,611.00	13,577,200
福島工業	5,100	5,020.00	25,602,000
オーイズミ	3,300	566.00	1,867,800
ダイコク電機	3,800	1,874.00	7,121,200
竹内製作所	13,800	2,274.00	31,381,200
アマノ	25,500	2,525.00	64,387,500

JUKI	12,300	1,083.00	13,320,900
サンデンホールディングス	10,100	1,456.00	14,705,600
蛇の目ミシン工業	7,400	698.00	5,165,200
マックス	12,700	1,384.00	17,576,800
グローリー	24,600	3,085.00	75,891,000
新晃工業	8,400	1,909.00	16,035,600
大和冷機工業	13,300	1,290.00	17,157,000
セガサミーホールディングス	81,900	1,930.00	158,067,000
日本ピストンリング	3,000	2,287.00	6,861,000
リケン	3,800	5,680.00	21,584,000
T P R	9,300	2,593.00	24,114,900
ツバキ・ナカシマ	8,300	2,671.00	22,169,300
ホシザキ	26,000	11,590.00	301,340,000
大豊工業	6,700	1,245.00	8,341,500
日本精工	169,600	1,145.00	194,192,000
NTN	191,100	446.00	85,230,600
ジェイテクト	88,000	1,509.00	132,792,000
不二越	7,700	4,995.00	38,461,500
日本トムソン	26,400	860.00	22,704,000
THK	51,500	3,270.00	168,405,000
ユーシン精機	7,300	1,304.00	9,519,200
前澤給装工業	3,200	1,958.00	6,265,600
イーグル工業	10,200	1,754.00	17,890,800
前澤工業	6,000	454.00	2,724,000
日本ピラー工業	8,300	1,503.00	12,474,900
キッツ	35,100	899.00	31,554,900
マキタ	107,700	4,870.00	524,499,000
日立造船	65,700	507.00	33,309,900
三菱重工業	138,400	3,955.00	547,372,000
I H I	63,500	3,900.00	247,650,000
スター精密	13,200	1,701.00	22,453,200
日清紡ホールディングス	50,500	1,169.00	59,034,500
イビデン	50,800	1,756.00	89,204,800
コニカミノルタ	193,600	1,037.00	200,763,200
ブラザー工業	101,000	2,167.00	218,867,000
ミネベアミツミ	153,500	1,875.00	287,812,500
日立製作所	1,982,000	781.60	1,549,131,200
三菱電機	825,600	1,451.00	1,197,945,600
富士電機	249,000	849.00	211,401,000
東洋電機製造	3,300	1,828.00	6,032,400
安川電機	95,700	3,995.00	382,321,500
シンフォニアテクノロジー	54,000	376.00	20,304,000

明電舎	70,000	398.00	27,860,000
オリジン電気	2,400	2,139.00	5,133,600
山洋電気	4,000	7,650.00	30,600,000
デンヨー	7,700	1,741.00	13,405,700
東芝テック	59,000	663.00	39,117,000
芝浦メカトロニクス	13,000	361.00	4,693,000
マブチモーター	22,900	5,300.00	121,370,000
日本電産	99,400	16,605.00	1,650,537,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,600	2,483.00	8,938,800
トレックス・セミコンダクター	2,600	1,403.00	3,647,800
東光高岳	4,400	1,941.00	8,540,400
ダブル・スコープ	12,200	1,715.00	20,923,000
ダイヘン	45,000	655.00	29,475,000
ヤーマン	12,200	1,927.00	23,509,400
JVCケンウッド	61,800	303.00	18,725,400
ミマキエンジニアリング	7,800	881.00	6,871,800
第一精工	4,100	1,802.00	7,388,200
日新電機	19,300	1,003.00	19,357,900
大崎電気工業	17,800	832.00	14,809,600
オムロン	87,800	5,240.00	460,072,000
日東工業	13,300	2,144.00	28,515,200
I D E C	10,300	2,572.00	26,491,600
不二電機工業	1,200	1,426.00	1,711,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	149,000	493.00	73,457,000
サクサホールディングス	2,100	2,356.00	4,947,600
メルコホールディングス	4,100	4,095.00	16,789,500
テクノメディカ	1,800	2,012.00	3,621,600
日本電気	106,900	3,080.00	329,252,000
富士通	849,000	671.80	570,358,200
沖電気工業	33,500	1,209.00	40,501,500
岩崎通信機	3,600	819.00	2,948,400
電気興業	4,700	3,325.00	15,627,500
サンケン電気	48,000	563.00	27,024,000
ナカヨ	1,600	1,819.00	2,910,400
アイホン	4,700	1,725.00	8,107,500
ルネサスエレクトロニクス	43,100	1,085.00	46,763,500
セイコーエプソン	123,000	1,907.00	234,561,000
ワコム	64,600	617.00	39,858,200
アルバック	19,000	4,300.00	81,700,000
アクセル	3,900	827.00	3,225,300
E I Z O	7,600	4,420.00	33,592,000
日本信号	22,800	1,048.00	23,894,400

京三製作所	19,400	738.00	14,317,200
能美防災	11,100	2,396.00	26,595,600
ホーチキ	6,200	2,175.00	13,485,000
星和電機	3,500	533.00	1,865,500
エレコム	7,300	2,504.00	18,279,200
パナソニック	943,200	1,487.00	1,402,538,400
シャープ	76,600	2,492.00	190,887,200
アンリツ	60,300	1,534.00	92,500,200
富士通ゼネラル	25,300	1,596.00	40,378,800
ソニー	552,700	5,491.00	3,034,875,700
T D K	43,200	11,410.00	492,912,000
帝国通信工業	3,900	1,254.00	4,890,600
タムラ製作所	32,000	648.00	20,736,000
アルプス電気	71,300	2,715.00	193,579,500
池上通信機	26,000	149.00	3,874,000
パイオニア	137,600	155.00	21,328,000
日本電波工業	7,800	555.00	4,329,000
鈴木	4,200	952.00	3,998,400
日本トリム	1,900	4,740.00	9,006,000
ローランド ディー・ジー・	4,400	2,408.00	10,595,200
フォスター電機	9,700	1,546.00	14,996,200
クラリオン	44,000	288.00	12,672,000
S M K	21,000	361.00	7,581,000
ヨコオ	5,500	1,857.00	10,213,500
ホシデン	21,100	937.00	19,770,700
ヒロセ電機	14,000	13,650.00	191,100,000
日本航空電子工業	21,000	1,709.00	35,889,000
T O A	8,900	1,173.00	10,439,700
マクセルホールディングス	16,600	1,804.00	29,946,400
古野電気	10,200	877.00	8,945,400
ユニデンホールディングス	23,000	319.00	7,337,000
アルパイン	19,700	2,035.00	40,089,500
スミダコーポレーション	8,700	1,192.00	10,370,400
アイコム	4,600	2,610.00	12,006,000
リオン	3,600	2,312.00	8,323,200
本多通信工業	6,800	946.00	6,432,800
横河電機	82,700	1,911.00	158,039,700
新電元工業	2,900	5,270.00	15,283,000
アズビル	24,800	4,920.00	122,016,000
東亜ディーケーケー	4,400	1,196.00	5,262,400
日本光電工業	34,600	3,075.00	106,395,000
チノー	2,900	1,602.00	4,645,800

共和電業	9,500	421.00	3,999,500
日本電子材料	3,300	699.00	2,306,700
堀場製作所	16,400	7,650.00	125,460,000
アドバンテスト	46,100	2,228.00	102,710,800
小野測器	3,900	860.00	3,354,000
エスベック	7,500	2,074.00	15,555,000
キーエンス	40,500	64,460.00	2,610,630,000
日置電機	4,400	4,385.00	19,294,000
シスメックス	64,300	10,860.00	698,298,000
日本マイクロニクス	14,100	955.00	13,465,500
メガチップス	6,600	2,935.00	19,371,000
O B A R A G R O U P	4,900	6,240.00	30,576,000
澤藤電機	1,100	2,270.00	2,497,000
コーセル	11,700	1,364.00	15,958,800
イリソ電子工業	7,000	6,420.00	44,940,000
新日本無線	4,900	750.00	3,675,000
オブテックスグループ	13,600	3,035.00	41,276,000
千代田インテグレ	4,000	2,364.00	9,456,000
アイ・オー・データ機器	3,700	1,201.00	4,443,700
レーザーテック	17,000	3,290.00	55,930,000
スタンレー電気	63,300	3,830.00	242,439,000
岩崎電気	3,400	1,597.00	5,429,800
ウシオ電機	50,400	1,366.00	68,846,400
岡谷電機産業	6,600	518.00	3,418,800
ヘリオス テクノ ホールディング	7,600	687.00	5,221,200
日本セラミック	8,500	2,947.00	25,049,500
遠藤照明	4,600	880.00	4,048,000
古河電池	6,300	855.00	5,386,500
双信電機	4,200	555.00	2,331,000
山一電機	6,200	1,512.00	9,374,400
図研	5,600	1,806.00	10,113,600
日本電子	30,000	1,079.00	32,370,000
カシオ計算機	66,400	1,800.00	119,520,000
ファナック	78,500	22,180.00	1,741,130,000
日本シイエムケイ	15,100	691.00	10,434,100
エンプラス	3,900	3,070.00	11,973,000
大真空	3,300	1,312.00	4,329,600
ローム	37,100	9,180.00	340,578,000
浜松ホトニクス	59,300	4,640.00	275,152,000
三井ハイテック	11,200	1,317.00	14,750,400
新光電気工業	31,600	943.00	29,798,800
京セラ	135,600	6,158.00	835,024,800

太陽誘電	37,200	2,876.00	106,987,200
村田製作所	86,600	18,125.00	1,569,625,000
ユーシン	12,300	711.00	8,745,300
双葉電子工業	13,700	1,911.00	26,180,700
北陸電気工業	3,600	1,231.00	4,431,600
ニチコン	26,300	1,348.00	35,452,400
日本ケミコン	6,700	4,125.00	27,637,500
K O A	11,600	2,638.00	30,600,800
市光工業	12,600	1,321.00	16,644,600
小糸製作所	49,500	7,570.00	374,715,000
ミツバ	15,600	966.00	15,069,600
S C R E E Nホールディングス	15,600	8,230.00	128,388,000
キャノン電子	7,700	2,233.00	17,194,100
キャノン	444,500	3,712.00	1,649,984,000
リコー	248,300	1,017.00	252,521,100
象印マホービン	15,600	1,582.00	24,679,200
M U T O Hホールディングス	1,300	2,375.00	3,087,500
東京エレクトロン	55,100	18,635.00	1,026,788,500
トヨタ紡織	24,100	2,071.00	49,911,100
芦森工業	1,700	2,402.00	4,083,400
ユニプレス	16,000	2,238.00	35,808,000
豊田自動織機	66,800	6,010.00	401,468,000
モリタホールディングス	13,300	2,281.00	30,337,300
三櫻工業	10,400	714.00	7,425,600
デンソー	183,200	5,406.00	990,379,200
東海理化電機製作所	21,800	2,040.00	44,472,000
三井E & Sホールディングス	29,800	1,388.00	41,362,400
川崎重工業	64,200	3,225.00	207,045,000
名村造船所	24,700	431.00	10,645,700
日本車輛製造	30,000	277.00	8,310,000
三菱ロジスネクスト	10,000	1,315.00	13,150,000
近畿車輛	1,100	2,370.00	2,607,000
日産自動車	973,700	1,067.50	1,039,424,750
いすゞ自動車	239,200	1,464.00	350,188,800
トヨタ自動車	1,003,700	7,091.00	7,117,236,700
日野自動車	117,800	1,164.00	137,119,200
三菱自動車工業	305,600	865.00	264,344,000
エフテック	5,300	1,426.00	7,557,800
レシップホールディングス	3,000	883.00	2,649,000
G M B	1,400	1,445.00	2,023,000
ファルテック	1,500	1,196.00	1,794,000
武蔵精密工業	8,800	3,750.00	33,000,000

日産車体	32,200	975.00	31,395,000	
新明和工業	35,900	1,319.00	47,352,100	
極東開発工業	15,300	1,657.00	25,352,100	
日信工業	16,800	1,960.00	32,928,000	
トピー工業	6,800	2,982.00	20,277,600	
ティラド	3,000	3,570.00	10,710,000	
曙ブレーキ工業	38,100	286.00	10,896,600	
タチエス	14,000	1,841.00	25,774,000	
NOK	44,400	2,139.00	94,971,600	
フタバ産業	25,200	711.00	17,917,200	
KYB	8,600	5,050.00	43,430,000	
大同メタル工業	10,300	1,091.00	11,237,300	
プレス工業	43,800	636.00	27,856,800	
ミクニ	10,500	557.00	5,848,500	
太平洋工業	17,300	1,657.00	28,666,100	
ケーヒン	19,000	2,210.00	41,990,000	
河西工業	10,200	1,384.00	14,116,800	
アイシン精機	68,000	5,030.00	342,040,000	
マツダ	259,100	1,353.50	350,691,850	
今仙電機製作所	7,700	1,187.00	9,139,900	
本田技研工業	742,900	3,310.00	2,458,999,000	
スズキ	163,600	6,173.00	1,009,902,800	
SUBARU	256,300	3,184.00	816,059,200	
安永	4,000	1,954.00	7,816,000	
ヤマハ発動機	116,600	2,795.00	325,897,000	
ショーワ	21,500	1,911.00	41,086,500	
TBK	9,900	502.00	4,969,800	
エクセディ	10,000	3,500.00	35,000,000	
豊田合成	30,000	2,778.00	83,340,000	
愛三工業	14,500	931.00	13,499,500	
盟和産業	1,300	1,270.00	1,651,000	
日本プラスト	4,500	981.00	4,414,500	
ヨロズ	8,400	1,643.00	13,801,200	
エフ・シー・シー	13,500	3,115.00	42,052,500	
シマノ	33,300	16,140.00	537,462,000	
テイ・エス テック	19,200	4,590.00	88,128,000	
ジャムコ	4,200	2,471.00	10,378,200	
テルモ	126,500	6,560.00	829,840,000	
クリエートメディック	2,700	1,413.00	3,815,100	
日機装	28,500	1,125.00	32,062,500	
島津製作所	98,700	3,240.00	319,788,000	
JMS	7,600	647.00	4,917,200	

長野計器	6,500	1,254.00	8,151,000
ブイ・テクノロジー	1,900	20,890.00	39,691,000
東京計器	5,300	1,221.00	6,471,300
愛知時計電機	1,100	4,125.00	4,537,500
インターアクション	4,400	1,464.00	6,441,600
オーバル	8,100	313.00	2,535,300
東京精密	14,900	3,690.00	54,981,000
マニー	10,100	5,120.00	51,712,000
ニコン	143,900	1,736.00	249,810,400
トプコン	44,300	1,816.00	80,448,800
オリンパス	123,000	4,135.00	508,605,000
理研計器	7,900	2,509.00	19,821,100
タムロン	6,700	2,011.00	13,473,700
H O Y A	166,200	6,358.00	1,056,699,600
シード	1,200	6,600.00	7,920,000
ノーリツ鋼機	8,400	1,874.00	15,741,600
エー・アンド・デイ	7,600	1,032.00	7,843,200
シチズン時計	98,600	723.00	71,287,800
リズム時計工業	3,100	2,110.00	6,541,000
大研医器	7,400	763.00	5,646,200
メニコン	11,300	2,904.00	32,815,200
シンシア	900	626.00	563,400
松風	4,000	1,439.00	5,756,000
セイコーホールディングス	12,700	2,384.00	30,276,800
ニプロ	57,200	1,300.00	74,360,000
中本パックス	2,100	1,750.00	3,675,000
スノーピーク	2,500	1,486.00	3,715,000
パラマウントベッドホールディングス	8,700	4,660.00	40,542,000
トランザクション	4,500	995.00	4,477,500
S H O - B I	2,600	438.00	1,138,800
ニホンフラッシュ	3,900	2,755.00	10,744,500
前田工織	9,100	1,879.00	17,098,900
永大産業	10,600	540.00	5,724,000
アートネイチャー	8,800	675.00	5,940,000
バンダイナムコホールディングス	85,400	4,645.00	396,683,000
アイフィスジャパン	1,700	740.00	1,258,000
共立印刷	13,700	374.00	5,123,800
S H O E I	4,000	3,770.00	15,080,000
フランスベッドホールディングス	9,700	948.00	9,195,600
パイロットコーポレーション	14,400	6,300.00	90,720,000
萩原工業	4,600	1,788.00	8,224,800
トッパン・フォームズ	17,700	1,116.00	19,753,200

フジシールインターナショナル	18,500	3,820.00	70,670,000
タカラトミー	34,600	874.00	30,240,400
廣濟堂	7,600	505.00	3,838,000
A s - m e エステール	2,300	780.00	1,794,000
アーク	41,400	121.00	5,009,400
タカノ	3,500	1,014.00	3,549,000
プロネクサス	7,700	1,287.00	9,909,900
ホクシン	5,500	174.00	957,000
ウッドワン	2,800	1,389.00	3,889,200
大建工業	6,500	2,493.00	16,204,500
凸版印刷	233,000	858.00	199,914,000
大日本印刷	108,000	2,471.00	266,868,000
図書印刷	5,500	985.00	5,417,500
共同印刷	2,500	2,818.00	7,045,000
N I S S H A	16,900	2,230.00	37,687,000
光村印刷	700	2,243.00	1,570,100
宝印刷	4,300	1,793.00	7,709,900
アシックス	82,000	1,815.00	148,830,000
ツツミ	2,600	1,823.00	4,739,800
小松ウオール工業	2,800	2,008.00	5,622,400
ヤマハ	55,600	5,730.00	318,588,000
河合楽器製作所	2,800	5,650.00	15,820,000
クリナップ	7,700	815.00	6,275,500
ピジョン	49,900	5,430.00	270,957,000
兼松サステック	600	1,949.00	1,169,400
キングジム	6,800	1,062.00	7,221,600
リンテック	19,600	3,220.00	63,112,000
イトーキ	17,400	635.00	11,049,000
任天堂	50,800	36,110.00	1,834,388,000
三菱鉛筆	13,600	2,274.00	30,926,400
タカラスタANDARD	17,100	1,812.00	30,985,200
コクヨ	39,600	1,962.00	77,695,200
ナカバヤシ	8,000	686.00	5,488,000
グローブライド	3,700	4,150.00	15,355,000
オカムラ	28,800	1,596.00	45,964,800
美津濃	8,200	4,000.00	32,800,000
東京電力ホールディングス	659,100	509.00	335,481,900
中部電力	252,600	1,647.50	416,158,500
関西電力	336,900	1,564.50	527,080,050
中国電力	114,100	1,409.00	160,766,900
北陸電力	80,900	1,095.00	88,585,500
東北電力	193,400	1,333.00	257,802,200

四国電力	74,300	1,487.00	110,484,100
九州電力	182,300	1,200.00	218,760,000
北海道電力	82,800	730.00	60,444,000
沖縄電力	16,700	2,171.00	36,255,700
電源開発	65,700	2,750.00	180,675,000
エフオン	4,100	1,633.00	6,695,300
イーレックス	13,000	1,118.00	14,534,000
レノバ	4,300	1,430.00	6,149,000
東京瓦斯	176,100	2,848.50	501,620,850
大阪瓦斯	160,200	2,204.00	353,080,800
東邦瓦斯	40,900	3,790.00	155,011,000
北海道瓦斯	22,000	308.00	6,776,000
広島ガス	16,900	379.00	6,405,100
西部瓦斯	10,000	3,000.00	30,000,000
静岡ガス	23,300	1,022.00	23,812,600
メタウォーター	4,700	3,125.00	14,687,500
SBSホールディングス	8,100	1,204.00	9,752,400
東武鉄道	87,100	3,420.00	297,882,000
相鉄ホールディングス	26,400	3,400.00	89,760,000
東京急行電鉄	224,200	1,922.00	430,912,400
京浜急行電鉄	113,100	1,818.00	205,615,800
小田急電鉄	122,800	2,357.00	289,439,600
京王電鉄	46,100	5,350.00	246,635,000
京成電鉄	57,500	3,780.00	217,350,000
富士急行	11,300	3,385.00	38,250,500
新京成電鉄	2,100	2,200.00	4,620,000
東日本旅客鉄道	148,300	10,505.00	1,557,891,500
西日本旅客鉄道	74,500	8,043.00	599,203,500
東海旅客鉄道	73,900	23,590.00	1,743,301,000
西武ホールディングス	105,200	1,866.00	196,303,200
鴻池運輸	11,700	1,686.00	19,726,200
西日本鉄道	22,900	3,025.00	69,272,500
ハマキョウレックス	5,800	3,340.00	19,372,000
サカイ引越センター	4,300	5,660.00	24,338,000
近鉄グループホールディングス	78,200	4,485.00	350,727,000
阪急阪神ホールディングス	104,300	4,430.00	462,049,000
南海電気鉄道	37,100	3,100.00	115,010,000
京阪ホールディングス	34,800	3,910.00	136,068,000
神戸電鉄	1,900	3,990.00	7,581,000
名古屋鉄道	62,300	2,888.00	179,922,400
山陽電気鉄道	6,000	2,700.00	16,200,000
日本通運	30,700	8,180.00	251,126,000

ヤマトホールディングス	137,100	3,373.00	462,438,300
山九	20,100	5,970.00	119,997,000
丸運	4,200	352.00	1,478,400
丸全昭和運輸	28,000	505.00	14,140,000
センコーグループホールディングス	47,000	898.00	42,206,000
トナミホールディングス	1,900	6,440.00	12,236,000
ニッコンホールディングス	29,700	2,956.00	87,793,200
日本石油輸送	900	3,235.00	2,911,500
福山通運	11,400	5,800.00	66,120,000
セイノーホールディングス	58,600	1,983.00	116,203,800
エスライン	2,100	1,173.00	2,463,300
神奈川中央交通	1,900	3,705.00	7,039,500
日立物流	17,200	2,900.00	49,880,000
丸和運輸機関	4,100	4,005.00	16,420,500
C & F ロジホールディングス	8,600	1,323.00	11,377,800
九州旅客鉄道	65,600	3,455.00	226,648,000
S Gホールディングス	73,900	2,338.00	172,778,200
日本郵船	65,600	2,189.00	143,598,400
商船三井	49,700	2,642.00	131,307,400
川崎汽船	36,400	2,082.00	75,784,800
N S ユナイテッド海運	4,000	2,087.00	8,348,000
飯野海運	41,000	485.00	19,885,000
共栄タンカー	900	1,864.00	1,677,600
乾汽船	6,000	1,132.00	6,792,000
日本航空	145,100	4,059.00	588,960,900
A N Aホールディングス	151,900	4,140.00	628,866,000
パスコ	8,000	314.00	2,512,000
トランコム	2,200	7,690.00	16,918,000
日新	6,800	2,591.00	17,618,800
三菱倉庫	27,100	2,378.00	64,443,800
三井倉庫ホールディングス	45,000	340.00	15,300,000
住友倉庫	54,000	682.00	36,828,000
澁澤倉庫	4,300	1,680.00	7,224,000
東陽倉庫	13,900	361.00	5,017,900
日本トランスシティ	18,700	537.00	10,041,900
ケイヒン	1,500	1,605.00	2,407,500
中央倉庫	4,800	1,253.00	6,014,400
川西倉庫	1,600	1,963.00	3,140,800
安田倉庫	6,900	909.00	6,272,100
東洋埠頭	2,400	1,707.00	4,096,800
宇徳	6,600	522.00	3,445,200
上組	48,200	2,317.00	111,679,400

サンリツ	1,900	800.00	1,520,000
キムラユニティー	2,100	1,136.00	2,385,600
キューソー流通システム	2,300	2,767.00	6,364,100
近鉄エクスプレス	14,800	2,313.00	34,232,400
東海運	4,200	370.00	1,554,000
エーアイティー	5,500	1,161.00	6,385,500
内外トランスライン	2,700	1,572.00	4,244,400
日本コンセプト	1,500	1,445.00	2,167,500
NEC ネットエスアイ	9,000	2,450.00	22,050,000
システナ	26,100	1,199.00	31,293,900
デジタルアーツ	4,000	5,630.00	22,520,000
新日鉄住金ソリューションズ	12,200	2,854.00	34,818,800
キューブシステム	4,800	968.00	4,646,400
エイジア	1,700	1,553.00	2,640,100
コア	3,500	1,392.00	4,872,000
ソリトンシステムズ	3,700	996.00	3,685,200
ソフトクリエイティブホールディングス	4,000	1,699.00	6,796,000
T I S	27,000	4,955.00	133,785,000
ネオス	2,600	438.00	1,138,800
電算システム	2,900	2,091.00	6,063,900
グリー	43,700	597.00	26,088,900
コーエーテクモホールディングス	13,900	2,220.00	30,858,000
三菱総合研究所	3,400	4,775.00	16,235,000
電算	1,000	2,228.00	2,228,000
A G S	4,700	881.00	4,140,700
ファインデックス	6,900	839.00	5,789,100
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	2,076.00	3,944,400
ブレインパッド	1,800	3,875.00	6,975,000
K L a b	15,400	1,461.00	22,499,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	2,340.00	13,806,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,400	1,182.00	1,654,800
ネクソン	182,500	1,597.00	291,452,500
アイスタイル	20,700	1,131.00	23,411,700
エムアップ	2,800	1,619.00	4,533,200
エイチーム	5,400	2,373.00	12,814,200
テクノスジャパン	7,500	985.00	7,387,500
コロプラ	25,400	732.00	18,592,800
モバイルクリエイティブ	6,900	315.00	2,173,500
ブロードリーフ	40,400	606.00	24,482,400
クロス・マーケティンググループ	2,400	666.00	1,598,400
ハーツユナイテッドグループ	4,400	1,612.00	7,092,800
メディアドゥホールディングス	2,700	2,347.00	6,336,900

サイバーリンクス	1,400	1,101.00	1,541,400
フィックスターズ	7,900	1,553.00	12,268,700
VOYAGE GROUP	4,400	1,158.00	5,095,200
オブティム	1,500	2,587.00	3,880,500
セレス	2,600	1,624.00	4,222,400
ベリサーブ	1,100	3,505.00	3,855,500
ティーガイア	8,200	2,995.00	24,559,000
セック	1,100	3,115.00	3,426,500
日本アジアグループ	8,400	483.00	4,057,200
豆蔵ホールディングス	6,200	967.00	5,995,400
テクマトリックス	4,500	2,224.00	10,008,000
プロシップ	1,200	2,588.00	3,105,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	220,300	282.00	62,124,600
GMOペイメントゲートウェイ	6,700	13,490.00	90,383,000
ザッパラス	4,100	372.00	1,525,200
システムリサーチ	1,100	3,230.00	3,553,000
インターネットイニシアティブ	13,200	2,260.00	29,832,000
さくらインターネット	9,800	832.00	8,153,600
ヴィンクス	2,300	1,039.00	2,389,700
GMOクラウド	1,900	3,070.00	5,833,000
SRAホールディングス	4,400	2,890.00	12,716,000
Minor iソリューションズ	1,700	1,620.00	2,754,000
朝日ネット	7,500	517.00	3,877,500
eBASE	2,200	1,670.00	3,674,000
アバント	2,400	944.00	2,265,600
アドソル日進	3,200	1,658.00	5,305,600
フリービット	5,600	1,366.00	7,649,600
コムチュア	4,200	2,779.00	11,671,800
サイバーコム	1,500	1,881.00	2,821,500
インフォテリア	4,200	1,023.00	4,296,600
メディカル・データ・ビジョン	6,300	1,549.00	9,758,700
gumi	9,400	749.00	7,040,600
ショーケース・ティービー	1,700	1,320.00	2,244,000
モバイルファクトリー	2,100	1,690.00	3,549,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,700	1,115.00	4,125,500
PCIホールディングス	1,500	3,060.00	4,590,000
パイプドHD	1,300	1,054.00	1,370,200
アイビーシー	1,400	2,108.00	2,951,200
ネオジャパン	2,000	1,771.00	3,542,000
オープンドア	3,300	2,098.00	6,923,400
マイネット	2,300	1,291.00	2,969,300
アカツキ	2,200	4,045.00	8,899,000

ベネフィットジャパン	600	1,293.00	775,800
Ubicomホールディングス	1,300	1,046.00	1,359,800
LINE	24,500	4,575.00	112,087,500
シンクロ・フード	2,900	990.00	2,871,000
オークネット	3,600	1,491.00	5,367,600
AOI TYO Holdings	6,800	1,376.00	9,356,800
マクロミル	10,200	2,666.00	27,193,200
ビーグリー	1,900	1,603.00	3,045,700
オロ	800	3,060.00	2,448,000
ソルクシーズ	3,200	1,325.00	4,240,000
フェイス	3,000	1,368.00	4,104,000
ハイマックス	1,200	1,801.00	2,161,200
野村総合研究所	51,500	5,480.00	282,220,000
サイバネットシステム	6,700	883.00	5,916,100
CEホールディングス	2,300	790.00	1,817,000
日本システム技術	1,400	1,517.00	2,123,800
インテージホールディングス	9,700	1,203.00	11,669,100
東邦システムサイエンス	2,900	873.00	2,531,700
ソースネクスト	11,500	803.00	9,234,500
フォーカスシステムズ	4,700	809.00	3,802,300
クレスコ	1,900	3,205.00	6,089,500
フジ・メディア・ホールディングス	84,900	1,849.00	156,980,100
オービック	25,500	9,230.00	235,365,000
ジャストシステム	13,200	2,224.00	29,356,800
TDCソフト	3,600	1,648.00	5,932,800
ヤフー	584,600	370.00	216,302,000
トレンドマイクロ	39,600	6,140.00	243,144,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,700	1,340.00	3,618,000
日本オラクル	13,100	8,500.00	111,350,000
アルファシステムズ	2,700	2,318.00	6,258,600
フューチャー	11,100	1,377.00	15,284,700
CAC Holdings	6,100	1,067.00	6,508,700
ソフトバンク・テクノロジー	3,500	1,565.00	5,477,500
トーセ	2,200	1,062.00	2,336,400
オービックビジネスコンサルタント	4,200	7,810.00	32,802,000
伊藤忠テクノソリューションズ	37,000	1,909.00	70,633,000
アイティフォー	9,900	1,241.00	12,285,900
東計電算	1,500	3,050.00	4,575,000
エクスネット	1,400	900.00	1,260,000
大塚商会	48,700	4,500.00	219,150,000
サイボウズ	11,100	541.00	6,005,100
ソフトブレーン	6,600	649.00	4,283,400

電通国際情報サービス	5,100	3,265.00	16,651,500
デジタルガレージ	14,600	4,350.00	63,510,000
E Mシステムズ	5,600	1,138.00	6,372,800
ウェザーニューズ	2,800	3,315.00	9,282,000
C I J	6,600	690.00	4,554,000
東洋ビジネスエンジニアリング	900	2,026.00	1,823,400
日本エンタープライズ	9,100	217.00	1,974,700
WOWOW	3,900	3,490.00	13,611,000
スカラ	6,600	1,012.00	6,679,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,000	898.00	6,286,000
ネットワンシステムズ	33,200	1,884.00	62,548,800
システムソフト	20,000	138.00	2,760,000
アルゴグラフィックス	3,800	3,540.00	13,452,000
マーベラス	13,800	901.00	12,433,800
エイベックス	15,100	1,483.00	22,393,300
日本ユニシス	22,600	2,660.00	60,116,000
兼松エレクトロニクス	5,200	3,950.00	20,540,000
東京放送ホールディングス	44,900	2,491.00	111,845,900
日本テレビホールディングス	74,500	1,862.00	138,719,000
朝日放送グループホールディングス	8,200	838.00	6,871,600
テレビ朝日ホールディングス	22,300	2,383.00	53,140,900
スカパーJ S A Tホールディングス	62,200	509.00	31,659,800
テレビ東京ホールディングス	6,700	3,400.00	22,780,000
日本BS放送	2,900	1,346.00	3,903,400
ビジョン	2,100	3,650.00	7,665,000
ワイヤレスゲート	3,900	1,292.00	5,038,800
コネクシオ	5,800	1,851.00	10,735,800
クロップス	1,800	867.00	1,560,600
日本電信電話	581,400	5,137.00	2,986,651,800
K D D I	729,500	3,016.00	2,200,172,000
光通信	9,800	20,120.00	197,176,000
N T T ドコモ	581,800	2,807.50	1,633,403,500
エムティーアイ	10,500	605.00	6,352,500
G M O インターネット	29,600	2,703.00	80,008,800
アイドママーケティングコミュニケーション	1,900	917.00	1,742,300
カドカワ	23,700	1,216.00	28,819,200
学研ホールディングス	2,800	5,110.00	14,308,000
ゼンリン	14,800	2,578.00	38,154,400
昭文社	3,900	767.00	2,991,300
インプレスホールディングス	6,400	167.00	1,068,800
アイネット	4,700	1,767.00	8,304,900
松竹	5,400	16,310.00	88,074,000

東宝	53,300	3,820.00	203,606,000
東映	3,000	11,410.00	34,230,000
エヌ・ティ・ティ・データ	251,800	1,266.00	318,778,800
ピー・シー・エー	1,300	1,802.00	2,342,600
ビジネスブレイン太田昭和	1,500	2,273.00	3,409,500
D T S	8,400	4,205.00	35,322,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,700	5,630.00	212,251,000
シーイーシー	4,900	4,065.00	19,918,500
カプコン	34,800	2,678.00	93,194,400
アイ・エス・ピー	1,700	1,902.00	3,233,400
ジャステック	4,800	1,152.00	5,529,600
S C S K	18,700	5,210.00	97,427,000
日本システムウエア	2,800	2,201.00	6,162,800
アイネス	10,400	1,101.00	11,450,400
T K C	7,200	4,030.00	29,016,000
富士ソフト	11,300	4,635.00	52,375,500
N S D	13,400	2,517.00	33,727,800
コナミホールディングス	33,100	5,750.00	190,325,000
福井コンピュータホールディングス	2,500	1,889.00	4,722,500
J B C Cホールディングス	6,500	1,162.00	7,553,000
ミロク情報サービス	7,200	2,807.00	20,210,400
ソフトバンクグループ	366,800	8,198.00	3,007,026,400
ハウスイ	700	1,127.00	788,900
高千穂交易	3,100	1,158.00	3,589,800
伊藤忠食品	2,000	6,120.00	12,240,000
エレマテック	3,800	2,690.00	10,222,000
J A L U X	2,300	2,999.00	6,897,700
あらた	4,000	6,540.00	26,160,000
トーメンデバイス	1,200	2,876.00	3,451,200
東京エレクトロン デバイス	3,000	1,959.00	5,877,000
フィールズ	6,100	976.00	5,953,600
双日	481,200	405.00	194,886,000
アルフレッサ ホールディングス	90,400	2,630.00	237,752,000
横浜冷凍	20,700	1,008.00	20,865,600
神栄	1,100	1,420.00	1,562,000
ラサ商事	3,600	956.00	3,441,600
ラクーン	4,800	561.00	2,692,800
アルコニックス	8,600	1,644.00	14,138,400
神戸物産	5,300	5,010.00	26,553,000
ペッパーフードサービス	5,900	4,755.00	28,054,500
あい ホールディングス	13,100	2,416.00	31,649,600
ディービーエックス	2,900	1,385.00	4,016,500

ダイワボウホールディングス	6,900	5,960.00	41,124,000
マクニカ・富士エレホールディングス	15,600	1,721.00	26,847,600
ラクト・ジャパン	1,500	6,060.00	9,090,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,300	1,124.00	17,197,200
八洲電機	6,200	954.00	5,914,800
メディアスホールディングス	4,500	1,035.00	4,657,500
U K Cホールディングス	5,200	2,314.00	12,032,800
ジューテックホールディングス	1,900	1,155.00	2,194,500
大光	2,000	778.00	1,556,000
O C H Iホールディングス	2,400	1,437.00	3,448,800
T O K A Iホールディングス	43,000	1,078.00	46,354,000
C o m i n i x	1,200	914.00	1,096,800
三洋貿易	4,300	2,148.00	9,236,400
ビューティガレージ	1,100	2,218.00	2,439,800
ウイン・パートナーズ	5,900	1,470.00	8,673,000
ミタチ産業	1,800	950.00	1,710,000
シップヘルスケアホールディングス	16,900	4,080.00	68,952,000
明治電機工業	2,800	1,950.00	5,460,000
デリカフーズホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000
スターティアホールディングス	1,800	667.00	1,200,600
コメダホールディングス	15,100	2,154.00	32,525,400
富士興産	3,200	625.00	2,000,000
協栄産業	1,000	2,076.00	2,076,000
小野建	7,200	1,897.00	13,658,400
佐島電機	5,900	1,052.00	6,206,800
エコートレーディング	1,800	711.00	1,279,800
伯東	5,000	1,641.00	8,205,000
コンドーテック	6,400	1,019.00	6,521,600
中山福	4,600	746.00	3,431,600
ナガイレーベン	11,800	2,812.00	33,181,600
三菱食品	8,900	2,927.00	26,050,300
松田産業	5,900	1,646.00	9,711,400
第一興商	12,100	5,270.00	63,767,000
メディバルホールディングス	81,500	2,250.00	183,375,000
S P K	1,700	2,813.00	4,782,100
萩原電気ホールディングス	2,900	3,200.00	9,280,000
アズワン	6,400	7,770.00	49,728,000
スズデン	2,800	1,608.00	4,502,400
尾家産業	2,400	1,398.00	3,355,200
シモジマ	5,000	1,123.00	5,615,000
ドウシシャ	8,600	2,501.00	21,508,600
小津産業	1,800	2,085.00	3,753,000

高速	4,900	1,342.00	6,575,800
たけびし	2,900	1,665.00	4,828,500
リックス	1,800	1,937.00	3,486,600
丸文	7,100	852.00	6,049,200
ハピネット	5,600	1,363.00	7,632,800
橋本総業ホールディングス	1,700	1,783.00	3,031,100
日本ライフライン	23,200	2,715.00	62,988,000
エクセル	2,900	2,554.00	7,406,600
マルカキカイ	2,600	1,945.00	5,057,000
I D O M	24,600	627.00	15,424,200
日本エム・ディ・エム	5,400	1,052.00	5,680,800
進和	4,800	2,415.00	11,592,000
エスケイジャパン	1,900	445.00	845,500
ダイトロン	3,700	2,260.00	8,362,000
シークス	10,300	2,320.00	23,896,000
田中商事	2,400	705.00	1,692,000
オーハシテクニカ	4,600	1,802.00	8,289,200
白銅	2,900	2,316.00	6,716,400
伊藤忠商事	596,700	2,005.00	1,196,383,500
丸紅	668,200	827.90	553,202,780
高島	1,400	2,137.00	2,991,800
長瀬産業	49,000	1,741.00	85,309,000
蝶理	5,200	1,937.00	10,072,400
豊田通商	90,800	3,735.00	339,138,000
三共生興	13,900	463.00	6,435,700
兼松	34,700	1,645.00	57,081,500
ツカモトコーポレーション	1,500	1,212.00	1,818,000
三井物産	669,900	1,808.50	1,211,514,150
日本紙パルプ商事	4,200	5,100.00	21,420,000
日立ハイテクノロジーズ	28,200	4,390.00	123,798,000
カメイ	10,600	1,682.00	17,829,200
東都水産	1,200	1,888.00	2,265,600
O U Gホールディングス	1,300	2,787.00	3,623,100
スターゼン	3,200	5,990.00	19,168,000
山善	31,700	1,080.00	34,236,000
椿本興業	1,800	3,875.00	6,975,000
住友商事	512,900	1,814.00	930,400,600
内田洋行	3,700	3,650.00	13,505,000
三菱商事	570,600	3,083.00	1,759,159,800
第一実業	3,700	3,360.00	12,432,000
キャノンマーケティングジャパン	23,200	2,260.00	52,432,000
西華産業	4,900	2,448.00	11,995,200

佐藤商事	7,300	1,272.00	9,285,600
菱洋エレクトロ	7,600	1,730.00	13,148,000
東京産業	8,000	619.00	4,952,000
ユアサ商事	7,700	3,570.00	27,489,000
神鋼商事	1,800	2,983.00	5,369,400
小林産業	5,200	342.00	1,778,400
阪和興業	15,200	4,275.00	64,980,000
正栄食品工業	4,500	3,795.00	17,077,500
カナデン	7,800	1,406.00	10,966,800
菱電商事	5,900	1,840.00	10,856,000
フルサト工業	4,500	1,819.00	8,185,500
岩谷産業	18,000	3,820.00	68,760,000
すてきナイスグループ	3,500	1,335.00	4,672,500
昭光通商	28,000	101.00	2,828,000
ニチモウ	1,300	1,681.00	2,185,300
極東貿易	12,000	421.00	5,052,000
イワキ	11,400	434.00	4,947,600
三愛石油	21,900	1,339.00	29,324,100
稲畑産業	19,500	1,532.00	29,874,000
G S Iクレオス	2,200	1,506.00	3,313,200
明和産業	7,400	497.00	3,677,800
ワキタ	17,300	1,143.00	19,773,900
東邦ホールディングス	24,100	2,650.00	63,865,000
サンゲツ	27,100	2,251.00	61,002,100
ミツウロコグループホールディングス	11,700	848.00	9,921,600
シナネンホールディングス	3,600	2,722.00	9,799,200
伊藤忠エネクス	18,000	1,043.00	18,774,000
サンリオ	22,800	2,055.00	46,854,000
サンワテクノス	5,300	1,574.00	8,342,200
リョーサン	10,200	3,840.00	39,168,000
新光商事	8,900	1,754.00	15,610,600
トーホー	3,700	2,597.00	9,608,900
三信電気	7,500	1,900.00	14,250,000
東陽テクニカ	9,400	892.00	8,384,800
モスフードサービス	10,700	3,255.00	34,828,500
加賀電子	7,400	2,561.00	18,951,400
ソーダニッカ	8,300	731.00	6,067,300
立花エレテック	5,500	2,089.00	11,489,500
フォーバル	3,600	884.00	3,182,400
P A L T A C	11,400	6,030.00	68,742,000
三谷産業	9,400	344.00	3,233,600
西本Wismettacホールディングス	2,200	5,720.00	12,584,000

ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	1,502.00	1,051,400
ヤマタネ	4,100	2,288.00	9,380,800
丸紅建材リース	8,000	242.00	1,936,000
日鉄住金物産	6,400	5,500.00	35,200,000
泉州電業	2,700	3,330.00	8,991,000
トラスコ中山	16,900	2,789.00	47,134,100
オートバックスセブン	32,300	1,955.00	63,146,500
モリト	6,400	1,009.00	6,457,600
加藤産業	12,700	3,780.00	48,006,000
イノテック	7,000	1,367.00	9,569,000
イエローハット	7,700	3,190.00	24,563,000
J Kホールディングス	8,200	879.00	7,207,800
日伝	6,800	2,096.00	14,252,800
北沢産業	6,400	260.00	1,664,000
杉本商事	4,400	1,890.00	8,316,000
因幡電機産業	10,800	4,550.00	49,140,000
バイテックホールディングス	3,700	2,243.00	8,299,100
東テク	2,700	2,638.00	7,122,600
ミスミグループ本社	94,500	3,165.00	299,092,500
アルテック	6,600	308.00	2,032,800
タキヒヨー	2,700	2,407.00	6,498,900
蔵王産業	1,300	1,672.00	2,173,600
スズケン	37,100	4,690.00	173,999,000
ジェコス	5,600	1,078.00	6,036,800
ルネサスイーストン	7,400	568.00	4,203,200
ローソン	20,600	6,960.00	143,376,000
サンエー	6,200	5,470.00	33,914,000
カワチ薬品	6,300	2,264.00	14,263,200
エービーシー・マート	14,800	6,220.00	92,056,000
ハードオフコーポレーション	3,600	968.00	3,484,800
アスクル	7,100	3,435.00	24,388,500
ゲオホールディングス	14,900	1,465.00	21,828,500
アダストリア	12,600	1,442.00	18,169,200
ジーフット	4,900	770.00	3,773,000
くらコーポレーション	4,800	7,170.00	34,416,000
キャンドウ	3,900	1,771.00	6,906,900
パルグループホールディングス	4,200	2,723.00	11,436,600
エディオン	31,700	1,084.00	34,362,800
サーラコーポレーション	14,000	696.00	9,744,000
ワッツ	3,200	1,120.00	3,584,000
ハローズ	3,100	2,640.00	8,184,000
あみやき亭	1,800	4,665.00	8,397,000

ひらまつ	11,200	506.00	5,667,200
大黒天物産	2,000	5,110.00	10,220,000
ハニーズホールディングス	7,900	962.00	7,599,800
ファーマライズホールディングス	2,000	670.00	1,340,000
アルペン	6,300	2,417.00	15,227,100
ハブ	2,100	1,150.00	2,415,000
クオール	9,000	2,086.00	18,774,000
ジーンズ	5,500	6,600.00	36,300,000
ビックカメラ	43,300	1,666.00	72,137,800
D C Mホールディングス	43,900	1,060.00	46,534,000
MonotaRO	28,900	5,060.00	146,234,000
東京一番フーズ	2,100	680.00	1,428,000
DDホールディングス	1,800	2,749.00	4,948,200
きちり	2,300	1,021.00	2,348,300
アークランドサービスホールディングス	6,800	2,499.00	16,993,200
J.フロント リテイリング	97,100	1,695.00	164,584,500
ドトール・日レスホールディングス	14,300	2,158.00	30,859,400
マツモトキヨシホールディングス	33,600	5,040.00	169,344,000
ブロンコピリー	4,300	4,725.00	20,317,500
スタートトゥデイ	79,900	4,400.00	351,560,000
トレジャー・ファクトリー	2,500	724.00	1,810,000
物語コーポレーション	2,300	10,930.00	25,139,000
ココカラファイン	8,500	6,870.00	58,395,000
三越伊勢丹ホールディングス	152,100	1,368.00	208,072,800
Hamee	2,300	1,522.00	3,500,600
ウエルシアホールディングス	21,500	5,810.00	124,915,000
クリエイティブSDホールディングス	12,000	3,205.00	38,460,000
丸善C H Iホールディングス	9,400	382.00	3,590,800
ティーライフ	1,200	1,367.00	1,640,400
エー・ピーカンパニー	1,700	696.00	1,183,200
チムニー	2,500	2,910.00	7,275,000
シュッピン	5,000	1,620.00	8,100,000
ネクステージ	8,700	1,309.00	11,388,300
ジョイフル本田	23,900	1,704.00	40,725,600
鳥貴族	2,900	2,549.00	7,392,100
キリン堂ホールディングス	2,900	2,682.00	7,777,800
ホットランド	4,800	1,391.00	6,676,800
すかいらーく	50,600	1,663.00	84,147,800
綿半ホールディングス	3,100	3,260.00	10,106,000
ヨシックス	1,300	3,305.00	4,296,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,100	1,423.00	38,563,300
ブックオフコーポレーション	4,600	785.00	3,611,000

ゴルフダイジェスト・オンライン	3,300	1,099.00	3,626,700
B E E N O S	2,000	1,647.00	3,294,000
あさひ	6,100	1,430.00	8,723,000
日本調剤	2,900	2,854.00	8,276,600
コスモス薬品	4,100	22,440.00	92,004,000
トーエル	3,900	927.00	3,615,300
一六堂	2,000	409.00	818,000
オンリー	1,500	921.00	1,381,500
セブン&アイ・ホールディングス	340,800	4,780.00	1,629,024,000
薬王堂	3,600	3,705.00	13,338,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	21,900	1,655.00	36,244,500
ツルハホールディングス	17,600	14,190.00	249,744,000
サンマルクホールディングス	5,900	2,768.00	16,331,200
フェリシモ	2,100	1,374.00	2,885,400
トリドールホールディングス	10,100	2,678.00	27,047,800
T O K Y O B A S E	7,300	900.00	6,570,000
ウイルプラスホールディングス	900	1,162.00	1,045,800
サツドラホールディングス	1,400	2,186.00	3,060,400
ダイユー・リックホールディングス	3,800	1,131.00	4,297,800
パロックジャパンリミテッド	6,600	968.00	6,388,800
クスリのアオキホールディングス	6,500	7,520.00	48,880,000
力の源ホールディングス	1,900	1,447.00	2,749,300
スシローグローバルホールディングス	8,900	6,510.00	57,939,000
L I X I L ビバ	10,400	1,717.00	17,856,800
メディカルシステムネットワーク	9,500	487.00	4,626,500
総合メディカル	7,100	2,308.00	16,386,800
はるやまホールディングス	3,800	1,023.00	3,887,400
ノジマ	14,400	2,524.00	36,345,600
カップ・クリエイト	10,100	1,453.00	14,675,300
ライトオン	6,900	1,019.00	7,031,100
良品計画	10,800	39,000.00	421,200,000
三城ホールディングス	10,200	493.00	5,028,600
アドヴァン	8,300	952.00	7,901,600
アルビス	2,600	3,225.00	8,385,000
コナカ	10,400	509.00	5,293,600
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,753.00	1,928,300
G - 7ホールディングス	2,400	3,000.00	7,200,000
イオン北海道	8,300	802.00	6,656,600
コジマ	13,700	538.00	7,370,600
ヒマラヤ	2,600	1,161.00	3,018,600
コーナン商事	11,600	2,619.00	30,380,400
エコス	3,300	1,669.00	5,507,700

ワタミ	9,700	1,456.00	14,123,200
マルシェ	2,200	815.00	1,793,000
ドンキホーテホールディングス	52,700	5,360.00	282,472,000
西松屋チェーン	17,900	1,296.00	23,198,400
ゼンショーホールディングス	42,200	2,810.00	118,582,000
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,715.00	8,575,000
ハークスレイ	2,000	1,100.00	2,200,000
サイゼリヤ	13,400	2,517.00	33,727,800
V Tホールディングス	27,700	559.00	15,484,300
魚力	2,300	1,491.00	3,429,300
ポブラ	2,000	878.00	1,756,000
フジ・コーポレーション	1,500	2,651.00	3,976,500
ユナイテッドアローズ	10,100	4,140.00	41,814,000
ハイデイ日高	10,700	2,695.00	28,836,500
京都きもの友禅	5,200	646.00	3,359,200
コロワイド	27,000	2,961.00	79,947,000
ピーシーデポコーポレーション	12,300	555.00	6,826,500
壱番屋	5,700	4,995.00	28,471,500
トップカルチャー	3,100	408.00	1,264,800
P L A N T	1,900	1,306.00	2,481,400
スギホールディングス	17,900	6,640.00	118,856,000
ヴィア・ホールディングス	9,800	720.00	7,056,000
スクロール	12,500	556.00	6,950,000
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,626.00	21,795,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	26,000	12,270.00	319,020,000
木曽路	10,000	2,805.00	28,050,000
S R Sホールディングス	9,700	1,017.00	9,864,900
タカキュー	6,700	215.00	1,440,500
ケーヨー	15,100	562.00	8,486,200
上新電機	9,600	3,550.00	34,080,000
日本瓦斯	15,000	6,310.00	94,650,000
ロイヤルホールディングス	14,500	2,979.00	43,195,500
いなげや	9,100	1,797.00	16,352,700
島忠	18,400	3,475.00	63,940,000
チヨダ	9,600	2,526.00	24,249,600
ライフコーポレーション	6,200	2,735.00	16,957,000
リンガーハット	10,100	2,590.00	26,159,000
M r M a x H D	10,300	687.00	7,076,100
テンアライド	7,400	472.00	3,492,800
A O K Iホールディングス	16,300	1,590.00	25,917,000
オークワ	12,000	1,135.00	13,620,000
コメリ	12,600	2,814.00	35,456,400

青山商事	15,600	3,815.00	59,514,000
しまむら	9,500	11,160.00	106,020,000
はせがわ	4,400	496.00	2,182,400
高島屋	128,000	926.00	118,528,000
松屋	16,400	1,701.00	27,896,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	38,600	1,689.00	65,195,400
近鉄百貨店	3,100	4,040.00	12,524,000
パルコ	7,900	1,259.00	9,946,100
丸井グループ	77,900	2,339.00	182,208,100
アクシアル リテイリング	6,800	4,115.00	27,982,000
イオン	312,900	2,372.50	742,355,250
イズミ	14,700	6,980.00	102,606,000
東武ストア	1,000	3,090.00	3,090,000
平和堂	16,500	2,598.00	42,867,000
フジ	9,800	2,292.00	22,461,600
ヤオコー	9,200	6,070.00	55,844,000
ゼビオホールディングス	11,100	1,752.00	19,447,200
ケーズホールディングス	71,400	1,135.00	81,039,000
Olympicグループ	4,800	939.00	4,507,200
日産東京販売ホールディングス	12,200	357.00	4,355,400
Genky DrugStores	3,300	4,290.00	14,157,000
アインホールディングス	10,900	8,330.00	90,797,000
元気寿司	2,100	3,460.00	7,266,000
ヤマダ電機	272,700	537.00	146,439,900
アークランドサカモト	13,800	1,618.00	22,328,400
ニトリホールディングス	32,300	18,305.00	591,251,500
グルメ杵屋	6,000	1,270.00	7,620,000
愛眼	6,400	435.00	2,784,000
ケーユーホールディングス	4,200	953.00	4,002,600
吉野家ホールディングス	26,800	2,195.00	58,826,000
松屋フーズ	3,900	3,725.00	14,527,500
サガミチェーン	10,900	1,403.00	15,292,700
関西スーパーマーケット	6,200	1,214.00	7,526,800
王将フードサービス	6,000	6,290.00	37,740,000
プレナス	9,200	1,821.00	16,753,200
ミニストップ	6,100	2,219.00	13,535,900
アークス	15,300	2,928.00	44,798,400
バローホールディングス	18,900	2,451.00	46,323,900
藤久	700	1,497.00	1,047,900
ベルク	3,600	5,850.00	21,060,000
大庄	4,400	1,766.00	7,770,400
ファーストリテイリング	10,900	51,640.00	562,876,000

サンドラッグ	34,500	4,500.00	155,250,000
サクスパー ホールディングス	7,700	985.00	7,584,500
ヤマザワ	1,700	1,865.00	3,170,500
やまや	1,700	3,270.00	5,559,000
ペルーナ	20,000	1,383.00	27,660,000
島根銀行	1,700	1,247.00	2,119,900
じもとホールディングス	54,600	164.00	8,954,400
めぶきフィナンシャルグループ	423,100	363.00	153,585,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	11,000	2,498.00	27,478,000
九州フィナンシャルグループ	133,600	522.00	69,739,200
ゆうちょ銀行	230,700	1,275.00	294,142,500
富山第一銀行	20,500	472.00	9,676,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	486,200	568.00	276,161,600
西日本フィナンシャルホールディングス	52,800	1,211.00	63,940,800
関西みらいフィナンシャルグループ	35,600	791.00	28,159,600
三十三フィナンシャルグループ	6,900	2,011.00	13,875,900
新生銀行	70,500	1,697.00	119,638,500
あおぞら銀行	48,500	4,300.00	208,550,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,700,700	625.00	3,562,937,500
りそなホールディングス	893,600	586.40	524,007,040
三井住友トラスト・ホールディングス	160,100	4,375.00	700,437,500
三井住友フィナンシャルグループ	616,300	4,273.00	2,633,449,900
第四銀行	10,000	4,390.00	43,900,000
北越銀行	8,200	2,198.00	18,023,600
千葉銀行	288,400	779.00	224,663,600
群馬銀行	165,400	586.00	96,924,400
武蔵野銀行	13,000	3,300.00	42,900,000
千葉興業銀行	22,300	470.00	10,481,000
筑波銀行	33,900	262.00	8,881,800
七十七銀行	25,500	2,392.00	60,996,000
青森銀行	6,300	3,215.00	20,254,500
秋田銀行	5,200	2,993.00	15,563,600
山形銀行	9,200	2,349.00	21,610,800
岩手銀行	5,700	4,205.00	23,968,500
東邦銀行	72,800	401.00	29,192,800
東北銀行	4,100	1,353.00	5,547,300
みちのく銀行	5,200	1,756.00	9,131,200
ふくおかフィナンシャルグループ	331,000	546.00	180,726,000
静岡銀行	215,000	1,011.00	217,365,000
十六銀行	10,900	2,895.00	31,555,500
スルガ銀行	83,300	959.00	79,884,700
八十二銀行	147,400	478.00	70,457,200

山梨中央銀行	50,000	418.00	20,900,000
大垣共立銀行	12,900	2,802.00	36,145,800
福井銀行	7,000	2,348.00	16,436,000
北國銀行	9,200	4,440.00	40,848,000
清水銀行	3,300	2,139.00	7,058,700
富山銀行	1,600	4,275.00	6,840,000
滋賀銀行	77,000	562.00	43,274,000
南都銀行	9,500	2,850.00	27,075,000
百五銀行	78,200	440.00	34,408,000
京都銀行	31,100	5,110.00	158,921,000
紀陽銀行	30,600	1,797.00	54,988,200
ほくほくフィナンシャルグループ	54,200	1,484.00	80,432,800
広島銀行	120,200	740.00	88,948,000
山陰合同銀行	48,300	985.00	47,575,500
中国銀行	56,300	1,145.00	64,463,500
鳥取銀行	2,600	1,695.00	4,407,000
伊予銀行	116,200	737.00	85,639,400
百十四銀行	87,000	358.00	31,146,000
四国銀行	12,500	1,331.00	16,637,500
阿波銀行	65,000	682.00	44,330,000
大分銀行	4,700	3,755.00	17,648,500
宮崎銀行	5,400	3,335.00	18,009,000
佐賀銀行	4,900	2,430.00	11,907,000
十八銀行	50,000	283.00	14,150,000
沖縄銀行	7,900	4,025.00	31,797,500
琉球銀行	15,800	1,643.00	25,959,400
セブン銀行	305,400	339.00	103,530,600
みずほフィナンシャルグループ	11,063,600	186.10	2,058,935,960
高知銀行	2,900	1,184.00	3,433,600
山口フィナンシャルグループ	102,000	1,255.00	128,010,000
長野銀行	2,700	1,827.00	4,932,900
名古屋銀行	6,600	3,860.00	25,476,000
北洋銀行	122,700	360.00	44,172,000
愛知銀行	2,700	4,790.00	12,933,000
中京銀行	3,300	2,256.00	7,444,800
大光銀行	2,800	2,162.00	6,053,600
愛媛銀行	11,400	1,247.00	14,215,800
トマト銀行	3,100	1,508.00	4,674,800
京葉銀行	72,000	467.00	33,624,000
栃木銀行	42,000	382.00	16,044,000
北日本銀行	2,500	2,592.00	6,480,000
東和銀行	14,200	1,111.00	15,776,200

福島銀行	7,300	689.00	5,029,700
大東銀行	3,900	1,206.00	4,703,400
トモニホールディングス	67,100	457.00	30,664,700
フィデアホールディングス	78,700	169.00	13,300,300
池田泉州ホールディングス	86,100	372.00	32,029,200
F P G	27,200	1,467.00	39,902,400
マーキュリアインベストメント	2,300	1,041.00	2,394,300
S B Iホールディングス	92,100	2,965.00	273,076,500
ジャフコ	11,700	4,585.00	53,644,500
大和証券グループ本社	697,200	634.40	442,303,680
野村ホールディングス	1,401,200	540.20	756,928,240
岡三証券グループ	70,000	532.00	37,240,000
丸三証券	26,100	1,017.00	26,543,700
東洋証券	30,000	256.00	7,680,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	90,400	715.00	64,636,000
光世証券	2,100	1,289.00	2,706,900
水戸証券	24,200	397.00	9,607,400
いちよし証券	17,100	1,207.00	20,639,700
松井証券	39,900	1,047.00	41,775,300
だいこう証券ビジネス	4,200	600.00	2,520,000
マネックスグループ	83,200	643.00	53,497,600
カブドットコム証券	52,500	360.00	18,900,000
極東証券	11,000	1,426.00	15,686,000
岩井コスモホールディングス	8,400	1,427.00	11,986,800
藍澤証券	15,400	778.00	11,981,200
マネーパートナーズグループ	10,800	397.00	4,287,600
かんぽ生命保険	30,800	2,325.00	71,610,000
S O M P Oホールディングス	159,700	4,548.00	726,315,600
アニコム ホールディングス	5,600	4,305.00	24,108,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	212,900	3,415.00	727,053,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	66,900	2,144.00	143,433,600
第一生命ホールディングス	460,600	1,966.00	905,539,600
東京海上ホールディングス	306,800	5,313.00	1,630,028,400
アドバンテッジリスクマネジメント	2,600	1,234.00	3,208,400
T & Dホールディングス	251,800	1,676.00	422,016,800
アドバンスクリエイト	1,900	2,245.00	4,265,500
全国保証	22,900	5,100.00	116,790,000
ジェイリース	1,500	765.00	1,147,500
イントラスト	1,600	759.00	1,214,400
アルヒ	9,200	2,259.00	20,782,800
クレディセゾン	61,800	1,703.00	105,245,400
アクリーティブ	4,200	280.00	1,176,000

芙蓉総合リース	9,300	7,480.00	69,564,000
興銀リース	15,300	2,834.00	43,360,200
東京センチュリー	16,400	6,280.00	102,992,000
日本証券金融	33,300	605.00	20,146,500
アイフル	136,600	344.00	46,990,400
リコーリース	6,400	3,625.00	23,200,000
イオンフィナンシャルサービス	57,800	2,333.00	134,847,400
アコム	163,700	427.00	69,899,900
ジャックス	9,900	2,360.00	23,364,000
オリエントコーポレーション	176,200	149.00	26,253,800
日立キャピタル	22,400	2,862.00	64,108,800
アプラスフィナンシャル	38,500	111.00	4,273,500
オリックス	543,200	1,774.50	963,908,400
三菱UFJリース	206,700	674.00	139,315,800
九州リースサービス	3,500	770.00	2,695,000
日本取引所グループ	233,700	2,086.00	487,498,200
イー・ギャランティ	4,300	2,081.00	8,948,300
アサックス	1,100	1,945.00	2,139,500
NECキャピタルソリューション	3,300	1,931.00	6,372,300
いちご	116,500	523.00	60,929,500
日本駐車場開発	98,400	187.00	18,400,800
ヒューリック	170,000	1,180.00	200,600,000
三栄建築設計	3,300	1,853.00	6,114,900
スター・マイカ	4,000	2,452.00	9,808,000
野村不動産ホールディングス	54,200	2,466.00	133,657,200
三重交通グループホールディングス	16,400	514.00	8,429,600
サムティ	7,000	2,089.00	14,623,000
ディア・ライフ	9,100	508.00	4,622,800
コーセーアールイー	1,800	821.00	1,477,800
エー・ディー・ワークス	107,300	40.00	4,292,000
日本商業開発	4,600	1,821.00	8,376,600
プレサンスコーポレーション	11,200	1,770.00	19,824,000
ユニゾホールディングス	11,200	2,069.00	23,172,800
THEグローバル社	3,900	852.00	3,322,800
日本管理センター	5,400	1,294.00	6,987,600
サンセイランディック	2,400	1,164.00	2,793,600
エストラスト	1,100	917.00	1,008,700
フージャースホールディングス	19,700	778.00	15,326,600
オープンハウス	13,300	6,370.00	84,721,000
東急不動産ホールディングス	197,200	778.00	153,421,600
飯田グループホールディングス	67,900	2,117.00	143,744,300
イーランド	1,300	1,187.00	1,543,100

ムゲンエステート	5,000	1,088.00	5,440,000
ビーロット	1,300	1,584.00	2,059,200
ファーストブラザーズ	2,200	1,401.00	3,082,200
ハウストゥ	1,500	5,080.00	7,620,000
シーアールイー	1,300	2,113.00	2,746,900
ケイアイスター不動産	2,900	2,560.00	7,424,000
グッドコムアセット	1,000	1,790.00	1,790,000
パーク24	47,500	2,982.00	141,645,000
パラカ	2,500	2,601.00	6,502,500
三井不動産	406,600	2,682.00	1,090,501,200
三菱地所	606,100	1,957.00	1,186,137,700
平和不動産	14,400	2,130.00	30,672,000
東京建物	89,000	1,538.00	136,882,000
ダイビル	20,900	1,136.00	23,742,400
京阪神ビルディング	13,400	924.00	12,381,600
住友不動産	195,000	4,154.00	810,030,000
大京	13,000	2,475.00	32,175,000
テーオーシー	28,100	817.00	22,957,700
東京楽天地	1,300	5,760.00	7,488,000
レオパレス21	97,200	613.00	59,583,600
スターツコーポレーション	11,100	2,650.00	29,415,000
フジ住宅	10,400	964.00	10,025,600
空港施設	8,100	612.00	4,957,200
明和地所	4,500	658.00	2,961,000
ゴールドクレスト	6,400	1,767.00	11,308,800
日本エスリード	3,200	1,897.00	6,070,400
日神不動産	10,900	692.00	7,542,800
日本エスコン	14,700	643.00	9,452,100
タカラレーベン	38,100	402.00	15,316,200
サンヨーハウジング名古屋	4,600	1,194.00	5,492,400
イオンモール	52,500	1,996.00	104,790,000
ファースト住建	3,100	1,439.00	4,460,900
カチタス	11,100	4,435.00	49,228,500
トーセイ	10,000	1,218.00	12,180,000
穴吹興産	900	3,325.00	2,992,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	50,700	1,194.00	60,535,800
サンフロンティア不動産	9,900	1,283.00	12,701,700
エフ・ジェー・ネクスト	6,200	1,050.00	6,510,000
インテリックス	2,300	963.00	2,214,900
ランドビジネス	4,600	332.00	1,527,200
グランディハウス	7,100	497.00	3,528,700
日本空港ビルデング	23,800	5,540.00	131,852,000

日本工営	5,300	2,887.00	15,301,100
L I F U L L	27,500	712.00	19,580,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,400	2,344.00	15,001,600
日本M&Aセンター	54,600	3,390.00	185,094,000
メンバーズ	2,700	1,409.00	3,804,300
中広	900	800.00	720,000
タケエイ	8,300	1,212.00	10,059,600
トラスト・テック	3,800	4,125.00	15,675,000
コシダカホールディングス	21,200	1,652.00	35,022,400
パソナグループ	7,500	1,744.00	13,080,000
C D S	2,200	1,327.00	2,919,400
リンクアンドモチベーション	14,600	1,372.00	20,031,200
G C A	9,100	883.00	8,035,300
エス・エム・エス	15,600	4,200.00	65,520,000
パーソルホールディングス	72,800	2,502.00	182,145,600
リニカル	5,100	2,365.00	12,061,500
クックパッド	24,800	528.00	13,094,400
エスクリ	2,800	795.00	2,226,000
アイ・ケイ・ケイ	4,700	828.00	3,891,600
学情	3,600	1,672.00	6,019,200
スタジオアリス	4,000	2,624.00	10,496,000
シミックホールディングス	4,400	2,206.00	9,706,400
N J S	2,000	1,748.00	3,496,000
総合警備保障	31,400	5,250.00	164,850,000
カカクコム	59,400	2,492.00	148,024,800
アイロムグループ	2,700	2,040.00	5,508,000
セントケア・ホールディング	3,500	713.00	2,495,500
サイネックス	1,200	833.00	999,600
ルネサンス	3,900	2,521.00	9,831,900
ディップ	11,200	2,791.00	31,259,200
オプトホールディング	5,500	2,389.00	13,139,500
ツクイ	18,600	952.00	17,707,200
キャリアデザインセンター	2,000	1,971.00	3,942,000
エムスリー	83,000	4,515.00	374,745,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,400	638.00	4,083,200
プラス	700	836.00	585,200
アウトソーシング	23,600	2,037.00	48,073,200
ウェルネット	8,000	1,202.00	9,616,000
ワールドホールディングス	2,600	3,400.00	8,840,000
ディー・エヌ・エー	42,600	2,067.00	88,054,200
博報堂D Yホールディングス	109,700	1,808.00	198,337,600
ぐるなび	12,600	894.00	11,264,400

エスアールジータカミヤ	9,500	718.00	6,821,000
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	923.00	8,583,900
ファンコミュニケーションズ	22,100	716.00	15,823,600
ライク	3,100	1,810.00	5,611,000
ビジネス・ブレイクスルー	3,700	439.00	1,624,300
WDBホールディングス	3,600	3,180.00	11,448,000
ティア	4,100	1,057.00	4,333,700
CDG	800	1,688.00	1,350,400
バリューコマース	7,100	1,466.00	10,408,600
インフォマート	40,000	1,467.00	58,680,000
J Pホールディングス	24,800	375.00	9,300,000
エコナックホールディングス	15,900	127.00	2,019,300
E P Sホールディングス	11,900	2,398.00	28,536,200
レグス	2,000	1,061.00	2,122,000
プレステージ・インターナショナル	16,400	1,494.00	24,501,600
アミューズ	5,300	3,080.00	16,324,000
ドリームインキュベータ	2,700	2,170.00	5,859,000
クイック	5,000	1,725.00	8,625,000
T A C	4,800	329.00	1,579,200
ケネディクス	104,600	665.00	69,559,000
電通	96,100	5,290.00	508,369,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,742.00	6,445,400
ぴあ	2,600	6,420.00	16,692,000
イオンファンタジー	2,500	6,380.00	15,950,000
シーティーエス	7,800	1,176.00	9,172,800
ネクシィーズグループ	3,000	1,676.00	5,028,000
みらかホールディングス	23,500	3,195.00	75,082,500
アルプス技研	7,000	2,427.00	16,989,000
ダイオーズ	1,600	1,326.00	2,121,600
日本空調サービス	8,400	812.00	6,820,800
オリエンタルランド	93,200	11,725.00	1,092,770,000
ダスキン	21,300	2,703.00	57,573,900
明光ネットワークジャパン	10,100	1,206.00	12,180,600
ファルコホールディングス	4,100	1,902.00	7,798,200
ラウンドワン	24,500	1,718.00	42,091,000
リゾートトラスト	33,400	1,974.00	65,931,600
ビー・エム・エル	10,200	2,817.00	28,733,400
ワタベウェディング	1,400	502.00	702,800
りらいあコミュニケーションズ	12,500	1,611.00	20,137,500
リソー教育	13,400	801.00	10,733,400
早稲田アカデミー	1,200	2,416.00	2,899,200
ユー・エス・エス	96,400	2,106.00	203,018,400

東京個別指導学院	2,800	914.00	2,559,200
サイバーエージェント	48,600	6,570.00	319,302,000
楽天	404,600	708.40	286,618,640
クリーク・アンド・リバー社	4,000	1,107.00	4,428,000
テー・オー・ダブリュー	7,500	841.00	6,307,500
セントラルスポーツ	3,000	4,105.00	12,315,000
フルキャストホールディングス	6,900	2,741.00	18,912,900
リソルホールディングス	900	4,350.00	3,915,000
テクノプロ・ホールディングス	14,900	6,840.00	101,916,000
アトラ	1,400	670.00	938,000
インターワークス	1,800	1,000.00	1,800,000
Keeper 技研	2,600	1,320.00	3,432,000
ファーストロジック	1,600	678.00	1,084,800
三機サービス	1,200	1,919.00	2,302,800
Gunosy	4,800	1,385.00	6,648,000
デザインワン・ジャパン	1,600	1,252.00	2,003,200
イー・ガーディアン	3,900	3,100.00	12,090,000
リブセンス	5,000	565.00	2,825,000
ジャパンマテリアル	21,600	1,753.00	37,864,800
ベクトル	9,600	2,321.00	22,281,600
ウチヤマホールディングス	3,900	542.00	2,113,800
ライクキッズネクスト	1,400	1,380.00	1,932,000
キャリアリンク	2,600	543.00	1,411,800
I B J	6,400	655.00	4,192,000
アサンテ	2,900	2,069.00	6,000,100
N・フィールド	4,500	1,692.00	7,614,000
バリューHR	1,800	2,053.00	3,695,400
M&Aキャピタルパートナーズ	2,000	10,100.00	20,200,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,300	1,827.00	6,029,100
E R Iホールディングス	2,200	1,065.00	2,343,000
アビスト	1,200	4,790.00	5,748,000
シグマクシス	4,300	1,284.00	5,521,200
ウィルグループ	3,500	1,042.00	3,647,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,900	436.00	4,752,400
日本ビューホテル	2,600	1,388.00	3,608,800
リクルートホールディングス	608,600	3,146.00	1,914,655,600
エラン	2,000	2,631.00	5,262,000
土木管理総合試験所	2,700	584.00	1,576,800
日本郵政	447,700	1,202.00	538,135,400
ベルシステム24ホールディングス	13,300	1,842.00	24,498,600
鎌倉新書	1,500	3,365.00	5,047,500
一蔵	1,100	788.00	866,800

LITALICO	1,800	1,994.00	3,589,200
グローバルグループ	1,000	1,904.00	1,904,000
エボラブルアジア	2,300	2,444.00	5,621,200
ストライク	2,000	4,480.00	8,960,000
ソラスト	4,800	3,885.00	18,648,000
セラク	1,800	890.00	1,602,000
インソース	2,600	2,214.00	5,756,400
キャリアインデックス	1,100	3,145.00	3,459,500
MS - Japan	800	7,460.00	5,968,000
船場	1,600	1,163.00	1,860,800
フルテック	900	1,157.00	1,041,300
グリーンズ	1,800	1,570.00	2,826,000
日総工産	1,300	5,540.00	7,202,000
キュービーネットホールディングス	4,000	2,077.00	8,308,000
リログループ	43,200	2,917.00	126,014,400
東祥	4,900	4,280.00	20,972,000
エイチ・アイ・エス	12,300	3,255.00	40,036,500
ラックランド	1,500	2,683.00	4,024,500
共立メンテナンス	14,100	6,050.00	85,305,000
イチネンホールディングス	8,900	1,410.00	12,549,000
建設技術研究所	5,500	1,492.00	8,206,000
スペース	5,200	1,456.00	7,571,200
長大	3,200	849.00	2,716,800
燦ホールディングス	1,900	2,490.00	4,731,000
スバル興業	600	6,400.00	3,840,000
東京テアトル	3,400	1,433.00	4,872,200
タナベ経営	1,600	2,056.00	3,289,600
ナガワ	1,600	4,715.00	7,544,000
よみうりランド	1,700	4,670.00	7,939,000
東京都競馬	5,900	4,695.00	27,700,500
カナモト	12,100	3,570.00	43,197,000
東京ドーム	32,000	960.00	30,720,000
西尾レントオール	8,000	3,550.00	28,400,000
トランス・コスモス	8,800	2,634.00	23,179,200
乃村工藝社	18,500	2,451.00	45,343,500
藤田観光	3,200	3,435.00	10,992,000
KNT - CTホールディングス	4,900	1,557.00	7,629,300
日本管財	8,500	2,226.00	18,921,000
トーカイ	7,700	2,450.00	18,865,000
白洋舎	900	3,440.00	3,096,000
セコム	83,700	8,355.00	699,313,500
セントラル警備保障	3,800	5,110.00	19,418,000

丹青社	16,200	1,433.00	23,214,600	
メイテック	9,200	5,070.00	46,644,000	
応用地質	8,600	1,448.00	12,452,800	
船井総研ホールディングス	16,400	2,482.00	40,704,800	
進学会ホールディングス	3,800	607.00	2,306,600	
オオバ	6,300	619.00	3,899,700	
いであ	1,600	1,085.00	1,736,000	
学究社	2,900	1,822.00	5,283,800	
ベネッセホールディングス	28,900	3,995.00	115,455,500	
イオンディライト	9,700	3,810.00	36,957,000	
ナック	5,400	944.00	5,097,600	
ニチイ学館	15,100	1,294.00	19,539,400	
ダイセキ	13,300	3,180.00	42,294,000	
ステップ	2,900	1,693.00	4,909,700	
合 計	99,633,800		203,990,078,740	

(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

注記事項(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13期中間計算期間(2018年6月26日から2018年12月25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。

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2018年 6月25日現在）	第13期中間計算期間 （2018年12月25日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	390,446
コール・ローン	1,442,208	1,448,067
親投資信託受益証券	600,182,639	736,331,562
未収入金	19,187	26,832
流動資産合計	601,644,034	738,196,907
資産合計	601,644,034	738,196,907
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	213,826	275,930
未払委託者報酬	916,348	1,182,504
未払利息	3	4
その他未払費用	28,109	19,650
流動負債合計	1,158,286	1,478,088
負債合計	1,158,286	1,478,088
純資産の部		
元本等		
元本	516,120,633	766,926,285
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	84,365,115	30,207,466
（分配準備積立金）	105,618,481	99,456,563
元本等合計	600,485,748	736,718,819
純資産合計	600,485,748	736,718,819
負債純資産合計	601,644,034	738,196,907

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2017年 6月27日 至 2017年12月26日	第13期中間計算期間 自 2018年 6月26日 至 2018年12月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	64,838,775	141,441,008
営業収益合計	64,838,775	141,441,008
営業費用		
支払利息	152	402
受託者報酬	181,412	275,930
委託者報酬	777,431	1,182,504
その他費用	12,897	19,664
営業費用合計	971,892	1,478,500
営業利益又は営業損失（ ）	63,866,883	142,919,508
経常利益又は経常損失（ ）	63,866,883	142,919,508
中間純利益又は中間純損失（ ）	63,866,883	142,919,508
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（ ）	4,243,661	151,914
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	29,535,053	84,365,115
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,203,521	34,382,133
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,203,521	34,382,133
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,903,609	5,883,292
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,903,609	5,883,292
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	96,458,187	30,207,466

(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12期 (2018年 6月25日現在)	第13期中間計算期間 (2018年12月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	516,120,633口	766,926,285口
2. 「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)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 - 円	元本の欠損 30,207,466円
3. 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 1.1635円 (1万口当たり純資産額) (11,635円)	1口当たり純資産額 0.9606円 (1万口当たり純資産額) (9,606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13期中間計算期間 (2018年12月25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

	第13期中間計算期間 (2018年12月25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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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>

（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12期 自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25日	第13期中間計算期間 自 2018年 6月26日 至 2018年12月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	443,492,115円	516,120,633円
期中追加設定元本額	205,570,147円	287,539,546円
期中一部解約元本額	132,941,629円	36,733,894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

	2018年12月25日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,140,704,796
コール・ローン	4,230,583,517
株式	215,861,612,460
未収入金	1,339,000
未収配当金	21,362,590
前払金	308,796,000
流動資産合計	221,564,398,363
資産合計	221,564,398,363
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	308,808,960
未払金	5,661,271,068
未払解約金	115,355,582
未払利息	11,859
その他未払費用	16,428
流動負債合計	6,085,463,897
負債合計	6,085,463,897
純資産の部	
元本等	
元本	167,716,687,546
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,762,246,920
元本等合計	215,478,934,466
純資産合計	215,478,934,466
負債純資産合計	221,564,398,363

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月25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。

	2018年12月25日現在
	(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）

	2018年12月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	167,716,687,546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 1.2848円 (1万口当たり純資産額) (12,848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

	2018年12月25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	2018年12月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月26日
期首元本額	133,374,481,612円
期中追加設定元本額	41,955,215,456円
期中一部解約元本額	7,613,009,522円
期末元本額	167,716,687,546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）	644,890,698円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,652,226,308円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,343,313円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,006,320,674円
世界経済インデックスファンド	1,764,421,330円
日本株式インデックス・オープン	5,713,969,800円
DCマイセレクション25	5,895,038,545円
DCマイセレクション50	18,115,636,763円
DCマイセレクション75	17,144,869,063円
DC日本株式インデックス・オープン	5,450,960,407円
DCマイセレクションS25	2,358,825,957円
DCマイセレクションS50	7,242,134,254円
DCマイセレクションS75	4,948,981,059円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,943,553,202円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	354,009,133円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	569,853,330円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	373,788,241円
DC世界経済インデックスファンド	1,373,064,100円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	573,109,871円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	23,263,031円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	47,238,346円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	42,572,583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）	333,302,239円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,630,550円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	113,015,142円

区分	2018年12月25日現在
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	421,370,993円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	68,664,392円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	616,932,741円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,789,145,573円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	719,279,827円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,549,453,718円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	658,460,002円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	50,009,114円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	809,696,446円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	193,907,468円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	452,455,084円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	590,110,432円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	59,218,672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)	922,715,415円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,200,692,196円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,250,411,514円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	919,432,566円
分散投資コア戦略ファンドS	1,929,253,756円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	192,747,852円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	192,934,307円
コア投資戦略ファンド(切替型)	571,766,575円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,697,030円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	8,482,373円
SMT インデックスバランス・オープン	65,939,773円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	704,216,160円
SMT 世界経済インデックス・オープン	7,421,916円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	49,346,024円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,903,260円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,271,105円
グローバル経済コア	306,325,114円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	7,135,914円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	37,460,351円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	577,422円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	24,868,646円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	9,311,253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)	46,878,319,340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)	682,236,077円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

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	2,879,276,000	-	2,570,480,000	308,796,000
	合計	2,879,276,000	-	2,570,480,000	308,796,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

【純資産額計算書】

(2019年 1月31日現在)

資産総額	1,615,120,402円
負債総額	4,966,511円
純資産総額（ - ）	1,610,153,891円
発行済口数	1,511,605,200口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0652円
（1万口当たり純資産額）	（10,652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

(2019年 1月31日現在)

資産総額	272,638,679,723円
負債総額	3,547,596,195円
純資産総額（ - ）	269,091,083,528円
発行済口数	188,793,426,909口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4253円
（1万口当たり純資産額）	（14,253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（2019年 1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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。

[D0（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 - D0 - 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2019年 3月25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。

2019年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	11,462,075
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	81	335,324
単位型公社債投資信託	0	0
合計	613	11,797,399

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭

和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千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32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,260,630	23,973,152
前払費用	143,622	157,614
未収委託者報酬	5,252,944	5,373,307
繰延税金資産	61,677	94,211
その他	5,474	9,842
流動資産合計	25,724,348	29,608,128
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 47,993	1 36,782
器具備品	1 73,765	1 79,655
その他	1 2,830	1 1,912
有形固定資産合計	124,589	118,350
無形固定資産		
ソフトウェア	221,499	210,679
その他	6,656	4,377
無形固定資産合計	228,156	215,056
投資その他の資産		
投資有価証券	71,153	42,802
長期前払費用	9,828	7,810
長期貸付金	19,838	17,088
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	137,359	154,422
その他	145	70
貸倒引当金	19,838	17,088
投資その他の資産合計	243,485	230,105
固定資産合計	596,231	563,512
資産合計	26,320,580	30,171,641

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）	当事業年度 （平成30年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
固定負債		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	71,500	74,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,134	182
評価・換算差額等合計	1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

（２）【損益計算書】

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178
広告宣伝費	95,688	175,296
公告費	3,094	-
調査費	6,239,223	6,008,380
調査費	360,520	396,842
委託調査費	5,876,937	5,609,496
図書費	1,766	2,041
営業雑経費	1,460,885	1,474,361
通信費	24,920	33,158
印刷費	370,785	368,414
協会費	30,665	36,616
諸会費	105	105
情報機器関連費	943,725	942,093
その他営業雑経費	90,684	93,973
営業費用合計	20,679,217	20,202,216
一般管理費		
給料	1,874,710	2,006,157
役員報酬	89,520	84,130
給料・手当	1,526,244	1,649,268
賞与	258,946	272,758
退職給付費用	76,106	84,944
福利費	221,018	239,702
交際費	5,612	5,831
旅費交通費	61,961	73,807
租税公課	106,691	102,158
不動産賃借料	113,697	124,629
減価償却費	134,710	119,300
業務委託費	1 486,690	1 484,841
諸経費	223,685	246,326
一般管理費合計	3,304,885	3,487,699
営業利益	6,261,346	5,516,262

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136

収益分配金		129		116
投資有価証券売却益		307		499
貸倒引当金戻入		3,000		2,750
その他		1,591		4,351
営業外収益合計		9,697		9,854
営業外費用				
長期前払費用償却	1	4,644	1	-
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		-		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		-		51,569
特別損失合計		-		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

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．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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。

3．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当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職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。

4．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。

未適用の会計基準等

- ・「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 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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 (平成29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
建 物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
そ の 他	1,759	"	2,677	"
計	362,567	"	392,342	"

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	"	-	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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(千円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30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(千円)	配当金 の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株 式	30,000	利益剰余金	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30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

平成30年6月29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(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成30年3月31日	平成30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、資金運用については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、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きわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

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

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、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、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

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、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）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。

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（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	20,260,630	20,260,630	-
（2）未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
（4）未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
（5）未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（*）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。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
（2）未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
（4）未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
（5）未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-

（*）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。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

これらは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）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。

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

これらは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。

（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：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

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、「(3)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（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499
----------------	---	--------	--------	-------

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	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	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

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	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

当事業年度（平成30年3月31日現在）

（単位：千円）

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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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。

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（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. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
(1) 退職給付債務	437,197	496,696
(2) 退職給付引当金	437,197	496,696

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
(1) 退職給付費用	76,106	84,944

（注）1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

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 （平成29年3月31日）		当事業年度 （平成30年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	"	5,232	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	"	32,511	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	"	152,088	"
その他	6,972	"	23,674	"
繰延税金資産 合計	205,870	"	255,547	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
その他	-	"	80	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,913	"
繰延税金資産の純額	199,037	"	248,633	"

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。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（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 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

（注）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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）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）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性がないため、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
該当事項はありません。

(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 平成28年4月1日 至 平成29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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(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

投信販売代行手数料

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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

(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

投信販売代行手数料

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。

(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（平成29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（平成30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 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25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 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
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：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806

固定資産

有形固定資産

建物	1	35,878
器具備品	1	94,797
その他有形固定資産	1	1,967
有形固定資産合計		132,642

無形固定資産

476,662

投資その他の資産

投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590
その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284

固定資産合計

920,589

資産合計

32,413,396

負債の部

流動負債

未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	2	107,652
流動負債合計		4,638,109

固定負債

退職給付引当金	530,260
資産除去債務	13,489
その他固定負債	578
固定負債合計	544,327
負債合計	5,182,436

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	75,000
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	24,405,169
利益剰余金合計	26,580,169
株主資本合計	27,230,169
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	789
評価・換算差額等合計	789
純資産合計	27,230,959
負債・純資産合計	32,413,396

中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	1	2,088,498
営業利益		2,433,271
営業外収益	2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774

法人税等合計
中間純利益

730,051

1,668,135

中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
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	300,000	350,000	350,000

	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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
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	500	-	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	607	607	607
当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

重要な会計方針

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

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。）

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. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3. 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当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職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。

4. 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。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しておりましたが、当中間会計期間より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。

なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に及ぼす

影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第33期中間会計期間末
（2018年9月30日）

1	有形固定資産の減価償却累計額	
	建物	66,454千円
	器具備品	342,351千円
	その他有形固定資産	3,136千円
	計	411,942千円
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「その他流動負債」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第33期中間会計期間
（自 2018年4月1日
至 2018年9月30日）

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	19,715千円
	無形固定資産	44,989千円
2	営業外収益の主要項目	
	受取利息	819千円
	貸倒引当金戻入	17,088千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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（千円）	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	30,000	10,000	2018年3月31日	2018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）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

2018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：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	23,034,588	23,034,588	-
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	-
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	-
(4)投資有価証券 其他有価証券	37,331	37,331	-
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	-
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	-

(*)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。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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。

(4)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。

(5)未払金、並びに(6)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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、「（4）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末（2018年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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	21,579	19,493	2,085
小計	21,579	19,493	2,085
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	15,752	16,700	947
小計	15,752	16,700	947
合計	37,331	36,193	1,137

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（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）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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

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

（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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
1株当たり純資産額	9,076,986円44銭
1株当たり中間純利益	556,045円23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おりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
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）

（共通支配下の取引等）

1．取引の概要

(1) 対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

2．実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定であります。

（その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加）

当社は、2018年9月28日開催の臨時株主総会において、その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加について決議しており、2018年10月1日付で実行しております。

1. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的
資本規模の充実を図るため、会社法第450条第1項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。
2. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領
 - (1) 減少すべきその他資本剰余金の額
その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。
 - (2) その他資本剰余金の額の減少方法
減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。
資本金の額は2,000,000千円になります。

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

当社は2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年3月25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（2018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） （2018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 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2018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。

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（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）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みます。）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

平成30年 6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

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

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平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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平成30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すべ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。

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

2018年8月24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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2017年6月27日から2018年6月25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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2018年6月25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すべ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。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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2018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（2018年4月1日から2018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。

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

2019年2月25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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2018年6月26日から2018年12月25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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2018年12月25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（2018年6月26日から2018年12月25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。

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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。