

【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】	2020年9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 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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】

2020年 9月26日から2021年 3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：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

「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、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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 に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

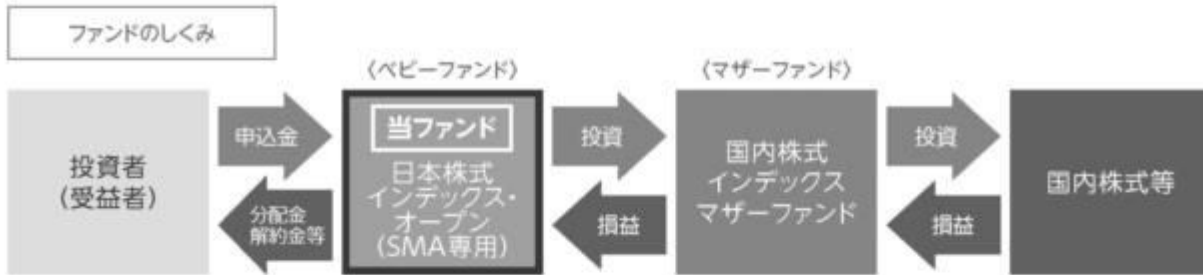
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

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



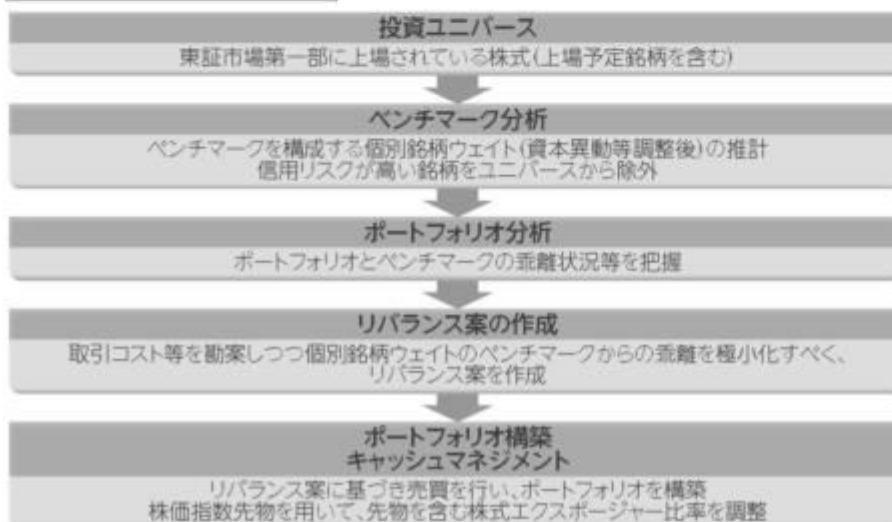
? ファミリーファンド方式とは

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 (2020年7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	2,171銘柄	1	トヨタ自動車	111,715
時価総額	約338兆円	2	ソフトバンクグループ	82,694
※上記時価総額は浮動株ベース		3	ソニー	81,474
		4	キーエンス	64,528
		5	日本電信電話	51,617
		6	武田薬品工業	50,328
		7	任天堂	45,860
		8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	42,724
		9	第一三共	42,666
		10	ダイキン工業	37,856
		※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（2020年 7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せん。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で第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。

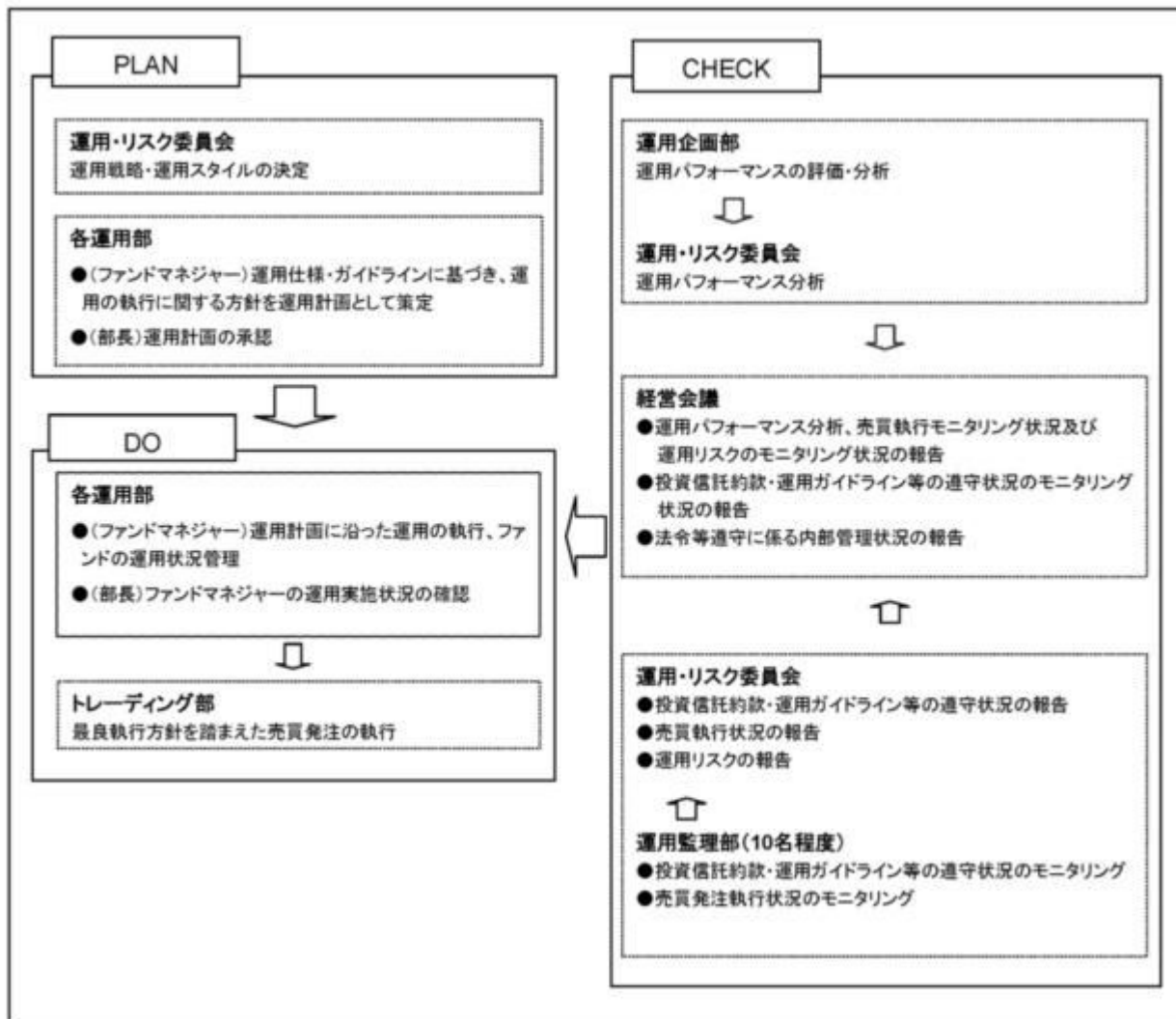
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に

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。

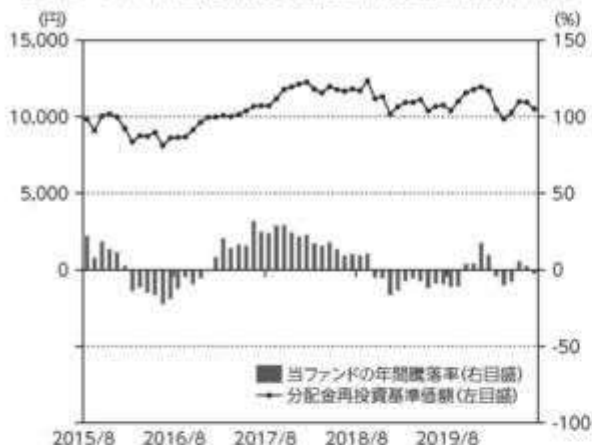
(2) リスクの管理体制

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〕

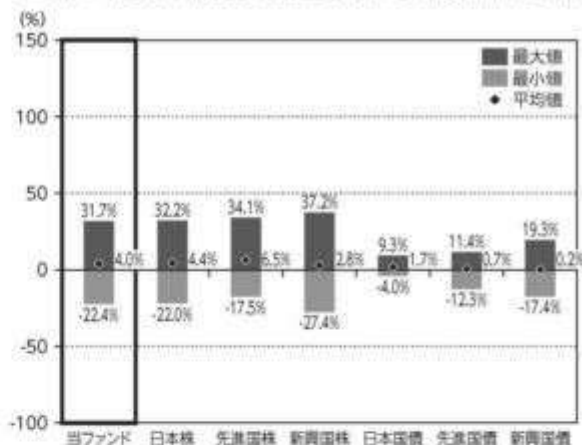
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2015年8月～2020年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。時指数は、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。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場主体の動きを表す投資収益指数で、一定の購入価格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該の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより構築されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのオミューサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤謬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権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Emerging Markets インデックス(除く日本、円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.407%（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 0.132% (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 0.198% (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 0.077% (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
ず（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ま
す。）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。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2020年7月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年7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	1,502,520,702	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		773,422	0.05
合計（純資産総額）		1,503,294,124	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	1,062,227,432	1.4741	1,565,923,387	1.4145	1,502,520,702	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
第13期計算期間末	(2019年 6月25日)	1,610,423,900	1,610,423,900	10,595	10,595
第14期計算期間末	(2020年 6月25日)	1,570,256,552	1,570,256,552	10,957	10,957
	2019年 7月末日	1,692,126,423		10,757	
	8月末日	1,694,660,386		10,390	
	9月末日	1,711,059,999		11,012	
	10月末日	1,684,191,414		11,559	
	11月末日	1,703,531,774		11,780	
	12月末日	1,657,696,377		11,945	
	2020年 1月末日	1,614,425,144		11,686	
	2月末日	1,528,956,197		10,482	
	3月末日	1,409,250,247		9,854	
	4月末日	1,472,391,959		10,278	
	5月末日	1,572,493,095		10,973	
	6月末日	1,563,895,282		10,951	
	7月末日	1,503,294,124		10,507	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
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
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	0
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	8.9
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	3.4

(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期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	1,166,396,443	162,578,396	1,519,938,680
第14期計算期間	2019年 6月26日～2020年 6月25日	390,544,895	477,351,199	1,433,132,376

(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	304,352,825,510	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,799,843,841	1.23
合計(純資産総額)		308,152,669,351	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	3,875,935,000	1.26

(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	1,619,700	6,768.91	10,963,603,527	6,217.00	10,069,674,900	3.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,130,300	4,860.82	5,494,184,846	6,595.00	7,454,328,500	2.42
日本	株式	ソニー	電気機器	909,400	6,904.48	6,278,934,112	8,076.00	7,344,314,400	2.38
日本	株式	キーエンス	電気機器	131,500	44,366.34	5,834,173,710	44,220.00	5,814,930,000	1.89
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,904,200	2,448.21	4,661,881,482	2,443.50	4,652,912,700	1.51

日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,207,800	4,181.46	5,050,367,388	3,756.00	4,536,496,800	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	89,000	43,699.48	3,889,253,720	46,440.00	4,133,160,000	1.34
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,794,000	445.00	4,358,330,000	393.20	3,851,000,800	1.25
日本	株式	第一三共	医薬品	415,400	10,027.42	4,165,390,268	9,258.00	3,845,773,200	1.25
日本	株式	ダイキン工業	機械	184,900	15,901.87	2,940,255,763	18,450.00	3,411,405,000	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,038,600	3,139.89	3,261,089,754	3,259.00	3,384,797,400	1.10
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	993,800	3,719.65	3,696,588,170	3,268.00	3,247,738,400	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	288,000	10,110.25	2,911,752,000	10,420.00	3,000,960,000	0.97
日本	株式	信越化学工業	化学	244,100	12,616.39	3,079,660,799	12,275.00	2,996,327,500	0.97
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,018,700	2,948.94	3,004,085,178	2,907.50	2,961,870,250	0.96
日本	株式	日本電産	電気機器	349,400	6,642.25	2,320,802,150	8,375.00	2,926,225,000	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,142,900	2,792.09	3,191,079,661	2,524.00	2,884,679,600	0.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	426,500	6,037.09	2,574,818,885	6,609.00	2,818,738,500	0.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	990,200	3,127.44	3,096,791,088	2,800.00	2,772,560,000	0.90
日本	株式	花王	化学	347,600	8,656.03	3,008,836,028	7,636.00	2,654,273,600	0.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	92,100	21,662.80	1,995,143,880	28,800.00	2,652,480,000	0.86
日本	株式	S M C	機械	45,500	54,474.07	2,478,570,185	55,070.00	2,505,685,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,454,900	134.78	2,622,131,422	127.60	2,482,445,240	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	136,500	19,268.77	2,630,187,105	17,705.00	2,416,732,500	0.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,000,000	2,312.72	2,312,720,000	2,300.00	2,300,000,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	506,200	4,681.98	2,370,018,276	4,436.00	2,245,503,200	0.73
日本	株式	日立製作所	電気機器	697,500	3,464.21	2,416,286,475	3,128.00	2,181,780,000	0.71
日本	株式	中外製薬	医薬品	454,000	5,302.28	2,407,235,120	4,736.00	2,150,144,000	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,258,600	1,909.30	2,403,044,980	1,650.00	2,076,690,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,451,700	1,420.01	2,061,428,517	1,370.50	1,989,554,850	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.46
		食料品	3.83
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.15
		医薬品	6.76
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.54

ガラス・土石製品	0.74
鉄鋼	0.53
非鉄金属	0.69
金属製品	0.53
機械	5.31
電気機器	15.57
輸送用機器	6.95
精密機器	2.62
その他製品	2.49
電気・ガス業	1.45
陸運業	3.50
海運業	0.13
空運業	0.31
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	10.68
卸売業	4.45
小売業	5.01
銀行業	4.77
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	1.83
その他金融業	1.07
不動産業	1.86
サービス業	5.20
小計	98.77
合計	98.77

(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	259円		4,072,344,950	3,875,935,000	1.26

(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。

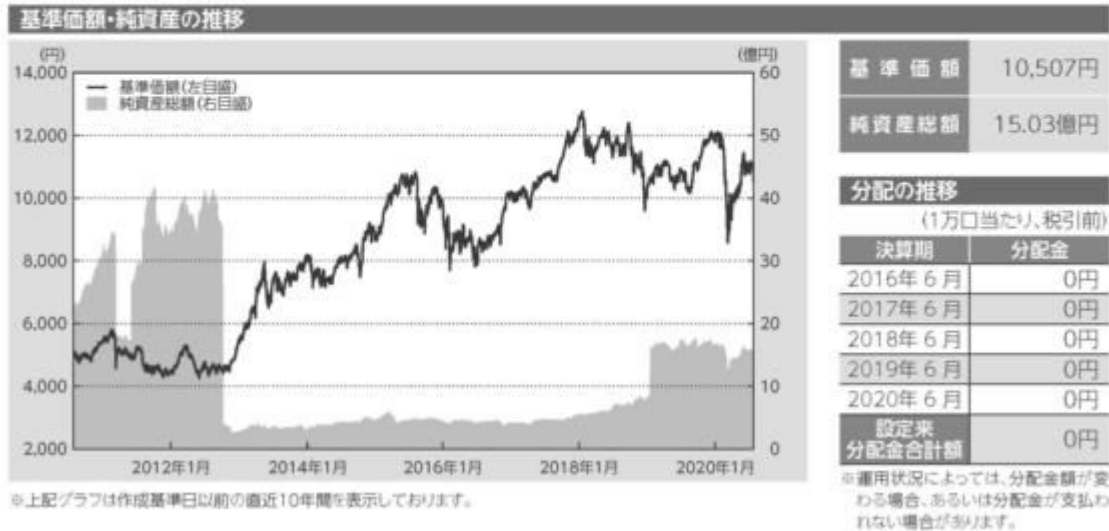
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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

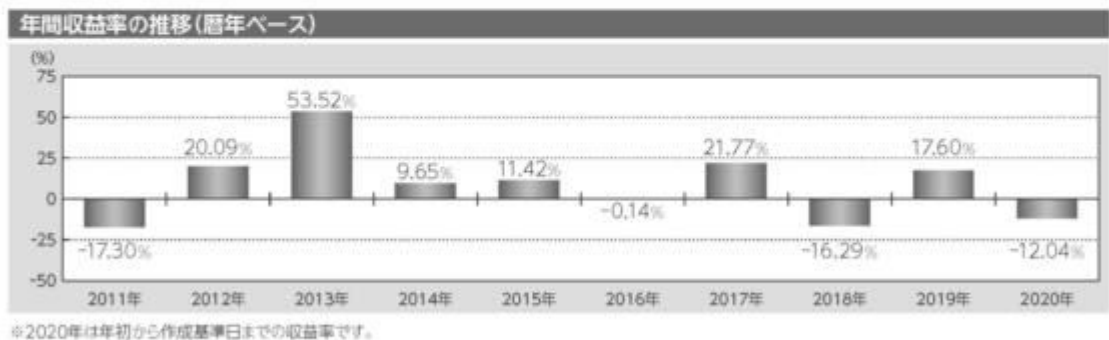
当初設定日：2007年2月16日
作成基準日：2020年7月31日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.4%
ソニー	日本	株式	電気機器	2.4%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.5%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.2%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.2%
ダイキン工業	日本	株式	機械	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定

した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（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え、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、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14期計算期間(2019年6月26日から2020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13期 (2019年 6月25日現在)	第14期 (2020年 6月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,817,196	3,961,239
親投資信託受益証券	1,609,616,486	1,569,462,064
未収入金	46,346	36,626
流動資産合計	1,613,480,028	1,573,459,929
資産合計	1,613,480,028	1,573,459,929
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	566,828	589,411
未払委託者報酬	2,429,217	2,525,962
未払利息	8	5
その他未払費用	60,075	87,999
流動負債合計	3,056,128	3,203,377
負債合計	3,056,128	3,203,377
純資産の部		
元本等		
元本	1,519,938,680	1,433,132,376
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	90,485,220	137,124,176
(分配準備積立金)	114,541,355	117,240,134
元本等合計	1,610,423,900	1,570,256,552
純資産合計	1,610,423,900	1,570,256,552
負債純資産合計	1,613,480,028	1,573,459,929

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	2018年 6月26日 至 2019年 6月25日	自	2019年 6月26日 至 2020年 6月25日
営業収益				
受取利息		1		7
有価証券売買等損益		56,815,341		71,326,397
営業収益合計		56,815,340		71,326,404
営業費用				
支払利息		1,283		1,319
受託者報酬		842,758		1,233,700
委託者報酬		3,611,721		5,287,136
その他費用		60,107		87,999
営業費用合計		4,515,869		6,610,154
営業利益又は営業損失（ ）		61,331,209		64,716,250
経常利益又は経常損失（ ）		61,331,209		64,716,250
当期純利益又は当期純損失（ ）		61,331,209		64,716,250
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（ ）		1,394,690		16,046,315
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		84,365,115		90,485,220
剰余金増加額又は欠損金減少額		84,750,368		27,432,231
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		84,750,368		27,432,231
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,693,744		29,463,210
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,693,744		29,463,210
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		90,485,220		137,124,176

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2019年 6月25日現在)	第14期 (2020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	1,519,938,680口	1,433,132,376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) 1.0595円 (10,595円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0957円 (10,957円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 2018年 6月26日 至 2019年 6月25日			第14期 自 2019年 6月26日 至 2020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	23,145,534円	費用控除後の配当等収益額	A	34,239,793円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	850,049,137円	収益調整金額	C	826,671,178円
分配準備積立金額	D	91,395,821円	分配準備積立金額	D	83,000,341円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	964,590,492円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	943,911,312円
当ファンドの期末残存口数	F	1,519,938,680口	当ファンドの期末残存口数	F	1,433,132,376口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,346円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,586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14期 自 2019年 6月26日 至 2020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運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (2020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13期	第14期
	自 2018年 6月26日 至 2019年 6月25日	自 2019年 6月26日 至 2020年 6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	516,120,633円	1,519,938,680円
期中追加設定元本額	1,166,396,443円	390,544,895円
期中一部解約元本額	162,578,396円	477,351,199円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (2019年 6月25日現在)	第14期 (2020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	55,174,480	58,116,397
合計	55,174,480	58,116,397

（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	1,064,402,892	1,569,462,064	
合計		1,064,402,892	1,569,462,064	

(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

項目	2020年 6月25日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,417,659,756
株式	316,448,497,910
派生商品評価勘定	9,448,700
未収配当金	1,340,203,935
前払金	98,732,200
差入委託証拠金	161,981,000
流動資産合計	321,476,523,501
資産合計	321,476,523,501
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	108,189,150
未払金	2,204,300
未払解約金	98,460,822
未払利息	5,046
その他未払費用	6,565
流動負債合計	208,865,883
負債合計	208,865,883
純資産の部	
元本等	
元本	217,882,558,317
剰余金	
剰余金又は欠損金()	103,385,099,301
元本等合計	321,267,657,618
純資産合計	321,267,657,618
負債純資産合計	321,476,523,501

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 6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。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 6月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	217,882,558,317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 1.4745円 (1万口当たり純資産額) (14,745円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 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。

	2020年 6月25日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月26日
期首元本額	193,887,535,122円
期中追加設定元本額	66,251,653,706円
期中一部解約元本額	42,256,630,511円
期末元本額	217,882,558,317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）	541,683,540円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,059,307,518円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,247,131円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,451,630,888円
世界経済インデックスファンド	2,276,541,990円
日本株式インデックス・オープン	4,156,840,526円
D C マイセレクション 2 5	6,808,202,012円
D C マイセレクション 5 0	19,230,133,948円
D C マイセレクション 7 5	17,910,782,169円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,803,793,335円
D C マイセレクション S 2 5	2,910,952,528円
D C マイセレクション S 5 0	8,230,340,400円
D C マイセレクション S 7 5	5,317,087,378円
D C 日本株式インデックス・オープン S	7,012,100,043円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	342,359,438円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	700,667,397円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	468,461,806円
D C 世界経済インデックスファンド	2,898,309,287円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,064,402,892円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,426,982円

区分	2020年 6月25日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	35,161,415円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,561,470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）	262,304,124円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,628,611円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	67,713,852円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	252,635,680円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,819,677円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	271,487,370円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,529,024,094円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	664,544,778円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,835,312,636円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	597,932,989円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	37,950,114円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	703,470,685円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	34,958,991円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	413,088,845円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	519,025,539円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	52,581,925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）	830,533,162円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,715,306,586円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,082,707,518円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,687,113,627円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,064,328,730円
分散投資コア戦略ファンドA	5,599,750,637円
分散投資コア戦略ファンドS	15,160,167,055円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	325,521,200円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	345,688,014円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,850,426,267円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,654,993円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,922,726円
SMT インデックスバランス・オープン	67,561,782円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,522,882,969円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,059,479円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	77,241,574円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,453,731円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,765,951円
グローバル経済コア	267,885,269円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,810,977円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	49,941,012円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,996,233円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	761,423,048円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	107,920,658円

区分	2020年 6月25日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	130,070円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	202,244円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	77,989円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	55,515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）	50,134,429,305円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,815,377,787円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	39,395,329円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,286,772円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020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		839,849,160
合計		839,849,160

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 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	4,833,532,200	-	4,734,800,000	98,732,200
	合計	4,833,532,200	-	4,734,800,000	98,732,200

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

	評価額

銘柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	6,900	2,682.00	18,505,800	
日本水産	195,900	469.00	91,877,100	
マルハニチロ	28,300	2,152.00	60,901,600	
カネコ種苗	5,900	1,464.00	8,637,600	
サカタのタネ	23,400	3,415.00	79,911,000	
ホクト	14,900	2,020.00	30,098,000	
ホクリヨウ	3,000	637.00	1,911,000	
住石ホールディングス	39,600	124.00	4,910,400	
日鉄鉱業	4,500	4,425.00	19,912,500	
三井松島ホールディングス	7,600	834.00	6,338,400	
国際石油開発帝石	786,000	690.50	542,733,000	
石油資源開発	25,600	1,846.00	47,257,600	
K & O エナジーグループ	9,500	1,471.00	13,974,500	
ヒノキヤグループ	4,900	1,732.00	8,486,800	
ショーボンドホールディングス	30,500	4,785.00	145,942,500	
ミライト・ホールディングス	58,200	1,569.00	91,315,800	
タマホーム	10,600	1,302.00	13,801,200	
サンヨーホームズ	1,700	657.00	1,116,900	
日本アクア	7,800	568.00	4,430,400	
ファーストコーポレーション	6,000	541.00	3,246,000	
ベステラ	3,400	998.00	3,393,200	
T A T E R U	40,400	195.00	7,878,000	
キャンディル	3,200	611.00	1,955,200	
スペースバリューホールディングス	23,900	353.00	8,436,700	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	949.00	3,606,200	
第一カッター興業	2,400	2,188.00	5,251,200	
明豊ファシリティワークス	6,300	570.00	3,591,000	
安藤・間	116,700	615.00	71,770,500	
東急建設	57,400	545.00	31,283,000	
コムシスホールディングス	69,500	3,070.00	213,365,000	
ピーアールホールディングス	21,300	542.00	11,544,600	
高松コンストラクショングループ	12,200	2,322.00	28,328,400	
東建コーポレーション	6,000	7,060.00	42,360,000	
ソネック	2,000	859.00	1,718,000	
ヤマウラ	8,500	825.00	7,012,500	
大成建設	150,900	3,790.00	571,911,000	
大林組	452,500	982.00	444,355,000	
清水建設	459,200	858.00	393,993,600	
飛鳥建設	13,000	1,035.00	13,455,000	
長谷工コーポレーション	175,200	1,359.00	238,096,800	
松井建設	17,800	641.00	11,409,800	

銭高組	2,000	3,970.00	7,940,000
鹿島建設	355,200	1,211.00	430,147,200
不動テトラ	11,800	1,430.00	16,874,000
大末建設	5,200	816.00	4,243,200
鉄建建設	9,800	2,042.00	20,011,600
西松建設	34,900	2,094.00	73,080,600
三井住友建設	109,300	463.00	50,605,900
大豊建設	10,200	2,345.00	23,919,000
前田建設工業	113,300	810.00	91,773,000
佐田建設	9,700	417.00	4,044,900
ナカノフドー建設	12,400	372.00	4,612,800
奥村組	24,500	2,443.00	59,853,500
東鉄工業	19,400	2,700.00	52,380,000
イチケン	3,300	1,477.00	4,874,100
富士ピー・エス	6,700	562.00	3,765,400
浅沼組	5,100	4,160.00	21,216,000
戸田建設	187,900	669.00	125,705,100
熊谷組	21,000	2,511.00	52,731,000
北野建設	2,800	2,621.00	7,338,800
植木組	2,000	2,417.00	4,834,000
矢作建設工業	20,000	759.00	15,180,000
ピーエス三菱	14,900	520.00	7,748,000
日本ハウスホールディングス	30,900	276.00	8,528,400
大東建託	49,400	10,045.00	496,223,000
新日本建設	19,200	823.00	15,801,600
N I P P O	37,400	2,603.00	97,352,200
東亜道路工業	2,800	3,195.00	8,946,000
前田道路	39,900	2,010.00	80,199,000
日本道路	4,400	7,230.00	31,812,000
東亜建設工業	14,100	1,515.00	21,361,500
日本国土開発	44,000	552.00	24,288,000
若築建設	8,100	1,138.00	9,217,800
東洋建設	50,700	405.00	20,533,500
五洋建設	179,400	557.00	99,925,800
世紀東急工業	21,700	744.00	16,144,800
福田組	5,200	4,905.00	25,506,000
住友林業	114,600	1,308.00	149,896,800
日本基礎技術	15,200	405.00	6,156,000
巴コーポレーション	20,100	339.00	6,813,900
大和ハウス工業	447,700	2,522.50	1,129,323,250
ライト工業	25,900	1,423.00	36,855,700
積水ハウス	490,700	2,039.50	1,000,782,650

日特建設	11,800	762.00	8,991,600
北陸電気工事	7,800	928.00	7,238,400
ユアテック	25,900	639.00	16,550,100
日本リーテック	9,500	2,443.00	23,208,500
四電工	2,500	2,485.00	6,212,500
中電工	18,200	2,248.00	40,913,600
関電工	64,400	917.00	59,054,800
きんでん	107,500	1,746.00	187,695,000
東京エネシス	15,000	786.00	11,790,000
トーエネック	4,500	3,590.00	16,155,000
住友電設	12,800	2,337.00	29,913,600
日本電設工業	24,800	2,329.00	57,759,200
協和エクシオ	68,600	2,558.00	175,478,800
新日本空調	12,000	2,421.00	29,052,000
九電工	31,700	3,110.00	98,587,000
三機工業	32,600	1,258.00	41,010,800
日揮ホールディングス	139,300	1,117.00	155,598,100
中外炉工業	4,900	1,506.00	7,379,400
ヤマト	14,500	661.00	9,584,500
太平電業	10,900	2,233.00	24,339,700
高砂熱学工業	39,300	1,593.00	62,604,900
三晃金属工業	2,000	2,059.00	4,118,000
朝日工業社	3,000	3,155.00	9,465,000
明星工業	29,300	786.00	23,029,800
大気社	22,000	2,949.00	64,878,000
ダイダン	10,800	2,753.00	29,732,400
日比谷総合設備	14,600	1,861.00	27,170,600
フィル・カンパニー	2,600	2,501.00	6,502,600
OSJBホールディングス	71,300	231.00	16,470,300
東洋エンジニアリング	19,000	353.00	6,707,000
レイズネクスト	24,300	1,228.00	29,840,400
日本製粉	42,400	1,601.00	67,882,400
日清製粉グループ本社	163,600	1,584.00	259,142,400
日東富士製粉	1,100	6,420.00	7,062,000
昭和産業	13,300	3,230.00	42,959,000
鳥越製粉	12,800	904.00	11,571,200
中部飼料	17,700	1,613.00	28,550,100
フィード・ワン	97,300	197.00	19,168,100
東洋精糖	2,400	1,218.00	2,923,200
日本甜菜製糖	7,600	1,680.00	12,768,000
三井製糖	12,700	2,010.00	25,527,000
塩水港精糖	15,700	206.00	3,234,200

日新製糖	6,900	1,855.00	12,799,500
森永製菓	34,000	4,260.00	144,840,000
中村屋	3,700	4,005.00	14,818,500
江崎グリコ	42,900	5,130.00	220,077,000
名糖産業	7,000	1,284.00	8,988,000
井村屋グループ	8,200	2,141.00	17,556,200
不二家	8,100	2,194.00	17,771,400
山崎製パン	108,500	1,817.00	197,144,500
第一屋製パン	2,500	961.00	2,402,500
モロゾフ	2,500	5,680.00	14,200,000
亀田製菓	8,200	5,060.00	41,492,000
寿スピリッツ	13,900	4,720.00	65,608,000
カルビー	66,000	2,938.00	193,908,000
森永乳業	26,800	4,685.00	125,558,000
六甲バター	9,600	1,472.00	14,131,200
ヤクルト本社	99,600	6,440.00	641,424,000
明治ホールディングス	95,800	8,380.00	802,804,000
雪印メグミルク	34,900	2,478.00	86,482,200
プリマハム	22,600	2,682.00	60,613,200
日本ハム	55,300	4,235.00	234,195,500
林兼産業	4,800	571.00	2,740,800
丸大食品	15,400	1,875.00	28,875,000
S Foods	11,600	2,653.00	30,774,800
柿安本店	5,000	2,636.00	13,180,000
伊藤ハム米久ホールディングス	93,200	643.00	59,927,600
サッポロホールディングス	49,400	2,007.00	99,145,800
アサヒグループホールディングス	303,300	3,880.00	1,176,804,000
キリンホールディングス	614,100	2,301.00	1,413,044,100
宝ホールディングス	107,300	977.00	104,832,100
オエノンホールディングス	38,200	408.00	15,585,600
養命酒製造	4,400	1,801.00	7,924,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	101,600	2,016.00	204,825,600
サントリー食品インターナショナル	96,900	4,250.00	411,825,000
ダイトーグループホールディングス	7,400	4,860.00	35,964,000
伊藤園	44,000	6,230.00	274,120,000
キーコーヒー	14,200	2,302.00	32,688,400
ユニカフェ	3,700	972.00	3,596,400
ジャパンフーズ	2,100	1,200.00	2,520,000
日清オイリオグループ	18,600	3,325.00	61,845,000
不二製油グループ本社	35,300	2,799.00	98,804,700
かどや製油	1,600	3,660.00	5,856,000
J - オイルミルズ	7,500	3,945.00	29,587,500

キッコーマン	104,200	5,240.00	546,008,000
味の素	319,800	1,810.50	578,997,900
キューピー	80,600	2,066.00	166,519,600
ハウス食品グループ本社	54,200	3,500.00	189,700,000
カゴメ	55,000	3,150.00	173,250,000
焼津水産化学工業	7,000	929.00	6,503,000
アリアケジャパン	13,200	6,860.00	90,552,000
ピエトロ	1,900	1,626.00	3,089,400
エバラ食品工業	3,500	2,187.00	7,654,500
やまみ	1,200	2,120.00	2,544,000
ニチレイ	69,000	3,090.00	213,210,000
東洋水産	74,500	5,940.00	442,530,000
イトアンド	5,000	1,798.00	8,990,000
大冷	1,900	2,007.00	3,813,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,042.00	8,336,000
日清食品ホールディングス	61,600	9,400.00	579,040,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,145.00	15,229,500
一正蒲鉾	5,600	1,005.00	5,628,000
フジッコ	15,700	1,983.00	31,133,100
ロック・フィールド	15,600	1,340.00	20,904,000
日本たばこ産業	836,200	2,099.50	1,755,601,900
ケンコーマヨネーズ	8,100	1,945.00	15,754,500
わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,692.00	16,074,000
なとり	8,100	1,740.00	14,094,000
イフジ産業	2,500	810.00	2,025,000
ピククルスコーポレーション	3,200	2,402.00	7,686,400
北の達人コーポレーション	50,600	553.00	27,981,800
ユーグレナ	62,400	782.00	48,796,800
ミヨシ油脂	5,500	1,111.00	6,110,500
理研ビタミン	13,700	2,293.00	31,414,100
片倉工業	20,900	1,148.00	23,993,200
ゲンゼ	10,500	3,870.00	40,635,000
東洋紡	56,200	1,470.00	82,614,000
ユニチカ	42,700	347.00	14,816,900
富士紡ホールディングス	7,000	3,185.00	22,295,000
倉敷紡績	14,200	2,261.00	32,106,200
シキボウ	7,400	976.00	7,222,400
日本毛織	47,000	1,018.00	47,846,000
トーア紡コーポレーション	5,600	489.00	2,738,400
帝国繊維	16,100	2,281.00	36,724,100
帝人	115,600	1,715.00	198,254,000
東レ	1,024,100	498.70	510,718,670

サカイオーベックス	4,000	2,139.00	8,556,000
住江織物	3,100	2,047.00	6,345,700
日本フェルト	9,000	466.00	4,194,000
イチカワ	2,400	1,282.00	3,076,800
日東製網	1,600	1,365.00	2,184,000
アツギ	11,800	607.00	7,162,600
ダイニック	5,300	736.00	3,900,800
セーレン	35,100	1,340.00	47,034,000
ソトー	5,700	955.00	5,443,500
東海染工	2,000	1,126.00	2,252,000
小松マテーレ	23,300	714.00	16,636,200
ワコールホールディングス	36,900	2,033.00	75,017,700
ホギメディカル	16,100	3,345.00	53,854,500
クラウドシアホールディングス	3,700	448.00	1,657,600
T S Iホールディングス	47,600	462.00	21,991,200
マツオカコーポレーション	4,100	2,000.00	8,200,000
ワールド	20,100	1,670.00	33,567,000
三陽商会	7,400	817.00	6,045,800
ナイガイ	5,400	365.00	1,971,000
オンワードホールディングス	85,200	338.00	28,797,600
ルックホールディングス	5,000	775.00	3,875,000
ゴールドウイン	25,600	7,130.00	182,528,000
デサント	27,600	1,474.00	40,682,400
キング	6,900	539.00	3,719,100
ヤマトインターナショナル	12,700	385.00	4,889,500
特種東海製紙	9,000	4,450.00	40,050,000
王子ホールディングス	590,700	501.00	295,940,700
日本製紙	62,500	1,530.00	95,625,000
三菱製紙	16,000	352.00	5,632,000
北越コーポレーション	84,200	381.00	32,080,200
中越パルプ工業	6,000	1,544.00	9,264,000
巴川製紙所	4,200	925.00	3,885,000
大王製紙	62,300	1,442.00	89,836,600
阿波製紙	3,600	501.00	1,803,600
レンゴー	133,600	863.00	115,296,800
トモク	8,700	1,687.00	14,676,900
ザ・バック	10,700	3,090.00	33,063,000
クラレ	222,500	1,135.00	252,537,500
旭化成	936,600	859.50	805,007,700
共和レザー	7,700	692.00	5,328,400
昭和電工	100,600	2,468.00	248,280,800
住友化学	1,038,200	320.00	332,224,000

住友精化	6,300	3,445.00	21,703,500
日産化学	78,500	5,320.00	417,620,000
ラサ工業	5,000	1,532.00	7,660,000
クレハ	12,100	4,725.00	57,172,500
多木化学	5,500	7,350.00	40,425,000
テイカ	10,400	1,414.00	14,705,600
石原産業	25,300	711.00	17,988,300
片倉コープアグリ	3,600	1,230.00	4,428,000
日本曹達	20,900	2,773.00	57,955,700
東ソー	218,400	1,430.00	312,312,000
トクヤマ	40,700	2,454.00	99,877,800
セントラル硝子	28,900	1,819.00	52,569,100
東亜合成	88,700	1,050.00	93,135,000
大阪ソーダ	14,400	2,381.00	34,286,400
関東電化工業	33,500	825.00	27,637,500
デンカ	51,600	2,622.00	135,295,200
信越化学工業	242,600	12,280.00	2,979,128,000
日本カーバイド工業	4,800	1,293.00	6,206,400
堺化学工業	9,100	2,000.00	18,200,000
第一稀元素化学工業	15,300	789.00	12,071,700
エア・ウォーター	131,400	1,497.00	196,705,800
大陽日酸	135,800	1,730.00	234,934,000
日本化学工業	4,400	2,243.00	9,869,200
東邦アセチレン	2,100	1,247.00	2,618,700
日本パーカライズン	71,300	1,069.00	76,219,700
高压ガス工業	22,400	770.00	17,248,000
チタン工業	1,800	1,773.00	3,191,400
四国化成工業	21,800	1,102.00	24,023,600
戸田工業	3,300	1,974.00	6,514,200
ステラ ケミファ	7,700	2,405.00	18,518,500
保土谷化学工業	5,300	4,080.00	21,624,000
日本触媒	21,900	5,640.00	123,516,000
大日精化工業	12,500	2,287.00	28,587,500
カネカ	36,600	2,773.00	101,491,800
三菱瓦斯化学	131,500	1,597.00	210,005,500
三井化学	128,300	2,253.00	289,059,900
J S R	131,700	2,027.00	266,955,900
東京応化工業	24,200	5,220.00	126,324,000
大阪有機化学工業	13,000	2,450.00	31,850,000
三菱ケミカルホールディングス	944,600	621.10	586,691,060
K Hネオケム	24,900	2,026.00	50,447,400
ダイセル	184,000	817.00	150,328,000

住友ベークライト	22,200	2,963.00	65,778,600
積水化学工業	303,800	1,522.00	462,383,600
日本ゼオン	127,400	974.00	124,087,600
アイカ工業	42,400	3,490.00	147,976,000
宇部興産	71,400	1,810.00	129,234,000
積水樹脂	25,400	2,146.00	54,508,400
タキロンシーアイ	30,600	672.00	20,563,200
旭有機材	8,000	1,419.00	11,352,000
ニチバン	7,400	1,468.00	10,863,200
リケンテクノス	35,500	432.00	15,336,000
大倉工業	6,700	1,572.00	10,532,400
積水化成成品工業	18,900	566.00	10,697,400
群栄化学工業	3,200	2,616.00	8,371,200
タイガースポリマー	7,400	488.00	3,611,200
ミライアル	5,000	1,016.00	5,080,000
ダイキアクシス	5,000	851.00	4,255,000
ダイキョーニシカワ	29,800	486.00	14,482,800
竹本容器	5,100	722.00	3,682,200
森六ホールディングス	7,600	1,742.00	13,239,200
日本化薬	87,500	1,072.00	93,800,000
カーリットホールディングス	15,100	501.00	7,565,100
日本精化	11,400	1,465.00	16,701,000
扶桑化学工業	14,300	3,785.00	54,125,500
トリケミカル研究所	3,100	11,470.00	35,557,000
A D E K A	65,000	1,411.00	91,715,000
日油	53,200	3,660.00	194,712,000
新日本理化	23,400	167.00	3,907,800
ハリマ化成グループ	11,700	975.00	11,407,500
花王	345,500	8,684.00	3,000,322,000
第一工業製薬	5,300	5,090.00	26,977,000
石原ケミカル	3,800	1,964.00	7,463,200
日華化学	4,800	946.00	4,540,800
ニイタカ	2,900	5,760.00	16,704,000
三洋化成工業	8,400	4,690.00	39,396,000
有機合成薬品工業	10,800	370.00	3,996,000
大日本塗料	16,000	904.00	14,464,000
日本ペイントホールディングス	116,600	7,930.00	924,638,000
関西ペイント	158,800	2,229.00	353,965,200
神東塗料	11,100	186.00	2,064,600
中国塗料	40,200	781.00	31,396,200
日本特殊塗料	10,600	963.00	10,207,800
藤倉化成	19,100	535.00	10,218,500

太陽ホールディングス	10,400	4,905.00	51,012,000
D I C	59,700	2,707.00	161,607,900
サカティンクス	30,800	1,009.00	31,077,200
東洋インキS Cホールディングス	29,900	2,042.00	61,055,800
T & K T O K A	10,900	832.00	9,068,800
富士フィルムホールディングス	276,600	4,651.00	1,286,466,600
資生堂	286,700	7,023.00	2,013,494,100
ライオン	187,600	2,569.00	481,944,400
高砂香料工業	9,000	2,142.00	19,278,000
マンダム	32,400	1,975.00	63,990,000
ミルボン	19,300	5,110.00	98,623,000
ファンケル	58,400	3,190.00	186,296,000
コーセー	27,100	13,050.00	353,655,000
コタ	8,300	1,195.00	9,918,500
シーボン	1,900	2,062.00	3,917,800
ポーラ・オルビスホールディングス	61,600	1,872.00	115,315,200
ノエビアホールディングス	12,200	4,575.00	55,815,000
アジュバンコスメジャパン	3,200	943.00	3,017,600
エステー	9,300	1,698.00	15,791,400
アグロ カネショウ	6,000	1,277.00	7,662,000
コニシ	23,700	1,479.00	35,052,300
長谷川香料	24,900	2,378.00	59,212,200
星光P M C	8,300	705.00	5,851,500
小林製薬	40,400	9,820.00	396,728,000
荒川化学工業	13,000	1,261.00	16,393,000
メック	9,900	2,122.00	21,007,800
日本高純度化学	4,000	2,586.00	10,344,000
タカラバイオ	37,800	3,135.00	118,503,000
J C U	17,500	3,250.00	56,875,000
新田ゼラチン	9,100	703.00	6,397,300
O A T アグリオ	2,500	1,069.00	2,672,500
デクセリアルズ	37,300	841.00	31,369,300
アース製薬	10,900	7,530.00	82,077,000
北興化学工業	14,800	622.00	9,205,600
大成ラミック	4,700	2,693.00	12,657,100
クミアイ化学工業	59,700	982.00	58,625,400
日本農薬	25,700	464.00	11,924,800
アキレス	9,900	2,193.00	21,710,700
有沢製作所	22,800	811.00	18,490,800
日東電工	99,600	5,860.00	583,656,000
レック	15,400	1,617.00	24,901,800
三光合成	16,500	287.00	4,735,500

きもと	24,500	152.00	3,724,000
藤森工業	12,900	3,600.00	46,440,000
前澤化成工業	9,200	998.00	9,181,600
未来工業	7,700	1,871.00	14,406,700
ウェブロックホールディングス	5,000	858.00	4,290,000
J S P	8,400	1,441.00	12,104,400
エフピコ	15,900	8,200.00	130,380,000
天馬	9,600	1,651.00	15,849,600
信越ポリマー	25,900	886.00	22,947,400
東リ	35,900	266.00	9,549,400
ニフコ	53,000	2,299.00	121,847,000
バルカー	11,700	1,833.00	21,446,100
ユニ・チャーム	278,100	4,424.00	1,230,314,400
ショーエイコーポレーション	2,100	932.00	1,957,200
協和キリン	145,100	2,839.00	411,938,900
武田薬品工業	1,200,400	3,930.00	4,717,572,000
アステラス製薬	1,251,000	1,818.00	2,274,318,000
大日本住友製薬	106,900	1,491.00	159,387,900
塩野義製薬	181,400	6,846.00	1,241,864,400
わかもと製薬	17,200	278.00	4,781,600
あすか製薬	16,400	1,216.00	19,942,400
日本新薬	37,800	8,850.00	334,530,000
バイオフェルミン製薬	2,400	2,393.00	5,743,200
中外製薬	150,400	17,430.00	2,621,472,000
科研製薬	24,700	5,520.00	136,344,000
エーザイ	172,700	8,631.00	1,490,573,700
ロート製薬	74,100	3,475.00	257,497,500
小野薬品工業	331,300	3,115.00	1,031,999,500
久光製薬	38,100	5,760.00	219,456,000
持田製薬	20,000	4,040.00	80,800,000
参天製薬	268,800	2,016.00	541,900,800
扶桑薬品工業	5,100	2,449.00	12,489,900
日本ケミファ	1,900	2,627.00	4,991,300
ツムラ	44,700	2,840.00	126,948,000
日医工	40,900	1,303.00	53,292,700
キッセイ薬品工業	25,500	2,589.00	66,019,500
生化学工業	28,000	1,144.00	32,032,000
栄研化学	25,400	1,719.00	43,662,600
日水製薬	6,100	1,186.00	7,234,600
鳥居薬品	9,000	3,050.00	27,450,000
J C R ファーマ	10,200	11,980.00	122,196,000
東和薬品	18,500	2,026.00	37,481,000

富士製薬工業	9,800	1,191.00	11,671,800
沢井製薬	29,600	5,590.00	165,464,000
ゼリア新薬工業	26,200	2,017.00	52,845,400
第一三共	412,900	8,950.00	3,695,455,000
キョーリン製薬ホールディングス	31,800	2,158.00	68,624,400
大幸薬品	17,600	2,606.00	45,865,600
ダイト	8,800	4,045.00	35,596,000
大塚ホールディングス	274,900	4,848.00	1,332,715,200
大正製薬ホールディングス	30,500	6,640.00	202,520,000
ペプチドリーム	73,300	5,140.00	376,762,000
日本コークス工業	121,900	65.00	7,923,500
ニチレキ	17,000	1,553.00	26,401,000
ユシロ化学工業	8,100	1,303.00	10,554,300
ビーピー・カストロール	5,100	1,215.00	6,196,500
富士石油	38,500	171.00	6,583,500
MORESCO	5,200	1,012.00	5,262,400
出光興産	160,100	2,265.00	362,626,500
ENEOSホールディングス	2,170,500	380.90	826,743,450
コスモエネルギーホールディングス	41,800	1,594.00	66,629,200
横浜ゴム	83,500	1,516.00	126,586,000
TOYO TIRE	82,800	1,440.00	119,232,000
ブリヂストン	415,600	3,511.00	1,459,171,600
住友ゴム工業	129,600	1,085.00	140,616,000
藤倉コンポジット	12,600	370.00	4,662,000
オカモト	8,800	3,825.00	33,660,000
フコク	6,300	681.00	4,290,300
ニッタ	16,300	2,280.00	37,164,000
住友理工	28,000	616.00	17,248,000
三ツ星ベルト	19,000	1,648.00	31,312,000
バンドー化学	25,400	625.00	15,875,000
日東紡績	21,500	5,200.00	111,800,000
A G C	142,600	3,190.00	454,894,000
日本板硝子	69,000	395.00	27,255,000
石塚硝子	2,600	2,045.00	5,317,000
日本山村硝子	6,000	861.00	5,166,000
日本電気硝子	58,000	1,771.00	102,718,000
オハラ	5,700	1,129.00	6,435,300
住友大阪セメント	27,300	3,705.00	101,146,500
太平洋セメント	91,100	2,414.00	219,915,400
日本ヒューム	14,500	757.00	10,976,500
日本コンクリート工業	31,200	278.00	8,673,600
三谷セキサン	6,700	5,310.00	35,577,000

アジアパイルホールディングス	20,500	463.00	9,491,500
東海カーボン	151,200	1,037.00	156,794,400
日本カーボン	7,400	3,560.00	26,344,000
東洋炭素	8,500	1,706.00	14,501,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	3,460.00	27,680,000
TOTO	103,100	4,115.00	424,256,500
日本碍子	173,200	1,454.00	251,832,800
日本特殊陶業	109,800	1,554.00	170,629,200
MARUWA	5,500	8,200.00	45,100,000
品川リフラクトリーズ	3,800	2,233.00	8,485,400
黒崎播磨	2,900	3,730.00	10,817,000
ヨータイ	11,500	715.00	8,222,500
イソライト工業	7,500	459.00	3,442,500
東京窯業	18,400	307.00	5,648,800
ニッカトー	6,600	705.00	4,653,000
フジインコーポレーテッド	12,900	3,135.00	40,441,500
クニミネ工業	5,900	985.00	5,811,500
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,080.00	2,592,000
ニチアス	39,500	2,159.00	85,280,500
ニチハ	20,100	2,221.00	44,642,100
日本製鉄	638,600	1,021.00	652,010,600
神戸製鋼所	261,300	386.00	100,861,800
中山製鋼所	20,000	359.00	7,180,000
合同製鐵	7,700	1,896.00	14,599,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	385,400	773.00	297,914,200
東京製鐵	69,600	636.00	44,265,600
共英製鋼	16,100	1,322.00	21,284,200
大和工業	30,300	2,197.00	66,569,100
東京鐵鋼	5,900	1,619.00	9,552,100
大阪製鐵	7,600	1,254.00	9,530,400
淀川製鋼所	19,300	1,827.00	35,261,100
丸一鋼管	46,300	2,694.00	124,732,200
モリ工業	4,300	2,330.00	10,019,000
大同特殊鋼	23,400	3,380.00	79,092,000
日本高周波鋼業	5,500	376.00	2,068,000
日本冶金工業	11,800	1,638.00	19,328,400
山陽特殊製鋼	9,800	929.00	9,104,200
愛知製鋼	8,000	3,135.00	25,080,000
日立金属	153,800	1,307.00	201,016,600
日本金属	3,300	611.00	2,016,300
大平洋金属	9,700	1,606.00	15,578,200
新日本電工	92,300	170.00	15,691,000

栗本鐵工所	7,100	1,706.00	12,112,600
虹技	2,200	1,254.00	2,758,800
三菱製鋼	10,700	690.00	7,383,000
日亜鋼業	21,100	288.00	6,076,800
日本精線	2,300	3,185.00	7,325,500
エンビプロ・ホールディングス	6,200	593.00	3,676,600
シンニッタン	22,400	242.00	5,420,800
新家工業	3,300	1,171.00	3,864,300
大紀アルミニウム工業所	23,700	557.00	13,200,900
日本軽金属ホールディングス	361,700	184.00	66,552,800
三井金属鉱業	38,600	2,180.00	84,148,000
東邦亜鉛	7,400	1,454.00	10,759,600
三菱マテリアル	94,300	2,252.00	212,363,600
住友金属鉱山	182,400	2,950.00	538,080,000
D O W Aホールディングス	36,100	3,235.00	116,783,500
古河機械金属	25,500	1,085.00	27,667,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,000	935.00	14,025,000
東邦チタニウム	25,700	652.00	16,756,400
U A C J	21,700	1,943.00	42,163,100
C Kサンエツ	3,000	3,430.00	10,290,000
古河電気工業	44,400	2,640.00	117,216,000
住友電気工業	533,600	1,243.00	663,264,800
フジクラ	172,300	320.00	55,136,000
昭和電線ホールディングス	16,600	1,149.00	19,073,400
東京特殊電線	2,200	2,083.00	4,582,600
タツタ電線	28,500	579.00	16,501,500
カナレ電気	2,400	1,860.00	4,464,000
平河ヒューテック	7,200	1,048.00	7,545,600
リョービ	17,700	1,222.00	21,629,400
アーレスティ	19,000	367.00	6,973,000
アサヒホールディングス	25,000	2,834.00	70,850,000
稲葉製作所	8,000	1,379.00	11,032,000
宮地エンジニアリンググループ	4,300	1,667.00	7,168,100
トーカロ	39,600	1,155.00	45,738,000
アルファC o	5,000	941.00	4,705,000
S U M C O	169,600	1,604.00	272,038,400
川田テクノロジーズ	2,900	4,915.00	14,253,500
R S Technologies	4,000	3,400.00	13,600,000
信和	8,200	744.00	6,100,800
東洋製罐グループホールディングス	90,900	1,189.00	108,080,100
ホッカンホールディングス	7,800	1,693.00	13,205,400
コロナ	7,900	1,006.00	7,947,400

横河ブリッジホールディングス	26,500	2,165.00	57,372,500
駒井ハルテック	2,700	1,474.00	3,979,800
高田機工	1,300	2,360.00	3,068,000
三和ホールディングス	134,500	951.00	127,909,500
文化シャッター	42,000	734.00	30,828,000
三協立山	18,400	964.00	17,737,600
アルインコ	10,400	932.00	9,692,800
東洋シャッター	3,400	712.00	2,420,800
LIXILグループ	210,500	1,547.00	325,643,500
日本フィルコン	10,900	529.00	5,766,100
ノーリツ	29,600	1,300.00	38,480,000
長府製作所	14,500	2,227.00	32,291,500
リンナイ	27,700	8,960.00	248,192,000
ダイニチ工業	7,700	659.00	5,074,300
日東精工	19,700	454.00	8,943,800
三洋工業	1,900	1,906.00	3,621,400
岡部	28,900	815.00	23,553,500
ジーテクト	17,700	1,012.00	17,912,400
東プレ	26,600	1,242.00	33,037,200
高周波熱錬	27,500	544.00	14,960,000
東京製綱	10,200	582.00	5,936,400
サンコール	10,700	436.00	4,665,200
モリテック スチール	11,100	326.00	3,618,600
パイオラックス	21,100	1,612.00	34,013,200
エイチワン	14,000	565.00	7,910,000
日本発條	153,100	687.00	105,179,700
中央発條	1,700	2,853.00	4,850,100
アドバネクス	2,000	1,316.00	2,632,000
立川ブラインド工業	6,300	1,269.00	7,994,700
三益半導体工業	11,100	2,310.00	25,641,000
日本ドライケミカル	3,600	1,673.00	6,022,800
日本製鋼所	43,400	1,525.00	66,185,000
三浦工業	61,800	4,470.00	276,246,000
タクマ	48,400	1,463.00	70,809,200
ツガミ	29,700	896.00	26,611,200
オークマ	16,700	4,530.00	75,651,000
芝浦機械	16,200	2,358.00	38,199,600
アマダ	177,100	884.00	156,556,400
アイダエンジニアリング	37,500	734.00	27,525,000
滝澤鉄工所	4,500	1,015.00	4,567,500
F U J I	61,400	1,874.00	115,063,600
牧野フライス製作所	16,800	3,340.00	56,112,000

オーエスジー	66,000	1,571.00	103,686,000
ダイジェット工業	1,700	1,247.00	2,119,900
旭ダイヤモンド工業	37,700	492.00	18,548,400
D M G 森精機	90,400	1,284.00	116,073,600
ソディック	33,600	813.00	27,316,800
ディスコ	19,300	25,800.00	497,940,000
日東工器	7,900	1,813.00	14,322,700
日進工具	5,600	2,704.00	15,142,400
パンチ工業	13,100	440.00	5,764,000
富士ダイス	6,400	641.00	4,102,400
豊和工業	8,000	802.00	6,416,000
O K K	5,800	416.00	2,412,800
東洋機械金属	10,400	417.00	4,336,800
津田駒工業	2,900	899.00	2,607,100
エンシュウ	3,600	921.00	3,315,600
島精機製作所	22,600	1,528.00	34,532,800
オプトラン	15,900	2,565.00	40,783,500
N C ホールディングス	4,500	538.00	2,421,000
イワキポンプ	9,200	988.00	9,089,600
フリー	14,000	1,026.00	14,364,000
ヤマシンフィルタ	31,100	1,090.00	33,899,000
日阪製作所	17,700	735.00	13,009,500
やまびこ	27,800	900.00	25,020,000
平田機工	6,800	5,600.00	38,080,000
ペガサスミシン製造	14,700	329.00	4,836,300
マルマエ	5,300	993.00	5,262,900
タツモ	6,700	1,663.00	11,142,100
ナプテスコ	84,100	3,325.00	279,632,500
三井海洋開発	15,200	1,506.00	22,891,200
レオン自動機	14,100	1,272.00	17,935,200
S M C	45,300	55,710.00	2,523,663,000
ホソカワミクロン	5,000	5,580.00	27,900,000
ユニオンツール	5,300	2,680.00	14,204,000
オイレス工業	18,500	1,414.00	26,159,000
日精エー・エス・ビー機械	4,200	3,230.00	13,566,000
サトーホールディングス	20,400	2,294.00	46,797,600
技研製作所	12,600	4,945.00	62,307,000
日本エアージェット	5,200	1,074.00	5,584,800
カワタ	4,300	719.00	3,091,700
日精樹脂工業	12,200	799.00	9,747,800
オカダアイヨン	4,600	931.00	4,282,600
ワイエイシーホールディングス	6,100	649.00	3,958,900

小松製作所	653,600	2,136.50	1,396,416,400
住友重機械工業	82,600	2,362.00	195,101,200
日立建機	57,900	2,913.00	168,662,700
日工	19,900	620.00	12,338,000
巴工業	6,200	1,917.00	11,885,400
井関農機	14,500	1,133.00	16,428,500
TOWA	14,600	1,166.00	17,023,600
丸山製作所	3,100	1,168.00	3,620,800
北川鉄工所	6,600	1,590.00	10,494,000
ローツェ	6,300	5,480.00	34,524,000
タカキタ	5,200	577.00	3,000,400
クボタ	765,500	1,628.50	1,246,616,750
荏原実業	3,700	2,830.00	10,471,000
三菱化工機	5,000	1,702.00	8,510,000
月島機械	26,700	1,156.00	30,865,200
帝国電機製作所	12,000	1,240.00	14,880,000
新東工業	34,400	802.00	27,588,800
澁谷工業	12,700	2,850.00	36,195,000
アイチ コーポレーション	25,100	746.00	18,724,600
小森コーポレーション	36,800	740.00	27,232,000
鶴見製作所	11,200	1,798.00	20,137,600
住友精密工業	2,200	2,255.00	4,961,000
日本ギア工業	6,100	282.00	1,720,200
酒井重工業	2,800	2,139.00	5,989,200
荏原製作所	59,800	2,531.00	151,353,800
石井鐵工所	1,900	2,415.00	4,588,500
西島製作所	14,700	792.00	11,642,400
北越工業	14,900	1,064.00	15,853,600
ダイキン工業	183,800	16,860.00	3,098,868,000
オルガノ	5,200	5,560.00	28,912,000
トーヨーカネツ	6,300	2,049.00	12,908,700
栗田工業	78,100	3,010.00	235,081,000
椿本チエイン	20,600	2,638.00	54,342,800
大同工業	7,100	670.00	4,757,000
木村化工機	12,300	433.00	5,325,900
アネスト岩田	22,500	833.00	18,742,500
ダイフク	73,700	9,440.00	695,728,000
サムコ	3,600	2,046.00	7,365,600
加藤製作所	8,000	1,183.00	9,464,000
油研工業	2,500	1,471.00	3,677,500
タダノ	69,800	895.00	62,471,000
フジテック	52,500	1,869.00	98,122,500

C K D	39,600	1,849.00	73,220,400
キトー	11,000	1,323.00	14,553,000
平和	40,300	1,803.00	72,660,900
理想科学工業	12,800	1,387.00	17,753,600
S A N K Y O	32,100	2,676.00	85,899,600
日本金銭機械	16,100	596.00	9,595,600
マースグループホールディングス	9,200	1,623.00	14,931,600
フクシマガリレイ	8,900	3,445.00	30,660,500
オーイズミ	6,300	399.00	2,513,700
ダイコク電機	6,700	1,291.00	8,649,700
竹内製作所	24,200	1,764.00	42,688,800
アマノ	37,800	2,294.00	86,713,200
J U K I	20,100	567.00	11,396,700
蛇の目マシン工業	13,300	459.00	6,104,700
マックス	22,100	1,525.00	33,702,500
グローリー	37,100	2,480.00	92,008,000
新晃工業	13,500	1,432.00	19,332,000
大和冷機工業	20,900	933.00	19,499,700
セガサミーホールディングス	143,200	1,296.00	185,587,200
日本ピストンリング	5,300	1,248.00	6,614,400
リケン	6,700	3,125.00	20,937,500
T P R	19,500	1,301.00	25,369,500
ツバキ・ナカシマ	29,500	871.00	25,694,500
ホシザキ	42,200	9,180.00	387,396,000
大豊工業	11,900	543.00	6,461,700
日本精工	271,700	794.00	215,729,800
N T N	334,300	215.00	71,874,500
ジェイテクト	138,500	828.00	114,678,000
不二越	13,400	3,325.00	44,555,000
日本トムソン	43,000	341.00	14,663,000
T H K	84,000	2,674.00	224,616,000
ユーシン精機	11,300	715.00	8,079,500
前澤給装工業	5,300	1,982.00	10,504,600
イーグル工業	17,900	724.00	12,959,600
前澤工業	9,800	347.00	3,400,600
日本ピラー工業	14,600	1,377.00	20,104,200
キッツ	58,600	677.00	39,672,200
マキタ	188,200	3,890.00	732,098,000
日立造船	114,800	391.00	44,886,800
三菱重工業	241,800	2,520.50	609,456,900
I H I	104,000	1,510.00	157,040,000
スター精密	22,300	1,232.00	27,473,600

日清紡ホールディングス	96,300	788.00	75,884,400
イビデン	88,500	3,115.00	275,677,500
コニカミノルタ	316,700	379.00	120,029,300
ブラザー工業	176,500	1,965.00	346,822,500
ミネベアミツミ	268,100	1,954.00	523,867,400
日立製作所	693,300	3,400.00	2,357,220,000
三菱電機	1,442,800	1,377.00	1,986,735,600
富士電機	87,000	2,864.00	249,168,000
東洋電機製造	5,300	1,167.00	6,185,100
安川電機	155,300	3,710.00	576,163,000
シンフォニアテクノロジー	18,800	1,058.00	19,890,400
明電舎	26,600	1,732.00	46,071,200
オリジン	4,000	1,461.00	5,844,000
山洋電気	7,100	4,645.00	32,979,500
デンヨー	12,400	1,827.00	22,654,800
東芝テック	18,100	4,150.00	75,115,000
芝浦メカトロニクス	2,800	2,789.00	7,809,200
マブチモーター	40,100	3,455.00	138,545,500
日本電産	347,300	6,965.00	2,418,944,500
トレックス・セミコンダクター	8,700	1,299.00	11,301,300
東光高岳	8,600	1,007.00	8,660,200
ダイヘン	15,800	3,720.00	58,776,000
ヤーマン	24,100	1,044.00	25,160,400
JVCケンウッド	120,900	169.00	20,432,100
ミマキエンジニアリング	14,400	379.00	5,457,600
第一精工	6,100	2,198.00	13,407,800
日新電機	33,900	1,029.00	34,883,100
大崎電気工業	28,900	502.00	14,507,800
オムロン	129,400	7,160.00	926,504,000
日東工業	21,300	1,849.00	39,383,700
I D E C	20,900	1,694.00	35,404,600
正興電機製作所	4,000	1,056.00	4,224,000
不二電機工業	2,800	1,319.00	3,693,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,500	1,861.00	90,258,500
サクサホールディングス	3,400	1,710.00	5,814,000
メルコホールディングス	5,200	3,005.00	15,626,000
テクノメディカ	3,600	1,800.00	6,480,000
日本電気	175,000	5,170.00	904,750,000
富士通	139,100	12,570.00	1,748,487,000
沖電気工業	58,700	1,022.00	59,991,400
岩崎通信機	6,300	836.00	5,266,800
電気興業	7,000	2,636.00	18,452,000

サンケン電気	15,800	2,223.00	35,123,400
ナカヨ	2,900	1,481.00	4,294,900
アイホン	8,200	1,565.00	12,833,000
ルネサスエレクトロニクス	691,100	602.00	416,042,200
セイコーエプソン	179,100	1,224.00	219,218,400
ワコム	98,000	561.00	54,978,000
アルバック	26,600	3,210.00	85,386,000
アクセル	6,800	789.00	5,365,200
E I Z O	11,200	4,060.00	45,472,000
日本信号	36,800	1,130.00	41,584,000
京三製作所	34,000	526.00	17,884,000
能美防災	19,400	2,036.00	39,498,400
ホーチキ	10,900	1,243.00	13,548,700
星和電機	8,100	584.00	4,730,400
エレコム	16,100	5,210.00	83,881,000
パナソニック	1,648,600	924.80	1,524,625,280
シャープ	167,100	1,163.00	194,337,300
アンリツ	92,900	2,554.00	237,266,600
富士通ゼネラル	39,200	2,170.00	85,064,000
ソニー	903,800	7,555.00	6,828,209,000
T D K	69,700	10,640.00	741,608,000
帝国通信工業	6,800	1,211.00	8,234,800
タムラ製作所	48,500	449.00	21,776,500
アルプスアルパイン	128,100	1,431.00	183,311,100
池上通信機	4,600	874.00	4,020,400
鈴木	7,800	752.00	5,865,600
日本トリム	2,100	3,255.00	6,835,500
ローランド ディー . ジー .	8,400	1,261.00	10,592,400
フォスター電機	15,300	1,115.00	17,059,500
S M K	3,700	2,511.00	9,290,700
ヨコオ	9,600	2,572.00	24,691,200
ホシデン	40,000	962.00	38,480,000
ヒロセ電機	22,400	11,860.00	265,664,000
日本航空電子工業	33,200	1,459.00	48,438,800
T O A	15,600	733.00	11,434,800
マクセルホールディングス	31,600	1,017.00	32,137,200
古野電気	19,200	953.00	18,297,600
ユニデンホールディングス	4,000	1,843.00	7,372,000
スミダコーポレーション	11,800	754.00	8,897,200
アイコム	8,000	3,025.00	24,200,000
リオン	6,300	2,297.00	14,471,100
本多通信工業	13,600	443.00	6,024,800

横河電機	132,400	1,656.00	219,254,400
新電元工業	5,200	2,207.00	11,476,400
アズビル	91,100	3,290.00	299,719,000
東亜ディーケーケー	7,800	888.00	6,926,400
日本光電工業	59,800	3,535.00	211,393,000
チノー	5,100	1,345.00	6,859,500
共和電業	15,400	412.00	6,344,800
日本電子材料	5,800	959.00	5,562,200
堀場製作所	28,600	5,550.00	158,730,000
アドバンテスト	107,300	5,980.00	641,654,000
小野測器	7,100	534.00	3,791,400
エスベック	13,100	1,740.00	22,794,000
キーエンス	130,700	44,740.00	5,847,518,000
日置電機	7,700	2,970.00	22,869,000
シスメックス	103,200	8,249.00	851,296,800
日本マイクロニクス	25,700	1,065.00	27,370,500
メガチップス	13,700	2,205.00	30,208,500
O B A R A G R O U P	8,600	3,250.00	27,950,000
澤藤電機	2,100	1,638.00	3,439,800
原田工業	7,500	814.00	6,105,000
コーセル	19,800	933.00	18,473,400
イリソ電子工業	12,300	3,490.00	42,927,000
オブテックスグループ	24,100	1,224.00	29,498,400
千代田インテグレ	7,000	1,655.00	11,585,000
アイ・オー・データ機器	5,200	1,136.00	5,907,200
レーザーテック	63,400	10,480.00	664,432,000
スタンレー電気	101,700	2,549.00	259,233,300
岩崎電気	5,900	2,008.00	11,847,200
ウシオ電機	80,100	1,329.00	106,452,900
岡谷電機産業	13,000	328.00	4,264,000
ハリオス テクノ ホールディング	15,000	331.00	4,965,000
エノモト	4,800	1,031.00	4,948,800
日本セラミック	14,900	2,272.00	33,852,800
遠藤照明	8,200	602.00	4,936,400
古河電池	10,700	1,481.00	15,846,700
双信電機	8,500	387.00	3,289,500
山一電機	10,800	1,422.00	15,357,600
図研	9,600	2,782.00	26,707,200
日本電子	28,600	2,969.00	84,913,400
カシオ計算機	127,700	1,828.00	233,435,600
ファナック	137,100	19,370.00	2,655,627,000
日本シイエムケイ	35,300	425.00	15,002,500

エンプラス	7,600	2,361.00	17,943,600
大真空	5,600	1,991.00	11,149,600
ローム	64,100	7,130.00	457,033,000
浜松ホトニクス	103,600	4,825.00	499,870,000
三井ハイテック	16,300	1,640.00	26,732,000
新光電気工業	48,800	1,469.00	71,687,200
京セラ	203,100	5,989.00	1,216,365,900
太陽誘電	64,300	3,350.00	215,405,000
村田製作所	423,900	6,387.00	2,707,449,300
双葉電子工業	23,400	997.00	23,329,800
北陸電気工業	6,400	902.00	5,772,800
ニチコン	49,700	734.00	36,479,800
日本ケミコン	11,000	1,745.00	19,195,000
K O A	22,300	1,001.00	22,322,300
市光工業	22,700	494.00	11,213,800
小糸製作所	86,600	4,300.00	372,380,000
ミツバ	27,800	452.00	12,565,600
S C R E E Nホールディングス	25,100	5,030.00	126,253,000
キャノン電子	15,500	1,650.00	25,575,000
キャノン	776,700	2,253.50	1,750,293,450
リコー	367,200	795.00	291,924,000
象印マホービン	42,600	1,477.00	62,920,200
M U T O Hホールディングス	2,200	1,537.00	3,381,400
東京エレクトロン	91,600	25,545.00	2,339,922,000
トヨタ紡織	42,100	1,448.00	60,960,800
芦森工業	3,100	1,049.00	3,251,900
ユニプレス	28,000	968.00	27,104,000
豊田自動織機	116,800	5,810.00	678,608,000
モリタホールディングス	25,300	1,784.00	45,135,200
三櫻工業	18,400	811.00	14,922,400
デンソー	317,700	4,104.00	1,303,840,800
東海理化電機製作所	38,000	1,560.00	59,280,000
三井E & Sホールディングス	52,100	428.00	22,298,800
川崎重工業	112,300	1,564.00	175,637,200
名村造船所	46,400	161.00	7,470,400
日本車輛製造	5,300	2,584.00	13,695,200
三菱ロジスネクスト	19,100	915.00	17,476,500
近畿車輛	2,200	1,226.00	2,697,200
日産自動車	1,701,600	404.90	688,977,840
いすゞ自動車	418,000	961.80	402,032,400
トヨタ自動車	1,609,800	6,795.00	10,938,591,000
日野自動車	180,200	718.00	129,383,600

三菱自動車工業	534,000	277.00	147,918,000
エフテック	10,200	513.00	5,232,600
レシップホールディングス	5,600	571.00	3,197,600
G M B	2,700	692.00	1,868,400
ファルテック	2,600	674.00	1,752,400
武蔵精密工業	32,200	938.00	30,203,600
日産車体	28,200	889.00	25,069,800
新明和工業	38,900	1,009.00	39,250,100
極東開発工業	26,800	1,302.00	34,893,600
日信工業	29,400	2,189.00	64,356,600
トピー工業	11,900	1,268.00	15,089,200
ティラド	5,300	1,409.00	7,467,700
曙ブレーキ工業	79,200	181.00	14,335,200
タチエス	23,800	875.00	20,825,000
N O K	77,600	1,326.00	102,897,600
フタバ産業	40,300	446.00	17,973,800
K Y B	16,100	2,079.00	33,471,900
大同メタル工業	27,800	543.00	15,095,400
プレス工業	71,800	279.00	20,032,200
ミクニ	18,600	278.00	5,170,800
太平洋工業	30,300	944.00	28,603,200
ケーヒン	33,200	2,525.00	83,830,000
河西工業	19,600	453.00	8,878,800
アイシン精機	118,800	3,150.00	374,220,000
マツダ	424,500	648.00	275,076,000
今仙電機製作所	13,500	735.00	9,922,500
本田技研工業	1,136,000	2,779.50	3,157,512,000
スズキ	286,000	3,733.00	1,067,638,000
S U B A R U	447,900	2,295.50	1,028,154,450
安永	7,000	1,102.00	7,714,000
ヤマハ発動機	188,100	1,681.00	316,196,100
ショーワ	34,100	2,224.00	75,838,400
T B K	17,300	441.00	7,629,300
エクセディ	19,600	1,621.00	31,771,600
豊田合成	46,600	2,245.00	104,617,000
愛三工業	22,700	538.00	12,212,600
盟和産業	2,300	935.00	2,150,500
日本プラスト	11,500	456.00	5,244,000
ヨロズ	13,500	1,082.00	14,607,000
エフ・シー・シー	23,600	1,880.00	44,368,000
シマノ	54,000	20,520.00	1,108,080,000
テイ・エス テック	33,500	2,978.00	99,763,000

ジャムコ	7,300	769.00	5,613,700
テルモ	408,300	4,172.00	1,703,427,600
クリエートメディック	4,800	980.00	4,704,000
日機装	43,300	1,038.00	44,945,400
日本エム・ディ・エム	8,300	1,699.00	14,101,700
島津製作所	172,400	2,852.00	491,684,800
JMS	12,200	826.00	10,077,200
長野計器	10,500	992.00	10,416,000
ブイ・テクノロジー	6,800	3,765.00	25,602,000
東京計器	9,200	960.00	8,832,000
愛知時計電機	1,900	4,460.00	8,474,000
インターアクション	7,800	2,030.00	15,834,000
オーバル	13,100	230.00	3,013,000
東京精密	26,200	3,435.00	89,997,000
マニー	57,500	2,853.00	164,047,500
ニコン	220,400	924.00	203,649,600
トプコン	72,700	866.00	62,958,200
オリンパス	798,300	2,132.50	1,702,374,750
理研計器	12,700	2,444.00	31,038,800
タムロン	11,600	1,853.00	21,494,800
HOYA	288,100	10,540.00	3,036,574,000
シード	6,200	719.00	4,457,800
ノーリツ鋼機	9,800	1,506.00	14,758,800
エー・アンド・デイ	13,200	709.00	9,358,800
朝日インテック	163,400	3,070.00	501,638,000
シチズン時計	169,100	355.00	60,030,500
リズム時計工業	4,600	605.00	2,783,000
大研医器	10,100	603.00	6,090,300
メニコン	20,400	5,320.00	108,528,000
シンシア	1,600	440.00	704,000
松風	6,500	1,535.00	9,977,500
セイコーホールディングス	20,400	1,718.00	35,047,200
ニプロ	99,900	1,174.00	117,282,600
中本パックス	3,700	1,528.00	5,653,600
スノーピーク	7,700	1,089.00	8,385,300
パラマウントベッドホールディングス	15,200	4,405.00	66,956,000
トランザクション	7,900	1,042.00	8,231,800
粧美堂	4,200	341.00	1,432,200
ニホンフラッシュ	13,500	1,404.00	18,954,000
前田工織	15,900	2,440.00	38,796,000
永大産業	18,900	308.00	5,821,200
アートネイチャー	15,400	595.00	9,163,000

バンダイナムコホールディングス	149,200	5,803.00	865,807,600	
アイフィスジャパン	3,700	721.00	2,667,700	
共立印刷	24,100	140.00	3,374,000	
S H O E I	12,600	2,599.00	32,747,400	
フランスベッドホールディングス	20,400	844.00	17,217,600	
パイロットコーポレーション	23,600	3,130.00	73,868,000	
萩原工業	8,000	1,423.00	11,384,000	
トッパン・フォームズ	30,900	1,064.00	32,877,600	
フジシールインターナショナル	32,300	2,040.00	65,892,000	
タカラトミー	64,700	849.00	54,930,300	
廣濟堂	10,000	777.00	7,770,000	
エステールホールディングス	3,800	600.00	2,280,000	
アーク	55,100	114.00	6,281,400	
タカノ	5,600	695.00	3,892,000	
プロネクサス	12,400	1,169.00	14,495,600	
ホクシン	8,900	124.00	1,103,600	
ウッドワン	4,800	1,140.00	5,472,000	
大建工業	9,700	1,776.00	17,227,200	
凸版印刷	203,600	1,814.00	369,330,400	
大日本印刷	188,800	2,431.00	458,972,800	
共同印刷	4,400	2,790.00	12,276,000	
N I S S H A	29,600	990.00	29,304,000	
光村印刷	1,300	1,502.00	1,952,600	
T A K A R A & C O M P A N Y	7,000	1,831.00	12,817,000	
アシックス	119,100	1,280.00	152,448,000	
ツツミ	4,500	1,853.00	8,338,500	
小松ウオール工業	4,400	1,765.00	7,766,000	
ヤマハ	85,800	5,030.00	431,574,000	
河合楽器製作所	4,400	2,710.00	11,924,000	
クリナップ	13,400	535.00	7,169,000	
ビジョン	87,200	4,210.00	367,112,000	
オリバー	3,100	2,480.00	7,688,000	
兼松サステック	900	1,450.00	1,305,000	
キングジム	12,000	869.00	10,428,000	
リンテック	34,300	2,479.00	85,029,700	
イトーキ	30,700	349.00	10,714,300	
任天堂	88,500	48,270.00	4,271,895,000	
三菱鉛筆	23,800	1,325.00	31,535,000	
タカラスタンド	29,800	1,478.00	44,044,400	
コクヨ	69,200	1,267.00	87,676,400	
ナカバヤシ	14,200	581.00	8,250,200	
グローブライド	6,500	2,122.00	13,793,000	

オカムラ	50,300	750.00	37,725,000
美津濃	13,100	2,161.00	28,309,100
東京電力ホールディングス	1,151,800	334.00	384,701,200
中部電力	441,400	1,372.00	605,600,800
関西電力	546,600	1,015.50	555,072,300
中国電力	208,100	1,441.00	299,872,100
北陸電力	131,900	672.00	88,636,800
東北電力	360,400	1,009.00	363,643,600
四国電力	129,900	780.00	101,322,000
九州電力	297,400	878.00	261,117,200
北海道電力	135,000	409.00	55,215,000
沖縄電力	28,100	1,761.00	49,484,100
電源開発	114,800	2,035.00	233,618,000
エフオン	7,800	582.00	4,539,600
イーレックス	20,600	1,375.00	28,325,000
レノバ	24,100	924.00	22,268,400
東京瓦斯	277,500	2,508.50	696,108,750
大阪瓦斯	280,000	2,109.00	590,520,000
東邦瓦斯	71,000	5,380.00	381,980,000
北海道瓦斯	7,700	1,587.00	12,219,900
広島ガス	29,700	356.00	10,573,200
西部瓦斯	16,200	2,607.00	42,233,400
静岡ガス	41,000	975.00	39,975,000
メタウォーター	7,000	4,780.00	33,460,000
SBSホールディングス	12,500	2,304.00	28,800,000
東武鉄道	150,400	3,690.00	554,976,000
相鉄ホールディングス	46,200	2,893.00	133,656,600
東急	363,900	1,533.00	557,858,700
京浜急行電鉄	185,300	1,703.00	315,565,900
小田急電鉄	214,600	2,701.00	579,634,600
京王電鉄	74,900	6,280.00	470,372,000
京成電鉄	100,400	3,400.00	341,360,000
富士急行	19,700	3,155.00	62,153,500
新京成電鉄	3,700	2,235.00	8,269,500
東日本旅客鉄道	253,900	7,600.00	1,929,640,000
西日本旅客鉄道	128,600	6,119.00	786,903,400
東海旅客鉄道	120,000	16,860.00	2,023,200,000
西武ホールディングス	193,600	1,221.00	236,385,600
鴻池運輸	23,000	1,115.00	25,645,000
西日本鉄道	40,000	2,919.00	116,760,000
ハマキョウレックス	11,100	3,085.00	34,243,500
サカイ引越センター	7,600	5,630.00	42,788,000

近鉄グループホールディングス	136,600	4,890.00	667,974,000
阪急阪神ホールディングス	182,200	3,635.00	662,297,000
南海電気鉄道	64,800	2,488.00	161,222,400
京阪ホールディングス	60,800	4,810.00	292,448,000
神戸電鉄	3,300	3,725.00	12,292,500
名古屋鉄道	112,300	3,050.00	342,515,000
山陽電気鉄道	9,800	2,173.00	21,295,400
日本通運	47,300	5,480.00	259,204,000
ヤマトホールディングス	239,500	2,345.00	561,627,500
山九	38,000	4,090.00	155,420,000
丸運	7,800	230.00	1,794,000
丸全昭和運輸	11,100	3,215.00	35,686,500
センコーグループホールディングス	75,300	796.00	59,938,800
トナミホールディングス	3,300	5,700.00	18,810,000
ニッコンホールディングス	48,900	2,118.00	103,570,200
日本石油輸送	1,500	3,080.00	4,620,000
福山通運	17,500	3,705.00	64,837,500
セイノーホールディングス	102,300	1,396.00	142,810,800
エスライン	4,100	991.00	4,063,100
神奈川中央交通	3,400	4,165.00	14,161,000
日立物流	25,000	2,882.00	72,050,000
丸和運輸機関	14,400	2,998.00	43,171,200
C & F ロジホールディングス	13,800	1,529.00	21,100,200
九州旅客鉄道	119,800	2,867.00	343,466,600
S Gホールディングス	143,400	3,560.00	510,504,000
日本郵船	114,900	1,500.00	172,350,000
商船三井	86,900	1,898.00	164,936,200
川崎汽船	42,100	1,070.00	45,047,000
N S ユナイテッド海運	8,200	1,508.00	12,365,600
飯野海運	67,500	338.00	22,815,000
共栄タンカー	3,600	809.00	2,912,400
乾汽船	7,900	872.00	6,888,800
日本航空	241,600	1,975.50	477,280,800
A N A ホールディングス	249,800	2,475.00	618,255,000
パスコ	2,600	1,533.00	3,985,800
トランコム	3,800	7,050.00	26,790,000
日新	11,800	1,602.00	18,903,600
三菱倉庫	43,300	2,674.00	115,784,200
三井倉庫ホールディングス	15,600	1,492.00	23,275,200
住友倉庫	49,100	1,274.00	62,553,400
澁澤倉庫	7,500	2,005.00	15,037,500
東陽倉庫	24,700	329.00	8,126,300

日本トランスシティ	30,100	482.00	14,508,200
ケイヒン	2,600	1,291.00	3,356,600
中央倉庫	8,300	942.00	7,818,600
川西倉庫	2,500	1,021.00	2,552,500
安田倉庫	11,200	896.00	10,035,200
ファイブホールディングス	2,900	1,096.00	3,178,400
東洋埠頭	4,200	1,344.00	5,644,800
宇徳	11,700	551.00	6,446,700
上組	76,200	2,074.00	158,038,800
サンリツ	3,200	593.00	1,897,600
キムラユニティ	3,600	1,020.00	3,672,000
キューソー流通システム	3,400	1,605.00	5,457,000
近鉄エクスプレス	29,000	1,849.00	53,621,000
東海運	7,800	276.00	2,152,800
エーアイティー	9,600	751.00	7,209,600
内外トランスライン	4,800	970.00	4,656,000
日本コンセプト	4,300	1,240.00	5,332,000
NEC ネットエスアイ	40,300	2,156.00	86,886,800
クロスキャット	4,000	1,297.00	5,188,000
システナ	50,700	1,479.00	74,985,300
デジタルアーツ	7,000	9,000.00	63,000,000
日鉄ソリューションズ	21,300	2,922.00	62,238,600
キューブシステム	7,900	861.00	6,801,900
エイジア	2,800	1,525.00	4,270,000
コア	6,300	1,212.00	7,635,600
ラクーンホールディングス	6,700	983.00	6,586,100
ソリトンシステムズ	6,400	1,534.00	9,817,600
ソフトクリエイティブホールディングス	6,300	2,292.00	14,439,600
T I S	141,700	2,265.00	320,950,500
ネオス	5,700	724.00	4,126,800
電算システム	5,500	3,835.00	21,092,500
グリー	87,600	492.00	43,099,200
コーエーテクモホールディングス	29,100	3,475.00	101,122,500
三菱総合研究所	6,200	4,110.00	25,482,000
電算	1,700	2,252.00	3,828,400
A G S	8,400	864.00	7,257,600
ファインデックス	12,300	1,087.00	13,370,100
ブレインパッド	3,700	4,715.00	17,445,500
K L a b	27,400	747.00	20,467,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	17,500	927.00	16,222,500
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	3,170.00	6,974,000
ネクソン	395,000	2,560.00	1,011,200,000

アイスタイル	40,800	286.00	11,668,800
エムアップホールディングス	4,200	2,423.00	10,176,600
エイチーム	10,100	880.00	8,888,000
エニグモ	13,700	1,230.00	16,851,000
テクノスジャパン	11,500	719.00	8,268,500
コロプラ	46,800	1,005.00	47,034,000
ブロードリーフ	70,800	544.00	38,515,200
クロス・マーケティンググループ	7,300	375.00	2,737,500
デジタルハーツホールディングス	7,900	888.00	7,015,200
システム情報	10,900	1,551.00	16,905,900
メディアドゥ	4,500	4,625.00	20,812,500
じげん	36,000	358.00	12,888,000
エンカレッジ・テクノロジー	3,500	848.00	2,968,000
サイバーリンクス	2,400	2,309.00	5,541,600
フィックスターズ	15,300	1,362.00	20,838,600
CARTA HOLDINGS	7,100	1,318.00	9,357,800
オブティム	7,500	3,410.00	25,575,000
セレス	4,900	1,142.00	5,595,800
SHIFT	5,700	11,150.00	63,555,000
ティーガイア	12,700	2,051.00	26,047,700
セック	2,200	3,155.00	6,941,000
日本アジアグループ	14,900	305.00	4,544,500
テクマトリックス	10,100	3,795.00	38,329,500
プロシップ	4,400	1,373.00	6,041,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,300	1,971.00	67,605,300
GMOペイメントゲートウェイ	30,000	11,780.00	353,400,000
ザッパラス	7,000	394.00	2,758,000
システムリサーチ	3,900	2,105.00	8,209,500
インターネットイニシアティブ	21,000	3,700.00	77,700,000
さくらインターネット	15,700	697.00	10,942,900
ヴィンクス	4,200	1,384.00	5,812,800
GMOクラウド	2,700	10,660.00	28,782,000
SRAホールディングス	7,700	2,391.00	18,410,700
システムインテグレータ	4,800	1,001.00	4,804,800
朝日ネット	10,300	1,354.00	13,946,200
eBASE	17,200	1,392.00	23,942,400
アバント	13,800	1,052.00	14,517,600
アドソル日進	5,100	2,460.00	12,546,000
フリービット	7,800	748.00	5,834,400
コムチュア	16,000	2,873.00	45,968,000
サイバーコム	2,700	1,837.00	4,959,900
アステリア	9,300	528.00	4,910,400

アイル	8,100	1,636.00	13,251,600
マークライنز	7,200	2,314.00	16,660,800
メディカル・データ・ビジョン	11,100	1,302.00	14,452,200
ショーケース	3,900	742.00	2,893,800
モバイルファクトリー	3,500	1,147.00	4,014,500
テラスカイ	5,200	3,035.00	15,782,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,800	1,455.00	8,439,000
P C Iホールディングス	5,600	1,218.00	6,820,800
パイプドHD	2,000	1,678.00	3,356,000
アイビーシー	2,600	1,018.00	2,646,800
ネオジャパン	2,800	2,400.00	6,720,000
P R T I M E S	1,300	2,950.00	3,835,000
ランドコンピュータ	2,500	1,102.00	2,755,000
ダブルスタンダード	1,900	5,030.00	9,557,000
オープンドア	7,300	1,446.00	10,555,800
マイネット	4,600	1,143.00	5,257,800
アカツキ	5,100	4,055.00	20,680,500
ベネフィットジャパン	1,300	1,492.00	1,939,600
U b i c o mホールディングス	3,300	2,278.00	7,517,400
L I N E	32,500	5,390.00	175,175,000
カナミックネットワーク	13,300	1,126.00	14,975,800
ノムラシステムコーポレーション	3,700	692.00	2,560,400
チェンジ	5,000	7,760.00	38,800,000
シンクロ・フード	7,000	363.00	2,541,000
オークネット	9,000	1,067.00	9,603,000
セグエグループ	3,500	866.00	3,031,000
エイトレッド	2,500	2,095.00	5,237,500
A O I T Y O H o l d i n g s	15,000	473.00	7,095,000
マクロミル	29,400	769.00	22,608,600
ビーグリー	2,900	1,929.00	5,594,100
オロ	3,800	2,825.00	10,735,000
ユーザーローカル	1,500	3,560.00	5,340,000
テモナ	3,400	1,010.00	3,434,000
ニーズウェル	3,100	748.00	2,318,800
サインポスト	3,100	1,859.00	5,762,900
ソルクシーズ	6,500	761.00	4,946,500
フェイス	5,500	683.00	3,756,500
プロトコーポレーション	13,000	1,066.00	13,858,000
ハイマックス	1,800	2,000.00	3,600,000
野村総合研究所	200,800	2,930.00	588,344,000
サイバネットシステム	10,600	704.00	7,462,400
C Eホールディングス	8,100	593.00	4,803,300

日本システム技術	2,500	1,862.00	4,655,000
インテージホールディングス	18,100	886.00	16,036,600
東邦システムサイエンス	4,100	972.00	3,985,200
ソースネクスト	68,300	280.00	19,124,000
インフォコム	15,600	3,035.00	47,346,000
HEROZ	2,100	3,795.00	7,969,500
ラクスル	11,400	3,075.00	35,055,000
F I G	16,500	284.00	4,686,000
システムサポート	3,300	2,276.00	7,510,800
イーソル	7,000	1,291.00	9,037,000
アルテリア・ネットワークス	15,900	1,990.00	31,641,000
東海ソフト	1,200	1,520.00	1,824,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,014.00	2,737,800
トピラシステムズ	1,800	1,897.00	3,414,600
フォーカスシステムズ	9,100	897.00	8,162,700
クレスコ	8,800	1,538.00	13,534,400
フジ・メディア・ホールディングス	136,700	1,040.00	142,168,000
オービック	49,100	19,310.00	948,121,000
ジャストシステム	23,100	7,690.00	177,639,000
T D C ソフト	12,800	919.00	11,763,200
Zホールディングス	1,944,900	540.00	1,050,246,000
トレンドマイクロ	63,000	5,940.00	374,220,000
I Dホールディングス	5,600	1,469.00	8,226,400
日本オラクル	28,700	12,260.00	351,862,000
アルファシステムズ	4,500	3,820.00	17,190,000
フューチャー	17,300	1,743.00	30,153,900
C A C H o l d i n g s	9,500	1,269.00	12,055,500
S Bテクノロジー	5,200	3,440.00	17,888,000
トーセ	4,200	853.00	3,582,600
オービックビジネスコンサルタント	14,500	5,880.00	85,260,000
伊藤忠テクノソリューションズ	64,600	4,110.00	265,506,000
アイティフォー	17,600	741.00	13,041,600
東計電算	2,200	4,440.00	9,768,000
エクスネット	2,600	970.00	2,522,000
大塚商会	76,700	5,600.00	429,520,000
サイボウズ	16,600	3,470.00	57,602,000
ソフトブレーン	9,100	458.00	4,167,800
電通国際情報サービス	8,800	4,990.00	43,912,000
A C C E S S	13,600	1,022.00	13,899,200
デジタルガレージ	25,600	3,580.00	91,648,000
E Mシステムズ	20,300	995.00	20,198,500
ウェザーニューズ	4,900	3,635.00	17,811,500

C I J	10,000	890.00	8,900,000
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,651.00	4,506,700
日本エンタープライズ	15,700	258.00	4,050,600
WOWOW	6,900	2,408.00	16,615,200
スカラ	9,900	738.00	7,306,200
インテリジェント ウェイブ	8,700	836.00	7,273,200
I M A G I C A G R O U P	12,900	385.00	4,966,500
ネットワンシステムズ	54,000	3,685.00	198,990,000
システムソフト	33,800	101.00	3,413,800
アルゴグラフィックス	12,100	3,560.00	43,076,000
マーベラス	22,100	740.00	16,354,000
エイベックス	24,700	854.00	21,093,800
日本ユニシス	44,300	3,395.00	150,398,500
兼松エレクトロニクス	7,800	3,795.00	29,601,000
東京放送ホールディングス	86,300	1,739.00	150,075,700
日本テレビホールディングス	118,500	1,181.00	139,948,500
朝日放送グループホールディングス	14,500	773.00	11,208,500
テレビ朝日ホールディングス	39,100	1,569.00	61,347,900
スカパーJ S A Tホールディングス	93,900	446.00	41,879,400
テレビ東京ホールディングス	11,700	2,384.00	27,892,800
日本BS放送	5,100	1,066.00	5,436,600
ビジョン	13,600	746.00	10,145,600
スマートバリュー	4,000	1,236.00	4,944,000
ワイヤレスゲート	7,200	719.00	5,176,800
コネクシオ	8,300	1,415.00	11,744,500
クロップス	3,000	725.00	2,175,000
日本電信電話	1,892,600	2,491.00	4,714,466,600
K D D I	1,055,200	3,170.00	3,344,984,000
ソフトバンク	1,286,900	1,382.50	1,779,139,250
光通信	14,600	24,440.00	356,824,000
N T T ドコモ	1,012,500	2,899.50	2,935,743,750
エムティーアイ	14,200	663.00	9,414,600
G M O インターネット	55,900	3,100.00	173,290,000
ファイバーゲート	4,800	1,519.00	7,291,200
アйдママーケティングコミュニケーション	4,900	475.00	2,327,500
K A D O K A W A	38,300	2,049.00	78,476,700
学研ホールディングス	19,200	1,459.00	28,012,800
ゼンリン	28,500	1,228.00	34,998,000
昭文社ホールディングス	7,400	406.00	3,004,400
インプレスホールディングス	11,700	153.00	1,790,100
アイネット	7,500	1,508.00	11,310,000
松竹	9,400	14,880.00	139,872,000

東宝	83,600	3,840.00	321,024,000
東映	5,300	14,500.00	76,850,000
エヌ・ティ・ティ・データ	377,200	1,210.00	456,412,000
ピー・シー・エー	2,500	4,585.00	11,462,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,600	2,532.00	6,583,200
D T S	31,800	2,295.00	72,981,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,400	5,450.00	329,180,000
シーイーシー	15,400	1,782.00	27,442,800
カブコン	66,800	4,005.00	267,534,000
アイ・エス・ピー	2,900	2,263.00	6,562,700
ジャステック	9,300	1,187.00	11,039,100
S C S K	32,700	5,260.00	172,002,000
日本システムウエア	4,800	2,300.00	11,040,000
アイネス	14,200	1,388.00	19,709,600
T K C	12,000	5,640.00	67,680,000
富士ソフト	18,200	4,315.00	78,533,000
N S D	45,700	1,841.00	84,133,700
コナミホールディングス	51,500	3,540.00	182,310,000
福井コンピュータホールディングス	5,700	2,792.00	15,914,400
J B C Cホールディングス	9,800	1,530.00	14,994,000
ミロク情報サービス	12,600	2,360.00	29,736,000
ソフトバンクグループ	1,123,400	5,370.00	6,032,658,000
ハウスイ	1,200	884.00	1,060,800
高千穂交易	5,500	949.00	5,219,500
カワニシホールディングス	1,700	1,450.00	2,465,000
伊藤忠食品	3,500	5,210.00	18,235,000
エレマテック	13,300	883.00	11,743,900
J A L U X	4,000	1,762.00	7,048,000
あらた	11,300	4,645.00	52,488,500
トーマンデバイス	2,100	3,680.00	7,728,000
東京エレクトロン デバイス	5,200	2,863.00	14,887,600
フィールズ	10,900	344.00	3,749,600
双日	784,800	236.00	185,212,800
アルフレッサ ホールディングス	157,900	2,194.00	346,432,600
横浜冷凍	37,200	889.00	33,070,800
ラサ商事	7,500	892.00	6,690,000
アルコニックス	15,100	1,134.00	17,123,400
神戸物産	49,000	6,180.00	302,820,000
ハイパー	2,200	592.00	1,302,400
あい ホールディングス	20,300	1,548.00	31,424,400
ディーブイエックス	5,100	780.00	3,978,000
ダイワボウホールディングス	12,100	7,310.00	88,451,000

マクニカ・富士エレホールディングス	33,900	1,523.00	51,629,700
ラクト・ジャパン	5,300	3,690.00	19,557,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,800	1,025.00	27,470,000
八洲電機	11,000	922.00	10,142,000
メディアスホールディングス	8,100	907.00	7,346,700
レスターホールディングス	14,800	2,068.00	30,606,400
ジュテックホールディングス	3,300	1,055.00	3,481,500
大光	6,100	670.00	4,087,000
OCHIホールディングス	4,100	1,477.00	6,055,700
TOKAIホールディングス	75,100	993.00	74,574,300
黒谷	3,900	518.00	2,020,200
Cominix	2,500	722.00	1,805,000
三洋貿易	14,300	1,010.00	14,443,000
ビューティガレージ	2,300	1,675.00	3,852,500
ウイン・パートナーズ	10,300	961.00	9,898,300
ミタチ産業	4,300	603.00	2,592,900
シップヘルスケアホールディングス	22,800	4,335.00	98,838,000
明治電機工業	4,500	1,367.00	6,151,500
デリカフーズホールディングス	5,000	620.00	3,100,000
スターティアホールディングス	3,300	624.00	2,059,200
コメダホールディングス	31,000	1,836.00	56,916,000
ピーバンドットコム	1,400	1,002.00	1,402,800
アセンテック	1,500	3,270.00	4,905,000
富士興産	4,400	448.00	1,971,200
協栄産業	1,600	1,133.00	1,812,800
小野建	12,800	1,224.00	15,667,200
南陽	3,100	1,451.00	4,498,100
佐島電機	9,700	829.00	8,041,300
エコートレーディング	3,300	528.00	1,742,400
伯東	8,700	998.00	8,682,600
コンドーテック	11,000	1,118.00	12,298,000
中山福	8,200	511.00	4,190,200
ナガイレーベン	18,900	2,600.00	49,140,000
三菱食品	15,600	2,687.00	41,917,200
松田産業	10,400	1,334.00	13,873,600
第一興商	21,200	3,250.00	68,900,000
メディバルホールディングス	153,400	2,039.00	312,782,600
SPK	6,100	1,407.00	8,582,700
萩原電気ホールディングス	5,300	2,050.00	10,865,000
アズワン	9,300	11,740.00	109,182,000
スズデン	4,900	1,190.00	5,831,000
尾家産業	4,200	1,514.00	6,358,800

シモジマ	8,700	1,179.00	10,257,300
ドウシシャ	13,400	1,546.00	20,716,400
小津産業	3,100	1,782.00	5,524,200
高速	8,500	1,469.00	12,486,500
たけびし	5,000	1,499.00	7,495,000
リックス	3,200	1,542.00	4,934,400
丸文	12,600	474.00	5,972,400
ハピネット	11,900	1,149.00	13,673,100
橋本総業ホールディングス	2,900	2,051.00	5,947,900
日本ライフライン	42,100	1,401.00	58,982,100
タカショー	9,300	483.00	4,491,900
マルカ	5,000	1,920.00	9,600,000
I D O M	38,400	492.00	18,892,800
進和	8,400	1,940.00	16,296,000
エスケイジャパン	3,100	310.00	961,000
ダイトロン	6,000	1,675.00	10,050,000
シークス	18,100	1,009.00	18,262,900
田中商事	4,400	697.00	3,066,800
オーハシテクニカ	8,000	1,570.00	12,560,000
白銅	5,100	1,379.00	7,032,900
伊藤忠商事	993,900	2,296.00	2,281,994,400
丸紅	1,479,100	489.60	724,167,360
高島	2,300	1,784.00	4,103,200
長瀬産業	79,900	1,317.00	105,228,300
蝶理	9,100	1,815.00	16,516,500
豊田通商	158,600	2,691.00	426,792,600
三共生興	21,600	435.00	9,396,000
兼松	53,000	1,252.00	66,356,000
ツカモトコーポレーション	2,600	1,125.00	2,925,000
三井物産	1,230,400	1,591.50	1,958,181,600
日本紙パルプ商事	8,100	3,875.00	31,387,500
カメイ	18,500	1,025.00	18,962,500
東都水産	1,800	3,280.00	5,904,000
O U Gホールディングス	2,300	2,656.00	6,108,800
スターゼン	5,300	4,190.00	22,207,000
山善	55,500	900.00	49,950,000
椿本興業	2,600	3,785.00	9,841,000
住友商事	896,600	1,235.50	1,107,749,300
内田洋行	5,600	6,090.00	34,104,000
三菱商事	997,200	2,263.50	2,257,162,200
第一実業	7,000	3,650.00	25,550,000
キャノンマーケティングジャパン	35,200	2,225.00	78,320,000

西華産業	8,100	1,224.00	9,914,400
佐藤商事	11,700	837.00	9,792,900
菱洋エレクトロ	14,400	2,779.00	40,017,600
東京産業	12,900	520.00	6,708,000
ユアサ商事	13,500	2,876.00	38,826,000
神鋼商事	3,600	2,001.00	7,203,600
トルク	8,500	316.00	2,686,000
阪和興業	26,600	1,935.00	51,471,000
正栄食品工業	9,200	4,185.00	38,502,000
カナデン	11,600	1,306.00	15,149,600
菱電商事	10,200	1,480.00	15,096,000
フルサト工業	7,900	1,380.00	10,902,000
岩谷産業	31,500	3,755.00	118,282,500
ナイス	6,100	808.00	4,928,800
昭光通商	4,500	618.00	2,781,000
ニチモウ	2,200	1,867.00	4,107,400
極東貿易	4,100	1,360.00	5,576,000
イワキ	18,700	500.00	9,350,000
三愛石油	35,000	984.00	34,440,000
稲畑産業	31,300	1,275.00	39,907,500
G S Iクレオス	3,500	1,235.00	4,322,500
明和産業	13,200	465.00	6,138,000
クワザワ	5,100	529.00	2,697,900
ヤマエ久野	10,400	1,174.00	12,209,600
ワキタ	30,300	943.00	28,572,900
東邦ホールディングス	45,600	1,989.00	90,698,400
サンゲツ	38,700	1,495.00	57,856,500
ミツウロコグループホールディングス	21,000	1,160.00	24,360,000
シナネンホールディングス	5,900	2,746.00	16,201,400
伊藤忠エネクス	31,400	847.00	26,595,800
サンリオ	39,900	1,693.00	67,550,700
サンワテクノス	10,100	892.00	9,009,200
リョーサン	15,700	2,190.00	34,383,000
新光商事	22,300	834.00	18,598,200
トーホー	6,400	1,898.00	12,147,200
三信電気	7,600	1,485.00	11,286,000
東陽テクニカ	15,200	1,007.00	15,306,400
モスフードサービス	18,600	3,010.00	55,986,000
加賀電子	14,200	1,978.00	28,087,600
ソーダニッカ	14,700	511.00	7,511,700
立花エレテック	10,500	1,739.00	18,259,500
フォーバル	6,200	980.00	6,076,000

PAL TAC	22,800	4,955.00	112,974,000
三谷産業	18,800	336.00	6,316,800
西本Wismettacホールディングス	2,600	2,071.00	5,384,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,855.00	2,411,500
国際紙パルプ商事	33,700	276.00	9,301,200
ヤマタネ	7,100	1,177.00	8,356,700
丸紅建材リース	1,400	1,575.00	2,205,000
日鉄物産	10,100	3,425.00	34,592,500
泉州電業	4,400	2,884.00	12,689,600
トラスコ中山	29,600	2,773.00	82,080,800
オートバックスセブン	52,700	1,381.00	72,778,700
モリト	10,400	663.00	6,895,200
加藤産業	20,500	3,495.00	71,647,500
北恵	3,600	938.00	3,376,800
イノテック	7,400	971.00	7,185,400
イエローハット	26,900	1,487.00	40,000,300
J Kホールディングス	12,900	785.00	10,126,500
日伝	12,900	2,361.00	30,456,900
北沢産業	10,800	277.00	2,991,600
杉本商事	7,700	1,802.00	13,875,400
因幡電機産業	40,400	2,370.00	95,748,000
東テク	4,700	2,137.00	10,043,900
ミスミグループ本社	178,100	2,750.00	489,775,000
アルテック	11,400	228.00	2,599,200
タキヒヨー	4,300	1,840.00	7,912,000
蔵王産業	2,800	1,416.00	3,964,800
スズケン	60,200	3,915.00	235,683,000
ジェコス	9,800	914.00	8,957,200
グローセル	14,300	455.00	6,506,500
ローソン	36,000	5,530.00	199,080,000
サンエー	11,900	4,000.00	47,600,000
カワチ薬品	11,100	2,674.00	29,681,400
エービーシー・マート	22,200	6,410.00	142,302,000
ハードオフコーポレーション	6,000	702.00	4,212,000
アスクル	14,900	3,580.00	53,342,000
ゲオホールディングス	25,800	1,312.00	33,849,600
アダストリア	19,800	1,851.00	36,649,800
ジーフット	8,600	490.00	4,214,000
くら寿司	7,500	5,340.00	40,050,000
キャンドウ	6,900	2,131.00	14,703,900
パルグループホールディングス	14,700	1,336.00	19,639,200
エディオン	65,400	1,113.00	72,790,200

サーラコーポレーション	29,200	555.00	16,206,000	
ワッツ	6,500	926.00	6,019,000	
ハローズ	5,400	3,580.00	19,332,000	
フジオフードシステム	12,100	1,582.00	19,142,200	
あみやき亭	3,100	3,160.00	9,796,000	
ひらまつ	26,100	183.00	4,776,300	
大黒天物産	3,500	4,595.00	16,082,500	
ハニーズホールディングス	12,700	1,095.00	13,906,500	
ファーマライズホールディングス	3,800	675.00	2,565,000	
アルペン	11,000	1,768.00	19,448,000	
ハブ	4,300	715.00	3,074,500	
クオールホールディングス	21,100	1,134.00	23,927,400	
ジーンズホールディングス	7,600	6,750.00	51,300,000	
ビックカメラ	84,500	1,168.00	98,696,000	
D C Mホールディングス	78,900	1,158.00	91,366,200	
Monotaro	101,100	4,370.00	441,807,000	
東京一番フーズ	4,000	506.00	2,024,000	
D Dホールディングス	5,600	1,005.00	5,628,000	
きちりホールディングス	4,100	629.00	2,578,900	
アークランドサービスホールディングス	10,500	1,984.00	20,832,000	
J . フロント リテイリング	169,900	810.00	137,619,000	
ドトール・日レスホールディングス	20,600	1,726.00	35,555,600	
マツモトキヨシホールディングス	58,800	3,920.00	230,496,000	
ブロンコビリー	7,500	2,585.00	19,387,500	
Z O Z O	97,800	2,411.00	235,795,800	
トレジャー・ファクトリー	4,400	796.00	3,502,400	
物語コーポレーション	3,800	8,490.00	32,262,000	
ココカラファイン	14,900	5,790.00	86,271,000	
三越伊勢丹ホールディングス	248,800	658.00	163,710,400	
Hamee	5,200	1,697.00	8,824,400	
ウエルシアホールディングス	42,300	8,840.00	373,932,000	
クリエイトSDホールディングス	24,000	3,275.00	78,600,000	
丸善CHIホールディングス	16,600	394.00	6,540,400	
ティーライフ	2,300	1,015.00	2,334,500	
チムニー	4,500	1,480.00	6,660,000	
シュッピン	10,000	716.00	7,160,000	
オイシックス・ラ・大地	14,100	2,174.00	30,653,400	
ネクステージ	20,600	852.00	17,551,200	
ジョイフル本田	41,800	1,391.00	58,143,800	
鳥貴族	4,300	1,587.00	6,824,100	
麒麟堂ホールディングス	5,700	2,445.00	13,936,500	
ホットランド	9,600	1,231.00	11,817,600	

すかいらーくホールディングス	159,400	1,796.00	286,282,400
SFPホールディングス	8,200	1,601.00	13,128,200
綿半ホールディングス	5,400	1,881.00	10,157,400
ヨシックス	2,400	2,025.00	4,860,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,500	1,111.00	46,106,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	569.00	3,983,000
B E E N O S	6,800	1,032.00	7,017,600
あさひ	10,700	1,469.00	15,718,300
日本調剤	8,800	1,589.00	13,983,200
コスモス薬品	12,600	16,710.00	210,546,000
トーエル	7,200	701.00	5,047,200
オンリー	2,800	602.00	1,685,600
セブン&アイ・ホールディングス	555,900	3,482.00	1,935,643,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,700	749.00	57,448,300
ツルハホールディングス	30,900	14,880.00	459,792,000
サンマルクホールディングス	11,400	1,673.00	19,072,200
フェリシモ	3,400	1,083.00	3,682,200
トリドールホールディングス	35,300	1,258.00	44,407,400
T O K Y O B A S E	13,400	377.00	5,051,800
ウイルプラスホールディングス	2,100	710.00	1,491,000
J Mホールディングス	10,800	2,884.00	31,147,200
サツドラホールディングス	2,200	1,972.00	4,338,400
アレンザホールディングス	7,300	959.00	7,000,700
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,705.00	5,115,000
パロックジャパンリミテッド	10,200	681.00	6,946,200
クスリのアオキホールディングス	12,700	8,920.00	113,284,000
力の源ホールディングス	6,800	700.00	4,760,000
スシローグローバルホールディングス	78,100	2,431.00	189,861,100
L I X I L ビバ	14,100	2,596.00	36,603,600
メディカルシステムネットワーク	14,200	503.00	7,142,600
はるやまホールディングス	7,000	745.00	5,215,000
ノジマ	25,400	2,596.00	65,938,400
カップ・クリエイト	19,900	1,491.00	29,670,900
ライトオン	10,600	582.00	6,169,200
良品計画	188,800	1,550.00	292,640,000
三城ホールディングス	15,800	295.00	4,661,000
アドヴァン	21,900	1,314.00	28,776,600
アルビス	5,500	2,120.00	11,660,000
コナカ	17,500	301.00	5,267,500
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,606.00	3,051,400
G - 7ホールディングス	8,500	2,415.00	20,527,500

イオン北海道	18,900	798.00	15,082,200
コジマ	24,800	574.00	14,235,200
ヒマラヤ	5,200	819.00	4,258,800
コーナン商事	20,300	3,265.00	66,279,500
エコス	5,300	1,866.00	9,889,800
ワタミ	17,000	1,002.00	17,034,000
マルシェ	4,100	604.00	2,476,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	312,400	2,390.00	746,636,000
西松屋チェーン	31,400	1,147.00	36,015,800
ゼンショーホールディングス	68,200	2,227.00	151,881,400
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,595.00	14,514,500
ハークスレイ	3,200	1,107.00	3,542,400
サイゼリヤ	21,200	2,134.00	45,240,800
V Tホールディングス	59,500	347.00	20,646,500
魚力	4,100	1,610.00	6,601,000
フジ・コーポレーション	3,900	1,993.00	7,772,700
ユナイテッドアローズ	15,000	1,865.00	27,975,000
ハイデイ日高	20,600	1,788.00	36,832,800
京都きもの友禅	10,000	281.00	2,810,000
コロワイド	47,200	1,527.00	72,074,400
ピーシーデポコーポレーション	19,200	762.00	14,630,400
壱番屋	10,100	5,010.00	50,601,000
P L A N T	4,000	570.00	2,280,000
スギホールディングス	28,400	7,330.00	208,172,000
薬王堂ホールディングス	6,300	2,565.00	16,159,500
スクロール	22,400	452.00	10,124,800
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,772.00	25,871,200
ファミリーマート	113,600	1,841.00	209,137,600
木曽路	18,700	2,507.00	46,880,900
S R Sホールディングス	17,000	919.00	15,623,000
タカキュー	11,000	139.00	1,529,000
リテールパートナーズ	18,900	1,659.00	31,355,100
ケーヨー	29,400	673.00	19,786,200
上新電機	16,800	2,122.00	35,649,600
日本瓦斯	22,500	4,460.00	100,350,000
ロイヤルホールディングス	24,900	1,980.00	49,302,000
いなげや	17,700	1,721.00	30,461,700
島忠	26,800	2,920.00	78,256,000
チヨダ	15,100	1,182.00	17,848,200
ライフコーポレーション	10,800	3,330.00	35,964,000
リンガーハット	17,600	2,440.00	42,944,000
Mr M a x H D	20,000	548.00	10,960,000

テンアライド	13,100	384.00	5,030,400
AOKIホールディングス	28,800	639.00	18,403,200
オークワ	22,400	1,655.00	37,072,000
コメリ	22,000	2,721.00	59,862,000
青山商事	29,600	763.00	22,584,800
しまむら	16,600	7,680.00	127,488,000
はせがわ	8,200	331.00	2,714,200
高島屋	103,700	935.00	96,959,500
松屋	28,900	702.00	20,287,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,500	762.00	51,435,000
近鉄百貨店	5,500	3,060.00	16,830,000
丸井グループ	130,300	2,020.00	263,206,000
アクシアル リテイリング	11,800	4,155.00	49,029,000
イオン	546,900	2,458.50	1,344,553,650
イズミ	28,900	3,445.00	99,560,500
平和堂	28,900	1,845.00	53,320,500
フジ	17,200	1,867.00	32,112,400
ヤオコー	16,200	7,800.00	126,360,000
ゼビオホールディングス	17,400	850.00	14,790,000
ケーズホールディングス	137,300	1,490.00	204,577,000
Olympicグループ	7,600	853.00	6,482,800
日産東京販売ホールディングス	21,800	248.00	5,406,400
シルバーライフ	2,000	2,223.00	4,446,000
一家ダイニングプロジェクト	1,500	609.00	913,500
Genky DrugStores	6,300	3,570.00	22,491,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,500	677.00	2,369,500
ブックオフグループホールディングス	8,300	841.00	6,980,300
アインホールディングス	17,500	7,150.00	125,125,000
元気寿司	3,700	2,405.00	8,898,500
ヤマダ電機	433,400	530.00	229,702,000
アークランドサカモト	22,400	1,839.00	41,193,600
ニトリホールディングス	61,500	20,715.00	1,273,972,500
グルメ杵屋	10,300	1,026.00	10,567,800
愛眼	11,300	223.00	2,519,900
ケーユーホールディングス	7,700	830.00	6,391,000
吉野家ホールディングス	46,800	2,313.00	108,248,400
松屋フーズホールディングス	6,900	3,715.00	25,633,500
サガミホールディングス	19,200	1,265.00	24,288,000
関西スーパーマーケット	12,000	1,092.00	13,104,000
王将フードサービス	10,500	6,080.00	63,840,000
プレナス	16,000	1,810.00	28,960,000
ミニストップ	10,600	1,490.00	15,794,000

アークス	29,200	2,115.00	61,758,000
パローホールディングス	31,500	2,078.00	65,457,000
ベルク	7,000	7,100.00	49,700,000
大庄	7,800	1,307.00	10,194,600
ファーストリテイリング	19,000	62,090.00	1,179,710,000
サンドラッグ	53,500	3,510.00	187,785,000
サクスパー ホールディングス	12,400	622.00	7,712,800
ヤマザワ	3,400	1,743.00	5,926,200
やまや	3,000	2,242.00	6,726,000
ペルーナ	30,900	611.00	18,879,900
島根銀行	3,700	525.00	1,942,500
じもとホールディングス	96,100	95.00	9,129,500
めぶきフィナンシャルグループ	739,400	246.00	181,892,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,200	1,132.00	21,734,400
九州フィナンシャルグループ	311,300	448.00	139,462,400
ゆうちょ銀行	403,100	840.00	338,604,000
富山第一銀行	33,900	263.00	8,915,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	812,800	349.00	283,667,200
西日本フィナンシャルホールディングス	94,700	738.00	69,888,600
関西みらいフィナンシャルグループ	83,500	420.00	35,070,000
三十三フィナンシャルグループ	13,200	1,327.00	17,516,400
第四北越フィナンシャルグループ	24,700	2,188.00	54,043,600
新生銀行	104,400	1,310.00	136,764,000
あおぞら銀行	84,800	1,919.00	162,731,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,734,300	426.70	4,153,625,810
りそなホールディングス	1,561,600	368.10	574,824,960
三井住友トラスト・ホールディングス	269,000	2,964.00	797,316,000
三井住友フィナンシャルグループ	984,200	3,022.00	2,974,252,400
千葉銀行	474,900	514.00	244,098,600
群馬銀行	273,400	339.00	92,682,600
武蔵野銀行	21,200	1,523.00	32,287,600
千葉興業銀行	39,000	234.00	9,126,000
筑波銀行	59,200	175.00	10,360,000
七十七銀行	48,100	1,552.00	74,651,200
青森銀行	11,000	2,261.00	24,871,000
秋田銀行	9,100	1,487.00	13,531,700
山形銀行	16,000	1,293.00	20,688,000
岩手銀行	9,300	2,524.00	23,473,200
東邦銀行	127,200	221.00	28,111,200
東北銀行	6,800	942.00	6,405,600
みちのく銀行	9,100	1,084.00	9,864,400
ふくおかフィナンシャルグループ	119,900	1,713.00	205,388,700

静岡銀行	352,400	690.00	243,156,000
十六銀行	17,800	1,988.00	35,386,400
スルガ銀行	145,600	382.00	55,619,200
八十二銀行	343,400	398.00	136,673,200
山梨中央銀行	16,500	851.00	14,041,500
大垣共立銀行	28,100	2,249.00	63,196,900
福井銀行	12,200	1,623.00	19,800,600
北國銀行	14,200	2,864.00	40,668,800
清水銀行	5,900	1,748.00	10,313,200
富山銀行	2,700	2,212.00	5,972,400
滋賀銀行	28,500	2,375.00	67,687,500
南都銀行	23,700	2,069.00	49,035,300
百五銀行	128,100	322.00	41,248,200
京都銀行	51,000	3,800.00	193,800,000
紀陽銀行	50,400	1,658.00	83,563,200
ほくほくフィナンシャルグループ	94,700	883.00	83,620,100
広島銀行	210,100	503.00	105,680,300
山陰合同銀行	84,400	541.00	45,660,400
中国銀行	122,500	986.00	120,785,000
鳥取銀行	4,800	1,204.00	5,779,200
伊予銀行	203,000	645.00	130,935,000
百十四銀行	15,100	1,917.00	28,946,700
四国銀行	21,600	807.00	17,431,200
阿波銀行	23,200	2,456.00	56,979,200
大分銀行	8,200	2,414.00	19,794,800
宮崎銀行	9,500	2,328.00	22,116,000
佐賀銀行	8,600	1,173.00	10,087,800
沖縄銀行	13,000	3,080.00	40,040,000
琉球銀行	32,800	955.00	31,324,000
セブン銀行	475,400	296.00	140,718,400
みずほフィナンシャルグループ	19,336,400	131.80	2,548,537,520
高知銀行	5,200	680.00	3,536,000
山口フィナンシャルグループ	177,600	646.00	114,729,600
長野銀行	4,700	1,101.00	5,174,700
名古屋銀行	10,600	2,395.00	25,387,000
北洋銀行	214,500	208.00	44,616,000
愛知銀行	5,100	2,783.00	14,193,300
中京銀行	5,800	2,026.00	11,750,800
大光銀行	4,900	1,470.00	7,203,000
愛媛銀行	19,900	1,180.00	23,482,000
トマト銀行	5,500	1,012.00	5,566,000
京葉銀行	60,700	508.00	30,835,600

栃木銀行	68,700	166.00	11,404,200
北日本銀行	4,400	1,820.00	8,008,000
東和銀行	25,000	700.00	17,500,000
福島銀行	13,400	173.00	2,318,200
大東銀行	7,400	606.00	4,484,400
トモニホールディングス	110,000	344.00	37,840,000
フィデアホールディングス	138,200	104.00	14,372,800
池田泉州ホールディングス	163,600	163.00	26,666,800
F P G	44,200	619.00	27,359,800
マーキュリアインベストメント	6,600	589.00	3,887,400
S B Iホールディングス	159,000	2,276.00	361,884,000
ジャフコ	21,900	3,595.00	78,730,500
大和証券グループ本社	1,142,200	448.30	512,048,260
野村ホールディングス	2,504,300	475.50	1,190,794,650
岡三証券グループ	121,800	325.00	39,585,000
丸三証券	42,700	413.00	17,635,100
東洋証券	52,400	123.00	6,445,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	164,200	240.00	39,408,000
光世証券	3,800	522.00	1,983,600
水戸証券	42,100	197.00	8,293,700
いちよし証券	27,000	436.00	11,772,000
松井証券	81,500	830.00	67,645,000
マネックスグループ	105,300	219.00	23,060,700
極東証券	19,400	512.00	9,932,800
岩井コスモホールディングス	13,600	1,057.00	14,375,200
藍澤證券	25,800	668.00	17,234,400
マネーパートナーズグループ	16,100	200.00	3,220,000
スパークス・グループ	66,600	215.00	14,319,000
かんぽ生命保険	50,400	1,393.00	70,207,200
S O M P Oホールディングス	267,600	3,654.00	977,810,400
アニコム ホールディングス	11,800	4,595.00	54,221,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	372,100	2,998.00	1,115,555,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	116,900	2,593.00	303,121,700
第一生命ホールディングス	805,200	1,313.00	1,057,227,600
東京海上ホールディングス	503,100	4,660.00	2,344,446,000
T & Dホールディングス	425,300	946.00	402,333,800
アドバンスクリエイト	3,000	2,132.00	6,396,000
全国保証	40,100	4,130.00	165,613,000
ジェイリース	3,900	386.00	1,505,400
イントラスト	5,000	754.00	3,770,000
日本モーゲージサービス	2,900	1,998.00	5,794,200
C a s a	5,000	1,085.00	5,425,000

アルヒ	22,600	1,549.00	35,007,400
プレミアグループ	7,700	1,971.00	15,176,700
クレディセゾン	99,700	1,282.00	127,815,400
芙蓉総合リース	14,900	6,010.00	89,549,000
みずほリース	22,000	2,325.00	51,150,000
東京センチュリー	28,700	5,370.00	154,119,000
日本証券金融	62,700	506.00	31,726,200
アイフル	217,100	241.00	52,321,100
リコーリース	11,200	3,010.00	33,712,000
イオンフィナンシャルサービス	87,100	1,192.00	103,823,200
アコム	286,000	421.00	120,406,000
ジャックス	15,700	1,777.00	27,898,900
オリエントコーポレーション	384,900	122.00	46,957,800
日立キャピタル	33,500	2,354.00	78,859,000
アプラスフィナンシャル	68,300	68.00	4,644,400
オリックス	890,000	1,355.00	1,205,950,000
三菱UFJリース	361,200	514.00	185,656,800
九州リースサービス	7,000	501.00	3,507,000
日本取引所グループ	408,400	2,437.00	995,270,800
イー・ギャランティ	15,200	2,522.00	38,334,400
アサックス	7,400	703.00	5,202,200
NECキャピタルソリューション	5,800	1,985.00	11,513,000
いちご	188,700	270.00	50,949,000
日本駐車場開発	156,000	135.00	21,060,000
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	1,323.00	11,774,700
ADワークスグループ	26,400	187.00	4,936,800
ヒューリック	305,900	1,004.00	307,123,600
三栄建築設計	7,400	1,271.00	9,405,400
野村不動産ホールディングス	87,400	1,930.00	168,682,000
三重交通グループホールディングス	33,300	471.00	15,684,300
サムティ	21,700	1,362.00	29,555,400
ディア・ライフ	24,400	492.00	12,004,800
日本商業開発	10,400	1,523.00	15,839,200
ハウスコム	4,100	1,331.00	5,457,100
日本管理センター	11,100	1,204.00	13,364,400
サンセイランディック	6,600	862.00	5,689,200
フージャースホールディングス	28,400	533.00	15,137,200
オープンハウス	41,900	3,645.00	152,725,500
東急不動産ホールディングス	390,900	500.00	195,450,000
飯田グループホールディングス	119,900	1,684.00	201,911,600
イーランド	5,300	701.00	3,715,300
ムゲンエステート	13,600	539.00	7,330,400

ハウストゥ	7,000	1,029.00	7,203,000
シーアールイー	5,100	1,369.00	6,981,900
グッドコムアセット	4,600	1,674.00	7,700,400
ジェイ・エス・ビー	3,900	2,644.00	10,311,600
テンポイノベーション	6,200	676.00	4,191,200
パーク24	77,600	1,770.00	137,352,000
パラカ	4,900	1,662.00	8,143,800
三井不動産	702,900	1,903.50	1,337,970,150
三菱地所	998,300	1,584.00	1,581,307,200
平和不動産	26,800	3,085.00	82,678,000
東京建物	151,500	1,248.00	189,072,000
ダイビル	38,800	987.00	38,295,600
京阪神ビルディング	24,300	1,380.00	33,534,000
住友不動産	320,600	2,884.00	924,610,400
テオオーシー	31,000	681.00	21,111,000
東京楽天地	2,800	4,505.00	12,614,000
スターツコーポレーション	20,300	2,228.00	45,228,400
フジ住宅	20,600	524.00	10,794,400
空港施設	19,200	416.00	7,987,200
明和地所	12,800	412.00	5,273,600
ゴールドクレスト	12,600	1,484.00	18,698,400
エスリード	7,100	1,341.00	9,521,100
日神グループホールディングス	26,600	365.00	9,709,000
日本エスコン	25,700	808.00	20,765,600
タカラレーベン	65,000	354.00	23,010,000
A V A N T I A	10,700	833.00	8,913,100
イオンモール	72,800	1,402.00	102,065,600
毎日コムネット	6,300	797.00	5,021,100
ファースト住建	8,200	932.00	7,642,400
カチタス	36,000	2,555.00	91,980,000
トーセイ	21,500	1,135.00	24,402,500
穴吹興産	4,300	1,785.00	7,675,500
サンフロンティア不動産	22,100	853.00	18,851,300
エフ・ジェー・ネクスト	14,900	872.00	12,992,800
インテリックス	4,000	495.00	1,980,000
ランドビジネス	4,800	368.00	1,766,400
日本社宅サービス	6,400	1,101.00	7,046,400
グランディハウス	16,800	368.00	6,182,400
日本空港ビルデング	45,900	4,750.00	218,025,000
日本工営	9,300	3,005.00	27,946,500
L I F U L L	48,500	445.00	21,582,500
ジェイエシーリクルートメント	9,400	1,151.00	10,819,400

日本M & Aセンター	104,200	4,895.00	510,059,000
メンバーズ	4,200	1,579.00	6,631,800
中広	2,200	545.00	1,199,000
UTグループ	21,800	2,324.00	50,663,200
アイティメディア	5,600	1,672.00	9,363,200
タケエイ	13,400	1,028.00	13,775,200
E・Jホールディングス	2,500	1,598.00	3,995,000
ビーネックスグループ	17,400	946.00	16,460,400
コシダカホールディングス	33,500	439.00	14,706,500
アルトナー	3,500	938.00	3,283,000
パソナグループ	15,100	1,151.00	17,380,100
CDS	3,500	1,283.00	4,490,500
リンクアンドモチベーション	30,700	410.00	12,587,000
GCA	16,900	646.00	10,917,400
エス・エム・エス	43,000	2,511.00	107,973,000
サニーサイドアップグループ	4,900	831.00	4,071,900
パーソルホールディングス	137,900	1,476.00	203,540,400
リニカル	6,800	872.00	5,929,600
クックパッド	48,600	349.00	16,961,400
エスクリ	4,700	382.00	1,795,400
アイ・ケイ・ケイ	7,000	564.00	3,948,000
学情	5,000	1,218.00	6,090,000
スタジオアリス	7,000	1,604.00	11,228,000
シミックホールディングス	6,900	1,487.00	10,260,300
エプコ	3,100	1,073.00	3,326,300
NJS	3,100	1,797.00	5,570,700
総合警備保障	54,900	4,920.00	270,108,000
カカクコム	101,900	2,730.00	278,187,000
アイロムグループ	4,900	3,260.00	15,974,000
セントケア・ホールディング	9,300	406.00	3,775,800
サイネックス	2,500	681.00	1,702,500
ルネサンス	7,800	1,027.00	8,010,600
ディップ	19,500	2,254.00	43,953,000
オプトホールディング	7,600	1,445.00	10,982,000
ツクイ	32,800	512.00	16,793,600
キャリアデザインセンター	3,300	998.00	3,293,400
ベネフィット・ワン	50,200	2,136.00	107,227,200
エムスリー	304,000	4,585.00	1,393,840,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,800	305.00	2,684,000
プラス	2,100	546.00	1,146,600
アウトソーシング	79,100	684.00	54,104,400
ウェルネット	14,100	731.00	10,307,100

ワールドホールディングス	4,800	1,670.00	8,016,000	
ディー・エヌ・エー	67,700	1,342.00	90,853,400	
博報堂D Yホールディングス	191,900	1,246.00	239,107,400	
ぐるなび	24,200	760.00	18,392,000	
タカミヤ	14,900	532.00	7,926,800	
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	860.00	9,374,000	
ファンコミュニケーションズ	38,300	452.00	17,311,600	
ライク	4,600	1,464.00	6,734,400	
ビジネス・ブレークスルー	6,200	379.00	2,349,800	
エスプール	35,600	747.00	26,593,200	
WDBホールディングス	6,300	2,721.00	17,142,300	
手間いらず	900	4,835.00	4,351,500	
ティア	8,300	519.00	4,307,700	
C D G	1,600	1,576.00	2,521,600	
バリューコマース	7,800	3,005.00	23,439,000	
インフォマート	151,300	827.00	125,125,100	
J Pホールディングス	43,800	285.00	12,483,000	
エコナックホールディングス	26,400	102.00	2,692,800	
E P Sホールディングス	18,800	1,033.00	19,420,400	
レッグス	3,600	928.00	3,340,800	
プレステージ・インターナショナル	51,800	799.00	41,388,200	
アミューズ	7,600	2,282.00	17,343,200	
ドリームインキュベータ	4,300	1,429.00	6,144,700	
クイック	8,700	1,175.00	10,222,500	
T A C	9,100	197.00	1,792,700	
ケネディクス	128,700	531.00	68,339,700	
電通グループ	142,200	2,550.00	362,610,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,500	662.00	3,641,000	
ぴあ	4,000	3,480.00	13,920,000	
イオンファンタジー	5,400	1,590.00	8,586,000	
シーティーエス	15,700	874.00	13,721,800	
ネクシィーズグループ	4,400	1,002.00	4,408,800	
みらかホールディングス	38,600	2,586.00	99,819,600	
アルプス技研	12,300	1,866.00	22,951,800	
ダイオーズ	2,900	1,019.00	2,955,100	
日本空調サービス	14,600	730.00	10,658,000	
オリエンタルランド	146,600	14,510.00	2,127,166,000	
ダスキン	34,300	2,714.00	93,090,200	
明光ネットワークジャパン	17,600	853.00	15,012,800	
ファルコホールディングス	7,700	1,552.00	11,950,400	
ラウンドワン	38,700	813.00	31,463,100	
リゾートトラスト	63,300	1,449.00	91,721,700	

ビー・エム・エル	17,800	2,822.00	50,231,600
ワタベウェディング	2,600	347.00	902,200
りらいあコミュニケーションズ	25,000	1,024.00	25,600,000
リソー教育	63,400	333.00	21,112,200
早稲田アカデミー	6,100	923.00	5,630,300
ユー・エス・エス	154,400	1,738.00	268,347,200
東京個別指導学院	5,100	553.00	2,820,300
サイバーエージェント	85,000	5,360.00	455,600,000
楽天	642,800	998.00	641,514,400
クリーク・アンド・リバー社	7,400	1,063.00	7,866,200
テー・オー・ダブリュー	22,300	381.00	8,496,300
山田コンサルティンググループ	9,000	1,305.00	11,745,000
セントラルスポーツ	5,200	2,346.00	12,199,200
フルキャストホールディングス	13,900	1,490.00	20,711,000
エン・ジャパン	24,500	2,815.00	68,967,500
リソルホールディングス	1,500	3,515.00	5,272,500
テクノプロ・ホールディングス	27,500	6,280.00	172,700,000
アトラ	3,800	244.00	927,200
インターワークス	3,000	383.00	1,149,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,600	11,210.00	62,776,000
Keeper 技研	5,200	1,498.00	7,789,600
ファーストロジック	2,900	641.00	1,858,900
三機サービス	2,800	971.00	2,718,800
Gunosy	8,700	968.00	8,421,600
デザインワン・ジャパン	4,600	301.00	1,384,600
イー・ガーディアン	6,100	2,714.00	16,555,400
リブセンス	9,300	304.00	2,827,200
ジャパンマテリアル	42,500	1,695.00	72,037,500
ベクトル	17,400	884.00	15,381,600
ウチヤマホールディングス	7,200	325.00	2,340,000
チャーム・ケア・コーポレーション	11,900	876.00	10,424,400
ライクキッズ	2,500	1,002.00	2,505,000
キャリアリンク	4,800	573.00	2,750,400
I B J	9,600	787.00	7,555,200
アサンテ	5,600	1,491.00	8,349,600
N・フィールド	9,700	561.00	5,441,700
バリューHR	5,500	1,413.00	7,771,500
M&Aキャピタルパートナーズ	11,200	4,015.00	44,968,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	2,470.00	13,091,000
E R Iホールディングス	4,100	647.00	2,652,700
アビスト	2,200	2,686.00	5,909,200
シグマクシス	9,500	1,828.00	17,366,000

ウィルグループ	9,200	668.00	6,145,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	19,800	200.00	3,960,000
リクルートホールディングス	987,700	3,694.00	3,648,563,800
エラン	8,200	1,893.00	15,522,600
土木管理総合試験所	6,400	369.00	2,361,600
ネットマーケティング	5,500	651.00	3,580,500
日本郵政	1,130,200	764.50	864,037,900
ベルシステム24ホールディングス	23,200	1,360.00	31,552,000
鎌倉新書	10,500	1,206.00	12,663,000
S MN	3,100	1,156.00	3,583,600
一蔵	1,900	390.00	741,000
L I T A L I C O	4,800	2,495.00	11,976,000
グローバルキッズCOMPANY	2,700	555.00	1,498,500
エアトリ	7,200	1,363.00	9,813,600
アトラエ	4,200	3,255.00	13,671,000
ストライク	5,200	5,100.00	26,520,000
ソラスト	38,200	1,045.00	39,919,000
セラク	4,500	1,072.00	4,824,000
インソース	5,800	2,675.00	15,515,000
ベйкаレント・コンサルティング	8,400	9,310.00	78,204,000
Orchestra Holdings	3,000	1,680.00	5,040,000
アイモバイル	5,100	742.00	3,784,200
キャリアインデックス	6,100	368.00	2,244,800
MS - J a p a n	4,700	817.00	3,839,900
船場	2,400	972.00	2,332,800
グレイステクノロジー	6,400	6,240.00	39,936,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,600	3,450.00	50,370,000
フルテック	2,000	1,313.00	2,626,000
グリーンズ	3,800	504.00	1,915,200
GameWith	4,300	610.00	2,623,000
ソウルドアウト	2,900	2,500.00	7,250,000
MS&Consulting	2,800	530.00	1,484,000
ミダック	1,900	1,767.00	3,357,300
日総工産	9,400	677.00	6,363,800
キュービーネットホールディングス	5,700	2,083.00	11,873,100
RPAホールディングス	10,600	782.00	8,289,200
スプリックス	4,100	794.00	3,255,400
マネジメントソリューションズ	6,000	1,437.00	8,622,000
プロレド・パートナーズ	1,900	4,860.00	9,234,000
and factory	1,300	1,041.00	1,353,300
ギークス	1,500	1,325.00	1,987,500
カーブスホールディングス	38,100	600.00	22,860,000

フォーラムエンジニアリング	7,300	845.00	6,168,500
アドバンテッジリスクマネジメント	7,100	795.00	5,644,500
リログループ	75,400	2,022.00	152,458,800
東祥	8,700	1,303.00	11,336,100
エイチ・アイ・エス	21,500	1,694.00	36,421,000
ラックランド	3,300	2,220.00	7,326,000
共立メンテナンス	22,900	3,795.00	86,905,500
イチネンホールディングス	15,600	1,178.00	18,376,800
建設技術研究所	9,600	1,699.00	16,310,400
スペース	9,100	954.00	8,681,400
長大	5,600	1,054.00	5,902,400
燦ホールディングス	6,100	1,194.00	7,283,400
スバル興業	900	8,110.00	7,299,000
東京テアトル	5,500	1,240.00	6,820,000
タナベ経営	2,800	1,282.00	3,589,600
ナガワ	4,400	7,670.00	33,748,000
よみうりランド	3,000	3,615.00	10,845,000
東京都競馬	9,100	3,625.00	32,987,500
カナモト	22,600	2,248.00	50,804,800
東京ドーム	56,000	797.00	44,632,000
西尾レントオール	12,800	2,167.00	27,737,600
トランス・コスモス	13,200	2,395.00	31,614,000
乃村工藝社	59,200	885.00	52,392,000
藤田観光	6,000	1,791.00	10,746,000
KNT-CTホールディングス	8,600	1,074.00	9,236,400
日本管財	14,800	1,907.00	28,223,600
トーカイ	13,400	2,433.00	32,602,200
白洋舎	1,600	2,890.00	4,624,000
セコム	146,300	9,343.00	1,366,880,900
セントラル警備保障	6,700	4,225.00	28,307,500
丹青社	26,200	756.00	19,807,200
メイテック	16,900	5,260.00	88,894,000
応用地質	14,900	1,361.00	20,278,900
船井総研ホールディングス	28,600	2,434.00	69,612,400
進学会ホールディングス	5,700	509.00	2,901,300
オオバ	10,000	618.00	6,180,000
いであ	3,400	1,841.00	6,259,400
学究社	4,200	1,106.00	4,645,200
ベネッセホールディングス	46,000	2,890.00	132,940,000
イオンディライト	17,000	3,000.00	51,000,000
ナック	7,800	871.00	6,793,800
ニチイ学館	18,900	1,648.00	31,147,200

ダイセキ	23,200	2,743.00	63,637,600	
ステップ	5,100	1,527.00	7,787,700	
合 計	169,090,300		316,448,497,910	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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】

（2020年 7月31日現在）

資産総額	1,503,932,692円
負債総額	638,568円
純資産総額（ - ）	1,503,294,124円
発行済口数	1,430,766,634口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0507円
（1万口当たり純資産額）	（10,507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

（2020年 7月31日現在）

資産総額	309,182,179,022円
負債総額	1,029,509,671円
純資産総額（ - ）	308,152,669,351円
発行済口数	217,851,505,009口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4145円
（1万口当たり純資産額）	（14,145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（2020年7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、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2020年 9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。

2020年7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	529	12,560,142
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	291,933
単位型公社債投資信託	34	245,279
合計	641	13,097,354

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。

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

- (2) 委託者の財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに变更いたしました。
- (3) 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、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

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

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 9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 (2020年3月末日現在)

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年8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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2019年6月26日から2020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。

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2020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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。