

【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18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】	国内株式SMTBセレクション（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】

国内株式SMTBセレクション（SMA専用）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

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

（７）【申込期間】

2020年 9月19日から2021年 3月19日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、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 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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 >

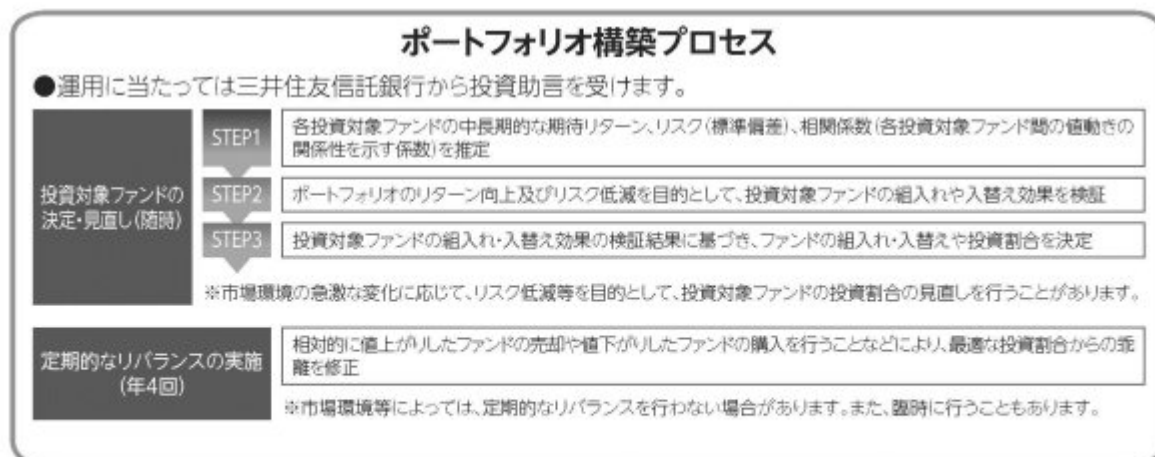
1. 主としてわが国の金融商品取引所等に上場されている株式等を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド^{*}」)に投資します。

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

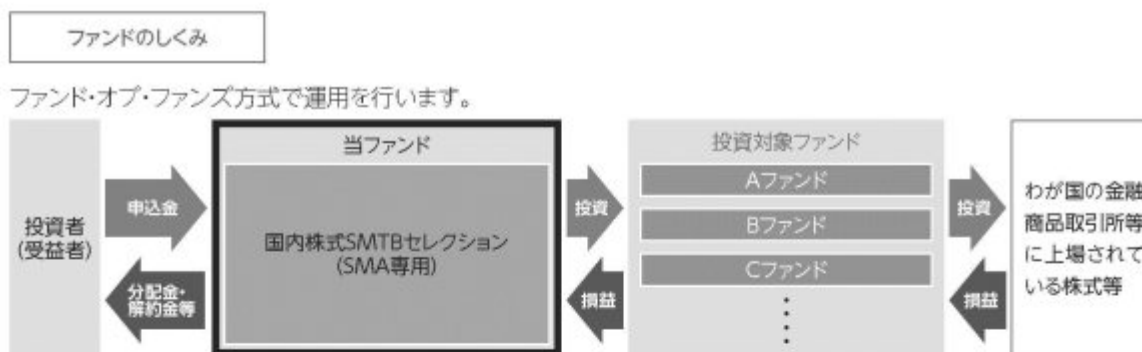
投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

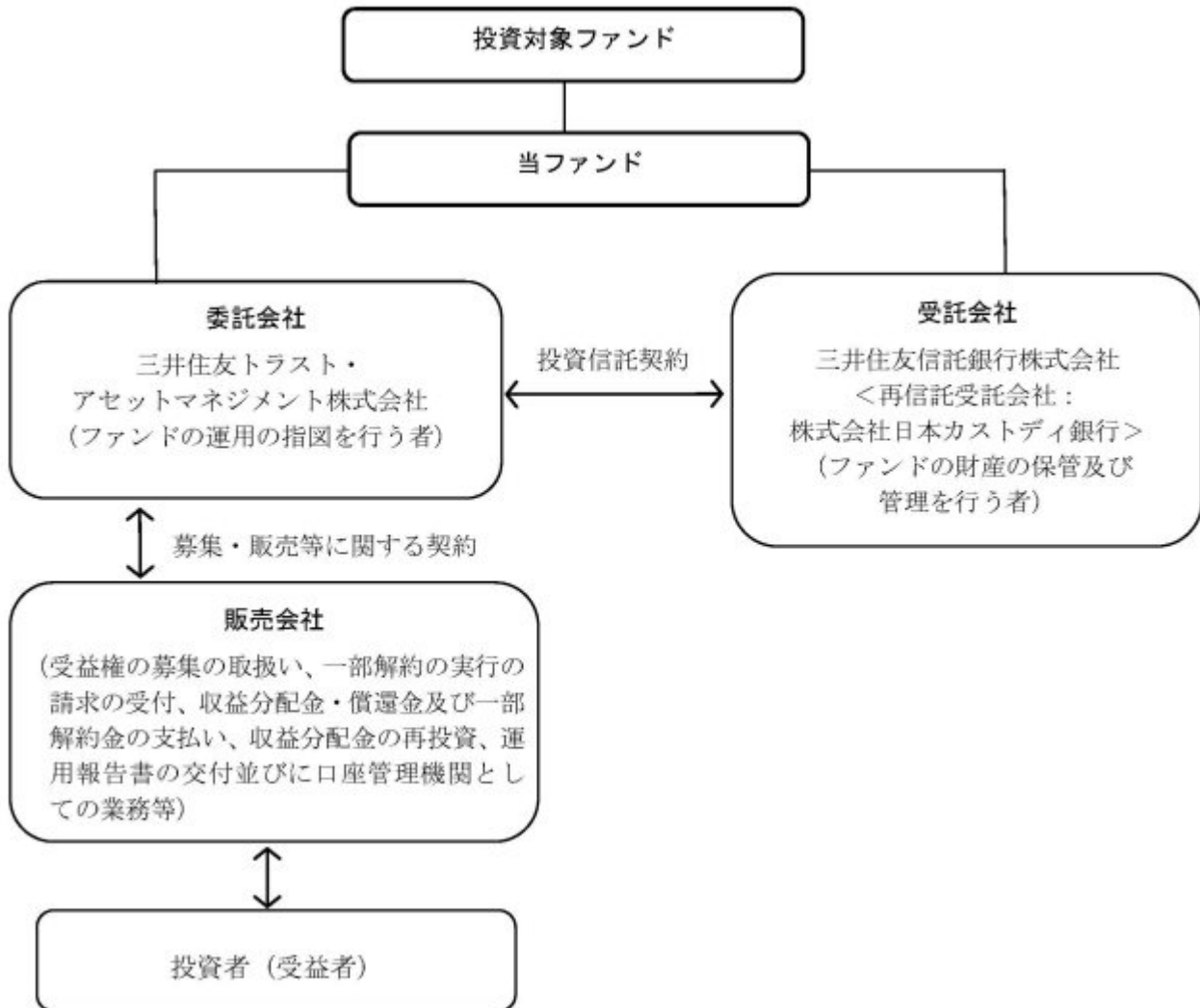
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2015年2月6日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(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】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

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

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．金銭債権
 - 3．約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2020年 7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

1. JPX日経インデックス400 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上市されている株式に投資し、JPX日経インデックス400（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引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。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>同一銘柄の転換社債並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（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPX日経インデックス400（配当込み）
決算日	年1回：10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2014年1月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

J P X日経インデックス400とは、株式会社日本取引所グループ及び株式会社東京証券取引所（以下、総称して「J P Xグループ」）並びに株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」）によって独自に開発された手法により、東京証券取引所市場第一部、同第二部、マザーズ、JASDAQ上場銘柄から原則400銘柄を選定し、算出される株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、J P Xグループ並びに日経によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P Xグループ及び日経は、同指数自体及び同指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

同指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJ P Xグループ及び日経に帰属しています。

当ファンドは、当社の責任のもとで運用されるものであり、J P Xグループ及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

J P Xグループ及び日経は、同指数の構成銘柄、計算方法、その他同指数の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、東証株価指数の動きを上回る投資成果を目指して運用を行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。 なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（ ）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2025年2月17日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（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。

3. 日本株配当マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度	<p>わが国の株式の中から、予想配当利回りが比較的高いと判断される銘柄を中心に投資し、安定的な配当収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。</p> <p>また、わが国の株式の中から、配当増が予想される銘柄群も組み入れることにより、値上がり益の追求も目指します。</p> <p>株式の組入れ比率は、原則として高位を維持します。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	解約時：0.3%
設定日	2005年6月29日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

4. 中小型株式 マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の中小型株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、わが国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます）のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞り込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。</p> <p>株式への投資比率は、原則として高位（80%以上）を保ちます。ただし、相場下落の可能性が高いと判断した場合には、キャッシュ比率の引上げおよび以下に記載する有価証券先物取引等により、実質的な株式への投資比率を引下げるよう努めます。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができるものとします。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：6月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年9月22日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

5. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（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。

6. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

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

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（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。

7. マネープールマザーファンド

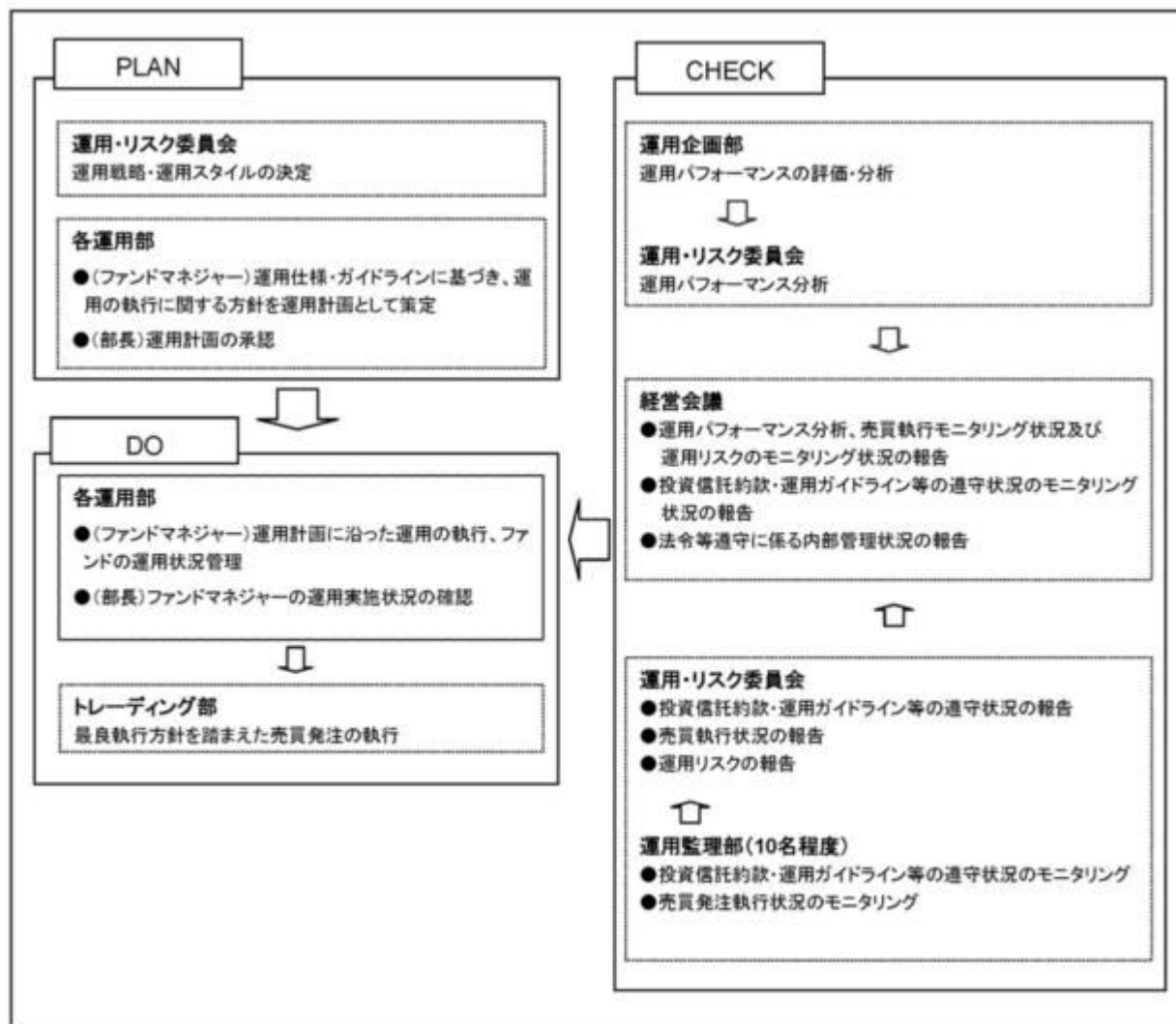
運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。

投資態度	<p>主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2010年2月26日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．外貨建資産への投資

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

ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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。

金利変動リスク

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

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>

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

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。

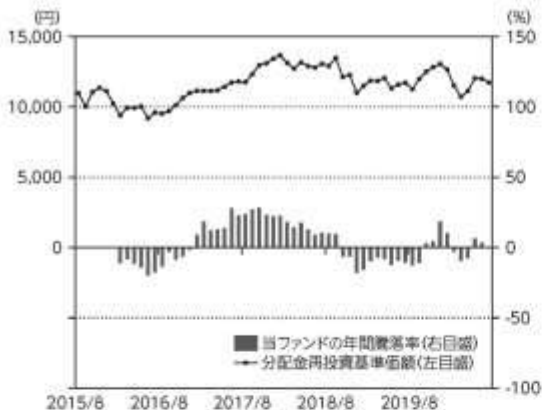
(2) リスクの管理体制

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。

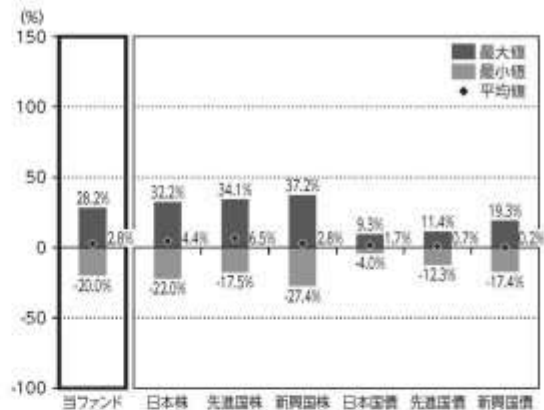
【参考情報】

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



- *当ファンドについては2016年2月～2020年7月の4年6ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては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。
- *当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

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内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的所有権であり、算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Market インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Market 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.は同指数の内容及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動「サービス」に関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの提供、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、誤差または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index (配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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>

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜0.55%）（ ）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 0.352% (税抜 0.32%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% (税抜 0.03%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考) 各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
JPX日経インデックス400 マザーファンド	ありません。
F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド (適格機関投資家専用)	年率 0.374% (税抜 0.34%)

日本株配当マザーファンド	ありません。
中小型株式 マザーファンド	ありません。
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517% （税抜 0.47%）
マネープールマザーファンド	ありません。

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

実質的な信託報酬率：年率0.605%～1.1774%程度（税抜 0.55%～1.08%程度）
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.5724%程度（税抜 0.0%～0.53%程度））

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

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。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

徴収が行われます。

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	51,052,810,926	40.66
親投資信託受益証券	日本	73,511,900,264	58.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		998,598,366	0.80
合計(純資産総額)		125,563,309,556	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	投資信託受益証券	F0Fs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,313,151,093	1.3198	34,730,070,298	1.208	31,786,286,520	25.31
日本	親投資信託受益証券	J P X日経インデックス400 マザーファンド	22,608,594,288	1.4948	33,795,326,742	1.3390	30,272,907,751	24.11
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	22,001,284,009	0.962	21,166,577,294	0.8757	19,266,524,406	15.34
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	12,641,059,306	1.5919	20,123,302,310	1.4145	17,880,778,388	14.24
日本	親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	3,142,037,830	4.1367	12,997,667,892	4.1949	13,180,534,493	10.50
日本	親投資信託受益証券	日本株配当マザーファンド	6,857,182,082	2.0332	13,942,022,610	1.7759	12,177,669,659	9.70
日本	親投資信託受益証券	マネーパールマザーファンド	9,953	1.0024	9,976	1.0021	9,973	0.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	40.66
親投資信託受益証券	58.55
合計	99.20

(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1期計算期間末 (2015年12月21日)	77,117,716,194	77,117,716,194	11,046	11,046
第2期計算期間末 (2016年12月20日)	84,938,273,661	84,938,273,661	11,162	11,162
第3期計算期間末 (2017年12月20日)	103,303,941,407	103,303,941,407	13,365	13,365
第4期計算期間末 (2018年12月20日)	113,782,503,744	113,782,503,744	11,282	11,282
第5期計算期間末 (2019年12月20日)	145,795,321,259	145,795,321,259	13,081	13,081
2019年 7月末日	127,473,899,078		11,723	
8月末日	123,498,822,353		11,260	
9月末日	139,295,295,336		12,009	
10月末日	143,519,596,954		12,510	
11月末日	144,627,216,989		12,828	
12月末日	144,192,175,635		13,054	
2020年 1月末日	131,594,114,836		12,670	
2月末日	120,589,704,096		11,527	
3月末日	116,274,185,063		10,725	
4月末日	123,981,591,587		11,141	
5月末日	134,426,786,961		12,039	
6月末日	133,707,913,604		12,008	
7月末日	125,563,309,556		11,739	

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	10.5
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	1.1
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	19.7
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	15.6
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	15.9
第6期中間計算期間	2019年12月21日～2020年 6月20日	6.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2015年 2月 6日～2015年12月21日	81,752,097,825	11,939,046,387	69,813,051,438
第2期計算期間	2015年12月22日～2016年12月20日	32,549,745,987	26,264,044,984	76,098,752,441
第3期計算期間	2016年12月21日～2017年12月20日	25,222,310,539	24,029,412,202	77,291,650,778
第4期計算期間	2017年12月21日～2018年12月20日	39,648,856,359	16,087,379,469	100,853,127,668
第5期計算期間	2018年12月21日～2019年12月20日	35,149,470,870	24,542,896,159	111,459,702,379
第6期中間計算期間	2019年12月21日～2020年 6月20日	17,302,113,630	17,363,199,720	111,398,616,289

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

J P X日経インデックス400 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	43,385,820,120	98.89

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		485,512,227	1.11
合計(純資産総額)		43,871,332,347	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	482,842,500	1.10

(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	ソニー	電気機器	112,700	6,479.18	730,203,875	8,076.00	910,165,200	2.07
日本	株式	キーエンス	電気機器	19,000	33,588.89	638,188,910	44,220.00	840,180,000	1.92
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	125,400	4,312.13	540,741,543	6,595.00	827,013,000	1.89
日本	株式	任天堂	その他製品	16,300	38,709.11	630,958,493	46,440.00	756,972,000	1.73
日本	株式	第一三共	医薬品	76,100	6,681.19	508,438,960	9,258.00	704,533,800	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	265,700	2,655.10	705,462,168	2,443.50	649,237,950	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	170,000	3,783.12	643,131,779	3,756.00	638,520,000	1.46
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	102,000	7,353.43	750,050,632	6,217.00	634,134,000	1.45
日本	株式	ダイキン工業	機械	33,900	14,707.65	498,589,622	18,450.00	625,455,000	1.43
日本	株式	KDDI	情報・通信業	190,300	2,992.69	569,509,600	3,259.00	620,187,700	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	182,200	3,509.37	639,408,224	3,268.00	595,429,600	1.36
日本	株式	HOYA	精密機器	52,800	9,201.89	485,860,068	10,420.00	550,176,000	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	44,700	11,960.82	534,648,654	12,275.00	548,692,500	1.25
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	186,700	2,890.20	539,602,189	2,907.50	542,830,250	1.24
日本	株式	日本電産	電気機器	64,000	7,485.90	479,097,972	8,375.00	536,000,000	1.22
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	209,500	2,868.75	601,003,174	2,524.00	528,778,000	1.21
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,323,800	547.98	725,427,324	393.20	520,518,160	1.19
日本	株式	村田製作所	電気機器	78,200	5,827.82	455,735,560	6,609.00	516,823,800	1.18

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	175,800	3,706.64	651,628,750	2,800.00	492,240,000	1.12
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	16,900	21,849.74	369,260,664	28,800.00	486,720,000	1.11
日本	株式	花王	化学	63,700	8,293.77	528,313,756	7,636.00	486,413,200	1.11
日本	株式	S M C	機械	8,300	46,112.52	382,733,916	55,070.00	457,081,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,566,000	163.01	581,304,130	127.60	455,021,600	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	25,000	20,649.97	516,249,250	17,705.00	442,625,000	1.01
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	183,300	2,275.87	417,168,101	2,300.00	421,590,000	0.96
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	92,800	5,688.74	527,915,326	4,436.00	411,660,800	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	127,800	4,082.53	521,748,048	3,128.00	399,758,400	0.91
日本	株式	中外製薬	医薬品	83,200	2,872.00	238,950,588	4,736.00	394,035,200	0.90
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	230,700	1,709.23	394,320,246	1,650.00	380,655,000	0.87
日本	株式	三菱電機	電気機器	266,100	1,503.37	400,049,070	1,370.50	364,690,050	0.83

(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	0.06
		鉱業	0.18
		建設業	2.36
		食料品	3.74
		繊維製品	0.34
		パルプ・紙	0.11
		化学	7.26
		医薬品	7.75
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.43
		非鉄金属	0.62
		金属製品	0.29
		機械	5.36
		電気機器	17.07
		輸送用機器	5.50
		精密機器	3.08
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	3.75
空運業	0.40		
情報・通信業	9.50		
卸売業	4.52		

	小売業	5.03
	銀行業	4.31
	証券、商品先物取引業	0.92
	保険業	2.31
	その他金融業	1.13
	不動産業	2.13
	サービス業	5.18
	小計	98.89
合計		98.89

(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	J P X日経インデックス400先物	買建	357円		506,394,630	482,842,500	1.10

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

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

日本株配当マザーファンド

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	16,013,261,570	97.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		360,097,643	2.20
合計(純資産総額)		16,373,359,213	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	269,370,000	1.65

(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	132,600	6,635.00	879,801,000	6,217.00	824,374,200	5.03
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	248,200	2,179.55	540,964,310	2,300.00	570,860,000	3.49
日本	株式	第一三共	医薬品	52,800	7,671.74	405,067,872	9,258.00	488,822,400	2.99
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,215,000	425.76	517,298,400	393.20	477,738,000	2.92
日本	株式	三井物産	卸売業	301,000	1,526.69	459,533,690	1,574.00	473,774,000	2.89
日本	株式	信越化学工業	化学	38,400	11,470.00	440,448,000	12,275.00	471,360,000	2.88
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	167,400	2,844.39	476,150,886	2,800.00	468,720,000	2.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	191,000	2,562.50	489,437,500	2,443.50	466,708,500	2.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	16,100	22,611.87	364,051,107	28,800.00	463,680,000	2.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	66,100	5,795.38	383,074,618	6,609.00	436,854,900	2.67
日本	株式	富士通	電気機器	30,200	10,362.01	312,932,702	14,120.00	426,424,000	2.60
日本	株式	三菱商事	卸売業	197,900	2,273.33	449,892,007	2,119.50	419,449,050	2.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	108,800	3,562.00	387,545,600	3,756.00	408,652,800	2.50
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,925,500	126.58	370,309,790	127.60	373,293,800	2.28
日本	株式	T D K	電気機器	31,800	8,853.04	281,526,672	11,680.00	371,424,000	2.27
日本	株式	任天堂	その他製品	7,600	44,370.00	337,212,000	46,440.00	352,944,000	2.16
日本	株式	K D D I	情報・通信業	107,700	3,128.00	336,885,600	3,259.00	350,994,300	2.14
日本	株式	光通信	情報・通信業	14,300	21,244.97	303,803,071	22,800.00	326,040,000	1.99
日本	株式	ネットワンシステムズ	情報・通信業	73,800	3,064.68	226,173,384	4,095.00	302,211,000	1.85
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	175,900	1,728.50	304,043,150	1,650.00	290,235,000	1.77
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	50,900	4,774.97	243,045,973	5,700.00	290,130,000	1.77
日本	株式	ディスコ	機械	11,200	23,448.01	262,617,712	25,170.00	281,904,000	1.72
日本	株式	日本電気	電気機器	45,000	4,301.80	193,581,000	5,890.00	265,050,000	1.62
日本	株式	三菱電機	電気機器	177,700	1,333.50	236,962,950	1,370.50	243,537,850	1.49
日本	株式	コーエーテクモホールディングス	情報・通信業	59,900	2,742.36	164,267,364	4,065.00	243,493,500	1.49
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	51,700	4,914.66	254,087,922	4,436.00	229,341,200	1.40
日本	株式	アズビル	電気機器	64,100	2,778.00	178,069,800	3,510.00	224,991,000	1.37
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	156,000	1,374.00	214,344,000	1,414.50	220,662,000	1.35
日本	株式	Zホールディングス	情報・通信業	389,400	383.76	149,436,144	557.00	216,895,800	1.32
日本	株式	日立製作所	電気機器	65,400	3,304.15	216,091,410	3,128.00	204,571,200	1.25

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.60
		建設業	2.31
		化学	4.93
		医薬品	7.25
		石油・石炭製品	0.75
		非鉄金属	0.81
		機械	2.92
		電気機器	19.23
		輸送用機器	8.10
		その他製品	2.99
		電気・ガス業	0.72
		陸運業	0.69
		倉庫・運輸関連業	0.46
		情報・通信業	15.21
		卸売業	9.21
		小売業	1.91
		銀行業	9.99
		証券、商品先物取引業	0.22
		保険業	3.46
		その他金融業	1.98
不動産業	2.50		
サービス業	1.57		
	小計	97.80	
合計		97.80	

(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	18円		285,582,850	269,370,000	1.65

(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。

中小型株式 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	34,581,535,000	95.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,788,638,646	4.92
合計(純資産総額)		36,370,173,646	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	MARUWA	ガラス・土石製品	140,000	8,150.00	1,141,000,000	9,100.00	1,274,000,000	3.50
日本	株式	サイバーエージェント	サービス業	210,000	5,250.00	1,102,500,000	5,950.00	1,249,500,000	3.44
日本	株式	日本M&Aセンター	サービス業	200,000	4,929.31	985,862,598	5,120.00	1,024,000,000	2.82
日本	株式	エムスリー	サービス業	180,000	4,535.00	816,300,000	5,380.00	968,400,000	2.66
日本	株式	ワークマン	小売業	95,000	9,550.00	907,250,000	9,940.00	944,300,000	2.60
日本	株式	GMOペイメントゲートウェイ	情報・通信業	80,000	12,030.00	962,400,000	11,000.00	880,000,000	2.42
日本	株式	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	サービス業	250,000	3,460.00	865,000,000	3,505.00	876,250,000	2.41
日本	株式	イビデン	電気機器	300,000	3,100.00	930,000,000	2,842.00	852,600,000	2.34
日本	株式	PALTA C	卸売業	145,000	4,945.00	717,025,000	5,720.00	829,400,000	2.28
日本	株式	ダイセキ	サービス業	360,000	2,814.00	1,013,040,000	2,252.00	810,720,000	2.23
日本	株式	インフォコム	情報・通信業	240,000	3,000.00	720,000,000	3,350.00	804,000,000	2.21
日本	株式	光通信	情報・通信業	34,000	24,140.00	820,760,000	22,800.00	775,200,000	2.13
日本	株式	アニコムホールディングス	保険業	180,000	4,480.00	806,400,000	4,195.00	755,100,000	2.08
日本	株式	アンリツ	電気機器	300,000	2,597.00	779,100,000	2,512.00	753,600,000	2.07
日本	株式	富士電機	電気機器	250,000	2,906.00	726,500,000	2,870.00	717,500,000	1.97
日本	株式	B A S E	情報・通信業	110,000	4,520.00	497,200,000	6,480.00	712,800,000	1.96

日本	株式	SHIFT	情報・通信業	64,000	11,130.00	712,320,000	11,100.00	710,400,000	1.95
日本	株式	メニコン	精密機器	135,000	5,340.00	720,900,000	5,160.00	696,600,000	1.92
日本	株式	オイシックス・ラ・大地	小売業	320,000	2,117.00	677,440,000	2,144.00	686,080,000	1.89
日本	株式	ネクソン	情報・通信業	250,000	2,488.00	622,000,000	2,730.00	682,500,000	1.88
日本	株式	クスリのアオキホールディングス	小売業	65,000	9,170.00	596,050,000	9,850.00	640,250,000	1.76
日本	株式	ネットワンシステムズ	情報・通信業	150,000	3,602.74	540,411,708	4,095.00	614,250,000	1.69
日本	株式	ジャパンマテリアル	サービス業	360,000	1,687.00	607,320,000	1,591.00	572,760,000	1.57
日本	株式	レーザーテック	電気機器	60,000	10,740.00	644,400,000	9,200.00	552,000,000	1.52
日本	株式	SHOEI	その他製品	190,000	2,655.00	504,450,000	2,794.00	530,860,000	1.46
日本	株式	ワコム	電気機器	900,000	552.00	496,800,000	572.00	514,800,000	1.42
日本	株式	フルヤ金属	その他製品	74,200	5,740.00	425,908,000	6,930.00	514,206,000	1.41
日本	株式	アルヒ	その他金融業	365,000	1,492.00	544,580,000	1,348.00	492,020,000	1.35
日本	株式	グレイステクノロジー	サービス業	90,000	6,460.00	581,400,000	5,460.00	491,400,000	1.35
日本	株式	レック	化学	320,000	1,628.00	520,960,000	1,528.00	488,960,000	1.34

(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	食料品	0.61
		化学	1.77
		医薬品	2.34
		ガラス・土石製品	3.50
		金属製品	2.18
		機械	3.38
		電気機器	11.58
		精密機器	2.64
		その他製品	3.49
		電気・ガス業	0.76
		倉庫・運輸関連業	1.01
		情報・通信業	23.50
		卸売業	4.30
		小売業	7.42
		保険業	2.08
		その他金融業	2.14
		不動産業	0.98
サービス業	21.42		
	小計	95.08	

合計	95.08
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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。

マネープールマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		480,670,214,019	100.00
合計(純資産総額)		480,670,214,019	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

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。

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：2015年2月6日

作成基準日：2020年7月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 11,739円

純資産総額 1,255.63億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年12月	0円
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs 用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	25.3%
JPX日経インデックス400 マザーファンド	24.1%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	15.3%
国内株式インデックス マザーファンド	14.2%
中小型株式 マザーファンド	10.5%
日本株配当マザーファンド	9.7%
マネーパールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法
計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・公社債等

計算日における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

2015年 2月 6日（設定日）から2024年12月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（4）【計算期間】

原則として、毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・ 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）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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5期計算期間(2018年12月21日から2019年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （2018年12月20日現在）	第5期 （2019年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	170,133,364	-
コール・ローン	1,282,084,006	1,460,042,774
投資信託受益証券	51,499,732,004	58,351,418,757
親投資信託受益証券	61,482,335,085	86,856,855,368
未収入金	-	300,175,643
流動資産合計	114,434,284,459	146,968,492,542
資産合計	114,434,284,459	146,968,492,542
負債の部		
流動負債		
未払解約金	298,361,120	769,559,973
未払受託者報酬	19,219,678	21,954,826
未払委託者報酬	333,140,881	380,550,261
未払利息	3,615	3,432
その他未払費用	1,055,421	1,102,791
流動負債合計	651,780,715	1,173,171,283
負債合計	651,780,715	1,173,171,283
純資産の部		
元本等		
元本	100,853,127,668	111,459,702,379
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,929,376,076	34,335,618,880
（分配準備積立金）	16,371,154,961	15,915,774,821
元本等合計	113,782,503,744	145,795,321,259
純資産合計	113,782,503,744	145,795,321,259
負債純資産合計	114,434,284,459	146,968,492,542

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2017年12月21日	自	2018年12月21日
	至	2018年12月20日	至	2019年12月20日
営業収益				
受取利息		93		576
有価証券売買等損益		18,855,401,308		20,978,812,335
営業収益合計		18,855,401,215		20,978,812,911
営業費用				
支払利息		692,672		834,238
受託者報酬		36,375,804		41,786,497
委託者報酬		630,513,661		724,299,121
その他費用		2,099,485		2,194,227
営業費用合計		669,681,622		769,114,083
営業利益又は営業損失（ ）		19,525,082,837		20,209,698,828
経常利益又は経常損失（ ）		19,525,082,837		20,209,698,828
当期純利益又は当期純損失（ ）		19,525,082,837		20,209,698,828
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（ ）		480,007,766		1,685,692,892
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,012,290,629		12,929,376,076
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,280,117,023		6,175,581,382
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,280,117,023		6,175,581,382
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,317,956,505		3,293,344,514
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,317,956,505		3,293,344,514
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,929,376,076		34,335,618,880

(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	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2018年12月20日現在)	第5期 (2019年12月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,853,127,668口	111,459,702,379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 1.1282円 (1万口当たり純資産額) (11,282円)	1口当たり純資産額 1.3081円 (1万口当たり純資産額) (13,081円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2017年12月21日 至 2018年12月20日	第5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日																																																												
分配金の計算過程	分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">589,109,836円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: center;">- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">13,131,801,316円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">15,782,045,125円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">29,502,956,277円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">100,853,127,668口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">2.925円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: center;">- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F × H/10,000</td> <td style="text-align: center;">- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	589,109,836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	13,131,801,316円	分配準備積立金額	D	15,782,045,125円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,502,956,277円	当ファンドの期末残存口数	F	100,853,127,668口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2.925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	<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">1,738,650,388円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">1,091,202,340円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">19,572,996,340円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">13,085,922,093円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">35,488,771,161円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">111,459,702,379口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F × 10,000</td> <td style="text-align: right;">3.184円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: center;">- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F × H/10,000</td> <td style="text-align: center;">- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,738,650,388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	1,091,202,340円	収益調整金額	C	19,572,996,340円	分配準備積立金額	D	13,085,922,093円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,488,771,161円	当ファンドの期末残存口数	F	111,459,702,379口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3.184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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	589,109,836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	13,131,801,316円																																																											
分配準備積立金額	D	15,782,045,125円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,502,956,277円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	100,853,127,668口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2.925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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,738,650,388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	1,091,202,340円																																																											
収益調整金額	C	19,572,996,340円																																																											
分配準備積立金額	D	13,085,922,093円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,488,771,161円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	111,459,702,379口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3.184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																																																											

（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5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2019年12月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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4期	第5期
	自 2017年12月21日 至 2018年12月20日	自 2018年12月21日 至 2019年12月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	77,291,650,778円	100,853,127,668円
期中追加設定元本額	39,648,856,359円	35,149,470,870円
期中一部解約元本額	16,087,379,469円	24,542,896,159円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2018年12月20日現在)	(2019年12月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	7,995,845,178	7,084,029,509
親投資信託受益証券	10,274,715,772	12,926,758,345
合計	18,270,560,950	20,010,787,854

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	22,392,495,275	21,855,075,388	
	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	27,323,757,857	36,496,343,369	
投資信託受益証券合計		49,716,253,132	58,351,418,757	
親投資信託受益証券	中小型株式 マザーファンド	3,488,999,054	14,525,051,961	
	国内株式インデックス マザーファンド	13,437,491,879	21,673,330,651	
	J P X 日経インデックス400 マザーファンド	23,923,612,804	36,177,287,282	
	日本株配当マザーファンド	7,024,581,857	14,481,175,498	
	マネープールマザーファンド	9,953	9,976	
親投資信託受益証券合計		47,874,695,547	86,856,855,368	
合計			145,208,274,125	

(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。

J P X 日経インデックス400 マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	788,753,249
株式	62,829,686,470
派生商品評価勘定	1,027,000
未収入金	347,241,850
未収配当金	5,064,300
前払金	1,475,200

	2019年12月20日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	15,719,500
流動資産合計	63,988,967,569
資産合計	63,988,967,569
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,506,380
未払金	187,850
未払解約金	368,703,728
未払利息	1,854
流動負債合計	371,399,812
負債合計	371,399,812
純資産の部	
元本等	
元本	42,069,940,769
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,547,626,988
元本等合計	63,617,567,757
純資産合計	63,617,567,757
負債純資産合計	63,988,967,569

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2019年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		42,069,940,769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)	1.5122円 (15,122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

	2019年12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2019年12月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(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> <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	2019年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月21日
期首元本額	57,179,327,498円
期中追加設定元本額	8,863,915,619円
期中一部解約元本額	23,973,302,348円
期末元本額	42,069,940,769円
期末元本額の内訳	
J P X 日経インデックス400・オープン	1,054,974,530円
S M T J P X 日経インデックス400・オープン	5,077,497,797円
S M T A M J P X 日経インデックス400オープン	1,234,378,869円

区分	2019年12月20日現在
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	23,923,612,804円
JPX日経インデックス400・オープン（SMA専用）	1,236,923,173円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	624,298,751円
FOFs用JPX日経インデックス400・オープン（適格機関投資家専用）	7,195,636,278円
JPX日経400オープン（適格機関投資家専用）	810,569,463円
FOFs用JPX日経インデックス400ファンドS（適格機関投資家専用）	912,049,104円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		3,711,140,385
合計		3,711,140,385

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「JPX日経インデックス400 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

（2019年12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	769,640,200	-	768,165,000	1,475,200
	合計	769,640,200	-	768,165,000	1,475,200

(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

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本水産	45,100	641.00	28,909,100	

マルハニチロ	6,500	2,800.00	18,200,000
国際石油開発帝石	181,100	1,168.50	211,615,350
安藤・間	26,900	966.00	25,985,400
東急建設	13,200	775.00	10,230,000
コムシスホールディングス	16,000	3,150.00	50,400,000
大成建設	34,800	4,465.00	155,382,000
大林組	104,200	1,236.00	128,791,200
清水建設	105,800	1,130.00	119,554,000
長谷工コーポレーション	40,400	1,480.00	59,792,000
鹿島建設	81,800	1,471.00	120,327,800
西松建設	8,000	2,480.00	19,840,000
三井住友建設	25,200	637.00	16,052,400
前田建設工業	26,100	1,071.00	27,953,100
戸田建設	43,300	723.00	31,305,900
熊谷組	4,800	3,320.00	15,936,000
大東建託	12,500	13,695.00	171,187,500
N I P P O	8,600	2,365.00	20,339,000
五洋建設	41,300	682.00	28,166,600
住友林業	26,400	1,614.00	42,609,600
大和ハウス工業	103,100	3,391.00	349,612,100
積水ハウス	114,000	2,373.00	270,522,000
協和エクシオ	15,800	2,790.00	44,082,000
九電工	7,300	3,320.00	24,236,000
森永製菓	7,800	5,440.00	42,432,000
江崎グリコ	9,900	5,050.00	49,995,000
カルビー	15,200	3,665.00	55,708,000
ヤクルト本社	22,900	5,980.00	136,942,000
明治ホールディングス	22,100	7,360.00	162,656,000
日本ハム	12,800	4,540.00	58,112,000
アサヒグループホールディングス	69,900	5,129.00	358,517,100
キリンホールディングス	141,500	2,488.00	352,052,000
サントリー食品インターナショナル	22,300	4,640.00	103,472,000
キッコーマン	24,000	5,370.00	128,880,000
味の素	73,700	1,825.50	134,539,350
キューピー	18,600	2,466.00	45,867,600
アリアケジャパン	3,000	7,880.00	23,640,000
ニチレイ	15,900	2,523.00	40,115,700
東洋水産	17,200	4,700.00	80,840,000
日清食品ホールディングス	14,200	8,170.00	116,014,000
日本たばこ産業	192,600	2,522.50	485,833,500
帝人	26,600	2,093.00	55,673,800
東レ	235,700	753.70	177,647,090

ゴールドウイン	5,900	7,950.00	46,905,000
王子ホールディングス	136,100	617.00	83,973,700
クラレ	51,300	1,365.00	70,024,500
旭化成	215,800	1,254.00	270,613,200
昭和電工	23,200	2,975.00	69,020,000
住友化学	239,200	505.00	120,796,000
日産化学	18,200	4,770.00	86,814,000
東ソー	50,300	1,712.00	86,113,600
トクヤマ	9,400	2,962.00	27,842,800
デンカ	11,900	3,315.00	39,448,500
信越化学工業	55,900	12,025.00	672,197,500
エア・ウォーター	30,300	1,616.00	48,964,800
大陽日酸	31,300	2,436.00	76,246,800
三菱瓦斯化学	30,700	1,691.00	51,913,700
三井化学	29,600	2,696.00	79,801,600
J S R	30,300	2,069.00	62,690,700
三菱ケミカルホールディングス	217,600	826.50	179,846,400
ダイセル	44,500	1,053.00	46,858,500
積水化学工業	70,000	1,924.00	134,680,000
アイカ工業	9,800	3,605.00	35,329,000
宇部興産	16,400	2,432.00	39,884,800
日立化成	15,100	4,570.00	69,007,000
ダイキョーニシカワ	6,900	876.00	6,044,400
日油	12,300	3,685.00	45,325,500
花王	79,600	9,078.00	722,608,800
日本ペイントホールディングス	26,900	5,600.00	150,640,000
関西ペイント	36,600	2,638.00	96,550,800
D I C	13,700	3,065.00	41,990,500
資生堂	66,000	7,814.00	515,724,000
ライオン	43,200	2,139.00	92,404,800
コーセー	6,300	16,100.00	101,430,000
ポーラ・オルビスホールディングス	14,200	2,684.00	38,112,800
小林製薬	9,300	9,360.00	87,048,000
日東電工	22,900	6,230.00	142,667,000
ニフコ	12,200	3,060.00	37,332,000
ユニ・チャーム	64,100	3,707.00	237,618,700
協和キリン	33,400	2,475.00	82,665,000
武田薬品工業	212,400	4,405.00	935,622,000
アステラス製薬	292,400	1,857.50	543,133,000
大日本住友製薬	24,600	2,109.00	51,881,400
塩野義製薬	42,500	6,901.00	293,292,500
田辺三菱製薬	42,000	2,006.00	84,252,000

日本新薬	8,700	9,330.00	81,171,000
中外製薬	34,700	9,960.00	345,612,000
科研製薬	5,700	6,100.00	34,770,000
エーザイ	39,800	8,155.00	324,569,000
小野薬品工業	76,300	2,456.50	187,430,950
久光製薬	9,800	5,510.00	53,998,000
参天製薬	61,900	2,050.00	126,895,000
沢井製薬	6,800	6,900.00	46,920,000
第一三共	95,100	7,044.00	669,884,400
大塚ホールディングス	63,300	4,969.00	314,537,700
ペプチドリーム	16,800	5,450.00	91,560,000
出光興産	37,400	3,045.00	113,883,000
J X T Gホールディングス	515,500	503.70	259,657,350
コスモエネルギーホールディングス	9,600	2,567.00	24,643,200
横浜ゴム	19,200	2,230.00	42,816,000
ブリヂストン	102,200	4,225.00	431,795,000
住友ゴム工業	29,900	1,401.00	41,889,900
A G C	32,900	3,990.00	131,271,000
太平洋セメント	21,000	3,360.00	70,560,000
東海カーボン	34,800	1,125.00	39,150,000
T O T O	23,700	4,660.00	110,442,000
日本碍子	40,600	1,912.00	77,627,200
日本特殊陶業	25,900	2,190.00	56,721,000
ニチアス	9,100	2,768.00	25,188,800
日本製鉄	147,100	1,696.00	249,481,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	88,800	1,445.00	128,316,000
日立金属	35,400	1,604.00	56,781,600
日本軽金属ホールディングス	83,200	234.00	19,468,800
住友金属鉱山	42,000	3,546.00	148,932,000
D O W Aホールディングス	8,300	4,170.00	34,611,000
古河電気工業	10,200	2,863.00	29,202,600
住友電気工業	122,900	1,663.00	204,382,700
S U M C O	39,300	1,841.00	72,351,300
三和ホールディングス	31,500	1,237.00	38,965,500
リンナイ	6,400	8,690.00	55,616,000
東プレ	6,100	1,809.00	11,034,900
アマダホールディングス	41,800	1,278.00	53,420,400
オーエスジー	15,200	2,154.00	32,740,800
D M G 森精機	20,800	1,725.00	35,880,000
ディスコ	4,500	26,240.00	118,080,000
ナブテスコ	19,400	3,355.00	65,087,000
三井海洋開発	3,500	2,701.00	9,453,500

S M C	10,400	50,700.00	527,280,000
小松製作所	150,600	2,652.00	399,391,200
住友重機械工業	19,000	3,160.00	60,040,000
日立建機	13,300	3,315.00	44,089,500
ハーモニック・ドライブ・システムズ	7,000	5,060.00	35,420,000
クボタ	176,400	1,738.50	306,671,400
ダイキン工業	42,300	15,470.00	654,381,000
ダイフク	17,000	6,480.00	110,160,000
竹内製作所	5,600	1,694.00	9,486,400
T P R	4,500	2,183.00	9,823,500
日本精工	62,600	1,063.00	66,543,800
ジェイテクト	31,900	1,342.00	42,809,800
T H K	19,300	2,988.00	57,668,400
マキタ	43,300	3,760.00	162,808,000
三菱重工業	55,700	4,278.00	238,284,600
I H I	23,900	2,555.00	61,064,500
コニカミノルタ	72,600	712.00	51,691,200
ブラザー工業	40,600	2,270.00	92,162,000
ミネベアミツミ	61,700	2,315.00	142,835,500
日立製作所	159,700	4,676.00	746,757,200
三菱電機	332,400	1,527.00	507,574,800
富士電機	20,000	3,385.00	67,700,000
安川電機	35,800	4,175.00	149,465,000
東芝テック	4,200	4,610.00	19,362,000
日本電産	40,000	15,210.00	608,400,000
日新電機	7,800	1,368.00	10,670,400
オムロン	30,900	6,530.00	201,777,000
日本電気	40,300	4,495.00	181,148,500
富士通	32,000	10,410.00	333,120,000
ルネサスエレクトロニクス	158,600	766.00	121,487,600
セイコーエプソン	41,200	1,707.00	70,328,400
アルバック	6,600	4,320.00	28,512,000
エレコム	3,600	4,315.00	15,534,000
パナソニック	379,800	1,016.50	386,066,700
富士通ゼネラル	9,000	2,431.00	21,879,000
ソニー	142,100	7,326.00	1,041,024,600
T D K	16,000	12,380.00	198,080,000
アルプスアルパイン	29,400	2,522.00	74,146,800
ヒロセ電機	5,100	13,910.00	70,941,000
横河電機	30,500	1,952.00	59,536,000
アズビル	21,000	3,185.00	66,885,000
日本光電工業	13,700	2,969.00	40,675,300

堀場製作所	6,600	7,520.00	49,632,000
アドバンテスト	24,700	6,150.00	151,905,000
キーエンス	23,800	38,740.00	922,012,000
シスメックス	23,700	7,496.00	177,655,200
O B A R A G R O U P	1,700	3,815.00	6,485,500
レーザーテック	6,800	10,830.00	73,644,000
スタンレー電気	23,500	3,200.00	75,200,000
カシオ計算機	29,400	2,206.00	64,856,400
ファナック	31,600	20,570.00	650,012,000
浜松ホトニクス	23,800	4,575.00	108,885,000
京セラ	46,800	7,494.00	350,719,200
太陽誘電	14,800	3,160.00	46,768,000
村田製作所	97,600	6,564.00	640,646,400
小糸製作所	19,900	5,600.00	111,440,000
S C R E E Nホールディングス	5,800	7,530.00	43,674,000
キャノン	178,900	3,086.00	552,085,400
東京エレクトロン	22,200	23,950.00	531,690,000
トヨタ紡織	9,700	1,801.00	17,469,700
豊田自動織機	26,900	6,560.00	176,464,000
デンソー	73,200	5,074.00	371,416,800
川崎重工業	25,900	2,476.00	64,128,400
いすゞ自動車	96,300	1,335.00	128,560,500
トヨタ自動車	127,400	7,744.00	986,585,600
日野自動車	41,500	1,170.00	48,555,000
アイシン精機	27,400	4,180.00	114,532,000
マツダ	97,800	953.00	93,203,400
本田技研工業	261,700	3,170.00	829,589,000
スズキ	65,900	4,710.00	310,389,000
S U B A R U	103,200	2,802.50	289,218,000
ヤマハ発動機	43,300	2,293.00	99,286,900
豊田合成	10,700	2,790.00	29,853,000
シマノ	12,400	17,560.00	217,744,000
テイ・エス テック	7,700	3,505.00	26,988,500
テルモ	94,100	3,922.00	369,060,200
島津製作所	39,700	3,460.00	137,362,000
ブイ・テクノロジー	1,600	5,670.00	9,072,000
東京精密	6,000	4,300.00	25,800,000
ニコン	53,800	1,359.00	73,114,200
オリンパス	183,900	1,658.00	304,906,200
H O Y A	66,900	10,225.00	684,052,500
朝日インテック	37,600	3,180.00	119,568,000
バンダイナムコホールディングス	34,400	6,530.00	224,632,000

パイロットコーポレーション	5,800	4,545.00	26,361,000
タカラトミー	14,900	1,417.00	21,113,300
ヤマハ	19,800	6,090.00	120,582,000
ピジョン	20,100	4,145.00	83,314,500
任天堂	20,400	43,200.00	881,280,000
中部電力	101,700	1,567.50	159,414,750
関西電力	125,900	1,288.50	162,222,150
東北電力	83,000	1,107.00	91,881,000
九州電力	68,500	958.00	65,623,000
電源開発	26,400	2,698.00	71,227,200
東京瓦斯	63,900	2,684.50	171,539,550
大阪瓦斯	64,500	2,157.00	139,126,500
東武鉄道	35,100	3,980.00	139,698,000
相鉄ホールディングス	14,200	2,960.00	42,032,000
東急	83,800	2,031.00	170,197,800
小田急電鉄	49,400	2,575.00	127,205,000
京王電鉄	17,200	6,680.00	114,896,000
京成電鉄	23,100	4,240.00	97,944,000
東日本旅客鉄道	58,500	9,849.00	576,166,500
西日本旅客鉄道	29,600	9,514.00	281,614,400
東海旅客鉄道	27,600	22,435.00	619,206,000
西武ホールディングス	44,600	1,818.00	81,082,800
近鉄グループホールディングス	31,500	5,920.00	186,480,000
阪急阪神ホールディングス	42,000	4,730.00	198,660,000
京阪ホールディングス	18,700	5,290.00	98,923,000
名古屋鉄道	34,500	3,375.00	116,437,500
日本通運	11,100	6,510.00	72,261,000
ヤマトホールディングス	55,200	1,856.00	102,451,200
山九	8,700	5,580.00	48,546,000
日立物流	5,800	3,060.00	17,748,000
日本航空	57,600	3,407.00	196,243,200
ANAホールディングス	57,500	3,642.00	209,415,000
日鉄ソリューションズ	4,900	3,705.00	18,154,500
T I S	10,900	6,600.00	71,940,000
ネクソン	92,800	1,475.00	136,880,000
コロブラ	10,700	1,288.00	13,781,600
ティーガイア	2,900	2,702.00	7,835,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	7,900	2,396.00	18,928,400
GMOペイメントゲートウェイ	5,400	7,400.00	39,960,000
アカツキ	1,200	5,820.00	6,984,000
野村総合研究所	54,500	2,417.00	131,726,500
オービック	11,300	14,610.00	165,093,000

Zホールディングス	447,900	434.00	194,388,600
トレンドマイクロ	14,500	5,770.00	83,665,000
日本オラクル	6,600	10,130.00	66,858,000
伊藤忠テクノソリューションズ	14,900	3,090.00	46,041,000
大塚商会	17,600	4,560.00	80,256,000
デジタルガレージ	5,900	4,490.00	26,491,000
日本ユニシス	10,200	3,480.00	35,496,000
日本テレビホールディングス	27,200	1,450.00	39,440,000
日本電信電話	166,000	5,588.00	927,608,000
K D D I	243,100	3,287.00	799,069,700
光通信	3,400	28,110.00	95,574,000
N T T ドコモ	240,900	3,048.00	734,263,200
東宝	19,500	4,560.00	88,920,000
エヌ・ティ・ティ・データ	86,800	1,468.00	127,422,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	13,900	5,540.00	77,006,000
カブコン	15,400	3,080.00	47,432,000
S C S K	7,500	5,720.00	42,900,000
コナミホールディングス	11,800	4,500.00	53,100,000
ソフトバンクグループ	156,600	4,674.00	731,948,400
双日	180,800	355.00	64,184,000
アルフレッサ ホールディングス	36,400	2,270.00	82,628,000
神戸物産	11,300	3,710.00	41,923,000
ダイワボウホールディングス	2,800	6,520.00	18,256,000
T O K A I ホールディングス	17,300	1,135.00	19,635,500
シップヘルスケアホールディングス	5,200	5,140.00	26,728,000
コメダホールディングス	7,100	2,093.00	14,860,300
第一興商	6,500	5,680.00	36,920,000
メディカルホールディングス	35,300	2,413.00	85,178,900
日本ライフライン	9,700	1,497.00	14,520,900
伊藤忠商事	229,000	2,539.00	581,431,000
丸紅	340,800	816.00	278,092,800
豊田通商	36,500	3,930.00	143,445,000
兼松	12,200	1,479.00	18,043,800
三井物産	287,800	1,983.50	570,851,300
日立ハイテクノロジーズ	11,400	7,790.00	88,806,000
住友商事	206,600	1,649.50	340,786,700
三菱商事	229,700	2,913.00	669,116,100
岩谷産業	7,300	3,765.00	27,484,500
P A L T A C	5,200	5,520.00	28,704,000
日鉄物産	2,300	5,310.00	12,213,000
ミスミグループ本社	41,000	2,655.00	108,855,000
ローソン	8,300	6,240.00	51,792,000

エービーシー・マート	5,100	7,520.00	38,352,000	
日本マクドナルドホールディングス	13,700	5,270.00	72,199,000	
セリア	7,800	2,943.00	22,955,400	
ビックカメラ	19,400	1,259.00	24,424,600	
MonotaRO	23,300	2,884.00	67,197,200	
J・フロント リテイリング	39,100	1,470.00	57,477,000	
マツモトキヨシホールディングス	13,500	4,315.00	58,252,500	
ZOZO	22,500	2,139.00	48,127,500	
ウエルシアホールディングス	9,700	6,850.00	66,445,000	
クリエイトSDホールディングス	4,800	2,773.00	13,310,400	
すかいらーくホールディングス	36,700	2,214.00	81,253,800	
コスモス薬品	1,400	22,500.00	31,500,000	
セブン&アイ・ホールディングス	128,100	4,035.00	516,883,500	
ツルハホールディングス	7,100	13,940.00	98,974,000	
クスリのアオキホールディングス	3,300	6,800.00	22,440,000	
ノジマ	5,800	2,292.00	13,293,600	
良品計画	43,500	2,533.00	110,185,500	
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	78,500	1,839.00	144,361,500	
ゼンショーホールディングス	15,700	2,453.00	38,512,100	
ワークマン	3,400	10,280.00	34,952,000	
ユナイテッドアローズ	3,400	3,215.00	10,931,000	
スギホールディングス	6,500	6,230.00	40,495,000	
ファミリーマート	26,200	2,648.00	69,377,600	
しまむら	3,800	9,290.00	35,302,000	
丸井グループ	30,000	2,605.00	78,150,000	
イオン	126,000	2,240.00	282,240,000	
イズミ	6,700	4,030.00	27,001,000	
ヤオコー	3,700	5,490.00	20,313,000	
ケーズホールディングス	31,600	1,450.00	45,820,000	
アインホールディングス	4,400	6,680.00	29,392,000	
ニトリホールディングス	14,200	17,155.00	243,601,000	
ファーストリテイリング	4,400	66,650.00	293,260,000	
サンドラッグ	12,300	4,010.00	49,323,000	
めぶきフィナンシャルグループ	170,400	282.00	48,052,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	192,800	454.00	87,531,200	
新生銀行	24,100	1,658.00	39,957,800	
あおぞら銀行	19,500	2,944.00	57,408,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,664,300	599.20	997,248,560	
りそなホールディングス	359,800	484.80	174,431,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	62,000	4,366.00	270,692,000	
三井住友フィナンシャルグループ	219,700	4,100.00	900,770,000	
千葉銀行	112,800	638.00	71,966,400	

セブン銀行	109,500	360.00	39,420,000
みずほフィナンシャルグループ	4,454,900	169.20	753,769,080
F P G	10,300	1,032.00	10,629,600
S B I ホールディングス	36,600	2,300.00	84,180,000
大和証券グループ本社	263,100	562.70	148,046,370
野村ホールディングス	576,900	561.70	324,044,730
松井証券	18,700	877.00	16,399,900
S O M P O ホールディングス	61,600	4,393.00	270,608,800
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	85,700	3,640.00	311,948,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	26,900	2,700.00	72,630,000
第一生命ホールディングス	185,500	1,861.00	345,215,500
東京海上ホールディングス	117,200	6,190.00	725,468,000
T & D ホールディングス	101,400	1,433.00	145,306,200
全国保証	9,200	4,670.00	42,964,000
芙蓉総合リース	3,400	7,410.00	25,194,000
東京センチュリー	6,600	5,880.00	38,808,000
イオンフィナンシャルサービス	20,100	1,711.00	34,391,100
オリエントコーポレーション	88,700	163.00	14,458,100
オリックス	205,100	1,843.50	378,101,850
三菱U F J リース	83,200	724.00	60,236,800
日本取引所グループ	94,100	1,937.00	182,271,700
いちご	41,700	464.00	19,348,800
ヒューリック	68,400	1,337.00	91,450,800
野村不動産ホールディングス	19,900	2,691.00	53,550,900
プレサンスコーポレーション	5,300	1,214.00	6,434,200
オープンハウス	9,500	3,165.00	30,067,500
東急不動産ホールディングス	89,100	777.00	69,230,700
飯田グループホールディングス	27,300	1,957.00	53,426,100
パーク24	17,600	2,650.00	46,640,000
三井不動産	163,700	2,746.00	449,520,200
三菱地所	229,700	2,127.00	488,571,900
東京建物	35,800	1,714.00	61,361,200
住友不動産	73,700	3,878.00	285,808,600
スターツコーポレーション	4,500	2,785.00	12,532,500
イオンモール	16,400	1,937.00	31,766,800
日本空港ビルデング	10,500	6,170.00	64,785,000
ミクシィ	8,100	2,057.00	16,661,700
ジェイエイシーリクルートメント	2,100	2,029.00	4,260,900
日本M & A センター	24,000	3,680.00	88,320,000
U T グループ	5,000	3,220.00	16,100,000
エス・エム・エス	9,900	3,010.00	29,799,000
パーソルホールディングス	31,800	1,969.00	62,614,200

総合警備保障	12,600	6,070.00	76,482,000
カカクコム	23,800	2,801.00	66,663,800
ディップ	4,500	3,240.00	14,580,000
ベネフィット・ワン	11,600	2,249.00	26,088,400
エムスリー	70,000	3,195.00	223,650,000
アウトソーシング	18,200	1,201.00	21,858,200
ディー・エヌ・エー	15,600	1,763.00	27,502,800
博報堂D Yホールディングス	44,200	1,752.00	77,438,400
電通	32,700	3,720.00	121,644,000
オリエンタルランド	33,800	14,875.00	502,775,000
リゾートトラスト	14,600	1,860.00	27,156,000
ユー・エス・エス	35,600	2,059.00	73,300,400
サイバーエージェント	18,300	3,840.00	70,272,000
楽天	148,000	963.00	142,524,000
エン・ジャパン	5,600	5,020.00	28,112,000
テクノプロ・ホールディングス	6,400	7,890.00	50,496,000
リクルートホールディングス	227,500	4,049.00	921,147,500
リログループ	17,400	2,879.00	50,094,600
カナモト	5,200	2,880.00	14,976,000
セコム	33,700	9,768.00	329,181,600
メイテック	3,900	6,130.00	23,907,000
合計	27,617,700		62,829,686,470

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株配当マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2019年12月20日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	303,364,660
株式	23,365,053,290
派生商品評価勘定	1,642,500
未収配当金	4,480,000
差入委託証拠金	3,600,000
流動資産合計	23,678,140,450
資産合計	23,678,140,450
負債の部	
流動負債	
前受金	1,642,500
未払解約金	38,343,700
未払利息	713
流動負債合計	39,986,913
負債合計	39,986,913
純資産の部	
元本等	
元本	11,466,271,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,171,881,596
元本等合計	23,638,153,537
純資産合計	23,638,153,537
負債純資産合計	23,678,140,450

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2019年12月20日現在

(貸借対照表に関する注記)

	2019年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,466,271,941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) 2.0615円 (20,615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

	2019年12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2019年12月20日現在
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	2019年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月21日
期首元本額	12,439,911,498円
期中追加設定元本額	1,520,182,089円
期中一部解約元本額	2,493,821,646円
期末元本額	11,466,271,941円
期末元本額の内訳	

区分	2019年12月20日現在
日本株配当オープン	1,038,032,042円
3資産バランスオープン	868,948,423円
3資産バランスオープンアルファ	164,661,808円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,024,581,857円
日本株配当オープン（SMA専用）	360,299,836円
FOFs用日本株配当オープン（適格機関投資家専用）	1,785,494,369円
FOFs用日本株配当ファンドS（適格機関投資家専用）	224,253,606円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,047,663,935
合計	2,047,663,935

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株配当マザーファンド」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

（2019年12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	153,697,500	-	155,340,000	1,642,500
	合計	153,697,500	-	155,340,000	1,642,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

国際石油開発帝石	161,200	1,168.50	188,362,200
コムシスホールディングス	101,200	3,150.00	318,780,000
西松建設	70,200	2,480.00	174,096,000
大和ハウス工業	77,000	3,391.00	261,107,000
協和エクシオ	98,000	2,790.00	273,420,000
日本たばこ産業	174,000	2,522.50	438,915,000
信越化学工業	52,800	12,025.00	634,920,000
富士フィルムホールディングス	74,200	5,295.00	392,889,000
ポーラ・オルビスホールディングス	29,000	2,684.00	77,836,000
武田薬品工業	132,900	4,405.00	585,424,500
アステラス製薬	214,900	1,857.50	399,176,750
第一三共	45,800	7,044.00	322,615,200
出光興産	61,800	3,045.00	188,181,000
住友電気工業	77,500	1,663.00	128,882,500
三和ホールディングス	73,400	1,237.00	90,795,800
牧野フライス製作所	28,200	5,040.00	142,128,000
ソディック	131,200	1,001.00	131,331,200
ディスコ	14,300	26,240.00	375,232,000
日立建機	25,600	3,315.00	84,864,000
日立製作所	91,400	4,676.00	427,386,400
三菱電機	332,600	1,527.00	507,880,200
富士電機	120,600	3,385.00	408,231,000
I D E C	67,800	2,247.00	152,346,600
日本電気	42,000	4,495.00	188,790,000
富士通	34,900	10,410.00	363,309,000
T D K	34,000	12,380.00	420,920,000
アズビル	144,400	3,185.00	459,914,000
アドバンテスト	34,300	6,150.00	210,945,000
ローム	38,600	8,720.00	336,592,000
村田製作所	73,200	6,564.00	480,484,800
キャノン	45,500	3,086.00	140,413,000
東京エレクトロン	16,500	23,950.00	395,175,000
デンソー	31,900	5,074.00	161,860,600
トヨタ自動車	162,200	7,744.00	1,256,076,800
S U B A R U	152,100	2,802.50	426,260,250
ピジョン	10,700	4,145.00	44,351,500
任天堂	10,200	43,200.00	440,640,000
関西電力	85,200	1,288.50	109,780,200
九州電力	15,500	958.00	14,849,000
西日本旅客鉄道	41,400	9,514.00	393,879,600
日本航空	79,700	3,407.00	271,537,900
住友倉庫	78,200	1,501.00	117,378,200

コーエーテクモホールディングス	29,800	2,878.00	85,764,400	
Zホールディングス	236,200	434.00	102,510,800	
トレンドマイクロ	19,500	5,770.00	112,515,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	53,500	3,090.00	165,315,000	
ネットワンシステムズ	42,700	2,750.00	117,425,000	
日本電信電話	127,300	5,588.00	711,352,400	
KDDI	131,700	3,287.00	432,897,900	
ソフトバンク	247,300	1,449.00	358,337,700	
光通信	15,200	28,110.00	427,272,000	
萩原電気ホールディングス	55,400	2,932.00	162,432,800	
伊藤忠商事	269,700	2,539.00	684,768,300	
三井物産	319,500	1,983.50	633,728,250	
住友商事	29,800	1,649.50	49,155,100	
三菱商事	185,600	2,913.00	540,652,800	
DCMホールディングス	156,100	1,077.00	168,119,700	
セブン&アイ・ホールディングス	86,100	4,035.00	347,413,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,413,200	599.20	846,789,440	
三井住友フィナンシャルグループ	184,400	4,100.00	756,040,000	
みずほフィナンシャルグループ	3,308,400	169.20	559,781,280	
大和証券グループ本社	96,600	562.70	54,356,820	
SOMPOホールディングス	67,900	4,393.00	298,284,700	
ソニーフィナンシャルホールディングス	54,000	2,700.00	145,800,000	
第一生命ホールディングス	233,800	1,861.00	435,101,800	
T&Dホールディングス	256,500	1,433.00	367,564,500	
オリックス	322,200	1,843.50	593,975,700	
野村不動産ホールディングス	96,000	2,691.00	258,336,000	
パーク24	63,400	2,650.00	168,010,000	
電通	28,900	3,720.00	107,508,000	
りらいあコミュニケーションズ	138,300	1,410.00	195,003,000	
テクノプロ・ホールディングス	38,800	7,890.00	306,132,000	
ベルシステム24ホールディングス	139,900	1,678.00	234,752,200	
合計	11,833,800		23,365,053,290	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年12月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,863,906,855
株式	39,003,231,000
未収入金	389,044,610
未収配当金	18,428,000
流動資産合計	41,274,610,465
資産合計	41,274,610,465
負債の部	
流動負債	
未払金	265,178,488
未払解約金	51,416,479
未払利息	4,381
流動負債合計	316,599,348
負債合計	316,599,348
純資産の部	
元本等	
元本	9,838,394,791
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,119,616,326
元本等合計	40,958,011,117
純資産合計	40,958,011,117
負債純資産合計	41,274,610,465

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

		2019年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		9,838,394,791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)	4.1631円 (41,631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

		2019年12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	

	2019年12月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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	2019年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月21日
期首元本額	10,326,897,022円
期中追加設定元本額	1,318,115,741円
期中一部解約元本額	1,806,617,972円
期末元本額	9,838,394,791円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	5,956,125,968円
中小型株式オープン（SMA専用）	247,474,010円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	3,488,999,054円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	145,795,759円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,475,324,166
合計	4,475,324,166

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
安藤・間	550,000	966.00	531,300,000	
寿スピリッツ	100,000	8,070.00	807,000,000	
トリケミカル研究所	100,000	8,590.00	859,000,000	
レック	315,000	1,357.00	427,455,000	
エフピコ	40,000	6,700.00	268,000,000	
日本新薬	20,000	9,330.00	186,600,000	
ステムリム	210,000	871.00	182,910,000	
MARUWA	155,000	8,340.00	1,292,700,000	
RS Technologies	110,000	3,945.00	433,950,000	
NITTOKU	90,000	3,895.00	350,550,000	
平田機工	95,000	7,240.00	687,800,000	
スター精密	270,000	1,596.00	430,920,000	
イビデン	300,000	2,659.00	797,700,000	
富士電機	195,000	3,385.00	660,075,000	
第一精工	150,000	2,530.00	379,500,000	
ワコム	880,000	474.00	417,120,000	
アンリツ	290,000	2,122.00	615,380,000	
イリソ電子工業	115,000	5,000.00	575,000,000	
レーザーテック	122,000	10,830.00	1,321,260,000	
日本セラミック	110,000	2,808.00	308,880,000	
SCREENホールディングス	29,000	7,530.00	218,370,000	
インターアクション	340,000	2,914.00	990,760,000	
メニコン	110,000	4,540.00	499,400,000	
スノーピーク	105,000	1,122.00	117,810,000	
フルヤ金属	90,000	5,950.00	535,500,000	
SHOEI	102,000	5,380.00	548,760,000	
アシックス	250,000	1,859.00	464,750,000	

トランコム	48,000	8,250.00	396,000,000
システナ	435,000	1,796.00	781,260,000
S H I F T	51,000	7,750.00	395,250,000
GMOペイメントゲートウェイ	90,000	7,400.00	666,000,000
カナミックネットワーク	285,000	726.00	206,910,000
オロ	145,000	3,735.00	541,575,000
インフォコム	260,000	2,540.00	660,400,000
HEROZ	17,000	12,070.00	205,190,000
メルカリ	50,000	2,146.00	107,300,000
チームスピリット	100,000	2,225.00	222,500,000
L i n k - U	50,000	5,330.00	266,500,000
B A S E	55,000	1,832.00	100,760,000
Zホールディングス	1,000,000	434.00	434,000,000
ネットワンシステムズ	300,000	2,750.00	825,000,000
ビジョン	405,000	1,739.00	704,295,000
光通信	41,000	28,110.00	1,152,510,000
ゼンリン	225,000	1,932.00	434,700,000
東宝	160,000	4,560.00	729,600,000
アズワン	66,000	10,040.00	662,640,000
P A L T A C	182,000	5,520.00	1,004,640,000
シュッピン	420,000	1,176.00	493,920,000
オイシックス・ラ・大地	300,000	1,236.00	370,800,000
T O K Y O B A S E	325,000	631.00	205,075,000
クスリのアオキホールディングス	30,000	6,800.00	204,000,000
ほぼ日	28,500	5,410.00	154,185,000
幸楽苑ホールディングス	175,000	2,045.00	357,875,000
ワークマン	86,000	10,280.00	884,080,000
S B Iホールディングス	220,000	2,300.00	506,000,000
アニコムホールディングス	180,000	3,635.00	654,300,000
アルヒ	360,000	2,292.00	825,120,000
イー・ギャランティ	213,000	1,316.00	280,308,000
スター・マイカ・ホールディングス	208,000	1,697.00	352,976,000
ティーケーピー	84,000	4,215.00	354,060,000
日本M&Aセンター	130,000	3,680.00	478,400,000
リンクアンドモチベーション	400,000	617.00	246,800,000
エムスリー	250,000	3,195.00	798,750,000
手間いらず	90,000	6,010.00	540,900,000
シーティーエス	368,000	804.00	295,872,000
サイバーエージェント	160,000	3,840.00	614,400,000
ジャパンマテリアル	470,000	1,749.00	822,030,000
ロゼッタ	120,000	3,840.00	460,800,000
L I T A L I C O	220,000	2,288.00	503,360,000

エボラブルアジア	255,000	2,100.00	535,500,000	
グレイステクノロジー	70,000	2,697.00	188,790,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	200,000	2,773.00	554,600,000	
東祥	170,000	2,482.00	421,940,000	
乃村工藝社	310,000	1,436.00	445,160,000	
ダイセキ	330,000	3,175.00	1,047,750,000	
合 計	15,380,500		39,003,231,000	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,227,076,435
株式	322,351,447,670
派生商品評価勘定	11,803,500
未収入金	1,046,639,441
未収配当金	38,477,420
差入委託証拠金	79,553,900
流動資産合計	326,754,998,366
資産合計	326,754,998,366
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,480,400
前受金	8,323,100
未払金	542,300
未払解約金	995,593,717
未払利息	7,585
流動負債合計	1,007,947,102
負債合計	1,007,947,102
純資産の部	
元本等	
元本	201,967,964,538
剰余金	

	2019年12月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	123,779,086,726
元本等合計	325,747,051,264
純資産合計	325,747,051,264
負債純資産合計	326,754,998,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年12月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	201,967,964,538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 1.6129円 (1万口当たり純資産額) (16,129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

	2019年12月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2019年12月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月21日
期首元本額	165,487,029,053円
期中追加設定元本額	64,957,370,411円
期中一部解約元本額	28,476,434,926円
期末元本額	201,967,964,538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）	566,615,593円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,014,679,912円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,145,990円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,095,265,947円
世界経済インデックスファンド	2,073,910,469円
日本株式インデックス・オープン	4,563,866,409円
DCマイセレクション25	6,777,300,255円
DCマイセレクション50	19,143,709,896円
DCマイセレクション75	17,377,591,805円
DC日本株式インデックス・オープン	5,642,166,565円

区分	2019年12月20日現在
DCマイセレクションS25	2,709,026,946円
DCマイセレクションS50	7,763,421,358円
DCマイセレクションS75	5,052,737,205円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,597,350,733円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	391,544,027円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	711,605,998円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	469,762,922円
DC世界経済インデックスファンド	1,898,629,433円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,035,247,840円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,112,186円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,456,712円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,943,720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)	280,611,591円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,582,381円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	77,066,171円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	288,276,565円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	57,188,130円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	414,798,557円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,653,648,170円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	686,829,776円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,989,783,469円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	607,726,488円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,088,838円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	757,988,140円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,607,624円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	423,317,624円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	552,933,599円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,344,179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)	820,560,281円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,705,766,199円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,510,231円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,126,989,548円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,095,776,300円
分散投資コア戦略ファンドA	5,961,437,227円
分散投資コア戦略ファンドS	15,951,269,188円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	269,581,558円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	286,994,235円
コア投資戦略ファンド(切替型)	735,283,155円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	210,633,492円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,948,710円
SMT インデックスバランス・オープン	70,230,367円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,437,491,879円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	538,869,898円

区分	2019年12月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	17,180,961円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	62,741,578円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	9,869,166円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,651,618円
グローバル経済コア	271,152,116円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,644,598円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	41,110,019円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,597,636円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	353,247,293円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,581,000円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	46,697,266,838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）	570,780,038円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	11,833,788円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年12月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		35,753,279,831
合計		35,753,279,831

(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

（2019年12月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,063,956,900	-	3,072,280,000	8,323,100
	合計	3,063,956,900	-	3,072,280,000	8,323,100

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,300	2,835.00	17,860,500	
日本水産	178,900	641.00	114,674,900	
マルハニチロ	25,800	2,800.00	72,240,000	
カネコ種苗	5,400	1,484.00	8,013,600	
サカタのタネ	21,300	3,825.00	81,472,500	
ホクト	13,600	2,000.00	27,200,000	
ホクリヨウ	2,800	700.00	1,960,000	
住石ホールディングス	36,100	153.00	5,523,300	
日鉄鉱業	4,100	4,955.00	20,315,500	
三井松島ホールディングス	6,900	1,235.00	8,521,500	
国際石油開発帝石	717,800	1,168.50	838,749,300	
石油資源開発	23,400	3,085.00	72,189,000	
K & O エナジーグループ	8,700	1,672.00	14,546,400	
ヒノキヤグループ	4,400	2,269.00	9,983,600	
ショーボンドホールディングス	25,500	4,530.00	115,515,000	
ミライト・ホールディングス	53,200	1,677.00	89,216,400	
タマホーム	8,600	1,690.00	14,534,000	
サンヨーホームズ	1,500	674.00	1,011,000	
日本アクア	7,100	646.00	4,586,600	
ファーストコーポレーション	5,500	619.00	3,404,500	
ベステラ	3,100	1,244.00	3,856,400	
T A T E R U	36,900	218.00	8,044,200	
スペースバリューホールディングス	21,800	521.00	11,357,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,042.00	3,542,800	
第一カッター興業	2,200	1,819.00	4,001,800	
安藤・間	106,500	966.00	102,879,000	
東急建設	52,400	775.00	40,610,000	
コムシスホールディングス	63,400	3,150.00	199,710,000	
ミサワホーム	12,300	1,199.00	14,747,700	
ピーアールホールディングス	19,500	487.00	9,496,500	
高松コンストラクショングループ	11,100	2,818.00	31,279,800	
東建コーポレーション	5,500	7,490.00	41,195,000	
ソネック	1,800	828.00	1,490,400	

ヤマウラ	7,800	899.00	7,012,200
大成建設	137,800	4,465.00	615,277,000
大林組	413,200	1,236.00	510,715,200
清水建設	419,300	1,130.00	473,809,000
飛鳥建設	11,800	1,514.00	17,865,200
長谷工コーポレーション	160,000	1,480.00	236,800,000
松井建設	16,300	816.00	13,300,800
銭高組	1,800	3,990.00	7,182,000
鹿島建設	324,400	1,471.00	477,192,400
不動テトラ	10,800	1,700.00	18,360,000
大末建設	4,800	995.00	4,776,000
鉄建建設	9,000	2,865.00	25,785,000
西松建設	31,800	2,480.00	78,864,000
三井住友建設	99,800	637.00	63,572,600
大豊建設	9,300	2,931.00	27,258,300
前田建設工業	103,500	1,071.00	110,848,500
佐田建設	8,900	468.00	4,165,200
ナカノフドー建設	11,300	469.00	5,299,700
奥村組	22,400	3,005.00	67,312,000
東鉄工業	17,700	3,255.00	57,613,500
イチケン	3,000	1,799.00	5,397,000
富士ピー・エス	6,100	603.00	3,678,300
浅沼組	4,600	4,590.00	21,114,000
戸田建設	171,600	723.00	124,066,800
熊谷組	19,100	3,320.00	63,412,000
北野建設	2,500	2,646.00	6,615,000
植木組	1,800	2,584.00	4,651,200
矢作建設工業	18,200	848.00	15,433,600
ピーエス三菱	13,600	734.00	9,982,400
日本ハウスホールディングス	28,200	504.00	14,212,800
大東建託	49,500	13,695.00	677,902,500
新日本建設	17,600	970.00	17,072,000
N I P P O	34,200	2,365.00	80,883,000
東亜道路工業	2,600	3,640.00	9,464,000
前田道路	43,800	2,679.00	117,340,200
日本道路	4,000	7,100.00	28,400,000
東亜建設工業	12,900	1,666.00	21,491,400
日本国土開発	24,100	659.00	15,881,900
若築建設	7,400	1,747.00	12,927,800
東洋建設	46,300	526.00	24,353,800
五洋建設	163,800	682.00	111,711,600
世紀東急工業	19,800	902.00	17,859,600

福田組	4,800	5,160.00	24,768,000
住友林業	104,700	1,614.00	168,985,800
日本基礎技術	13,900	417.00	5,796,300
巴コーポレーション	18,300	469.00	8,582,700
大和ハウス工業	408,800	3,391.00	1,386,240,800
ライト工業	23,600	1,571.00	37,075,600
積水ハウス	452,100	2,373.00	1,072,833,300
日特建設	10,800	859.00	9,277,200
北陸電気工事	7,200	1,117.00	8,042,400
ユアテック	23,600	715.00	16,874,000
四電工	2,200	2,843.00	6,254,600
中電工	16,600	2,584.00	42,894,400
関電工	58,800	1,065.00	62,622,000
きんでん	98,200	1,717.00	168,609,400
東京エネシス	13,700	958.00	13,124,600
トーエネック	4,200	3,885.00	16,317,000
住友電設	11,700	2,865.00	33,520,500
日本電設工業	22,700	2,292.00	52,028,400
協和エクシオ	62,700	2,790.00	174,933,000
新日本空調	10,900	2,240.00	24,416,000
九電工	29,000	3,320.00	96,280,000
三機工業	29,800	1,540.00	45,892,000
日揮ホールディングス	127,200	1,805.00	229,596,000
中外炉工業	4,500	1,866.00	8,397,000
ヤマト	13,200	776.00	10,243,200
太平電業	10,000	2,324.00	23,240,000
高砂熱学工業	35,900	1,978.00	71,010,200
三晃金属工業	1,800	2,651.00	4,771,800
朝日工業社	2,800	3,425.00	9,590,000
明星工業	26,700	988.00	26,379,600
大気社	20,100	4,025.00	80,902,500
ダイダン	9,900	2,829.00	28,007,100
日比谷総合設備	13,300	2,035.00	27,065,500
東芝プラントシステム	32,000	2,667.00	85,344,000
OSJBホールディングス	65,200	270.00	17,604,000
東洋エンジニアリング	17,400	735.00	12,789,000
レイズネクスト	22,200	1,354.00	30,058,800
日本製粉	38,700	1,713.00	66,293,100
日清製粉グループ本社	149,400	1,955.00	292,077,000
日東富士製粉	1,000	6,410.00	6,410,000
昭和産業	12,100	3,210.00	38,841,000
鳥越製粉	11,700	902.00	10,553,400

中部飼料	16,200	1,653.00	26,778,600
フィード・ワン	88,800	189.00	16,783,200
東洋精糖	2,200	1,175.00	2,585,000
日本甜菜製糖	6,900	2,010.00	13,869,000
三井製糖	11,600	2,329.00	27,016,400
塩水港精糖	14,300	219.00	3,131,700
日新製糖	6,300	2,015.00	12,694,500
森永製菓	31,000	5,440.00	168,640,000
中村屋	3,400	4,440.00	15,096,000
江崎グリコ	39,200	5,050.00	197,960,000
名糖産業	6,400	1,324.00	8,473,600
井村屋グループ	5,600	2,007.00	11,239,200
不二家	7,400	2,202.00	16,294,800
山崎製パン	99,100	1,954.00	193,641,400
第一屋製パン	2,300	990.00	2,277,000
モロゾフ	2,300	5,080.00	11,684,000
亀田製菓	7,500	4,950.00	37,125,000
寿スピリッツ	12,700	8,070.00	102,489,000
カルビー	60,300	3,665.00	220,999,500
森永乳業	24,500	4,390.00	107,555,000
六甲バター	8,800	1,791.00	15,760,800
ヤクルト本社	91,000	5,980.00	544,180,000
明治ホールディングス	87,400	7,360.00	643,264,000
雪印メグミルク	31,800	2,515.00	79,977,000
プリマハム	20,700	2,576.00	53,323,200
日本ハム	50,500	4,540.00	229,270,000
林兼産業	4,400	728.00	3,203,200
丸大食品	14,100	2,328.00	32,824,800
S Foods	10,600	2,804.00	29,722,400
伊藤ハム米久ホールディングス	85,100	717.00	61,016,700
サッポロホールディングス	45,100	2,725.00	122,897,500
アサヒグループホールディングス	276,900	5,129.00	1,420,220,100
キリンホールディングス	560,800	2,488.00	1,395,270,400
宝ホールディングス	99,000	1,011.00	100,089,000
オエノンホールディングス	34,900	401.00	13,994,900
養命酒製造	4,000	1,985.00	7,940,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	92,800	2,824.00	262,067,200
サントリー食品インターナショナル	88,500	4,640.00	410,640,000
ダイドーグループホールディングス	6,800	4,570.00	31,076,000
伊藤園	40,100	5,550.00	222,555,000
キーコーヒー	13,000	2,306.00	29,978,000
ユニカフェ	3,400	1,034.00	3,515,600

ジャパンフーズ	1,900	1,279.00	2,430,100
日清オイリオグループ	17,000	3,895.00	66,215,000
不二製油グループ本社	32,200	2,998.00	96,535,600
かどや製油	1,400	3,780.00	5,292,000
J・オイルミルズ	6,900	4,500.00	31,050,000
キッコーマン	95,200	5,370.00	511,224,000
味の素	292,000	1,825.50	533,046,000
キューピー	73,600	2,466.00	181,497,600
ハウス食品グループ本社	49,500	3,790.00	187,605,000
カゴメ	50,200	2,660.00	133,532,000
焼津水産化学工業	6,400	1,040.00	6,656,000
アリアケジャパン	12,100	7,880.00	95,348,000
ピエトロ	1,700	1,639.00	2,786,300
エバラ食品工業	3,200	2,211.00	7,075,200
やまみ	600	2,368.00	1,420,800
ニチレイ	63,000	2,523.00	158,949,000
東洋水産	68,000	4,700.00	319,600,000
イトアンド	4,600	1,789.00	8,229,400
大冷	1,700	1,961.00	3,333,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,300	1,195.00	8,723,500
日清食品ホールディングス	56,200	8,170.00	459,154,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,169.00	14,098,500
一正蒲鉾	5,100	1,037.00	5,288,700
フジッコ	14,300	1,958.00	27,999,400
ロック・フィールド	14,200	1,541.00	21,882,200
日本たばこ産業	763,600	2,522.50	1,926,181,000
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,493.00	18,448,200
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,720.00	14,964,000
なとり	7,400	1,709.00	12,646,600
イフジ産業	2,300	781.00	1,796,300
ピクルスコーポレーション	2,900	3,020.00	8,758,000
北の達人コーポレーション	46,200	697.00	32,201,400
ユーグレナ	56,400	779.00	43,935,600
ミヨシ油脂	5,100	1,315.00	6,706,500
理研ビタミン	6,200	4,095.00	25,389,000
片倉工業	19,100	1,375.00	26,262,500
ゲンゼ	9,600	4,935.00	47,376,000
東洋紡	51,300	1,631.00	83,670,300
ユニチカ	39,000	391.00	15,249,000
富士紡ホールディングス	6,400	3,595.00	23,008,000
倉敷紡績	13,400	2,566.00	34,384,400
シキボウ	6,800	1,013.00	6,888,400

日本毛織	42,900	1,140.00	48,906,000
トーア紡コーポレーション	5,100	584.00	2,978,400
帝国繊維	14,700	2,182.00	32,075,400
帝人	105,500	2,093.00	220,811,500
東レ	934,900	753.70	704,634,130
サカイオーベックス	3,700	1,907.00	7,055,900
住江織物	3,800	2,918.00	11,088,400
日本フェルト	8,200	498.00	4,083,600
イチカワ	2,100	1,535.00	3,223,500
日東製網	1,500	1,676.00	2,514,000
アツギ	10,800	853.00	9,212,400
ダイニック	4,900	798.00	3,910,200
セーレン	32,000	1,602.00	51,264,000
ソトー	5,200	974.00	5,064,800
東海染工	1,900	1,134.00	2,154,600
小松マテーレ	21,300	817.00	17,402,100
ワコールホールディングス	33,700	2,948.00	99,347,600
ホギメディカル	14,700	3,685.00	54,169,500
レナウン	33,200	114.00	3,784,800
クラウディアホールディングス	3,400	486.00	1,652,400
T S Iホールディングス	43,500	564.00	24,534,000
マツオカコーポレーション	3,700	2,498.00	9,242,600
ワールド	18,300	2,871.00	52,539,300
三陽商会	6,800	1,361.00	9,254,800
ナイガイ	5,000	469.00	2,345,000
オンワードホールディングス	77,700	654.00	50,815,800
ルックホールディングス	4,500	1,235.00	5,557,500
ゴールドウイン	23,400	7,950.00	186,030,000
デサント	25,200	2,059.00	51,886,800
キング	6,300	525.00	3,307,500
ヤマトインターナショナル	8,100	408.00	3,304,800
特種東海製紙	8,200	4,150.00	34,030,000
王子ホールディングス	539,400	617.00	332,809,800
日本製紙	57,100	1,866.00	106,548,600
三菱製紙	14,600	495.00	7,227,000
北越コーポレーション	85,600	568.00	48,620,800
中越パルプ工業	5,500	1,665.00	9,157,500
巴川製紙所	3,800	882.00	3,351,600
大王製紙	56,600	1,494.00	84,560,400
阿波製紙	3,300	572.00	1,887,600
レンゴー	122,000	835.00	101,870,000
トーモク	7,900	1,884.00	14,883,600

ザ・パックス	9,800	4,210.00	41,258,000
クラレ	203,200	1,365.00	277,368,000
旭化成	855,300	1,254.00	1,072,546,200
共和レザー	7,000	828.00	5,796,000
昭和電工	91,900	2,975.00	273,402,500
住友化学	948,100	505.00	478,790,500
住友精化	5,700	3,580.00	20,406,000
日産化学	72,200	4,770.00	344,394,000
ラサ工業	4,500	1,594.00	7,173,000
クレハ	11,100	6,700.00	74,370,000
多木化学	3,800	4,595.00	17,461,000
テイカ	9,500	2,037.00	19,351,500
石原産業	23,100	1,075.00	24,832,500
片倉コープアグリ	3,300	1,200.00	3,960,000
日本曹達	19,100	2,999.00	57,280,900
東ソー	199,500	1,712.00	341,544,000
トクヤマ	37,200	2,962.00	110,186,400
セントラル硝子	26,400	2,719.00	71,781,600
東亜合成	81,000	1,318.00	106,758,000
大阪ソーダ	13,100	3,180.00	41,658,000
関東電化工業	30,600	1,010.00	30,906,000
デンカ	47,100	3,315.00	156,136,500
信越化学工業	221,600	12,025.00	2,664,740,000
日本カーバイド工業	4,400	1,485.00	6,534,000
堺化学工業	8,300	2,594.00	21,530,200
第一稀元素化学工業	14,000	893.00	12,502,000
エア・ウォーター	120,000	1,616.00	193,920,000
大陽日酸	124,000	2,436.00	302,064,000
日本化学工業	4,000	3,495.00	13,980,000
東邦アセチレン	1,900	1,356.00	2,576,400
日本パーカライズニング	65,100	1,208.00	78,640,800
高压ガス工業	20,500	881.00	18,060,500
チタン工業	1,600	2,760.00	4,416,000
四国化成工業	19,900	1,350.00	26,865,000
戸田工業	3,000	2,182.00	6,546,000
ステラ ケミファ	7,000	3,325.00	23,275,000
保土谷化学工業	4,800	4,180.00	20,064,000
日本触媒	20,000	6,820.00	136,400,000
大日精化工業	11,400	3,270.00	37,278,000
カネカ	33,400	3,635.00	121,409,000
三菱瓦斯化学	121,800	1,691.00	205,963,800
三井化学	117,200	2,696.00	315,971,200

J S R	120,200	2,069.00	248,693,800
東京応化工業	22,100	4,355.00	96,245,500
大阪有機化学工業	11,900	1,498.00	17,826,200
三菱ケミカルホールディングス	862,600	826.50	712,938,900
K Hネオケム	22,700	2,402.00	54,525,400
ダイセル	176,500	1,053.00	185,854,500
住友ベークライト	20,300	4,235.00	85,970,500
積水化学工業	277,500	1,924.00	533,910,000
日本ゼオン	116,400	1,370.00	159,468,000
アイカ工業	38,700	3,605.00	139,513,500
宇部興産	65,200	2,432.00	158,566,400
積水樹脂	23,200	2,308.00	53,545,600
タキロンシーアイ	27,900	731.00	20,394,900
旭有機材	7,300	1,749.00	12,767,700
日立化成	59,700	4,570.00	272,829,000
ニチバン	6,800	1,938.00	13,178,400
リケンテクノス	32,500	518.00	16,835,000
大倉工業	6,100	2,017.00	12,303,700
積水化成成品工業	17,300	836.00	14,462,800
群栄化学工業	2,900	2,642.00	7,661,800
タイガースポリマー	6,800	620.00	4,216,000
ミライアル	4,600	1,463.00	6,729,800
ダイキアクシス	4,600	1,009.00	4,641,400
ダイキョーニシカワ	27,200	876.00	23,827,200
竹本容器	4,600	996.00	4,581,600
森六ホールディングス	6,900	2,399.00	16,553,100
日本化薬	79,900	1,366.00	109,143,400
カーリットホールディングス	13,800	649.00	8,956,200
日本精化	10,400	1,286.00	13,374,400
扶桑化学工業	13,100	3,130.00	41,003,000
トリケミカル研究所	2,900	8,590.00	24,911,000
A D E K A	59,400	1,669.00	99,138,600
日油	48,600	3,685.00	179,091,000
新日本理化	21,400	208.00	4,451,200
ハリマ化成グループ	10,700	1,199.00	12,829,300
花王	315,500	9,078.00	2,864,109,000
第一工業製薬	4,800	4,595.00	22,056,000
石原ケミカル	3,500	2,145.00	7,507,500
日華化学	4,300	938.00	4,033,400
ニイタカ	2,000	1,805.00	3,610,000
三洋化成工業	7,700	5,450.00	41,965,000
有機合成薬品工業	9,900	303.00	2,999,700

大日本塗料	14,600	1,198.00	17,490,800
日本ペイントホールディングス	106,500	5,600.00	596,400,000
関西ペイント	145,000	2,638.00	382,510,000
神東塗料	10,100	213.00	2,151,300
中国塗料	36,700	1,046.00	38,388,200
日本特殊塗料	9,700	1,628.00	15,791,600
藤倉化成	17,400	588.00	10,231,200
太陽ホールディングス	9,500	4,380.00	41,610,000
D I C	54,500	3,065.00	167,042,500
サカタインクス	28,200	1,200.00	33,840,000
東洋インキＳＣホールディングス	27,300	2,685.00	73,300,500
T & K T O K A	10,000	1,042.00	10,420,000
富士フィルムホールディングス	252,600	5,295.00	1,337,517,000
資生堂	261,800	7,814.00	2,045,705,200
ライオン	171,300	2,139.00	366,410,700
高砂香料工業	8,200	2,581.00	21,164,200
マンダム	29,600	3,020.00	89,392,000
ミルボン	17,600	6,220.00	109,472,000
ファンケル	53,300	2,986.00	159,153,800
コーセー	24,800	16,100.00	399,280,000
コタ	6,900	1,521.00	10,494,900
シーボン	1,700	2,509.00	4,265,300
ポーラ・オルビスホールディングス	56,200	2,684.00	150,840,800
ノエビアホールディングス	12,600	5,900.00	74,340,000
アジュバンコスメジャパン	2,900	950.00	2,755,000
エステー	8,500	1,736.00	14,756,000
アグロ カネショウ	4,100	1,558.00	6,387,800
コニシ	21,600	1,529.00	33,026,400
長谷川香料	17,500	2,044.00	35,770,000
星光PMC	7,500	1,007.00	7,552,500
小林製薬	36,900	9,360.00	345,384,000
荒川化学工業	11,800	1,648.00	19,446,400
メック	9,000	1,602.00	14,418,000
日本高純度化学	3,600	2,657.00	9,565,200
タカラバイオ	34,500	2,093.00	72,208,500
J C U	16,000	3,270.00	52,320,000
新田ゼラチン	8,300	690.00	5,727,000
O A T アグリオ	2,300	1,586.00	3,647,800
デクセリアルズ	34,000	1,069.00	36,346,000
アース製薬	9,900	5,810.00	57,519,000
北興化学工業	13,500	594.00	8,019,000
大成ラミック	4,300	2,964.00	12,745,200

クミアイ化学工業	54,500	993.00	54,118,500
日本農薬	23,500	580.00	13,630,000
アキレス	9,100	1,836.00	16,707,600
有沢製作所	20,800	1,005.00	20,904,000
日東電工	90,900	6,230.00	566,307,000
レック	14,100	1,357.00	19,133,700
三光合成	15,100	436.00	6,583,600
きもと	22,400	180.00	4,032,000
藤森工業	11,800	3,520.00	41,536,000
前澤化成工業	8,400	1,228.00	10,315,200
未来工業	7,100	2,210.00	15,691,000
ウェーブロックホールディングス	4,500	844.00	3,798,000
JSP	7,700	1,972.00	15,184,400
エフピコ	14,500	6,700.00	97,150,000
天馬	8,800	2,001.00	17,608,800
信越ポリマー	23,700	1,030.00	24,411,000
東リ	32,800	331.00	10,856,800
ニフコ	48,400	3,060.00	148,104,000
バルカー	10,700	2,672.00	28,590,400
ユニ・チャーム	254,000	3,707.00	941,578,000
ショーエイコーポレーション	1,500	753.00	1,129,500
協和キリン	132,500	2,475.00	327,937,500
武田薬品工業	1,096,200	4,405.00	4,828,761,000
アステラス製薬	1,159,000	1,857.50	2,152,842,500
大日本住友製薬	97,700	2,109.00	206,049,300
塩野義製薬	168,500	6,901.00	1,162,818,500
田辺三菱製薬	160,800	2,006.00	322,564,800
わかもと製薬	15,700	273.00	4,286,100
あすか製薬	15,000	1,291.00	19,365,000
日本新薬	34,500	9,330.00	321,885,000
ビオフェルミン製薬	2,200	2,410.00	5,302,000
中外製薬	137,400	9,960.00	1,368,504,000
科研製薬	22,600	6,100.00	137,860,000
エーザイ	157,700	8,155.00	1,286,043,500
ロート製薬	67,600	3,345.00	226,122,000
小野薬品工業	302,600	2,456.50	743,336,900
久光製薬	38,900	5,510.00	214,339,000
持田製薬	18,300	4,600.00	84,180,000
参天製薬	245,400	2,050.00	503,070,000
扶桑薬品工業	4,600	2,113.00	9,719,800
日本ケミファ	1,700	2,868.00	4,875,600
ツムラ	40,800	3,230.00	131,784,000

日医工	37,300	1,375.00	51,287,500
キッセイ薬品工業	23,300	3,145.00	73,278,500
生化学工業	25,600	1,245.00	31,872,000
栄研化学	23,200	2,055.00	47,676,000
日水製薬	5,500	1,300.00	7,150,000
鳥居薬品	8,200	3,020.00	24,764,000
JCRファーマ	9,300	8,620.00	80,166,000
東和薬品	16,900	2,912.00	49,212,800
富士製薬工業	8,900	1,346.00	11,979,400
沢井製薬	27,000	6,900.00	186,300,000
ゼリア新薬工業	23,900	2,078.00	49,664,200
第一三共	377,000	7,044.00	2,655,588,000
キョーリン製薬ホールディングス	29,100	1,919.00	55,842,900
大幸薬品	5,300	3,280.00	17,384,000
ダイト	7,800	3,235.00	25,233,000
大塚ホールディングス	251,000	4,969.00	1,247,219,000
大正製薬ホールディングス	27,900	8,320.00	232,128,000
ペプチドリーム	66,600	5,450.00	362,970,000
日本コークス工業	111,300	80.00	8,904,000
ニチレキ	15,600	1,350.00	21,060,000
ユシロ化学工業	7,400	1,466.00	10,848,400
ビーピー・カストロール	4,700	1,597.00	7,505,900
富士石油	35,200	247.00	8,694,400
MORESCO	4,800	1,412.00	6,777,600
出光興産	148,200	3,045.00	451,269,000
JXTGホールディングス	2,043,400	503.70	1,029,260,580
コスモエネルギーホールディングス	38,100	2,567.00	97,802,700
横浜ゴム	76,300	2,230.00	170,149,000
TOYO TIRE	75,600	1,636.00	123,681,600
ブリヂストン	405,000	4,225.00	1,711,125,000
住友ゴム工業	118,400	1,401.00	165,878,400
藤倉コンポジット	11,500	493.00	5,669,500
オカモト	8,000	4,130.00	33,040,000
フコク	5,800	730.00	4,234,000
ニッタ	14,900	3,380.00	50,362,000
住友理工	25,500	1,038.00	26,469,000
三ツ星ベルト	17,300	2,153.00	37,246,900
バンドー化学	23,200	926.00	21,483,200
日東紡績	19,600	4,430.00	86,828,000
AGC	130,300	3,990.00	519,897,000
日本板硝子	63,000	748.00	47,124,000
石塚硝子	2,400	2,521.00	6,050,400

日本山村硝子	5,500	1,368.00	7,524,000
日本電気硝子	52,900	2,511.00	132,831,900
オハラ	5,200	1,432.00	7,446,400
住友大阪セメント	24,900	4,915.00	122,383,500
太平洋セメント	83,200	3,360.00	279,552,000
日本ヒューム	13,300	878.00	11,677,400
日本コンクリート工業	28,500	284.00	8,094,000
三谷セキサン	6,100	3,575.00	21,807,500
アジアパイルホールディングス	18,800	608.00	11,430,400
東海カーボン	138,100	1,125.00	155,362,500
日本カーボン	6,800	4,380.00	29,784,000
東洋炭素	7,700	2,345.00	18,056,500
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	4,725.00	34,492,500
TOTO	94,100	4,660.00	438,506,000
日本碍子	160,800	1,912.00	307,449,600
日本特殊陶業	102,600	2,190.00	224,694,000
MARUWA	5,100	8,340.00	42,534,000
品川リフラクトリーズ	3,500	3,565.00	12,477,500
黒崎播磨	2,600	6,600.00	17,160,000
ヨータイ	10,500	759.00	7,969,500
イソライト工業	6,800	688.00	4,678,400
東京窯業	16,900	354.00	5,982,600
ニッカトー	6,000	823.00	4,938,000
フジインコーポレーテッド	11,800	2,958.00	34,904,400
クニミネ工業	5,300	1,419.00	7,520,700
エーアンドエーマテリアル	2,200	1,394.00	3,066,800
ニチアス	36,100	2,768.00	99,924,800
ニチハ	18,300	2,696.00	49,336,800
日本製鉄	583,100	1,696.00	988,937,600
神戸製鋼所	238,600	594.00	141,728,400
中山製鋼所	18,200	559.00	10,173,800
合同製鐵	7,000	2,799.00	19,593,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	351,900	1,445.00	508,495,500
東京製鐵	63,500	799.00	50,736,500
共英製鋼	14,700	2,166.00	31,840,200
大和工業	27,700	2,721.00	75,371,700
東京鐵鋼	5,400	1,580.00	8,532,000
大阪製鐵	7,000	1,392.00	9,744,000
淀川製鋼所	17,600	2,095.00	36,872,000
丸一鋼管	42,300	3,115.00	131,764,500
モリ工業	3,900	2,536.00	9,890,400
大同特殊鋼	21,300	4,865.00	103,624,500

日本高周波鋼業	5,000	432.00	2,160,000	
日本冶金工業	10,800	2,353.00	25,412,400	
山陽特殊製鋼	9,400	1,591.00	14,955,400	
愛知製鋼	7,300	3,885.00	28,360,500	
日立金属	140,400	1,604.00	225,201,600	
日本金属	3,000	943.00	2,829,000	
大太平洋金属	8,800	2,599.00	22,871,200	
新日本電工	84,300	179.00	15,089,700	
栗本鐵工所	6,600	2,159.00	14,249,400	
虹技	2,000	1,440.00	2,880,000	
三菱製鋼	9,700	1,104.00	10,708,800	
日亜鋼業	19,200	346.00	6,643,200	
日本精線	2,100	3,250.00	6,825,000	
エンビプロ・ホールディングス	5,000	847.00	4,235,000	
シンニッタン	20,400	432.00	8,812,800	
新家工業	3,000	1,462.00	4,386,000	
大紀アルミニウム工業所	21,600	775.00	16,740,000	
日本軽金属ホールディングス	330,200	234.00	77,266,800	
三井金属鉱業	35,200	2,838.00	99,897,600	
東邦亜鉛	6,700	2,103.00	14,090,100	
三菱マテリアル	86,100	3,050.00	262,605,000	
住友金属鉱山	166,600	3,546.00	590,763,600	
D O W Aホールディングス	33,000	4,170.00	137,610,000	
古河機械金属	23,300	1,468.00	34,204,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,600	1,536.00	20,889,600	
東邦チタニウム	23,500	929.00	21,831,500	
U A C J	19,800	2,561.00	50,707,800	
C Kサンエツ	2,800	3,515.00	9,842,000	
古河電気工業	40,500	2,863.00	115,951,500	
住友電気工業	487,200	1,663.00	810,213,600	
フジクラ	157,600	465.00	73,284,000	
昭和電線ホールディングス	15,100	1,408.00	21,260,800	
東京特殊電線	2,000	2,275.00	4,550,000	
タツタ電線	26,000	608.00	15,808,000	
カナレ電気	2,200	1,887.00	4,151,400	
平河ヒューテック	5,000	1,564.00	7,820,000	
リョービ	16,100	2,104.00	33,874,400	
アーレスティ	17,300	568.00	9,826,400	
アサヒホールディングス	22,900	2,662.00	60,959,800	
稲葉製作所	7,300	1,437.00	10,490,100	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	2,093.00	8,372,000	
トーカロ	36,200	1,140.00	41,268,000	

アルファCo	4,600	1,303.00	5,993,800
SUMCO	156,000	1,841.00	287,196,000
川田テクノロジーズ	2,700	6,730.00	18,171,000
RS Technologies	3,700	3,945.00	14,596,500
信和	5,600	1,111.00	6,221,600
東洋製罐グループホールディングス	83,000	1,909.00	158,447,000
ホッカンホールディングス	7,200	2,045.00	14,724,000
コロナ	7,200	1,101.00	7,927,200
横河ブリッジホールディングス	24,200	1,998.00	48,351,600
駒井ハルテック	2,400	1,900.00	4,560,000
高田機工	1,200	2,709.00	3,250,800
三和ホールディングス	125,000	1,237.00	154,625,000
文化シャッター	38,400	983.00	37,747,200
三協立山	18,100	1,279.00	23,149,900
アルインコ	9,500	1,291.00	12,264,500
東洋シャッター	3,100	718.00	2,225,800
LIXILグループ	192,300	1,971.00	379,023,300
日本フィルコン	10,000	516.00	5,160,000
ノーリツ	27,000	1,507.00	40,689,000
長府製作所	13,200	2,482.00	32,762,400
リンナイ	25,300	8,690.00	219,857,000
ダイニチ工業	7,000	694.00	4,858,000
日東精工	18,000	646.00	11,628,000
三洋工業	1,700	2,025.00	3,442,500
岡部	26,400	969.00	25,581,600
ジーテクト	16,200	1,882.00	30,488,400
東プレ	24,300	1,809.00	43,958,700
高周波熱錬	25,100	904.00	22,690,400
東京製綱	9,300	1,324.00	12,313,200
サンコール	7,300	583.00	4,255,900
モリテック スチール	10,200	410.00	4,182,000
パイオラックス	19,300	2,205.00	42,556,500
エイチワン	12,800	846.00	10,828,800
日本発條	139,800	1,030.00	143,994,000
中央発條	1,600	3,050.00	4,880,000
アドバネクス	1,900	1,646.00	3,127,400
立川ブラインド工業	5,700	1,409.00	8,031,300
三益半導体工業	11,600	2,168.00	25,148,800
日本ドライケミカル	3,300	1,662.00	5,484,600
日本製鋼所	39,600	2,166.00	85,773,600
三浦工業	56,400	3,765.00	212,346,000
タクマ	44,300	1,317.00	58,343,100

ツガミ	27,100	1,109.00	30,053,900
オークマ	15,200	5,930.00	90,136,000
東芝機械	14,800	2,932.00	43,393,600
アマダホールディングス	165,800	1,278.00	211,892,400
アイダエンジニアリング	35,300	1,013.00	35,758,900
滝澤鉄工所	4,200	1,408.00	5,913,600
F U J I	56,100	1,998.00	112,087,800
牧野フライス製作所	15,300	5,040.00	77,112,000
オーエスジー	60,300	2,154.00	129,886,200
ダイジェット工業	1,600	1,499.00	2,398,400
旭ダイヤモンド工業	34,400	657.00	22,600,800
D M G 森精機	82,500	1,725.00	142,312,500
ソディック	30,800	1,001.00	30,830,800
ディスコ	17,600	26,240.00	461,824,000
日東工器	7,200	2,415.00	17,388,000
日進工具	3,900	2,664.00	10,389,600
パンチ工業	12,100	559.00	6,763,900
富士ダイス	6,000	727.00	4,362,000
豊和工業	7,400	857.00	6,341,800
O K K	5,600	675.00	3,780,000
東洋機械金属	9,600	562.00	5,395,200
津田駒工業	2,600	1,304.00	3,390,400
エンシュウ	3,200	1,363.00	4,361,600
島精機製作所	21,000	2,714.00	56,994,000
オプトラン	14,600	3,035.00	44,311,000
N C ホールディングス	4,200	686.00	2,881,200
イワキポンプ	6,400	1,191.00	7,622,400
フリー	12,900	1,064.00	13,725,600
ヤマシンフィルタ	28,500	872.00	24,852,000
日阪製作所	16,200	1,032.00	16,718,400
やまびこ	25,400	1,231.00	31,267,400
平田機工	6,200	7,240.00	44,888,000
ペガサスミシン製造	13,500	509.00	6,871,500
マルマエ	5,500	1,043.00	5,736,500
タツモ	6,200	1,328.00	8,233,600
ナプテスコ	76,800	3,355.00	257,664,000
三井海洋開発	13,900	2,701.00	37,543,900
レオン自動機	12,900	1,600.00	20,640,000
S M C	41,300	50,700.00	2,093,910,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	11,600	637.00	7,389,200
ホソカワミクロン	4,600	4,655.00	21,413,000
ユニオンツール	4,900	3,200.00	15,680,000

オイレス工業	16,900	1,675.00	28,307,500
日精エー・エス・ピー機械	4,400	4,720.00	20,768,000
サトーホールディングス	18,600	3,435.00	63,891,000
技研製作所	11,500	4,920.00	56,580,000
日本エアーテック	4,300	741.00	3,186,300
カワタ	4,000	1,183.00	4,732,000
日精樹脂工業	11,100	1,028.00	11,410,800
オカダアイヨン	4,300	1,319.00	5,671,700
ワイエイシイホールディングス	5,600	777.00	4,351,200
小松製作所	596,800	2,652.00	1,582,713,600
住友重機械工業	75,500	3,160.00	238,580,000
日立建機	52,800	3,315.00	175,032,000
日工	18,200	886.00	16,125,200
巴工業	5,700	2,320.00	13,224,000
井関農機	13,300	1,685.00	22,410,500
TOWA	13,500	1,184.00	15,984,000
丸山製作所	3,000	1,245.00	3,735,000
北川鉄工所	6,000	2,441.00	14,646,000
ローツェ	5,800	4,290.00	24,882,000
タカキタ	4,900	631.00	3,091,900
クボタ	699,100	1,738.50	1,215,385,350
荏原実業	3,400	2,267.00	7,707,800
三菱化工機	4,600	1,948.00	8,960,800
月島機械	24,400	1,662.00	40,552,800
帝国電機製作所	11,000	1,426.00	15,686,000
新東工業	31,400	1,056.00	33,158,400
澁谷工業	11,600	3,190.00	37,004,000
アイチ コーポレーション	23,000	750.00	17,250,000
小森コーポレーション	33,500	1,136.00	38,056,000
鶴見製作所	10,300	2,100.00	21,630,000
住友精密工業	2,000	3,415.00	6,830,000
日本ギア工業	4,400	406.00	1,786,400
酒井重工業	2,500	2,952.00	7,380,000
荏原製作所	54,500	3,355.00	182,847,500
石井鐵工所	1,800	2,539.00	4,570,200
西島製作所	13,400	921.00	12,341,400
北越工業	13,700	1,351.00	18,508,700
ダイキン工業	167,900	15,470.00	2,597,413,000
オルガノ	4,800	6,590.00	31,632,000
トーヨーカネツ	5,800	2,422.00	14,047,600
栗田工業	71,300	3,230.00	230,299,000
椿本チエイン	18,800	3,965.00	74,542,000

大同工業	6,400	828.00	5,299,200
木村化工機	11,200	710.00	7,952,000
アネスト岩田	20,700	1,069.00	22,128,300
ダイフク	67,400	6,480.00	436,752,000
サムコ	3,700	1,427.00	5,279,900
加藤製作所	7,300	1,768.00	12,906,400
油研工業	2,300	1,770.00	4,071,000
タダノ	63,700	994.00	63,317,800
フジテック	48,000	1,754.00	84,192,000
C K D	36,700	1,831.00	67,197,700
キトー	10,100	1,722.00	17,392,200
平和	36,800	2,238.00	82,358,400
理想科学工業	11,700	1,916.00	22,417,200
S A N K Y O	29,400	3,575.00	105,105,000
日本金銭機械	14,800	920.00	13,616,000
マースグループホールディングス	8,500	2,075.00	17,637,500
フクシマガリレイ	8,200	4,130.00	33,866,000
オーイズミ	5,800	570.00	3,306,000
ダイコク電機	6,200	1,716.00	10,639,200
竹内製作所	22,200	1,694.00	37,606,800
アマノ	34,500	3,375.00	116,437,500
J U K I	18,300	896.00	16,396,800
蛇の目ミシン工業	12,400	415.00	5,146,000
マックス	20,200	2,136.00	43,147,200
グローリー	36,600	3,370.00	123,342,000
新晃工業	12,300	1,999.00	24,587,700
大和冷機工業	19,200	1,240.00	23,808,000
セガサミーホールディングス	130,800	1,607.00	210,195,600
日本ピストンリング	4,900	1,565.00	7,668,500
リケン	6,100	4,225.00	25,772,500
T P R	17,800	2,183.00	38,857,400
ツバキ・ナカシマ	26,900	1,659.00	44,627,100
ホシザキ	38,500	10,010.00	385,385,000
大豊工業	10,900	896.00	9,766,400
日本精工	248,200	1,063.00	263,836,600
N T N	305,400	350.00	106,890,000
ジェイテクト	126,500	1,342.00	169,763,000
不二越	12,300	4,880.00	60,024,000
日本トムソン	39,400	505.00	19,897,000
T H K	76,700	2,988.00	229,179,600
ユーシン精機	10,400	1,025.00	10,660,000
前澤給装工業	4,900	2,201.00	10,784,900

イーグル工業	16,400	1,142.00	18,728,800
前澤工業	9,200	385.00	3,542,000
日本ピラー工業	13,400	1,554.00	20,823,600
キット	53,600	772.00	41,379,200
マキタ	171,900	3,760.00	646,344,000
日立造船	104,800	424.00	44,435,200
三菱重工業	220,800	4,278.00	944,582,400
I H I	95,000	2,555.00	242,725,000
スター精密	20,700	1,596.00	33,037,200
日清紡ホールディングス	88,000	1,053.00	92,664,000
イビデン	81,000	2,659.00	215,379,000
コニカミノルタ	289,000	712.00	205,768,000
ブラザー工業	161,200	2,270.00	365,924,000
ミネベアミツミ	244,900	2,315.00	566,943,500
日立製作所	633,100	4,676.00	2,960,375,600
三菱電機	1,317,600	1,527.00	2,011,975,200
富士電機	79,400	3,385.00	268,769,000
東洋電機製造	5,300	1,579.00	8,368,700
安川電機	141,900	4,175.00	592,432,500
シンフォニアテクノロジー	17,200	1,391.00	23,925,200
明電舎	24,300	2,338.00	56,813,400
オリジン	3,700	1,508.00	5,579,600
山洋電気	6,500	5,550.00	36,075,000
デンヨー	11,300	2,098.00	23,707,400
東芝テック	16,500	4,610.00	76,065,000
芝浦メカトロニクス	2,500	3,840.00	9,600,000
マブチモーター	36,600	4,290.00	157,014,000
日本電産	158,600	15,210.00	2,412,306,000
トレックス・セミコンダクター	8,000	1,696.00	13,568,000
東光高岳	8,000	1,179.00	9,432,000
ダイヘン	14,500	3,630.00	52,635,000
ヤーマン	20,100	761.00	15,296,100
J V C ケンウッド	110,200	265.00	29,203,000
ミマキエンジニアリング	13,300	520.00	6,916,000
第一精工	5,700	2,530.00	14,421,000
日新電機	31,000	1,368.00	42,408,000
大崎電気工業	26,400	716.00	18,902,400
オムロン	122,600	6,530.00	800,578,000
日東工業	19,400	2,597.00	50,381,800
I D E C	19,100	2,247.00	42,917,700
正興電機製作所	4,000	921.00	3,684,000
不二電機工業	2,200	1,299.00	2,857,800

ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,300	2,409.00	106,718,700
サクサホールディングス	3,100	1,958.00	6,069,800
メルコホールディングス	4,800	3,145.00	15,096,000
テクノメディカ	3,300	2,095.00	6,913,500
日本電気	159,900	4,495.00	718,750,500
富士通	127,000	10,410.00	1,322,070,000
沖電気工業	53,600	1,548.00	82,972,800
岩崎通信機	5,800	854.00	4,953,200
電気興業	6,400	3,445.00	22,048,000
サンケン電気	14,400	3,420.00	49,248,000
ナカヨ	2,600	1,704.00	4,430,400
アイホン	7,500	1,867.00	14,002,500
ルネサスエレクトロニクス	629,600	766.00	482,273,600
セイコーエプソン	163,600	1,707.00	279,265,200
ワコム	90,200	474.00	42,754,800
アルバック	26,300	4,320.00	113,616,000
アクセル	6,500	866.00	5,629,000
E I Z O	10,300	3,985.00	41,045,500
日本信号	33,700	1,438.00	48,460,600
京三製作所	31,100	615.00	19,126,500
能美防災	17,700	2,430.00	43,011,000
ホーチキ	10,000	1,806.00	18,060,000
星和電機	7,800	577.00	4,500,600
エレコム	14,500	4,315.00	62,567,500
パナソニック	1,505,500	1,016.50	1,530,340,750
シャープ	152,500	1,716.00	261,690,000
アンリツ	84,900	2,122.00	180,157,800
富士通ゼネラル	35,800	2,431.00	87,029,800
ソニー	832,700	7,326.00	6,100,360,200
T D K	63,700	12,380.00	788,606,000
帝国通信工業	6,400	1,221.00	7,814,400
タムラ製作所	44,300	711.00	31,497,300
アルプスアルパイン	116,900	2,522.00	294,821,800
池上通信機	4,200	1,066.00	4,477,200
鈴木	8,000	809.00	6,472,000
日本トリム	1,900	4,585.00	8,711,500
ローランド ディー・ジー	7,600	2,266.00	17,221,600
フォスター電機	13,900	2,051.00	28,508,900
S M K	3,400	3,055.00	10,387,000
ヨコオ	8,800	3,300.00	29,040,000
ホシデン	36,600	1,420.00	51,972,000
ヒロセ電機	20,400	13,910.00	283,764,000

日本航空電子工業	30,300	2,291.00	69,417,300
TOA	14,300	1,138.00	16,273,400
マクセルホールディングス	28,900	1,510.00	43,639,000
古野電気	17,500	1,374.00	24,045,000
ユニデンホールディングス	3,700	1,897.00	7,018,900
スミダコーポレーション	10,700	1,312.00	14,038,400
アイコム	7,300	2,740.00	20,002,000
リオン	5,800	3,165.00	18,357,000
本多通信工業	12,600	562.00	7,081,200
横河電機	121,000	1,952.00	236,192,000
新電元工業	4,700	3,945.00	18,541,500
アズビル	83,200	3,185.00	264,992,000
東亜ディーケーケー	7,200	1,068.00	7,689,600
日本光電工業	54,700	2,969.00	162,404,300
チノー	4,700	1,419.00	6,669,300
共和電業	14,100	450.00	6,345,000
日本電子材料	5,400	856.00	4,622,400
堀場製作所	26,100	7,520.00	196,272,000
アドバンテスト	98,000	6,150.00	602,700,000
小野測器	6,900	558.00	3,850,200
エスベック	12,000	2,244.00	26,928,000
キーエンス	119,400	38,740.00	4,625,556,000
日置電機	7,100	3,965.00	28,151,500
シスメックス	94,200	7,496.00	706,123,200
日本マイクロニクス	23,600	1,213.00	28,626,800
メガチップス	12,700	1,934.00	24,561,800
OBARA GROUP	7,000	3,815.00	26,705,000
澤藤電機	1,900	2,156.00	4,096,400
原田工業	7,000	1,021.00	7,147,000
コーセル	16,700	1,256.00	20,975,200
イリソ電子工業	11,200	5,000.00	56,000,000
オブテックスグループ	22,100	1,595.00	35,249,500
千代田インテグレ	6,400	2,466.00	15,782,400
アイ・オー・データ機器	5,600	1,064.00	5,958,400
レーザーテック	27,100	10,830.00	293,493,000
スタンレー電気	93,200	3,200.00	298,240,000
岩崎電気	5,600	1,522.00	8,523,200
ウシオ電機	77,000	1,625.00	125,125,000
岡谷電機産業	12,300	395.00	4,858,500
ヘリオス テクノ ホールディング	13,700	474.00	6,493,800
エノモト	4,600	1,341.00	6,168,600
日本セラミック	13,600	2,808.00	38,188,800

遠藤照明	7,700	716.00	5,513,200
古河電池	10,300	845.00	8,703,500
双信電機	7,900	490.00	3,871,000
山一電機	10,000	1,676.00	16,760,000
図研	8,900	2,481.00	22,080,900
日本電子	26,200	3,210.00	84,102,000
カシオ計算機	116,600	2,206.00	257,219,600
ファナック	125,200	20,570.00	2,575,364,000
日本シイエムケイ	32,100	669.00	21,474,900
エンプラス	6,900	3,570.00	24,633,000
大真空	5,300	1,715.00	9,089,500
ローム	58,600	8,720.00	510,992,000
浜松ホトニクス	94,700	4,575.00	433,252,500
三井ハイテック	15,000	1,637.00	24,555,000
新光電気工業	44,900	1,287.00	57,786,300
京セラ	185,500	7,494.00	1,390,137,000
太陽誘電	58,800	3,160.00	185,808,000
村田製作所	387,200	6,564.00	2,541,580,800
双葉電子工業	21,400	1,402.00	30,002,800
北陸電気工業	6,000	1,153.00	6,918,000
ニチコン	45,400	1,143.00	51,892,200
日本ケミコン	10,000	2,150.00	21,500,000
K O A	20,400	1,405.00	28,662,000
市光工業	20,600	828.00	17,056,800
小糸製作所	79,100	5,600.00	442,960,000
ミツバ	25,200	799.00	20,134,800
S C R E E Nホールディングス	22,900	7,530.00	172,437,000
キャノン電子	14,200	2,128.00	30,217,600
キャノン	709,300	3,086.00	2,188,899,800
リコー	335,300	1,159.00	388,612,700
象印マホービン	39,000	1,849.00	72,111,000
M U T O Hホールディングス	2,200	1,726.00	3,797,200
東京エレクトロン	87,900	23,950.00	2,105,205,000
トヨタ紡織	38,400	1,801.00	69,158,400
芦森工業	2,800	1,397.00	3,911,600
ユニプレス	25,600	1,595.00	40,832,000
豊田自動織機	106,600	6,560.00	699,296,000
モリタホールディングス	23,100	1,784.00	41,210,400
三櫻工業	16,800	1,352.00	22,713,600
デンソー	290,100	5,074.00	1,471,967,400
東海理化電機製作所	34,700	2,227.00	77,276,900
三井E & Sホールディングス	47,600	956.00	45,505,600

川崎重工業	102,500	2,476.00	253,790,000
名村造船所	42,400	263.00	11,151,200
日本車輛製造	4,800	3,205.00	15,384,000
三菱ロジスネクスト	17,400	1,339.00	23,298,600
近畿車輛	2,000	1,549.00	3,098,000
日産自動車	1,553,900	664.10	1,031,944,990
いすゞ自動車	381,800	1,335.00	509,703,000
トヨタ自動車	1,468,300	7,744.00	11,370,515,200
日野自動車	164,500	1,170.00	192,465,000
三菱自動車工業	487,700	476.00	232,145,200
エフテック	9,300	843.00	7,839,900
レシップホールディングス	5,200	668.00	3,473,600
G M B	2,400	809.00	1,941,600
ファルテック	2,400	1,228.00	2,947,200
武蔵精密工業	29,400	1,542.00	45,334,800
日産車体	25,700	1,015.00	26,085,500
新明和工業	35,500	1,507.00	53,498,500
極東開発工業	24,500	1,643.00	40,253,500
日信工業	26,800	2,216.00	59,388,800
トピー工業	10,900	2,036.00	22,192,400
ティラド	4,800	2,025.00	9,720,000
曙ブレーキ工業	72,300	252.00	18,219,600
タチエス	21,700	1,506.00	32,680,200
N O K	70,900	1,714.00	121,522,600
フタバ産業	36,700	782.00	28,699,400
K Y B	14,700	3,365.00	49,465,500
大同メタル工業	25,400	791.00	20,091,400
プレス工業	65,500	449.00	29,409,500
ミクニ	16,900	361.00	6,100,900
太平洋工業	27,600	1,504.00	41,510,400
ケーヒン	30,300	2,559.00	77,537,700
河西工業	17,900	899.00	16,092,100
アイシン精機	108,500	4,180.00	453,530,000
マツダ	387,700	953.00	369,478,100
今仙電機製作所	12,300	983.00	12,090,900
本田技研工業	1,037,400	3,170.00	3,288,558,000
スズキ	261,100	4,710.00	1,229,781,000
S U B A R U	409,000	2,802.50	1,146,222,500
安永	6,400	1,276.00	8,166,400
ヤマハ発動機	171,800	2,293.00	393,937,400
ショーワ	31,100	2,262.00	70,348,200
T B K	15,800	480.00	7,584,000

エクセディ	17,900	2,522.00	45,143,800
豊田合成	42,600	2,790.00	118,854,000
愛三工業	20,700	839.00	17,367,300
盟和産業	2,100	1,160.00	2,436,000
日本プラスト	10,400	753.00	7,831,200
ヨロズ	12,400	1,470.00	18,228,000
エフ・シー・シー	21,600	2,418.00	52,228,800
シマノ	49,300	17,560.00	865,708,000
テイ・エス テック	30,600	3,505.00	107,253,000
ジャムコ	6,600	1,460.00	9,636,000
テルモ	372,800	3,922.00	1,462,121,600
クリエートメディック	4,400	1,107.00	4,870,800
日機装	39,500	1,452.00	57,354,000
日本エム・ディ・エム	7,600	2,310.00	17,556,000
島津製作所	157,500	3,460.00	544,950,000
JMS	11,200	836.00	9,363,200
長野計器	9,600	892.00	8,563,200
ブイ・テクノロジー	6,200	5,670.00	35,154,000
東京計器	8,400	1,024.00	8,601,600
愛知時計電機	1,700	4,490.00	7,633,000
インターアクション	7,100	2,914.00	20,689,400
オーバル	12,000	252.00	3,024,000
東京精密	23,900	4,300.00	102,770,000
マニー	52,500	3,050.00	160,125,000
ニコン	213,200	1,359.00	289,738,800
トプコン	66,400	1,443.00	95,815,200
オリンパス	729,100	1,658.00	1,208,847,800
理研計器	11,600	2,316.00	26,865,600
タムロン	10,600	2,597.00	27,528,200
HOYA	265,300	10,225.00	2,712,692,500
シード	5,600	1,104.00	6,182,400
ノーリツ鋼機	8,900	1,609.00	14,320,100
エー・アンド・デイ	12,000	1,047.00	12,564,000
朝日インテック	111,800	3,180.00	355,524,000
シチズン時計	154,400	609.00	94,029,600
リズム時計工業	4,200	939.00	3,943,800
大研医器	9,200	642.00	5,906,400
メニコン	18,100	4,540.00	82,174,000
シンシア	1,500	629.00	943,500
松風	6,000	1,715.00	10,290,000
セイコーホールディングス	18,600	2,866.00	53,307,600
ニプロ	91,200	1,320.00	120,384,000

中本パックス	3,300	1,572.00	5,187,600
スノーピーク	6,000	1,122.00	6,732,000
パラマウントベッドホールディングス	13,900	4,680.00	65,052,000
トランザクション	8,400	977.00	8,206,800
S H O - B I	3,800	398.00	1,512,400
ニホンフラッシュ	6,200	2,913.00	18,060,600
前田工織	14,500	2,177.00	31,566,500
永大産業	17,200	351.00	6,037,200
アートネイチャー	14,100	856.00	12,069,600
バンダイナムコホールディングス	136,200	6,530.00	889,386,000
アイフィスジャパン	3,400	781.00	2,655,400
共立印刷	22,000	169.00	3,718,000
S H O E I	6,300	5,380.00	33,894,000
フランスベッドホールディングス	18,600	982.00	18,265,200
パイロットコーポレーション	23,000	4,545.00	104,535,000
萩原工業	7,300	1,764.00	12,877,200
トッパン・フォームズ	28,200	1,208.00	34,065,600
フジシールインターナショナル	29,500	2,483.00	73,248,500
タカラトミー	59,100	1,417.00	83,744,700
廣濟堂	9,200	815.00	7,498,000
エステールホールディングス	3,500	688.00	2,408,000
アーク	50,300	97.00	4,879,100
タカノ	5,100	828.00	4,222,800
プロネクサス	11,300	1,265.00	14,294,500
ホクシン	8,100	167.00	1,352,700
ウッドワン	4,400	1,220.00	5,368,000
大建工業	8,900	1,958.00	17,426,200
凸版印刷	186,000	2,297.00	427,242,000
大日本印刷	172,400	3,000.00	517,200,000
共同印刷	4,100	2,937.00	12,041,700
N I S S H A	27,000	1,133.00	30,591,000
光村印刷	1,100	1,790.00	1,969,000
T A K A R A & C O M P A N Y	6,400	1,747.00	11,180,800
アシックス	108,700	1,859.00	202,073,300
ツツミ	4,100	2,119.00	8,687,900
小松ウオール工業	4,000	2,383.00	9,532,000
ヤマハ	78,400	6,090.00	477,456,000
河合楽器製作所	4,100	3,815.00	15,641,500
クリナップ	12,300	709.00	8,720,700
ピジョン	79,600	4,145.00	329,942,000
オリバー	2,800	3,700.00	10,360,000
兼松サステック	800	1,768.00	1,414,400

キングジム	11,000	882.00	9,702,000
リンテック	31,300	2,473.00	77,404,900
イトーキ	28,000	572.00	16,016,000
任天堂	80,800	43,200.00	3,490,560,000
三菱鉛筆	21,700	1,702.00	36,933,400
タカスタンダード	27,200	1,994.00	54,236,800
コクヨ	63,200	1,672.00	105,670,400
ナカバヤシ	13,000	621.00	8,073,000
グロープライド	5,900	2,617.00	15,440,300
オカムラ	46,000	1,060.00	48,760,000
美津濃	12,000	2,782.00	33,384,000
東京電力ホールディングス	1,051,800	476.00	500,656,800
中部電力	403,100	1,567.50	631,859,250
関西電力	499,200	1,288.50	643,219,200
中国電力	182,100	1,453.00	264,591,300
北陸電力	120,500	810.00	97,605,000
東北電力	329,100	1,107.00	364,313,700
四国電力	118,600	1,109.00	131,527,400
九州電力	271,600	958.00	260,192,800
北海道電力	123,300	545.00	67,198,500
沖縄電力	24,400	2,103.00	51,313,200
電源開発	104,800	2,698.00	282,750,400
エフオン	6,200	760.00	4,712,000
イーレックス	18,700	1,879.00	35,137,300
レノバ	21,700	1,203.00	26,105,100
東京瓦斯	253,400	2,684.50	680,252,300
大阪瓦斯	255,700	2,157.00	551,544,900
東邦瓦斯	65,300	4,525.00	295,482,500
北海道瓦斯	7,100	1,634.00	11,601,400
広島ガス	27,100	363.00	9,837,300
西部瓦斯	14,800	2,609.00	38,613,200
静岡ガス	37,400	1,002.00	37,474,800
メタウォーター	6,400	4,350.00	27,840,000
SBSホールディングス	11,400	1,946.00	22,184,400
東武鉄道	139,000	3,980.00	553,220,000
相鉄ホールディングス	42,200	2,960.00	124,912,000
東急	332,300	2,031.00	674,901,300
京浜急行電鉄	169,200	2,094.00	354,304,800
小田急電鉄	196,000	2,575.00	504,700,000
京王電鉄	68,400	6,680.00	456,912,000
京成電鉄	91,700	4,240.00	388,808,000
富士急行	18,000	4,240.00	76,320,000

新京成電鉄	3,400	2,366.00	8,044,400
東日本旅客鉄道	231,900	9,849.00	2,283,983,100
西日本旅客鉄道	117,400	9,514.00	1,116,943,600
東海旅客鉄道	109,500	22,435.00	2,456,632,500
西武ホールディングス	176,800	1,818.00	321,422,400
鴻池運輸	21,000	1,665.00	34,965,000
西日本鉄道	36,500	2,555.00	93,257,500
ハマキョウレックス	10,100	3,595.00	36,309,500
サカイ引越センター	6,900	7,130.00	49,197,000
近鉄グループホールディングス	124,800	5,920.00	738,816,000
阪急阪神ホールディングス	166,400	4,730.00	787,072,000
南海電気鉄道	59,100	2,977.00	175,940,700
京阪ホールディングス	55,600	5,290.00	294,124,000
神戸電鉄	3,000	3,975.00	11,925,000
名古屋鉄道	102,600	3,375.00	346,275,000
山陽電気鉄道	8,900	2,186.00	19,455,400
日本通運	44,100	6,510.00	287,091,000
ヤマトホールディングス	218,700	1,856.00	405,907,200
山九	34,700	5,580.00	193,626,000
丸運	7,100	306.00	2,172,600
丸全昭和運輸	10,100	3,205.00	32,370,500
センコーグループホールディングス	68,800	949.00	65,291,200
トナミホールディングス	3,000	5,510.00	16,530,000
ニッコンホールディングス	44,700	2,749.00	122,880,300
日本石油輸送	1,400	2,900.00	4,060,000
福山通運	16,000	4,085.00	65,360,000
セイノーホールディングス	93,400	1,495.00	139,633,000
エスライン	3,700	1,051.00	3,888,700
神奈川中央交通	3,100	4,070.00	12,617,000
日立物流	22,900	3,060.00	70,074,000
丸和運輸機関	13,200	2,510.00	33,132,000
C & F ロジホールディングス	12,600	1,460.00	18,396,000
九州旅客鉄道	111,300	3,675.00	409,027,500
S Gホールディングス	131,000	2,578.00	337,718,000
日本郵船	104,800	1,982.00	207,713,600
商船三井	79,300	2,955.00	234,331,500
川崎汽船	38,400	1,883.00	72,307,200
N S ユナイテッド海運	7,300	2,302.00	16,804,600
飯野海運	61,700	369.00	22,767,300
共栄タンカー	1,600	1,810.00	2,896,000
乾汽船	7,200	1,147.00	8,258,400
日本航空	228,400	3,407.00	778,158,800

ANAホールディングス	228,100	3,642.00	830,740,200
パスコ	2,400	2,057.00	4,936,800
トランコム	3,500	8,250.00	28,875,000
日新	10,800	1,926.00	20,800,800
三菱倉庫	39,600	2,895.00	114,642,000
三井倉庫ホールディングス	14,300	1,998.00	28,571,400
住友倉庫	45,900	1,501.00	68,895,900
澁澤倉庫	6,800	2,285.00	15,538,000
東陽倉庫	22,500	344.00	7,740,000
日本トランスシティ	27,500	560.00	15,400,000
ケイヒン	2,400	1,365.00	3,276,000
中央倉庫	7,600	1,247.00	9,477,200
川西倉庫	2,300	1,063.00	2,444,900
安田倉庫	10,200	1,029.00	10,495,800
ファイズホールディングス	2,700	610.00	1,647,000
東洋埠頭	3,800	1,403.00	5,331,400
宇徳	10,700	544.00	5,820,800
上組	71,500	2,428.00	173,602,000
サンリツ	2,900	705.00	2,044,500
キムラユニティー	3,300	1,134.00	3,742,200
キューソー流通システム	3,100	1,912.00	5,927,200
近鉄エクスプレス	26,500	1,892.00	50,138,000
東海運	7,100	291.00	2,066,100
エーアイティー	8,800	988.00	8,694,400
内外トランスライン	4,400	1,509.00	6,639,600
日本コンセプト	4,000	1,504.00	6,016,000
NEC ネットズエスアイ	12,300	3,580.00	44,034,000
クロスキャット	3,700	1,147.00	4,243,900
システナ	46,300	1,796.00	83,154,800
デジタルアーツ	6,400	5,570.00	35,648,000
日鉄ソリューションズ	19,500	3,705.00	72,247,500
キューブシステム	7,300	795.00	5,803,500
エイジア	2,600	1,433.00	3,725,800
コア	5,700	1,403.00	7,997,100
ソリトンシステムズ	5,900	1,284.00	7,575,600
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	1,846.00	10,706,800
T I S	43,100	6,600.00	284,460,000
ネオス	5,200	814.00	4,232,800
電算システム	5,000	3,045.00	15,225,000
グリー	89,800	501.00	44,989,800
コーエーテクモホールディングス	26,600	2,878.00	76,554,800
三菱総合研究所	5,600	4,175.00	23,380,000

電算	1,600	2,242.00	3,587,200
A G S	7,700	811.00	6,244,700
ファインデックス	11,100	1,436.00	15,939,600
ブレインパッド	2,700	5,740.00	15,498,000
K L a b	25,000	844.00	21,100,000
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,900	959.00	15,248,100
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	1,910.00	3,820,000
ネクソン	368,000	1,475.00	542,800,000
アイスタイル	33,900	680.00	23,052,000
エムアップ	3,900	2,542.00	9,913,800
エイチーム	9,200	1,153.00	10,607,600
エニグモ	9,500	942.00	8,949,000
テクノスジャパン	10,700	489.00	5,232,300
コロプラ	42,600	1,288.00	54,868,800
ブロードリーフ	64,600	691.00	44,638,600
クロス・マーケティンググループ	6,600	367.00	2,422,200
デジタルハーツホールディングス	7,200	1,021.00	7,351,200
システム情報	6,900	1,051.00	7,251,900
メディアドゥホールディングス	4,100	4,105.00	16,830,500
じげん	32,600	537.00	17,506,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	965.00	2,412,500
サイバーリンクス	2,200	1,282.00	2,820,400
フィックスターズ	14,000	1,513.00	21,182,000
C A R T A H O L D I N G S	6,500	1,207.00	7,845,500
オブティム	3,500	3,305.00	11,567,500
セレス	4,500	1,277.00	5,746,500
S H I F T	3,400	7,750.00	26,350,000
ティーガイア	11,600	2,702.00	31,343,200
セック	2,000	3,800.00	7,600,000
日本アジアグループ	13,600	395.00	5,372,000
豆蔵ホールディングス	9,000	1,460.00	13,140,000
テクマトリックス	9,200	2,413.00	22,199,600
プロシップ	3,900	1,467.00	5,721,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,300	2,396.00	74,994,800
G M O ペイメントゲートウェイ	21,300	7,400.00	157,620,000
ザッパラス	7,500	419.00	3,142,500
システムリサーチ	3,600	1,817.00	6,541,200
インターネットイニシアティブ	19,200	2,890.00	55,488,000
さくらインターネット	14,300	701.00	10,024,300
ヴィンクス	3,900	1,257.00	4,902,300
G M O クラウド	2,500	2,603.00	6,507,500
S R A ホールディングス	7,000	2,652.00	18,564,000

システムインテグレータ	4,500	836.00	3,762,000
朝日ネット	9,700	642.00	6,227,400
e B A S E	8,000	1,132.00	9,056,000
アバント	9,500	1,025.00	9,737,500
アドソル日進	4,700	2,326.00	10,932,200
フリービット	8,000	964.00	7,712,000
コムチュア	14,600	2,433.00	35,521,800
サイバーコム	2,400	2,256.00	5,414,400
アステリア	8,400	633.00	5,317,200
アイル	4,800	2,094.00	10,051,200
マークラインズ	6,600	2,024.00	13,358,400
メディカル・データ・ビジョン	10,200	847.00	8,639,400
ショーケース	3,500	679.00	2,376,500
モバイルファクトリー	3,100	1,361.00	4,219,100
テラスカイ	4,800	2,406.00	11,548,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,694.00	9,994,600
P C Iホールディングス	2,800	2,147.00	6,011,600
パイプドHD	1,900	1,897.00	3,604,300
アイビーシー	2,600	1,222.00	3,177,200
ネオジャパン	2,700	1,022.00	2,759,400
P R T I M E S	1,200	2,320.00	2,784,000
ランドコンピュータ	2,200	1,122.00	2,468,400
ダブルスタンダード	1,700	4,855.00	8,253,500
オープンドア	6,600	1,608.00	10,612,800
マイネット	4,200	714.00	2,998,800
アカツキ	4,600	5,820.00	26,772,000
ベネフィットジャパン	1,200	2,028.00	2,433,600
U b i c o mホールディングス	3,100	1,176.00	3,645,600
L I N E	29,600	5,260.00	155,696,000
カナミックネットワーク	8,300	726.00	6,025,800
ノムラシステムコーポレーション	3,400	592.00	2,012,800
チェンジ	2,700	2,642.00	7,133,400
シンクロ・フード	6,100	555.00	3,385,500
オークネット	8,200	1,380.00	11,316,000
セグエグループ	2,500	917.00	2,292,500
エイトレッド	1,800	1,657.00	2,982,600
A O I T Y O H o l d i n g s	13,500	721.00	9,733,500
マクロミル	23,400	1,016.00	23,774,400
ビーグリー	2,700	1,307.00	3,528,900
オロ	3,500	3,735.00	13,072,500
テモナ	2,400	481.00	1,154,400
ニーズウェル	2,000	764.00	1,528,000

サインポスト	2,100	2,088.00	4,384,800
ソルクシーズ	5,800	977.00	5,666,600
フェイス	4,900	799.00	3,915,100
プロトコーポレーション	11,900	1,193.00	14,196,700
ハイマックス	1,700	2,035.00	3,459,500
野村総合研究所	216,200	2,417.00	522,555,400
サイバネットシステム	9,600	887.00	8,515,200
C Eホールディングス	8,100	465.00	3,766,500
日本システム技術	2,300	1,355.00	3,116,500
インテージホールディングス	16,500	924.00	15,246,000
東邦システムサイエンス	3,800	932.00	3,541,600
ソースネクスト	62,000	450.00	27,900,000
インフォコム	14,300	2,540.00	36,322,000
ラクスル	6,900	3,550.00	24,495,000
F I G	15,000	312.00	4,680,000
システムサポート	1,200	2,239.00	2,686,800
イーソル	4,800	2,012.00	9,657,600
アルテリア・ネットワークス	14,500	1,696.00	24,592,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,501.00	4,653,100
フォーカスシステムズ	8,400	895.00	7,518,000
クレスコ	4,000	3,580.00	14,320,000
フジ・メディア・ホールディングス	124,700	1,551.00	193,409,700
オービック	44,800	14,610.00	654,528,000
ジャストシステム	21,100	6,160.00	129,976,000
T D Cソフト	11,700	967.00	11,313,900
Zホールディングス	1,776,200	434.00	770,870,800
トレンドマイクロ	57,500	5,770.00	331,775,000
I Dホールディングス	5,100	1,509.00	7,695,900
日本オラクル	26,200	10,130.00	265,406,000
アルファシステムズ	4,100	2,878.00	11,799,800
フューチャー	15,800	1,844.00	29,135,200
C A C Holdings	8,600	1,656.00	14,241,600
S Bテクノロジー	4,800	1,945.00	9,336,000
トーセ	3,900	906.00	3,533,400
オービックビジネスコンサルタント	13,300	5,090.00	67,697,000
伊藤忠テクノソリューションズ	59,000	3,090.00	182,310,000
アイティフォー	16,000	875.00	14,000,000
東計電算	2,000	3,685.00	7,370,000
エクスネット	2,400	972.00	2,332,800
大塚商会	70,000	4,560.00	319,200,000
サイボウズ	15,400	1,221.00	18,803,400
ソフトブレーン	8,100	639.00	5,175,900

電通国際情報サービス	8,100	4,280.00	34,668,000
デジタルガレージ	23,300	4,490.00	104,617,000
E Mシステムズ	9,200	2,043.00	18,795,600
ウェザーニューズ	4,500	3,470.00	15,615,000
C I J	9,900	971.00	9,612,900
ビジネスエンジニアリング	1,600	3,180.00	5,088,000
日本エンタープライズ	14,500	236.00	3,422,000
WOWOW	6,300	2,825.00	17,797,500
スカラ	9,600	787.00	7,555,200
インテリジェント ウェイブ	5,300	793.00	4,202,900
I M A G I C A G R O U P	11,500	599.00	6,888,500
ネットワンシステムズ	49,400	2,750.00	135,850,000
システムソフト	33,600	106.00	3,561,600
アルゴグラフィックス	11,100	3,380.00	37,518,000
マーベラス	20,200	742.00	14,988,400
エイベックス	22,500	1,255.00	28,237,500
日本ユニシス	40,500	3,480.00	140,940,000
兼松エレクトロニクス	7,100	3,590.00	25,489,000
東京放送ホールディングス	78,800	1,881.00	148,222,800
日本テレビホールディングス	108,100	1,450.00	156,745,000
朝日放送グループホールディングス	13,300	783.00	10,413,900
テレビ朝日ホールディングス	35,700	2,030.00	72,471,000
スカパーJ S A Tホールディングス	85,700	494.00	42,335,800
テレビ東京ホールディングス	10,700	2,490.00	26,643,000
日本BS放送	4,700	1,173.00	5,513,100
ビジョン	12,200	1,739.00	21,215,800
スマートバリュー	4,200	780.00	3,276,000
ワイヤレスゲート	6,600	660.00	4,356,000
コネクシオ	7,500	1,607.00	12,052,500
クロップス	2,800	768.00	2,150,400
日本電信電話	864,200	5,588.00	4,829,149,600
K D D I	963,600	3,287.00	3,167,353,200
ソフトバンク	1,175,200	1,449.00	1,702,864,800
光通信	13,300	28,110.00	373,863,000
N T T ドコモ	955,100	3,048.00	2,911,144,800
エムティーアイ	13,000	718.00	9,334,000
G M Oインターネット	51,100	2,133.00	108,996,300
ファイバーゲート	2,700	1,484.00	4,006,800
アйдママーケティングコミュニケーション	4,300	688.00	2,958,400
K A D O K A W A	35,000	2,002.00	70,070,000
学研ホールディングス	4,400	7,560.00	33,264,000
ゼンリン	26,000	1,932.00	50,232,000

昭文社	6,700	413.00	2,767,100
インプレスホールディングス	10,700	194.00	2,075,800
アイネット	6,900	1,547.00	10,674,300
松竹	8,600	16,640.00	143,104,000
東宝	77,400	4,560.00	352,944,000
東映	4,900	16,640.00	81,536,000
エヌ・ティ・ティ・データ	344,400	1,468.00	505,579,200
ピー・シー・エー	1,700	5,100.00	8,670,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,292.00	5,500,800
D T S	29,000	2,522.00	73,138,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,200	5,540.00	305,808,000
シーイーシー	14,000	2,121.00	29,694,000
カプコン	61,100	3,080.00	188,188,000
アイ・エス・ピー	2,700	1,944.00	5,248,800
ジャステック	8,500	1,125.00	9,562,500
S C S K	29,900	5,720.00	171,028,000
日本システムウエア	4,400	2,477.00	10,898,800
アイネス	13,000	1,376.00	17,888,000
T K C	11,000	5,240.00	57,640,000
富士ソフト	16,600	4,270.00	70,882,000
N S D	21,300	3,595.00	76,573,500
コナミホールディングス	47,000	4,500.00	211,500,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	3,695.00	19,214,000
J B C Cホールディングス	8,900	1,857.00	16,527,300
ミロク情報サービス	11,500	3,425.00	39,387,500
ソフトバンクグループ	1,025,900	4,674.00	4,795,056,600
ハウスイ	1,100	867.00	953,700
高千穂交易	5,000	1,123.00	5,615,000
伊藤忠食品	3,200	5,280.00	16,896,000
エレマテック	12,100	1,184.00	14,326,400
J A L U X	3,700	2,499.00	9,246,300
あらた	10,300	4,660.00	47,998,000
トーメンデバイス	2,000	3,235.00	6,470,000
東京エレクトロン デバイス	4,700	2,623.00	12,328,100
フィールズ	9,900	579.00	5,732,100
双日	716,700	355.00	254,428,500
アルフレッサ ホールディングス	144,200	2,270.00	327,334,000
横浜冷凍	36,400	1,012.00	36,836,800
ラサ商事	6,900	981.00	6,768,900
ラクーンホールディングス	6,300	833.00	5,247,900
アルコニックス	13,800	1,442.00	19,899,600
神戸物産	44,800	3,710.00	166,208,000

あい ホールディングス	18,500	1,987.00	36,759,500
ディーブイエックス	4,700	874.00	4,107,800
ダイワボウホールディングス	11,000	6,520.00	71,720,000
マクニカ・富士エレホールディングス	31,000	1,964.00	60,884,000
ラクト・ジャパン	4,800	3,580.00	17,184,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,500	1,065.00	26,092,500
八洲電機	10,100	912.00	9,211,200
メディアスホールディングス	7,400	843.00	6,238,200
レスターホールディングス	13,500	2,015.00	27,202,500
ジューテックホールディングス	3,000	1,178.00	3,534,000
大光	5,600	665.00	3,724,000
OCHIホールディングス	3,800	1,463.00	5,559,400
TOKAIホールディングス	68,600	1,135.00	77,861,000
黒谷	3,000	470.00	1,410,000
Cominix	2,300	823.00	1,892,900
三洋貿易	6,500	2,439.00	15,853,500
ビューティガレージ	2,100	2,503.00	5,256,300
ウイン・パートナーズ	9,400	1,516.00	14,250,400
ミタチ産業	3,900	760.00	2,964,000
シップヘルスケアホールディングス	20,800	5,140.00	106,912,000
明治電機工業	4,100	1,732.00	7,101,200
デリカフーズホールディングス	4,600	722.00	3,321,200
スターティアホールディングス	3,000	795.00	2,385,000
コメダホールディングス	28,300	2,093.00	59,231,900
アセンテック	1,100	2,030.00	2,233,000
富士興産	4,000	696.00	2,784,000
協栄産業	1,500	1,600.00	2,400,000
小野建	11,600	1,424.00	16,518,400
南陽	2,900	1,998.00	5,794,200
佐島電機	9,600	931.00	8,937,600
エコートレーディング	3,000	561.00	1,683,000
伯東	7,900	1,391.00	10,988,900
コンドーテック	10,100	1,169.00	11,806,900
中山福	7,500	542.00	4,065,000
ナガイレーベン	18,800	2,577.00	48,447,600
三菱食品	14,300	3,100.00	44,330,000
松田産業	9,500	1,621.00	15,399,500
第一興商	19,300	5,680.00	109,624,000
メディバルホールディングス	140,100	2,413.00	338,061,300
SPK	2,800	2,925.00	8,190,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,932.00	14,073,600
アズワン	8,500	10,040.00	85,340,000

スズデン	4,500	1,510.00	6,795,000
尾家産業	3,800	1,477.00	5,612,600
シモジマ	8,000	1,238.00	9,904,000
ドウシシャ	12,300	1,769.00	21,758,700
小津産業	2,900	1,782.00	5,167,800
高速	7,700	1,279.00	9,848,300
たけびし	4,600	1,476.00	6,789,600
リックス	2,900	1,721.00	4,990,900
丸文	11,500	625.00	7,187,500
ハピネット	10,800	1,433.00	15,476,400
橋本総業ホールディングス	2,600	1,946.00	5,059,600
日本ライフライン	38,500	1,497.00	57,634,500
タカショー	6,400	503.00	3,219,200
エクセル	3,700	1,590.00	5,883,000
マルカ	4,600	2,379.00	10,943,400
I D O M	35,000	633.00	22,155,000
進和	7,700	2,422.00	18,649,400
エスケイジャパン	2,900	447.00	1,296,300
ダイトロン	5,500	1,962.00	10,791,000
シークス	16,500	1,614.00	26,631,000
田中商事	4,000	705.00	2,820,000
オーハシテクニカ	7,300	1,523.00	11,117,900
白銅	4,700	1,543.00	7,252,100
伊藤忠商事	907,600	2,539.00	2,304,396,400
丸紅	1,350,800	816.00	1,102,252,800
高島	2,100	1,863.00	3,912,300
長瀬産業	73,000	1,650.00	120,450,000
蝶理	8,300	2,230.00	18,509,000
豊田通商	144,800	3,930.00	569,064,000
三共生興	19,700	595.00	11,721,500
兼松	48,400	1,479.00	71,583,600
ツカモトコーポレーション	2,300	1,100.00	2,530,000
三井物産	1,140,600	1,983.50	2,262,380,100
日本紙パルプ商事	7,400	4,265.00	31,561,000
日立ハイテクノロジーズ	45,100	7,790.00	351,329,000
カメイ	16,900	1,369.00	23,136,100
東都水産	1,700	2,725.00	4,632,500
O U G ホールディングス	2,100	2,679.00	5,625,900
スターゼン	4,800	4,325.00	20,760,000
山善	50,700	1,117.00	56,631,900
椿本興業	2,400	4,255.00	10,212,000
住友商事	818,800	1,649.50	1,350,610,600

内田洋行	5,500	7,280.00	40,040,000
三菱商事	910,600	2,913.00	2,652,577,800
第一実業	6,400	3,830.00	24,512,000
キャノンマーケティングジャパン	37,100	2,612.00	96,905,200
西華産業	7,400	1,370.00	10,138,000
佐藤商事	10,700	1,003.00	10,732,100
菱洋エレクトロ	13,200	2,024.00	26,716,800
東京産業	11,800	611.00	7,209,800
ユアサ商事	12,300	3,710.00	45,633,000
神鋼商事	3,300	2,827.00	9,329,100
小林産業	7,800	298.00	2,324,400
阪和興業	24,300	2,896.00	70,372,800
正栄食品工業	8,400	3,970.00	33,348,000
カナデン	10,600	1,351.00	14,320,600
菱電商事	9,400	1,660.00	15,604,000
フルサト工業	7,200	1,778.00	12,801,600
岩谷産業	28,800	3,765.00	108,432,000
すてきナイスグループ	5,500	1,303.00	7,166,500
昭光通商	4,100	718.00	2,943,800
ニチモウ	2,000	2,007.00	4,014,000
極東貿易	3,700	2,241.00	8,291,700
イワキ	17,100	464.00	7,934,400
三愛石油	32,000	1,175.00	37,600,000
稲畑産業	28,600	1,677.00	47,962,200
G S I クレオス	3,200	1,303.00	4,169,600
明和産業	12,000	622.00	7,464,000
クワザワ	4,700	619.00	2,909,300
ワキタ	27,700	1,126.00	31,190,200
東邦ホールディングス	41,600	2,413.00	100,380,800
サンゲツ	35,700	2,104.00	75,112,800
ミツウロコグループホールディングス	19,100	1,427.00	27,255,700
シナネンホールディングス	5,400	2,011.00	10,859,400
伊藤忠エネクス	28,700	949.00	27,236,300
サンリオ	36,400	2,184.00	79,497,600
サンワテクノス	9,200	1,166.00	10,727,200
リョーサン	14,300	2,835.00	40,540,500
新光商事	20,400	897.00	18,298,800
トーホー	5,900	1,842.00	10,867,800
三信電気	7,000	1,796.00	12,572,000
東陽テクニカ	15,000	1,206.00	18,090,000
モスフードサービス	17,000	3,055.00	51,935,000
加賀電子	12,900	2,652.00	34,210,800

ソーダニッカ	13,400	636.00	8,522,400
立花エレテック	9,600	1,855.00	17,808,000
フォーバル	5,700	1,043.00	5,945,100
PALTAC	20,800	5,520.00	114,816,000
三谷産業	17,200	343.00	5,899,600
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,780.00	9,072,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,523.00	1,675,300
国際紙パルプ商事	30,800	316.00	9,732,800
ヤマタネ	6,500	1,574.00	10,231,000
丸紅建材リース	1,300	1,781.00	2,315,300
日鉄物産	9,300	5,310.00	49,383,000
泉州電業	4,000	3,425.00	13,700,000
トラスコ中山	27,000	2,872.00	77,544,000
オートバックスセブン	48,200	1,733.00	83,530,600
モリト	9,500	807.00	7,666,500
加藤産業	20,300	3,680.00	74,704,000
北恵	2,500	971.00	2,427,500
イノテック	7,700	1,133.00	8,724,100
イエローハット	24,500	2,019.00	49,465,500
JKホールディングス	11,800	687.00	8,106,600
日伝	11,800	2,088.00	24,638,400
北沢産業	9,900	280.00	2,772,000
杉本商事	7,000	2,082.00	14,574,000
因幡電機産業	36,900	2,809.00	103,652,100
東テク	4,300	2,695.00	11,588,500
ミスミグループ本社	162,500	2,655.00	431,437,500
アルテック	10,400	229.00	2,381,600
タキヒヨー	3,900	1,961.00	7,647,900
蔵王産業	2,500	1,494.00	3,735,000
スズケン	55,000	4,530.00	249,150,000
ジェコス	9,000	1,082.00	9,738,000
グローセル	13,000	451.00	5,863,000
ローソン	32,900	6,240.00	205,296,000
サンエー	10,800	4,905.00	52,974,000
カワチ薬品	10,200	2,189.00	22,327,800
エービーシー・マート	20,300	7,520.00	152,656,000
ハードオフコーポレーション	5,500	817.00	4,493,500
アスクル	13,600	3,350.00	45,560,000
ゲオホールディングス	23,600	1,388.00	32,756,800
アダストリア	18,100	2,615.00	47,331,500
ジーフット	8,300	622.00	5,162,600
くら寿司	6,800	5,010.00	34,068,000

キャンドウ	6,300	1,653.00	10,413,900
パルグループホールディングス	6,700	3,690.00	24,723,000
エディオン	59,800	1,228.00	73,434,400
サーラコーポレーション	26,800	646.00	17,312,800
ワッツ	6,200	600.00	3,720,000
ハローズ	5,000	2,765.00	13,825,000
フジオフードシステム	5,500	3,765.00	20,707,500
あみやき亭	2,900	3,700.00	10,730,000
ひらまつ	24,800	293.00	7,266,400
大黒天物産	3,200	3,305.00	10,576,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,642.00	19,047,200
ファーマライズホールディングス	3,500	652.00	2,282,000
アルペン	10,100	1,842.00	18,604,200
ハブ	4,000	1,021.00	4,084,000
クオールホールディングス	19,300	1,545.00	29,818,500
ジーンズホールディングス	6,900	7,330.00	50,577,000
ビックカメラ	77,200	1,259.00	97,194,800
D C Mホールディングス	70,300	1,077.00	75,713,100
MonotaRO	92,400	2,884.00	266,481,600
東京一番フーズ	3,700	627.00	2,319,900
DDホールディングス	5,100	1,547.00	7,889,700
きちりホールディングス	3,800	849.00	3,226,200
アークランドサービスホールディングス	9,600	1,887.00	18,115,200
J．フロント リテイリング	155,100	1,470.00	227,997,000
ドトール・日レスホールディングス	20,800	2,189.00	45,531,200
マツモトキヨシホールディングス	53,700	4,315.00	231,715,500
ブロンコビリー	6,900	2,847.00	19,644,300
Z O Z O	89,400	2,139.00	191,226,600
トレジャー・ファクトリー	4,100	1,091.00	4,473,100
物語コーポレーション	3,200	8,570.00	27,424,000
ココカラファイン	13,600	6,560.00	89,216,000
三越伊勢丹ホールディングス	227,000	1,002.00	227,454,000
H a m e e	4,200	1,412.00	5,930,400
ウエルシアホールディングス	38,600	6,850.00	264,410,000
クリエイティブSDホールディングス	19,200	2,773.00	53,241,600
丸善C H Iホールディングス	15,100	376.00	5,677,600
ティーライフ	2,000	904.00	1,808,000
エー・ピーカンパニー	2,900	547.00	1,586,300
チムニー	4,100	2,304.00	9,446,400
シュッピン	9,100	1,176.00	10,701,600
ネクステージ	18,700	1,260.00	23,562,000
ジョイフル本田	38,200	1,445.00	55,199,000

鳥貴族	4,400	2,186.00	9,618,400
キリン堂ホールディングス	5,200	2,095.00	10,894,000
ホットランド	8,800	1,380.00	12,144,000
すかいらーくホールディングス	145,500	2,214.00	322,137,000
SFPホールディングス	5,700	2,268.00	12,927,600
綿半ホールディングス	5,000	1,935.00	9,675,000
ヨシックス	2,200	2,780.00	6,116,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,000	969.00	36,822,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,400	689.00	4,409,600
B E E N O S	4,700	1,416.00	6,655,200
あさひ	9,900	1,327.00	13,137,300
日本調剤	4,000	3,755.00	15,020,000
コスモス薬品	5,700	22,500.00	128,250,000
トーエル	6,600	793.00	5,233,800
オンリー	2,500	808.00	2,020,000
セブン&アイ・ホールディングス	507,700	4,035.00	2,048,569,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,000	1,826.00	63,910,000
ツルハホールディングス	28,200	13,940.00	393,108,000
サンマルクホールディングス	10,400	2,349.00	24,429,600
フェリシモ	3,100	1,040.00	3,224,000
トリドールホールディングス	16,100	2,720.00	43,792,000
T O K Y O B A S E	12,100	631.00	7,635,100
ウイルプラスホールディングス	2,300	903.00	2,076,900
ジャパンミート	6,700	2,227.00	14,920,900
サツドラホールディングス	2,100	1,770.00	3,717,000
デファクトスタンダード	1,800	412.00	741,600
アレンザホールディングス	6,800	946.00	6,432,800
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,227.00	4,676,700
パロックジャパンリミテッド	9,300	952.00	8,853,600
クスリのアオキホールディングス	12,900	6,800.00	87,720,000
力の源ホールディングス	6,200	856.00	5,307,200
スシローグローバルホールディングス	14,300	9,020.00	128,986,000
L I X I L ビバ	12,900	2,046.00	26,393,400
メディカルシステムネットワーク	13,000	532.00	6,916,000
はるやまホールディングス	6,400	870.00	5,568,000
ノジマ	23,200	2,292.00	53,174,400
カップ・クリエイト	18,200	1,510.00	27,482,000
ライトオン	9,700	612.00	5,936,400
良品計画	172,400	2,533.00	436,689,200
三城ホールディングス	14,600	305.00	4,453,000
アドヴァン	20,000	1,318.00	26,360,000

アルビス	5,000	2,265.00	11,325,000
コナカ	15,900	423.00	6,725,700
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,668.00	3,002,400
G - 7ホールディングス	3,900	4,705.00	18,349,500
イオン北海道	13,300	791.00	10,520,300
コジマ	22,800	526.00	11,992,800
ヒマラヤ	4,900	837.00	4,101,300
コーナン商事	18,500	2,591.00	47,933,500
エコス	4,900	1,720.00	8,428,000
ワタミ	15,600	1,306.00	20,373,600
マルシェ	3,800	780.00	2,964,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	311,100	1,839.00	572,112,900
西松屋チェーン	28,800	943.00	27,158,400
ゼンショーホールディングス	62,300	2,453.00	152,821,900
幸楽苑ホールディングス	8,400	2,045.00	17,178,000
ハークスレイ	3,000	1,052.00	3,156,000
サイゼリヤ	21,500	2,653.00	57,039,500
V Tホールディングス	54,300	470.00	25,521,000
魚力	3,800	1,582.00	6,011,600
フジ・コーポレーション	3,500	2,370.00	8,295,000
ユナイテッドアローズ	13,700	3,215.00	44,045,500
ハイデイ日高	18,800	2,185.00	41,078,000
京都きもの友禅	9,000	350.00	3,150,000
コロワイド	43,200	2,220.00	95,904,000
ピーシーデポコーポレーション	17,700	565.00	10,000,500
壱番屋	9,200	5,560.00	51,152,000
P L A N T	3,700	650.00	2,405,000
スギホールディングス	26,000	6,230.00	161,980,000
薬王堂ホールディングス	5,800	2,494.00	14,465,200
スクロール	20,700	364.00	7,534,800
ヨンドシーホールディングス	13,300	2,630.00	34,979,000
ファミリーマート	103,700	2,648.00	274,597,600
木曽路	17,100	2,990.00	51,129,000
S R Sホールディングス	15,500	1,042.00	16,151,000
タカキュー	11,500	190.00	2,185,000
ケーヨー	27,000	555.00	14,985,000
上新電機	15,400	2,606.00	40,132,400
日本瓦斯	20,600	3,645.00	75,087,000
ロイヤルホールディングス	22,800	2,543.00	57,980,400
いなげや	16,200	1,474.00	23,878,800
島忠	24,500	3,020.00	73,990,000
チヨダ	13,800	1,628.00	22,466,400

ライフコーポレーション	9,900	2,573.00	25,472,700
リンガーハット	16,100	2,529.00	40,716,900
MrMaxHD	18,400	497.00	9,144,800
テンアライド	12,000	439.00	5,268,000
AOKIホールディングス	26,200	1,148.00	30,077,600
オークワ	20,500	1,406.00	28,823,000
コメリ	20,100	2,397.00	48,179,700
青山商事	27,000	1,584.00	42,768,000
しまむら	15,100	9,290.00	140,279,000
はせがわ	7,500	399.00	2,992,500
高島屋	94,700	1,249.00	118,280,300
松屋	26,400	879.00	23,205,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,600	1,278.00	78,724,800
近鉄百貨店	5,000	3,790.00	18,950,000
パルコ	12,700	1,345.00	17,081,500
丸井グループ	119,000	2,605.00	309,995,000
アクシアル リテイリング	10,800	3,890.00	42,012,000
イオン	499,400	2,240.00	1,118,656,000
イズミ	26,400	4,030.00	106,392,000
平和堂	26,400	2,111.00	55,730,400
フジ	15,800	1,982.00	31,315,600
ヤオコー	14,800	5,490.00	81,252,000
ゼビオホールディングス	15,900	1,341.00	21,321,900
ケーズホールディングス	125,400	1,450.00	181,830,000
Olympicグループ	7,100	644.00	4,572,400
日産東京販売ホールディングス	20,000	288.00	5,760,000
Genky DrugStores	6,400	2,307.00	14,764,800
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,401.00	3,362,400
総合メディカルホールディングス	11,400	2,019.00	23,016,600
ブックオフグループホールディングス	7,600	1,051.00	7,987,600
アインホールディングス	17,400	6,680.00	116,232,000
元気寿司	3,400	2,920.00	9,928,000
ヤマダ電機	395,800	570.00	225,606,000
アークランドサカモト	20,500	1,278.00	26,199,000
ニトリホールディングス	56,200	17,155.00	964,111,000
グルメ杵屋	9,500	1,219.00	11,580,500
愛眼	10,300	240.00	2,472,000
ケーユーホールディングス	7,100	967.00	6,865,700
吉野家ホールディングス	42,700	2,786.00	118,962,200
松屋フーズホールディングス	6,300	4,540.00	28,602,000
サガミホールディングス	17,500	1,362.00	23,835,000
関西スーパーマーケット	11,000	1,062.00	11,682,000

王将フードサービス	9,600	6,510.00	62,496,000
プレナス	14,700	1,954.00	28,723,800
ミニストップ	9,700	1,466.00	14,220,200
アークス	26,600	2,317.00	61,632,200
パローホールディングス	28,800	2,139.00	61,603,200
ベルク	6,500	5,720.00	37,180,000
大庄	7,100	1,648.00	11,700,800
ファーストリテイリング	17,400	66,650.00	1,159,710,000
サンドラッグ	48,900	4,010.00	196,089,000
サクスパー ホールディングス	11,300	931.00	10,520,300
ヤマザワ	3,200	1,715.00	5,488,000
やまや	2,800	2,261.00	6,330,800
ペルーナ	28,200	722.00	20,360,400
島根銀行	2,600	667.00	1,734,200
じもとホールディングス	87,800	115.00	10,097,000
めぶきフィナンシャルグループ	675,200	282.00	190,406,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,600	1,538.00	27,068,800
九州フィナンシャルグループ	213,200	481.00	102,549,200
ゆうちょ銀行	368,200	1,054.00	388,082,800
富山第一銀行	31,000	352.00	10,912,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	764,300	454.00	346,992,200
西日本フィナンシャルホールディングス	88,600	879.00	77,879,400
関西みらいフィナンシャルグループ	76,300	722.00	55,088,600
三十三フィナンシャルグループ	12,000	1,768.00	21,216,000
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	3,100.00	70,060,000
新生銀行	95,400	1,658.00	158,173,200
あおぞら銀行	77,400	2,944.00	227,865,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,945,600	599.20	5,360,203,520
りそなホールディングス	1,426,100	484.80	691,373,280
三井住友トラスト・ホールディングス	245,600	4,366.00	1,072,289,600
三井住友フィナンシャルグループ	898,700	4,100.00	3,684,670,000
千葉銀行	447,000	638.00	285,186,000
群馬銀行	255,400	385.00	98,329,000
武蔵野銀行	19,400	1,921.00	37,267,400
千葉興業銀行	35,600	384.00	13,670,400
筑波銀行	54,000	251.00	13,554,000
七十七銀行	43,900	1,844.00	80,951,600
青森銀行	10,100	2,949.00	29,784,900
秋田銀行	8,300	2,211.00	18,351,300
山形銀行	14,600	1,583.00	23,111,800
岩手銀行	8,500	2,982.00	25,347,000
東邦銀行	116,200	275.00	31,955,000

東北銀行	6,200	1,059.00	6,565,800
みちのく銀行	8,300	1,539.00	12,773,700
ふくおかフィナンシャルグループ	109,500	2,133.00	233,563,500
静岡銀行	321,800	832.00	267,737,600
十六銀行	16,300	2,592.00	42,249,600
スルガ銀行	132,900	523.00	69,506,700
八十二銀行	313,600	495.00	155,232,000
山梨中央銀行	15,100	1,189.00	17,953,900
大垣共立銀行	25,700	2,406.00	61,834,200
福井銀行	11,100	1,933.00	21,456,300
北國銀行	13,400	3,725.00	49,915,000
清水銀行	5,400	2,176.00	11,750,400
富山銀行	2,500	2,425.00	6,062,500
滋賀銀行	26,100	2,784.00	72,662,400
南都銀行	21,600	2,815.00	60,804,000
百五銀行	116,900	355.00	41,499,500
京都銀行	46,500	4,740.00	220,410,000
紀陽銀行	46,000	1,671.00	76,866,000
ほくほくフィナンシャルグループ	86,500	1,160.00	100,340,000
広島銀行	191,800	542.00	103,955,600
山陰合同銀行	77,100	674.00	51,965,400
中国銀行	111,800	1,104.00	123,427,200
鳥取銀行	4,400	1,379.00	6,067,600
伊予銀行	185,400	614.00	113,835,600
百十四銀行	13,800	2,156.00	29,752,800
四国銀行	19,700	1,056.00	20,803,200
阿波銀行	21,200	2,528.00	53,593,600
大分銀行	7,500	2,881.00	21,607,500
宮崎銀行	8,700	2,688.00	23,385,600
佐賀銀行	7,900	1,842.00	14,551,800
沖縄銀行	11,900	3,665.00	43,613,500
琉球銀行	30,000	1,238.00	37,140,000
セブン銀行	434,100	360.00	156,276,000
みずほフィナンシャルグループ	17,658,100	169.20	2,987,750,520
高知銀行	4,700	942.00	4,427,400
山口フィナンシャルグループ	162,200	761.00	123,434,200
長野銀行	4,300	1,704.00	7,327,200
名古屋銀行	10,500	3,440.00	36,120,000
北洋銀行	195,900	249.00	48,779,100
愛知銀行	4,700	3,715.00	17,460,500
中京銀行	5,300	2,233.00	11,834,900
大光銀行	4,500	1,720.00	7,740,000

愛媛銀行	18,100	1,205.00	21,810,500
トマト銀行	5,000	1,095.00	5,475,000
京葉銀行	55,400	632.00	35,012,800
栃木銀行	62,800	238.00	14,946,400
北日本銀行	4,000	2,300.00	9,200,000
東和銀行	22,800	892.00	20,337,600
福島銀行	12,200	273.00	3,330,600
大東銀行	6,800	651.00	4,426,800
トモニホールディングス	100,500	424.00	42,612,000
フィデアホールディングス	126,200	140.00	17,668,000
池田泉州ホールディングス	149,400	217.00	32,419,800
F P G	41,000	1,032.00	42,312,000
マーキュリアインベストメント	6,000	766.00	4,596,000
S B Iホールディングス	145,200	2,300.00	333,960,000
ジャフコ	20,000	4,365.00	87,300,000
大和証券グループ本社	1,043,100	562.70	586,952,370
野村ホールディングス	2,286,900	561.70	1,284,551,730
岡三証券グループ	111,200	398.00	44,257,600
丸三証券	39,000	508.00	19,812,000
東洋証券	47,800	151.00	7,217,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	149,900	330.00	49,467,000
光世証券	3,400	670.00	2,278,000
水戸証券	38,500	228.00	8,778,000
いちよし証券	24,600	653.00	16,063,800
松井証券	74,500	877.00	65,336,500
だいこう証券ビジネス	6,600	683.00	4,507,800
マネックスグループ	98,800	274.00	27,071,200
極東証券	17,700	760.00	13,452,000
岩井コスモホールディングス	12,400	1,286.00	15,946,400
藍澤證券	23,600	747.00	17,629,200
マネーパートナーズグループ	14,700	242.00	3,557,400
スパークス・グループ	45,800	262.00	11,999,600
かんぽ生命保険	46,000	1,907.00	87,722,000
S O M P Oホールディングス	244,300	4,393.00	1,073,209,900
アニコム ホールディングス	10,800	3,635.00	39,258,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	339,800	3,640.00	1,236,872,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	106,800	2,700.00	288,360,000
第一生命ホールディングス	735,400	1,861.00	1,368,579,400
東京海上ホールディングス	464,700	6,190.00	2,876,493,000
T & Dホールディングス	401,900	1,433.00	575,922,700
アドバンスクリエイト	3,000	1,897.00	5,691,000
全国保証	36,600	4,670.00	170,922,000

ジェイリース	3,600	317.00	1,141,200
イントラスト	4,500	719.00	3,235,500
日本モーゲージサービス	2,600	1,555.00	4,043,000
C a s a	4,500	1,372.00	6,174,000
アルヒ	20,700	2,292.00	47,444,400
プレミアグループ	7,000	2,358.00	16,506,000
クレディセゾン	91,000	1,886.00	171,626,000
芙蓉総合リース	13,600	7,410.00	100,776,000
みずほリース	20,000	3,460.00	69,200,000
東京センチュリー	26,200	5,880.00	154,056,000
日本証券金融	57,300	535.00	30,655,500
アイフル	198,200	240.00	47,568,000
リコーリース	10,200	4,075.00	41,565,000
イオンフィナンシャルサービス	79,500	1,711.00	136,024,500
アコム	261,200	494.00	129,032,800
ジャックス	14,300	2,767.00	39,568,100
オリエントコーポレーション	351,500	163.00	57,294,500
日立キャピタル	30,600	2,904.00	88,862,400
アプラスフィナンシャル	62,300	91.00	5,669,300
オリックス	812,800	1,843.50	1,498,396,800
三菱UFJリース	329,800	724.00	238,775,200
九州リースサービス	6,400	599.00	3,833,600
日本取引所グループ	373,000	1,937.00	722,501,000
イー・ギャランティ	13,900	1,316.00	18,292,400
アサックス	6,700	696.00	4,663,200
NECキャピタルソリューション	5,300	2,537.00	13,446,100
いちご	169,100	464.00	78,462,400
日本駐車場開発	152,100	159.00	24,183,900
スター・マイカ・ホールディングス	7,600	1,697.00	12,897,200
ヒューリック	278,900	1,337.00	372,889,300
三栄建築設計	6,100	1,648.00	10,052,800
野村不動産ホールディングス	79,500	2,691.00	213,934,500
三重交通グループホールディングス	28,800	624.00	17,971,200
サムティ	19,200	2,241.00	43,027,200
ディア・ライフ	19,300	580.00	11,194,000
コーセーアールイー	5,400	819.00	4,422,600
エー・ディー・ワークス	241,100	30.00	7,233,000
日本商業開発	9,100	1,619.00	14,732,900
ユニゾホールディングス	20,000	4,900.00	98,000,000
ハウスコム	2,600	1,577.00	4,100,200
日本管理センター	9,700	1,283.00	12,445,100
サンセイランディック	5,300	944.00	5,003,200

エストラスト	1,800	807.00	1,452,600
フージャースホールディングス	25,900	731.00	18,932,900
オープンハウス	38,300	3,165.00	121,219,500
東急不動産ホールディングス	355,700	777.00	276,378,900
飯田グループホールディングス	109,300	1,957.00	213,900,100
イーランド	3,700	865.00	3,200,500
ムゲンエステート	10,800	808.00	8,726,400
ハウスドゥ	7,200	1,494.00	10,756,800
シーアールイー	4,500	1,104.00	4,968,000
ケイアイスター不動産	4,800	2,180.00	10,464,000
グッドコムアセット	3,700	1,981.00	7,329,700
ジェイ・エス・ビー	1,700	5,100.00	8,670,000
テンポイノベーション	4,200	1,029.00	4,321,800
パーク24	70,400	2,650.00	186,560,000
パラカ	4,000	2,087.00	8,348,000
三井不動産	649,600	2,746.00	1,783,801,600
三菱地所	911,400	2,127.00	1,938,547,800
平和不動産	24,400	3,005.00	73,322,000
東京建物	143,100	1,714.00	245,273,400
ダイビル	34,800	1,217.00	42,351,600
京阪神ビルディング	22,200	1,470.00	32,634,000
住友不動産	292,600	3,878.00	1,134,702,800
テーオーシー	27,200	907.00	24,670,400
東京楽天地	2,400	6,410.00	15,384,000
スターツコーポレーション	18,300	2,785.00	50,965,500
フジ住宅	17,200	699.00	12,022,800
空港施設	15,600	552.00	8,611,200
明和地所	9,300	624.00	5,803,200
ゴールドクレスト	11,000	2,111.00	23,221,000
エスリード	5,700	2,237.00	12,750,900
日神不動産	21,900	560.00	12,264,000
日本エスコン	25,100	1,002.00	25,150,200
タカラレーベン	62,600	513.00	32,113,800
サンヨーハウジング名古屋	8,700	1,081.00	9,404,700
イオンモール	66,100	1,937.00	128,035,700
毎日コムネット	4,400	870.00	3,828,000
ファースト住建	6,600	1,280.00	8,448,000
カチタス	16,500	4,740.00	78,210,000
トーセイ	18,900	1,512.00	28,576,800
穴吹興産	1,800	3,575.00	6,435,000
サンフロンティア不動産	19,100	1,354.00	25,861,400
エフ・ジェー・ネクスト	12,700	1,151.00	14,617,700

インテリックス	5,500	717.00	3,943,500
ランドビジネス	5,500	746.00	4,103,000
日本社宅サービス	4,500	1,193.00	5,368,500
グランディハウス	13,000	486.00	6,318,000
日本空港ビルデング	41,800	6,170.00	257,906,000
日本工営	8,500	3,815.00	32,427,500
L I F U L L	44,200	563.00	24,884,600
ジェイエイシーリクルートメント	8,500	2,029.00	17,246,500
日本M&Aセンター	95,100	3,680.00	349,968,000
メンバーズ	3,800	2,324.00	8,831,200
中広	1,600	537.00	859,200
アイティメディア	4,000	751.00	3,004,000
タケエイ	12,200	1,268.00	15,469,600
E・Jホールディングス	1,600	1,745.00	2,792,000
トラスト・テック	14,000	1,278.00	17,892,000
コシダカホールディングス	30,400	1,573.00	47,819,200
アルトナー	3,200	776.00	2,483,200
パソナグループ	15,400	1,616.00	24,886,400
C D S	3,200	1,607.00	5,142,400
リンクアンドモチベーション	28,000	617.00	17,276,000
G C A	15,300	972.00	14,871,600
エス・エム・エス	39,200	3,010.00	117,992,000
サニーサイドアップ	2,900	1,108.00	3,213,200
パーソルホールディングス	126,000	1,969.00	248,094,000
リニカル	6,200	1,113.00	6,900,600
クックパッド	44,300	363.00	16,080,900
エスクリ	4,100	781.00	3,202,100
アイ・ケイ・ケイ	6,300	719.00	4,529,700
学情	4,500	2,207.00	9,931,500
スタジオアリス	6,400	1,908.00	12,211,200
シミックホールディングス	7,000	1,853.00	12,971,000
エプコ	2,100	1,555.00	3,265,500
N J S	2,900	1,848.00	5,359,200
総合警備保障	50,100	6,070.00	304,107,000
カカクコム	94,300	2,801.00	264,134,300
アイロムグループ	4,400	1,504.00	6,617,600
セントケア・ホールディング	8,400	478.00	4,015,200
サイネックス	2,300	687.00	1,580,100
ルネサンス	7,100	1,729.00	12,275,900
ディップ	17,800	3,240.00	57,672,000
オプトホールディング	6,900	1,669.00	11,516,100
ツクイ	29,900	571.00	17,072,900

キャリアデザインセンター	3,300	1,331.00	4,392,300
ベネフィット・ワン	34,600	2,249.00	77,815,400
エムスリー	277,600	3,195.00	886,932,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	611.00	5,071,300
プラス	1,600	833.00	1,332,800
アウトソーシング	72,100	1,201.00	86,592,100
ウェルネット	12,100	755.00	9,135,500
ワールドホールディングス	4,200	2,072.00	8,702,400
ディー・エヌ・エー	61,800	1,763.00	108,953,400
博報堂D Yホールディングス	175,200	1,752.00	306,950,400
ぐるなび	22,100	1,022.00	22,586,200
タカミヤ	13,600	698.00	9,492,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,500	1,140.00	9,690,000
ファンコミュニケーションズ	34,900	500.00	17,450,000
ライク	5,100	1,594.00	8,129,400
ビジネス・ブレークスルー	5,700	346.00	1,972,200
エスプール	24,400	794.00	19,373,600
WDBホールディングス	5,800	2,550.00	14,790,000
ティア	7,600	600.00	4,560,000
C D G	1,400	1,418.00	1,985,200
バリューコマース	7,100	2,345.00	16,649,500
インフォマート	69,100	1,941.00	134,123,100
J Pホールディングス	40,000	330.00	13,200,000
エコナックホールディングス	23,800	138.00	3,284,400
E P Sホールディングス	19,000	1,431.00	27,189,000
レグス	3,200	1,652.00	5,286,400
プレステージ・インターナショナル	47,300	1,008.00	47,678,400
アミューズ	6,900	3,005.00	20,734,500
ドリームインキュベータ	3,900	1,581.00	6,165,900
クイック	7,900	1,681.00	13,279,900
T A C	8,200	231.00	1,894,200
ケネディクス	120,000	579.00	69,480,000
電通	129,800	3,720.00	482,856,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,900	1,247.00	6,110,300
ぴあ	3,600	4,810.00	17,316,000
イオンファンタジー	4,900	2,919.00	14,303,100
シーティーエス	14,400	804.00	11,577,600
ネクシィーズグループ	4,500	1,826.00	8,217,000
みらかホールディングス	35,300	2,656.00	93,756,800
アルプス技研	11,200	2,055.00	23,016,000
ダイオーズ	2,600	1,341.00	3,486,600
日本空調サービス	13,400	864.00	11,577,600

オリエンタルランド	133,900	14,875.00	1,991,762,500
ダスキン	32,400	3,070.00	99,468,000
明光ネットワークジャパン	14,900	1,023.00	15,242,700
ファルコホールディングス	7,000	1,851.00	12,957,000
ラウンドワン	35,300	1,082.00	38,194,600
リゾートトラスト	57,800	1,860.00	107,508,000
ビー・エム・エル	16,300	3,130.00	51,019,000
ワタベウェディング	2,300	587.00	1,350,100
りらいあコミュニケーションズ	22,800	1,410.00	32,148,000
リソー教育	57,900	382.00	22,117,800
早稲田アカデミー	4,200	968.00	4,065,600
ユー・エス・エス	141,000	2,059.00	290,319,000
東京個別指導学院	4,600	721.00	3,316,600
サイバーエージェント	72,400	3,840.00	278,016,000
楽天	587,000	963.00	565,281,000
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,118.00	7,378,800
テー・オー・ダブリュー	11,200	909.00	10,180,800
山田コンサルティンググループ	6,200	1,655.00	10,261,000
セントラルスポーツ	4,700	3,270.00	15,369,000
フルキャストホールディングス	12,700	2,373.00	30,137,100
エン・ジャパン	22,400	5,020.00	112,448,000
リソルホールディングス	1,400	4,085.00	5,719,000
テクノプロ・ホールディングス	25,300	7,890.00	199,617,000
アトラ	3,300	370.00	1,221,000
インターワークス	2,700	528.00	1,425,600
アイ・アールジャパンホールディングス	5,100	4,955.00	25,270,500
K e e P e r 技研	4,700	1,345.00	6,321,500
ファーストロジック	3,100	621.00	1,925,100
三機サービス	2,800	1,099.00	3,077,200
G u n o s y	8,900	1,568.00	13,955,200
デザインワン・ジャパン	2,900	343.00	994,700
イー・ガーディアン	6,500	2,002.00	13,013,000
リブセンス	8,500	304.00	2,584,000
ジャパンマテリアル	38,800	1,749.00	67,861,200
ベクトル	15,800	1,052.00	16,621,600
ウチヤマホールディングス	6,500	548.00	3,562,000
チャーム・ケア・コーポレーション	4,700	1,930.00	9,071,000
ライクキッズ	3,200	842.00	2,694,400
キャリアリンク	4,400	612.00	2,692,800
I B J	8,700	1,159.00	10,083,300
アサンテ	5,100	2,029.00	10,347,900
N・フィールド	8,900	669.00	5,954,100

バリューHR	2,500	3,550.00	8,875,000
M&Aキャピタルパートナーズ	9,000	4,115.00	37,035,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	2,047.00	10,030,300
E R Iホールディングス	3,700	780.00	2,886,000
アビスト	2,000	2,634.00	5,268,000
シグマクシス	8,700	2,296.00	19,975,200
ウィルグループ	8,300	1,195.00	9,918,500
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	18,000	227.00	4,086,000
リクルートホールディングス	901,900	4,049.00	3,651,793,100
エラン	7,500	1,616.00	12,120,000
土木管理総合試験所	5,800	461.00	2,673,800
ネットマーケティング	4,700	991.00	4,657,700
日本郵政	1,032,100	1,039.00	1,072,351,900
ベルシステム24ホールディングス	21,200	1,678.00	35,573,600
鎌倉新書	9,500	1,698.00	16,131,000
S M N	2,200	838.00	1,843,600
一蔵	1,500	755.00	1,132,500
L I T A L I C O	4,400	2,288.00	10,067,200
グローバルキッズCOMPANY	2,100	735.00	1,543,500
エボラブルアジア	5,700	2,100.00	11,970,000
アトラエ	3,300	3,685.00	12,160,500
ストライク	4,800	4,465.00	21,432,000
ソラスト	34,800	1,243.00	43,256,400
セラク	4,100	816.00	3,345,600
インソース	6,100	3,440.00	20,984,000
ベйкаレント・コンサルティング	7,700	5,470.00	42,119,000
Orchestra Holdings	2,600	1,109.00	2,883,400
アイモバイル	4,200	672.00	2,822,400
キャリアインデックス	5,500	427.00	2,348,500
MS - Japan	4,200	1,558.00	6,543,600
船場	2,200	1,175.00	2,585,000
グレイステクノロジー	5,800	2,697.00	15,642,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13,300	2,773.00	36,880,900
フルテック	1,900	1,419.00	2,696,100
グリーンズ	4,900	1,170.00	5,733,000
ツナググループ・ホールディングス	1,700	710.00	1,207,000
GameWith	3,000	794.00	2,382,000
ソウルドアウト	2,000	1,901.00	3,802,000
MS&Consulting	1,900	1,072.00	2,036,800
日総工産	8,500	1,045.00	8,882,500
キュービーネットホールディングス	7,700	2,449.00	18,857,300
R P Aホールディングス	7,300	1,147.00	8,373,100

スプリックス	4,400	1,142.00	5,024,800
マネジメントソリューションズ	1,400	3,230.00	4,522,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,500	1,065.00	6,922,500
リログループ	68,900	2,879.00	198,363,100
東祥	7,900	2,482.00	19,607,800
エイチ・アイ・エス	19,700	3,130.00	61,661,000
ラックランド	2,600	2,329.00	6,055,400
共立メンテナンス	20,900	5,050.00	105,545,000
イチネンホールディングス	14,200	1,582.00	22,464,400
建設技術研究所	8,800	2,242.00	19,729,600
スペース	8,300	1,351.00	11,213,300
長大	4,700	1,330.00	6,251,000
燦ホールディングス	5,600	1,502.00	8,411,200
スバル興業	800	8,840.00	7,072,000
東京テアトル	5,000	1,417.00	7,085,000
タナベ経営	2,500	1,299.00	3,247,500
ナガワ	4,000	8,060.00	32,240,000
よみうりランド	2,800	4,585.00	12,838,000
東京都競馬	8,300	3,535.00	29,340,500
カナモト	20,700	2,880.00	59,616,000
東京ドーム	51,100	1,098.00	56,107,800
西尾レントオール	12,800	3,145.00	40,256,000
トランス・コスモス	12,000	2,929.00	35,148,000
乃村工藝社	54,100	1,436.00	77,687,600
藤田観光	5,500	2,893.00	15,911,500
KNT-CTホールディングス	7,800	1,494.00	11,653,200
日本管財	13,600	1,976.00	26,873,600
トーカイ	12,200	2,927.00	35,709,400
白洋舎	1,500	2,916.00	4,374,000
セコム	133,600	9,768.00	1,305,004,800
セントラル警備保障	6,100	6,190.00	37,759,000
丹青社	23,900	1,292.00	30,878,800
メイテック	15,600	6,130.00	95,628,000
応用地質	13,600	1,505.00	20,468,000
船井総研ホールディングス	26,100	2,504.00	65,354,400
進学会ホールディングス	5,200	528.00	2,745,600
オオバ	10,000	902.00	9,020,000
いであ	2,300	3,160.00	7,268,000
学究社	3,800	1,400.00	5,320,000
ベネッセホールディングス	42,000	2,904.00	121,968,000
イオンディライト	15,500	4,000.00	62,000,000
ナック	7,100	1,010.00	7,171,000

ニチイ学館	18,000	1,547.00	27,846,000
ダイセキ	21,200	3,175.00	67,310,000
ステップ	4,700	1,578.00	7,416,600
合 計	153,618,000		322,351,447,670

(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。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2019年12月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	540,689,682,501
流動資産合計	540,689,682,501
資産合計	540,689,682,501
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,592,875,283
未払利息	1,270,991
流動負債合計	10,594,146,274
負債合計	10,594,146,274
純資産の部	
元本等	
元本	528,832,318,446
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,263,217,781
元本等合計	530,095,536,227
純資産合計	530,095,536,227
負債純資産合計	540,689,682,501

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2019年12月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		528,832,318,446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)	1.0024円 (10,024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

	2019年12月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。

	2019年12月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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	2019年12月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月21日
期首元本額	574,541,558,799円
期中追加設定元本額	168,230,723,926円
期中一部解約元本額	213,939,964,279円
期末元本額	528,832,318,446円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円

区分	2019年12月20日現在
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン(円コース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(豪ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	1,993円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
欧州REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
GIVI世界株式ファンド(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS(SMA専用)	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円

区分	2019年12月20日現在
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（SMA専用）	996円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	9,957円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	996円
米国ハイイールド・リスクレーダー戦略ファンド	996円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
SMTAMインド債券オープン（毎月決算型）	997円
SMTAMインド債券オープン（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
米国株式ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	2,268,660,721円
日本債券ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	1,962,715,076円
225ベアファンド6（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	94,251,613,381円
225ベアファンド7（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	138,408,610,922円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,196,620,123円
米回国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	3,939,346,480円
日本債券ベアファンド4（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	863,270,335円
ドイツ中期国債ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	1,215,995,523円
TOPIXベアファンド2（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	11,941,998,706円
TOPIXベアファンドR（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	28,386,444,864円
225ベアファンド8（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	30,823,466,632円
225ベアファンド9（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	7,522,526,480円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド（適格機関投資家専用）	10,625,366,497円
225ベアファンド10（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	16,809,184,790円
TOPIXベアファンドR2（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	56,886,066,862円
ドイツ短期国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	298,774円
TOPIXベアファンドF（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	121,151,243,664円
米国短期・ドイツ短期国債LSファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	540,015,592円
TOPIXベアファンドF2（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	299,044円

区分	2019年12月20日現在
北米株配当戦略投信2018-11(為替ヘッジなし)(適格機関投資家専用)	9,977円
私募マネープールファンドAL(適格機関投資家専用)	13,847,146円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2019年12月21日から2020年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2019年12月20日現在)	第6期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,460,042,774	1,162,662,921
投資信託受益証券	58,351,418,757	53,818,138,950
親投資信託受益証券	86,856,855,368	81,240,201,001
未収入金	300,175,643	132,578,850
流動資産合計	146,968,492,542	136,353,581,722
資産合計	146,968,492,542	136,353,581,722
負債の部		
流動負債		
未払解約金	769,559,973	282,010,435
未払受託者報酬	21,954,826	21,119,493
未払委託者報酬	380,550,261	366,071,181
未払利息	3,432	3,624
その他未払費用	1,102,791	1,096,431
流動負債合計	1,173,171,283	670,301,164
負債合計	1,173,171,283	670,301,164
純資産の部		
元本等		
元本	111,459,702,379	111,398,616,289
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	34,335,618,880	24,284,664,269
（分配準備積立金）	15,915,774,821	13,544,214,405
元本等合計	145,795,321,259	135,683,280,558
純資産合計	145,795,321,259	135,683,280,558
負債純資産合計	146,968,492,542	136,353,581,722

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2018年12月21日 至 2019年 6月20日	第6期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
営業収益		
受取利息	576	2,906
有価証券売買等損益	3,917,451,516	8,010,427,092
営業収益合計	3,917,452,092	8,010,424,186
営業費用		
支払利息	498,787	338,700
受託者報酬	19,831,671	21,119,493
委託者報酬	343,748,860	366,071,181
その他費用	1,090,674	1,096,437
営業費用合計	365,169,992	388,625,811
営業利益又は営業損失（ ）	3,552,282,100	8,399,049,997
経常利益又は経常損失（ ）	3,552,282,100	8,399,049,997
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,552,282,100	8,399,049,997
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	404,163,354	1,273,102,307
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,929,376,076	34,335,618,880
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,409,583,990	2,330,512,676
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,409,583,990	2,330,512,676
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,312,212,679	5,255,519,597
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,312,212,679	5,255,519,597
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,174,866,133	24,284,664,269

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2019年12月20日現在)	第6期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	111,459,702,379口	111,398,616,289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) 1.3081円 (13,081円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2180円 (12,180円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第6期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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)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>

	第6期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2018年12月21日 至 2019年12月20日	第6期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	100,853,127,668円	111,459,702,379円
期中追加設定元本額	35,149,470,870円	17,302,113,630円
期中一部解約元本額	24,542,896,159円	17,363,199,720円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

J P X日経インデックス400 マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	525,789,306
株式	47,246,153,370
派生商品評価勘定	2,130,970
未収配当金	390,859,597
前払金	14,271,750
差入委託証拠金	48,305,750
流動資産合計	48,227,510,743
資産合計	48,227,510,743
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,412,510
未払金	78,970
未払解約金	97,463,240
未払利息	819
その他未払費用	1,160
流動負債合計	113,956,699
負債合計	113,956,699
純資産の部	
元本等	
元本	34,055,671,531
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,057,882,513
元本等合計	48,113,554,044
純資産合計	48,113,554,044
負債純資産合計	48,227,510,743

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

	2020年 6月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,055,671,531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 1.4128円 (1万口当たり純資産額) (14,128円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	42,069,940,769円
期中追加設定元本額	3,583,156,575円
期中一部解約元本額	11,597,425,813円
期末元本額	34,055,671,531円
期末元本額の内訳	
J P X日経インデックス400・オープン	950,459,149円
S M T J P X日経インデックス400・オープン	5,436,082,915円
S M T A M J P X日経インデックス400オープン	1,174,217,720円
国内株式S M T Bセレクション（S M A専用）	23,895,162,637円
J P X日経インデックス400・オープン（S M A専用）	1,217,612,392円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	594,327,770円
J P X日経400オープン（適格機関投資家専用）	787,808,948円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 6月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	876,260,250	-	861,988,500	14,271,750
	合計	876,260,250	-	861,988,500	14,271,750

（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。

日本株配当マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	240,733,444
株式	17,080,863,920
未収配当金	211,888,850
前払金	2,496,000
差入委託証拠金	21,000,000
流動資産合計	17,556,982,214
資産合計	17,556,982,214
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,496,000
未払解約金	83,058
未払利息	375
その他未払費用	474
流動負債合計	2,579,907
負債合計	2,579,907
純資産の部	
元本等	
元本	9,581,053,711
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,973,348,596
元本等合計	17,554,402,307
純資産合計	17,554,402,307
負債純資産合計	17,556,982,214

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

	2020年 6月20日現在
	<p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,581,053,711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 1.8322円 (1万口当たり純資産額) (18,322円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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>

（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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	11,466,271,941円
期中追加設定元本額	684,963,369円
期中一部解約元本額	2,570,181,599円
期末元本額	9,581,053,711円
期末元本額の内訳	
日本株配当オープン	1,002,368,853円
3 資産バランスオープン	914,154,689円
3 資産バランスオープンアルファ	171,437,269円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,132,149,086円
日本株配当オープン（SMA専用）	360,943,814円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 6月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	383,136,000	-	380,640,000	2,496,000
合計		383,136,000	-	380,640,000	2,496,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,078,723,646
株式	36,794,116,000
未収入金	157,522,317
未収配当金	93,712,500
流動資産合計	39,124,074,463
資産合計	39,124,074,463
負債の部	
流動負債	
未払金	288,062,340
未払解約金	28,547,575
未払利息	3,239
その他未払費用	3,041
流動負債合計	316,616,195
負債合計	316,616,195
純資産の部	
元本等	
元本	9,090,802,065
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	29,716,656,203
元本等合計	38,807,458,268
純資産合計	38,807,458,268
負債純資産合計	39,124,074,463

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20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,090,802,065口

	2020年 6月20日現在	
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)	4,2689円 (42,689円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2020年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	9,838,394,791円
期中追加設定元本額	228,575,039円
期中一部解約元本額	976,167,765円
期末元本額	9,090,802,065円

区分	2020年 6月20日現在
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	5,394,679,931円
中小型株式オープン（SMA専用）	248,821,821円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	3,327,551,686円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	119,748,627円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,057,708,743
株式	319,694,721,570
派生商品評価勘定	18,430,950
未収入金	6,256,000
未収配当金	2,205,314,347
前払金	13,005,200
差入委託証拠金	268,625,000
流動資産合計	326,264,061,810
資産合計	326,264,061,810
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,441,650
未払金	1,481,362,200
未払解約金	164,491,241
未払利息	6,324
その他未払費用	6,565
流動負債合計	1,677,307,980
負債合計	1,677,307,980
純資産の部	
元本等	
元本	217,207,428,701
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	107,379,325,129
元本等合計	324,586,753,830
純資産合計	324,586,753,830
負債純資産合計	326,264,061,810

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

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	217,207,428,701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 1.4944円 (1万口当たり純資産額) (14,944円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2020年 6月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(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> <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>

(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20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	201,967,964,538円
期中追加設定元本額	37,383,221,586円
期中一部解約元本額	22,143,757,423円
期末元本額	217,207,428,701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)	541,884,788円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,056,544,916円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,247,131円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,456,988,209円
世界経済インデックスファンド	2,267,498,983円
日本株式インデックス・オープン	4,162,104,107円
DCマイセクション25	6,804,127,335円
DCマイセクション50	19,225,045,646円

区分	2020年 6月20日現在
DCマイセレクション75	17,911,034,177円
DC日本株式インデックス・オープン	5,795,557,842円
DCマイセレクションS25	2,906,750,688円
DCマイセレクションS50	8,227,424,593円
DCマイセレクションS75	5,316,773,230円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,983,595,723円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	342,151,654円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,593,824円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	468,963,059円
DC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（SMA専用）	1,065,062,230円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,426,982円
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）	262,331,187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）	67,700,504円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	252,422,118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）	274,939,691円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,535,554,535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）	3,841,382,266円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	599,557,132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）	706,649,333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）	519,372,344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）	830,567,824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	2,082,798,101円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,519,407,180円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,708,791,063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）	325,254,047円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	345,761,536円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,756,510,656円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,528,316円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,916,070円
SMT インデックスバランス・オープン	67,555,039円

区分	2020年 6月20日現在
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	22,941,038円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	77,097,905円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,387,270円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,770,699円
グローバル経済コア	268,484,932円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,770,738円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	49,962,097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）	719,161,023円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	103,560,290円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	129,893円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	190,974円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	76,927円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	54,352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）	50,173,107,810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）	1,802,193,214円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	34,780,985円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,209,797円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 6月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,882,025,200	-	4,869,020,000	13,005,200
	合計	4,882,025,200	-	4,869,020,000	13,005,200

(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。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2020年 6月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	502,541,038,288
流動資産合計	502,541,038,288
資産合計	502,541,038,288
負債の部	
流動負債	
未払解約金	744,583,878
未払利息	783,275
その他未払費用	904,410
流動負債合計	746,271,563
負債合計	746,271,563
純資産の部	
元本等	
元本	500,732,907,735
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,061,858,990
元本等合計	501,794,766,725
純資産合計	501,794,766,725
負債純資産合計	502,541,038,288

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	500,732,907,735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 1.0021円 (1万口当たり純資産額) (10,021円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。

	2020年 6月20日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 6月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月21日
期首元本額	528,832,318,446円
期中追加設定元本額	213,880,567,196円
期中一部解約元本額	241,979,977,907円
期末元本額	500,732,907,735円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（円コース）	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（円コース）	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（豪ドルコース）	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（アジア通貨コース）	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド（米ドルコース）	1,005,802円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9,963円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,992,033円
バンクローン・オープン（円コース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（豪ドルコース）（SMA専用）	9,961円

区分	2020年 6月20日現在
バンクローン・オープン(米ドルコース)(SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン(ユーロコース)(SMA専用)	1,993円
債券総合型ファンド(為替ヘッジあり)(年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド(為替ヘッジなし)(年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(年1回決算型)(メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド(為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド(SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン(為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン(為替ヘッジなし)	696,865円
欧州REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,953円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	9,951円
GIVI世界株式ファンド(SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARTS(SMA専用)	1,004,876円
欧州REIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり(年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし(年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
NMS 米国地方債ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	996円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジあり(年2回決算型)	9,957円
USインフラ株式ファンド 為替ヘッジなし(年2回決算型)	996円

区分	2020年 6月20日現在
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
SMTAMインド債券オープン（毎月決算型）	997円
SMTAMインド債券オープン（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド（SMA専用）	9,979円
米国株式ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	3,960,156,334円
日本債券ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	1,958,973,307円
225ベアファンド6（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	100,951,667,711円
225ベアファンド7（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	129,155,540,193円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド（適格機関投資家専用）	607,915,273円
米国国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	3,401,863,149円
日本債券ベアファンド4（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	762,003,122円
ドイツ中期国債ベアファンド3（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	957,330,452円
TOPIXベアファンド2（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	22,620,303,673円
TOPIXベアファンドR（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	4,803,732,293円
225ベアファンド8（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	24,640,076,794円
225ベアファンド9（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	9,377,470,285円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド（適格機関投資家専用）	3,663,080,303円
225ベアファンド10（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	14,057,694,327円
TOPIXベアファンドR2（建玉比率非調整型/リセット型）（適格機関投資家専用）	45,186,140,764円
ドイツ短期国債ベアファンド（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	298,774円
TOPIXベアファンドF（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	134,512,105,593円
TOPIXベアファンドF2（建玉数量固定型/リセットあり）（適格機関投資家専用）	299,044円
米国株式ベアファンド4（建玉比率非調整型）（適格機関投資家専用）	299,342円
北米株配当戦略投信2018-11（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）	9,979円
私募マネープールファンドAL（適格機関投資家専用）	91,216,194円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【国内株式SMTBセレクション（SMA専用）】

【純資産額計算書】

（2020年 7月31日現在）

資産総額	125,850,159,601円
負債総額	286,850,045円
純資産総額（ - ）	125,563,309,556円
発行済口数	106,960,875,347口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1739円
（1万口当たり純資産額）	（11,739円）

（参考）

J P X日経インデックス400 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	44,071,776,941円
負債総額	200,444,594円
純資産総額（ - ）	43,871,332,347円
発行済口数	32,763,091,179口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3390円
（1万口当たり純資産額）	（13,390円）

日本株配当マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 7月31日現在）

資産総額	16,391,676,469円
負債総額	18,317,256円
純資産総額（ - ）	16,373,359,213円
発行済口数	9,219,558,175口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7759円
（1万口当たり純資産額）	（17,759円）

中小型株式 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	36,707,482,342円
負債総額	337,308,696円
純資産総額（ - ）	36,370,173,646円
発行済口数	8,670,124,194口
1口当たり純資産額（ / ）	4.1949円
（1万口当たり純資産額）	（41,949円）

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）

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(2020年 7月31日現在)

資産総額	480,670,592,587円
負債総額	378,568円
純資産総額（ - ）	480,670,214,019円
発行済口数	479,674,553,376口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0021円
（1万口当たり純資産額）	（10,021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します。）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18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。

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18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2月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2018年12月21日から2019年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2019年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月14日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2019年12月21日から2020年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要なに応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、国内株式SMTBセレクション（SMA専用）の2020年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月21日から2020年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。