

【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1月21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】	i - S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）
【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】

i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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 1月22日から2020年 7月21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17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、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 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	フ ァ ミ リ ー フ ァ ン ド フ ァ ン ド ・ オ ブ ・ フ ァ ン ズ	あり () なし	日経225 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 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ン グ				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<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]

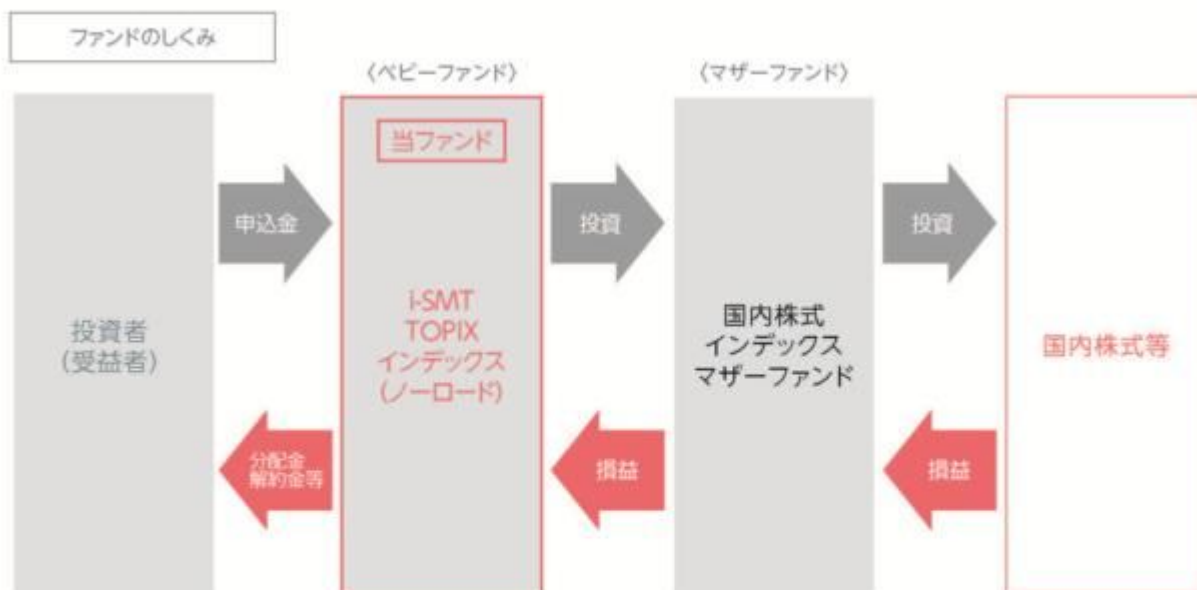
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[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 >

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



? ファミリーファンド方式とは

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

〈マザーファンドの概要〉

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

特色2 TOPIX(東証株価指数)^{*}に連動する投資成果を目指します。

※「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「TOPIX(東証株価指数)」の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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色3 ノーロードファンドです。

●購入時手数料が無料のノーロードファンドです。

その他の費用等については、後掲「4 手数料等及び税金」をご参照ください。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
 - 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。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

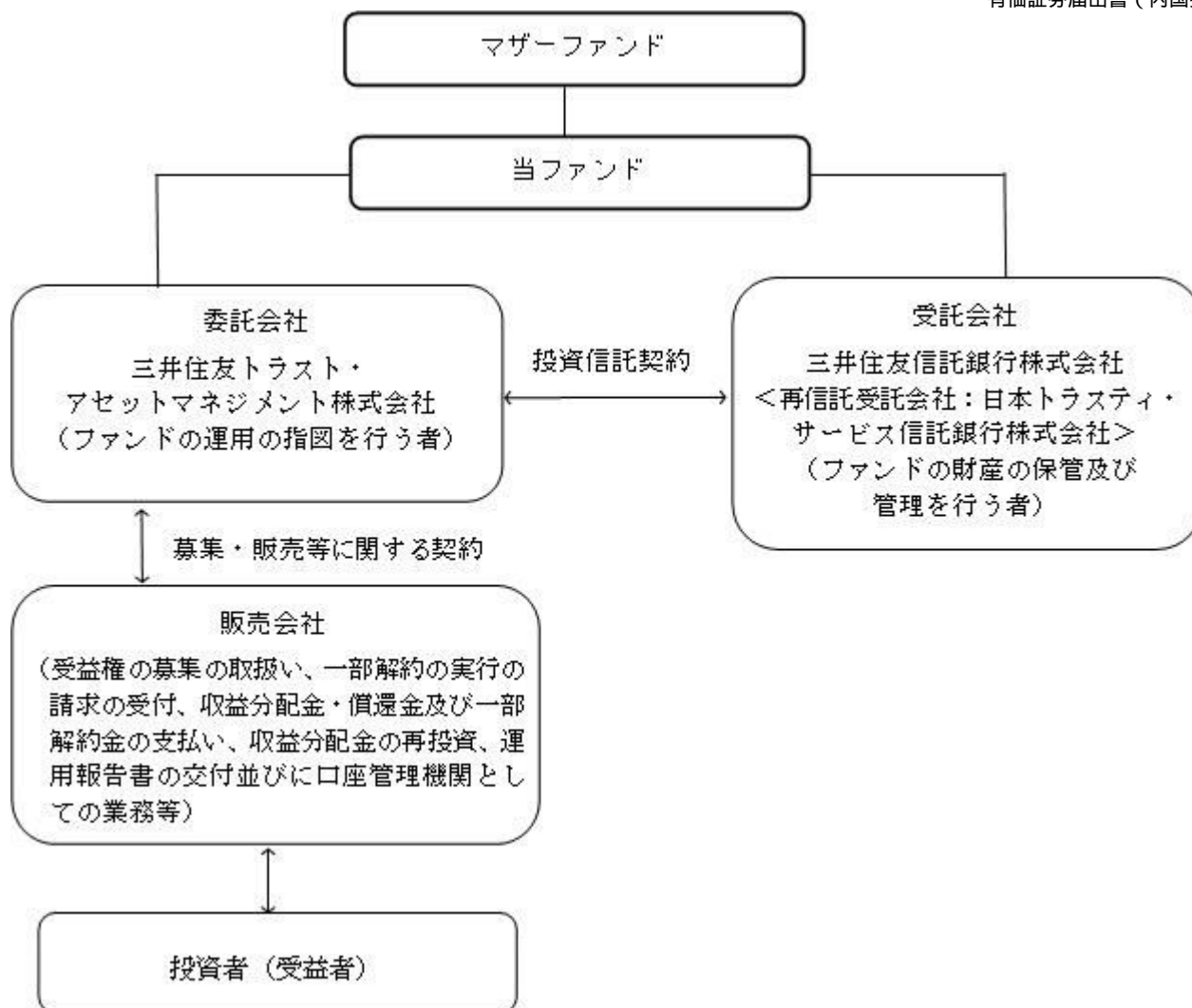
(2) 【ファンドの沿革】

2018年 1月12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（2019年11月29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。

投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指します。
- ロ．株式への実質投資割合は、原則として高位を維持します。
- ハ．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．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、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。
- 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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条に定めるものに限ります。）
 - 3. 金銭債権
 - 4. 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、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- 1. 株券又は新株引受権証書
- 2. 国債証券

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

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- 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。

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

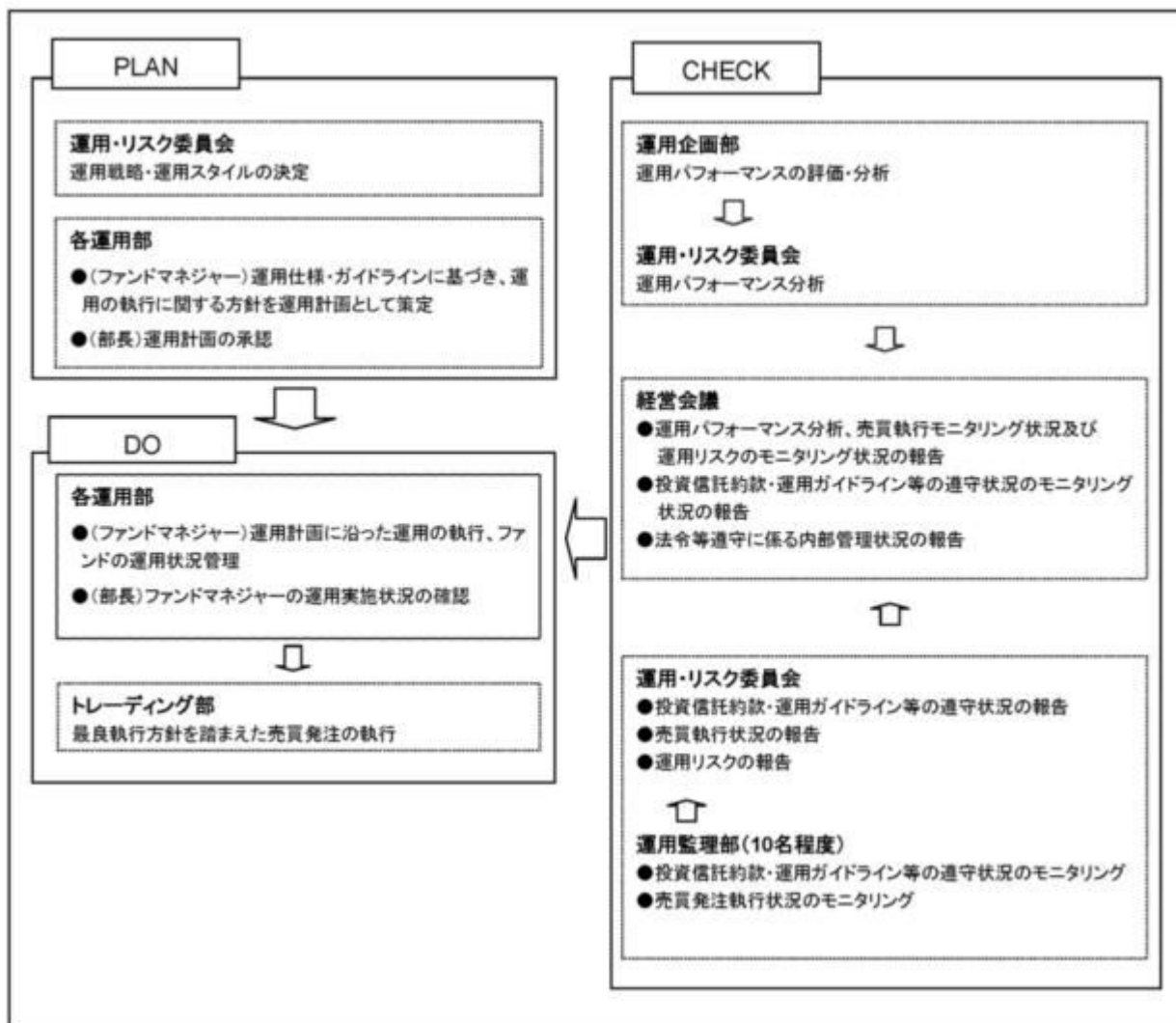
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・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。
- ・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．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

ニ．新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ホ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ヘ．信用取引の指図範囲

（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、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券

5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び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。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ト．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

委託会社は、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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

チ．有価証券の貸付の指図、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、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ) a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

リ．公社債の空売りの指図、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、投資信託財産において有しない公社債又は下記ヌ.の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付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)の売付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売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ヌ．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。

ル．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せん。）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。

(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。

ヲ. 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。

ワ. 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係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらか

じめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2014年12月～2019年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *当ファンドの年間騰落率のうち、設定前については、ベンチマークの年間騰落率を用いて算出していますので、当ファンドの実績ではありません。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証1種株価指数、配当込み)	TOPIX (東証1種株価指数)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を銘柄対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、有数の算出、掲載等の公表、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、ファンドの約定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社公表する、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にサービスに關し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは無効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、不備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 JPEL Morgan ガバナンス・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グループ・レポート・ベース・ファイ (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.187%（税抜 0.17%）（ ）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 0.0825% （税抜 0.075%）	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 0.0825% （税抜 0.075%）	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 0.022% （税抜 0.02%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の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

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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。
- 二．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、2019年11月29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、2019年11月29日現在の状況について記載してあります。

【i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	65,373,515	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		32,869	0.05
合計（純資産総額）		65,406,384	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	41,333,786	1.5161	62,667,144	1.5816	65,373,515	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2018年10月22日)	52,836,312	52,836,312	9,205	9,205
第2期計算期間末 (2019年10月21日)	65,609,096	65,609,096	9,053	9,053
2018年11月末日	53,138,324		9,056	
12月末日	50,988,649		8,128	
2019年1月末日	55,526,853		8,526	
2月末日	58,079,892		8,746	
3月末日	61,874,734		8,752	
4月末日	62,715,922		8,896	
5月末日	63,415,402		8,317	
6月末日	66,159,982		8,542	
7月末日	68,073,051		8,619	
8月末日	67,738,086		8,326	
9月末日	64,468,059		8,827	
10月末日	66,377,305		9,266	
11月末日	65,406,384		9,445	

【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	2018年 1月12日～2018年10月22日	0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2018年 1月12日～2018年10月22日	8.0
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	1.7

(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	2018年 1月12日～2018年10月22日	108,701,841	51,304,223	57,397,618
第2期計算期間	2018年10月23日～2019年10月21日	50,853,131	35,774,595	72,476,154

(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)

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	319,091,943,500	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,939,364,922	1.83
合計(純資産総額)		325,031,308,422	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	5,803,740,000	1.79

(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	1,482,300	6,645.97	9,851,321,331	7,638.00	11,321,807,400	3.48
日本	株式	ソニー	電気機器	840,700	5,405.49	4,544,395,443	6,904.00	5,804,192,800	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,031,100	508.66	4,593,759,326	578.10	5,220,878,910	1.61
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,106,700	3,827.87	4,236,303,729	4,455.00	4,930,348,500	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	872,400	4,937.06	4,307,091,144	5,527.00	4,821,754,800	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	120,500	31,440.53	3,788,583,865	37,440.00	4,511,520,000	1.39
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,035,700	5,188.25	5,373,470,525	4,253.00	4,404,832,100	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	907,300	3,800.91	3,448,565,643	3,989.00	3,619,219,700	1.11
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	910,500	3,593.73	3,272,091,165	3,962.00	3,607,401,000	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	81,600	39,047.07	3,186,240,912	42,350.00	3,455,760,000	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,047,300	2,751.91	2,882,075,343	3,067.00	3,212,069,100	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	972,800	2,791.20	2,715,279,360	3,139.00	3,053,619,200	0.94
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,826,900	155.83	2,777,965,827	169.20	3,016,311,480	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	964,200	2,589.11	2,496,419,862	3,003.00	2,895,492,600	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	469,100	5,566.91	2,611,437,481	5,952.00	2,792,083,200	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	639,200	3,820.49	2,442,057,208	4,300.00	2,748,560,000	0.85
日本	株式	花王	化学	318,500	8,599.35	2,738,892,975	8,612.00	2,742,922,000	0.84
日本	株式	HOYA	精密機器	267,800	7,978.25	2,136,575,350	9,990.00	2,675,322,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	169,500	13,794.65	2,338,193,175	15,745.00	2,668,777,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	126,400	18,482.34	2,336,167,776	20,905.00	2,642,392,000	0.81
日本	株式	三菱商事	卸売業	919,300	2,830.00	2,601,619,000	2,866.00	2,634,713,800	0.81
日本	株式	信越化学工業	化学	223,700	9,452.82	2,114,595,834	11,710.00	2,619,527,000	0.81
日本	株式	第一三共	医薬品	380,600	5,566.41	2,118,575,646	6,862.00	2,611,677,200	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	160,100	13,782.50	2,206,578,250	16,190.00	2,592,019,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	390,800	4,689.66	1,832,719,128	6,344.00	2,479,235,200	0.76
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	110,600	22,636.82	2,503,632,292	22,095.00	2,443,707,000	0.75

日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	234,100	10,404.30	2,435,646,630	10,070.00	2,357,387,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	1,151,500	1,684.86	1,940,116,290	1,939.50	2,233,334,250	0.69
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	916,300	2,021.08	1,851,915,604	2,388.00	2,188,124,400	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,170,100	1,538.98	1,800,760,498	1,867.50	2,185,161,750	0.67

(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	0.10
		鉱業	0.27
		建設業	2.73
		食料品	3.84
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.01
		医薬品	5.91
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.57
		機械	5.02
		電気機器	13.96
		輸送用機器	7.69
		精密機器	2.30
		その他製品	2.29
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.48
		海運業	0.17
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.40
		卸売業	4.87
		小売業	4.58
銀行業	5.75		
証券、商品先物取引業	0.82		
保険業	2.25		
その他金融業	1.15		
不動産業	2.37		

	サービス業	5.04
	小計	98.17
合計		98.17

(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	342	円	5,590,660,390	5,803,740,000	1.79

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

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

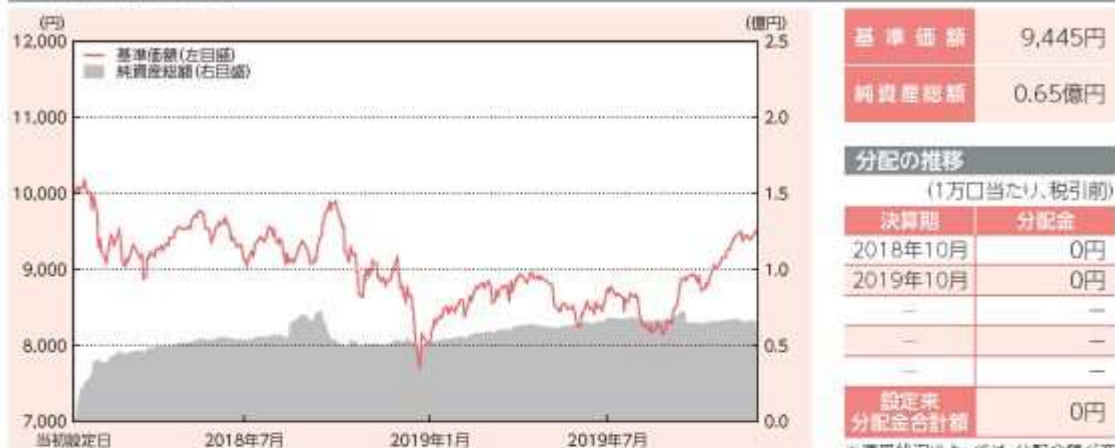
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2018年1月12日

作成基準日：2019年11月29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。

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.5%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.8%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.4%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.1%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

※2010年～2017年は、ファンドのベンチマークである「TOPIX(東証株価指数)」の年間収益率です。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、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します。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

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、5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（受入担保金代用有価証券及び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>

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

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。

<基準価額の照会方法>

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下

記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2018年 1月12日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年10月21日から翌年10月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年1月12日から2018年10月22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發します。

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發します。

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2期計算期間(2018年10月23日から2019年10月21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】

【i - SMT TOPIXインデックス(ノーロード)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2018年10月22日現在)	第2期 (2019年10月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	300,386	412,297
親投資信託受益証券	52,809,945	65,576,435
未収入金	565,128	473,764
流動資産合計	53,675,459	66,462,496
資産合計	53,675,459	66,462,496
負債の部		
流動負債		
未払解約金	807,421	791,382
未払受託者報酬	3,634	7,095
未払委託者報酬	27,216	53,206
その他未払費用	876	1,717
流動負債合計	839,147	853,400
負債合計	839,147	853,400
純資産の部		
元本等		
元本	57,397,618	72,476,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,561,306	6,867,058
(分配準備積立金)	920,675	1,989,608
元本等合計	52,836,312	65,609,096
純資産合計	52,836,312	65,609,096
負債純資産合計	53,675,459	66,462,496

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2018年 1月12日 至 2018年10月22日	自	2018年10月23日 至 2019年10月21日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,233,916		310,104
営業収益合計		2,233,916		310,104
営業費用				
支払利息		204		125
受託者報酬		8,535		13,058
委託者報酬		63,909		97,916
その他費用		2,039		3,154
営業費用合計		74,687		114,253
営業利益又は営業損失 ()		2,308,603		195,851
経常利益又は経常損失 ()		2,308,603		195,851
当期純利益又は当期純損失 ()		2,308,603		195,851
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 ()		549,918		900,796
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		4,561,306
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,767,040		3,546,506
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,767,040		3,546,506
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,569,661		6,948,905
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,569,661		6,948,905
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		4,561,306		6,867,058

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月21日から翌年10月20日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第2期計算期間は2018年10月23日から2019年10月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2018年10月22日現在)	第2期 (2019年10月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,397,618口	72,476,154口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,561,306円	元本の欠損 6,867,058円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9205円 (1万口当たり純資産額) (9,205円)	1口当たり純資産額 0.9053円 (1万口当たり純資産額) (9,053円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 1月12日 至 2018年10月22日			第2期 自 2018年10月23日 至 2019年10月21日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	920,675円	費用控除後の配当等収益額	A	1,440,429円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	38,357円	収益調整金額	C	697,398円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	549,179円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	959,032円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,687,006円
当ファンドの期末残存口数	F	57,397,618口	当ファンドの期末残存口数	F	72,476,154口

第1期 自 2018年 1月12日 至 2018年10月22日			第2期 自 2018年10月23日 至 2019年10月21日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	167円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	370円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	- 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2期 自 2018年10月23日 至 2019年10月21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2期 (2019年10月21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

	第2期 (2019年10月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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1期 自 2018年 1月12日 至 2018年10月22日	第2期 自 2018年10月23日 至 2019年10月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	57,397,618円
期中追加設定元本額	108,201,841円	50,853,131円
期中一部解約元本額	51,304,223円	35,774,595円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (2018年10月22日現在)	第2期 (2019年10月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,866,262	995,221
合計	1,866,262	995,221

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	43,270,495	65,576,435	
	合計	43,270,495	65,576,435	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年10月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,561,764,094
株式	314,586,614,780
派生商品評価勘定	184,819,460
未収入金	1,500,070,630
未収配当金	3,021,568,720
差入委託証拠金	205,620,400
流動資産合計	322,060,458,084

	2019年10月21日現在
項目	金額（円）
資産合計	322,060,458,084
負債の部	
流動負債	
前受金	184,832,500
未払解約金	1,397,362,552
未払利息	2,013
流動負債合計	1,582,197,065
負債合計	1,582,197,065
純資産の部	
元本等	
元本	211,468,660,977
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	109,009,600,042
元本等合計	320,478,261,019
純資産合計	320,478,261,019
負債純資産合計	322,060,458,084

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年10月21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)

	2019年10月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		211,468,660,977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)	1.5155円 (15,155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10月21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10月21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。

	2019年10月21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>(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10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月23日
期首元本額	149,729,501,028円
期中追加設定元本額	81,156,740,506円
期中一部解約元本額	19,417,580,557円
期末元本額	211,468,660,977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）	583,149,371円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,061,301,795円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,893,066円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,618,579,906円
世界経済インデックスファンド	2,105,776,805円
日本株式インデックス・オープン	5,292,541,436円
DCマイセレクション25	6,872,176,377円

区分	2019年10月21日現在
DCマイセレクション50	19,452,151,696円
DCマイセレクション75	17,636,491,535円
DC日本株式インデックス・オープン	5,690,600,131円
DCマイセレクションS25	2,773,483,995円
DCマイセレクションS50	7,899,903,120円
DCマイセレクションS75	5,106,325,581円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,540,871,449円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	388,087,018円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	699,129,737円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	460,159,438円
DC世界経済インデックスファンド	1,857,150,235円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,091,417,481円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	15,912,032円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,366,735円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	38,766,263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)	281,191,309円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,717,839円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,841,365円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	330,566,260円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	59,674,632円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	466,465,937円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,776,433,658円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	729,471,979円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,211,737,360円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	639,490,957円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	45,107,010円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	800,229,370円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	37,334,854円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	454,183,358円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	587,003,192円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,860,220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)	886,871,060円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,011,550,659円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,669,560,201円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,496,119,375円
分散投資コア戦略ファンドA	5,840,455,125円
分散投資コア戦略ファンドS	15,826,016,011円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	261,423,057円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	281,345,467円
コア投資戦略ファンド(切替型)	779,159,346円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,447,001円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,313,475円

区分	2019年10月21日現在
SMT インデックスバランス・オープン	74,512,082円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,975,790,491円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	680,819,456円
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,920,228円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	61,642,788円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	9,085,379円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,622,189円
グローバル経済コア	313,104,663円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,456,053円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	43,270,495円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,657,084円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	230,508,151円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	32,326,359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)	52,166,612,154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)	615,132,489円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	4,724,957円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	17,605,826,735
合計	17,605,826,735

(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10月21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	5,514,917,500	-	5,699,750,000
合計		5,514,917,500	-	5,699,750,000

(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。

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	6,000	2,884.00	17,304,000	
日本水産	183,300	605.00	110,896,500	
マルハニチロ	26,500	2,808.00	74,412,000	
カネコ種苗	5,500	1,344.00	7,392,000	
サカタのタネ	21,900	3,490.00	76,431,000	
ホクト	15,400	1,923.00	29,614,200	
ホクリヨウ	2,500	713.00	1,782,500	
住石ホールディングス	39,500	138.00	5,451,000	
日鉄鉱業	4,200	4,335.00	18,207,000	
三井松島ホールディングス	7,700	1,238.00	9,532,600	
国際石油開発帝石	735,300	963.90	708,755,670	
石油資源開発	26,300	2,688.00	70,694,400	
K&Oエナジーグループ	8,900	1,561.00	13,892,900	
ヒノキヤグループ	4,600	2,017.00	9,278,200	
ショーボンドホールディングス	26,200	4,090.00	107,158,000	
ミライト・ホールディングス	51,600	1,674.00	86,378,400	
タマホーム	8,800	1,765.00	15,532,000	
サンヨーホームズ	2,600	677.00	1,760,200	
日本アクア	7,300	652.00	4,759,600	
ファーストコーポレーション	5,600	641.00	3,589,600	
ベステラ	3,500	1,225.00	4,287,500	
T A T E R U	37,200	205.00	7,626,000	
スペースバリューホールディングス	22,300	531.00	11,841,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	834.00	2,919,000	
第一カッター興業	2,300	1,781.00	4,096,300	
安藤・間	117,500	819.00	96,232,500	
東急建設	53,700	859.00	46,128,300	
コムシスホールディングス	65,000	3,190.00	207,350,000	
ミサワホーム	14,400	1,142.00	16,444,800	
ピーアールホールディングス	20,000	441.00	8,820,000	

高松コンストラクショングループ	11,400	2,626.00	29,936,400
東建コーポレーション	5,600	6,900.00	38,640,000
ソネック	1,900	838.00	1,592,200
ヤマウラ	7,100	899.00	6,382,900
大成建設	150,500	4,195.00	631,347,500
大林組	453,500	1,108.00	502,478,000
清水建設	462,500	1,009.00	466,662,500
飛島建設	12,900	1,300.00	16,770,000
長谷工コーポレーション	189,000	1,342.00	253,638,000
松井建設	16,700	811.00	13,543,700
銭高組	1,800	4,030.00	7,254,000
鹿島建設	354,400	1,473.00	522,031,200
不動テトラ	10,400	1,425.00	14,820,000
大末建設	5,300	946.00	5,013,800
鉄建建設	9,200	2,862.00	26,330,400
西松建設	32,600	2,149.00	70,057,400
三井住友建設	109,100	592.00	64,587,200
大豊建設	10,200	3,085.00	31,467,000
前田建設工業	106,000	997.00	105,682,000
佐田建設	9,800	430.00	4,214,000
ナカノフドー建設	11,600	490.00	5,684,000
奥村組	24,900	3,020.00	75,198,000
東鉄工業	18,200	3,350.00	60,970,000
イチケン	2,700	1,704.00	4,600,800
富士ピー・エス	6,200	545.00	3,379,000
浅沼組	5,100	3,940.00	20,094,000
戸田建設	175,700	667.00	117,191,900
熊谷組	21,600	3,300.00	71,280,000
北野建設	3,200	2,708.00	8,665,600
植木組	1,900	2,583.00	4,907,700
矢作建設工業	20,600	724.00	14,914,400
ピーエス三菱	15,900	747.00	11,877,300
日本ハウスホールディングス	28,900	524.00	15,143,600
大東建託	53,900	14,050.00	757,295,000
新日本建設	18,000	824.00	14,832,000
N I P P O	40,000	2,193.00	87,720,000
東亜道路工業	2,800	3,475.00	9,730,000
前田道路	44,800	2,356.00	105,548,800
日本道路	4,100	6,660.00	27,306,000
東亜建設工業	13,200	1,452.00	19,166,400
日本国土開発	24,700	583.00	14,400,100
若築建設	7,600	1,623.00	12,334,800

東洋建設	55,400	489.00	27,090,600
五洋建設	179,800	627.00	112,734,600
世紀東急工業	22,000	751.00	16,522,000
福田組	4,900	4,465.00	21,878,500
住友林業	107,200	1,554.00	166,588,800
日本基礎技術	15,500	398.00	6,169,000
巴コーポレーション	18,800	417.00	7,839,600
大和ハウス工業	418,700	3,676.00	1,539,141,200
ライト工業	29,100	1,608.00	46,792,800
積水ハウス	463,000	2,334.50	1,080,873,500
日特建設	12,900	703.00	9,068,700
北陸電気工事	7,300	953.00	6,956,900
ユアテック	24,200	693.00	16,770,600
四電工	2,300	2,787.00	6,410,100
中電工	19,500	2,458.00	47,931,000
関電工	68,800	1,025.00	70,520,000
きんでん	100,500	1,583.00	159,091,500
東京エネシス	15,600	954.00	14,882,400
トーエネック	4,300	3,470.00	14,921,000
住友電設	10,500	2,153.00	22,606,500
日本電設工業	25,800	2,348.00	60,578,400
協和エクシオ	59,200	2,721.00	161,083,200
新日本空調	12,200	1,995.00	24,339,000
九電工	29,700	3,565.00	105,880,500
三機工業	33,000	1,308.00	43,164,000
日揮ホールディングス	130,300	1,508.00	196,492,400
中外炉工業	4,200	1,582.00	6,644,400
ヤマト	13,500	791.00	10,678,500
太平電業	10,200	2,506.00	25,561,200
高砂熱学工業	36,800	1,918.00	70,582,400
三晃金属工業	1,800	2,483.00	4,469,400
朝日工業社	3,100	3,160.00	9,796,000
明星工業	27,400	816.00	22,358,400
大気社	20,600	3,405.00	70,143,000
ダイダン	10,100	2,387.00	24,108,700
日比谷総合設備	13,600	1,944.00	26,438,400
東芝プラントシステム	32,700	2,068.00	67,623,600
OSJBホールディングス	66,700	260.00	17,342,000
東洋エンジニアリング	17,800	749.00	13,332,200
レイズネクスト	27,200	1,097.00	29,838,400
日本製粉	42,900	1,739.00	74,603,100
日清製粉グループ本社	153,000	2,067.00	316,251,000

日東富士製粉	1,000	6,520.00	6,520,000
昭和産業	12,400	3,155.00	39,122,000
鳥越製粉	12,000	912.00	10,944,000
中部飼料	16,500	1,221.00	20,146,500
フィード・ワン	91,000	164.00	14,924,000
東洋精糖	2,100	1,081.00	2,270,100
日本甜菜製糖	7,700	2,007.00	15,453,900
三井製糖	10,700	2,295.00	24,556,500
塩水港精糖	14,700	209.00	3,072,300
日新製糖	6,400	1,971.00	12,614,400
森永製菓	34,100	5,340.00	182,094,000
中村屋	3,500	4,630.00	16,205,000
江崎グリコ	40,200	4,865.00	195,573,000
名糖産業	6,500	1,256.00	8,164,000
井村屋グループ	5,800	2,011.00	11,663,800
不二家	7,600	2,082.00	15,823,200
山崎製パン	101,500	1,950.00	197,925,000
第一屋製パン	2,300	973.00	2,237,900
モロゾフ	2,300	5,060.00	11,638,000
亀田製菓	8,400	4,765.00	40,026,000
寿スピリッツ	14,300	7,210.00	103,103,000
カルビー	61,700	3,365.00	207,620,500
森永乳業	27,100	4,260.00	115,446,000
六甲バター	9,000	1,789.00	16,101,000
ヤクルト本社	100,300	6,090.00	610,827,000
明治ホールディングス	96,000	7,760.00	744,960,000
雪印メグミルク	32,600	2,605.00	84,923,000
プリマハム	19,100	2,545.00	48,609,500
日本ハム	56,100	4,675.00	262,267,500
林兼産業	4,500	618.00	2,781,000
丸大食品	14,400	2,337.00	33,652,800
S Foods	12,200	2,912.00	35,526,400
伊藤ハム米久ホールディングス	87,200	687.00	59,906,400
サッポロホールディングス	46,200	2,740.00	126,588,000
アサヒグループホールディングス	283,700	5,359.00	1,520,348,300
キリンホールディングス	574,400	2,258.00	1,296,995,200
宝ホールディングス	101,400	1,078.00	109,309,200
オエノンホールディングス	35,700	411.00	14,672,700
養命酒製造	4,100	1,926.00	7,896,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	95,100	2,523.00	239,937,300
サントリー食品インターナショナル	90,600	4,630.00	419,478,000
ダイドーグループホールディングス	7,600	4,520.00	34,352,000

伊藤園	41,100	5,270.00	216,597,000
キーコーヒー	13,300	2,240.00	29,792,000
ユニカフェ	3,500	1,018.00	3,563,000
ジャパンフーズ	1,900	1,206.00	2,291,400
日清オイリオグループ	17,400	3,595.00	62,553,000
不二製油グループ本社	33,000	3,205.00	105,765,000
かどや製油	1,500	3,710.00	5,565,000
J・オイルミルズ	7,000	4,275.00	29,925,000
キッコーマン	89,400	5,240.00	468,456,000
味の素	299,100	2,024.00	605,378,400
キューピー	75,400	2,449.00	184,654,600
ハウス食品グループ本社	50,700	4,035.00	204,574,500
カゴメ	51,400	2,775.00	142,635,000
焼津水産化学工業	6,600	1,052.00	6,943,200
アリアケジャパン	12,400	8,430.00	104,532,000
ピエトロ	1,800	1,607.00	2,892,600
エバラ食品工業	3,300	2,138.00	7,055,400
やまみ	700	2,085.00	1,459,500
ニチレイ	70,400	2,454.00	172,761,600
東洋水産	69,700	4,410.00	307,377,000
イトアンド	4,700	1,712.00	8,046,400
大冷	1,500	1,975.00	2,962,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,700	1,079.00	3,992,300
日清食品ホールディングス	57,600	8,210.00	472,896,000
永谷園ホールディングス	7,200	2,085.00	15,012,000
一正蒲鉾	5,300	1,075.00	5,697,500
フジッコ	14,700	2,000.00	29,400,000
ロック・フィールド	14,600	1,487.00	21,710,200
日本たばこ産業	782,100	2,408.50	1,883,687,850
ケンコーマヨネーズ	7,600	2,491.00	18,931,600
わらべや日洋ホールディングス	8,900	1,882.00	16,749,800
なとり	7,600	1,648.00	12,524,800
イフジ産業	2,400	736.00	1,766,400
ピククルスコーポレーション	3,200	2,605.00	8,336,000
北の達人コーポレーション	53,200	640.00	34,048,000
ユーグレナ	57,800	851.00	49,187,800
ミヨシ油脂	5,200	1,213.00	6,307,600
理研ビタミン	6,400	3,620.00	23,168,000
片倉工業	19,500	1,367.00	26,656,500
ゲンゼ	9,000	4,625.00	41,625,000
東洋紡	56,300	1,470.00	82,761,000
ユニチカ	40,100	333.00	13,353,300

富士紡ホールディングス	7,000	3,130.00	21,910,000
倉敷紡績	12,800	2,418.00	30,950,400
シキボウ	6,900	925.00	6,382,500
日本毛織	43,900	1,071.00	47,016,900
トーア紡コーポレーション	5,200	543.00	2,823,600
帝国繊維	15,100	1,932.00	29,173,200
帝人	108,000	2,160.00	233,280,000
東レ	1,025,900	846.20	868,116,580
サカイオーベックス	3,500	1,841.00	6,443,500
住江織物	3,900	2,807.00	10,947,300
日本フェルト	8,400	481.00	4,040,400
イチカワ	2,200	1,531.00	3,368,200
日東製網	1,500	1,604.00	2,406,000
アツギ	11,000	828.00	9,108,000
ダイニック	5,300	747.00	3,959,100
セーレン	32,800	1,281.00	42,016,800
ソトー	5,400	979.00	5,286,600
東海染工	1,900	1,134.00	2,154,600
小松マテーレ	21,800	835.00	18,203,000
ワコールホールディングス	37,400	2,802.00	104,794,800
ホギメディカル	16,500	3,310.00	54,615,000
レナウン	38,200	111.00	4,240,200
クラウディアホールディングス	3,500	494.00	1,729,000
T S Iホールディングス	49,000	569.00	27,881,000
マツオカコーポレーション	4,300	1,963.00	8,440,900
ワールド	17,300	2,445.00	42,298,500
三陽商会	7,000	1,468.00	10,276,000
ナイガイ	5,100	478.00	2,437,800
オンワードホールディングス	79,600	605.00	48,158,000
ルックホールディングス	4,600	1,120.00	5,152,000
ゴールドウイン	24,000	7,980.00	191,520,000
デサント	32,300	1,398.00	45,155,400
キング	7,200	529.00	3,808,800
ヤマトインターナショナル	8,400	388.00	3,259,200
特種東海製紙	8,400	3,925.00	32,970,000
王子ホールディングス	595,000	554.00	329,630,000
日本製紙	63,300	1,839.00	116,408,700
三菱製紙	21,500	474.00	10,191,000
北越コーポレーション	87,700	542.00	47,533,400
中越パルプ工業	5,600	1,531.00	8,573,600
巴川製紙所	4,400	943.00	4,149,200
大王製紙	64,400	1,448.00	93,251,200

阿波製紙	3,400	404.00	1,373,600
レンゴー	136,300	781.00	106,450,300
トーモク	8,100	1,620.00	13,122,000
ザ・パック	10,000	4,030.00	40,300,000
クラレ	208,200	1,368.00	284,817,600
旭化成	940,300	1,173.50	1,103,442,050
共和レザー	8,200	742.00	6,084,400
昭和電工	94,100	2,912.00	274,019,200
住友化学	1,040,400	507.00	527,482,800
住友精化	6,400	3,360.00	21,504,000
日産化学	80,100	4,360.00	349,236,000
ラサ工業	4,700	1,435.00	6,744,500
クレハ	12,200	6,710.00	81,862,000
多木化学	3,900	4,345.00	16,945,500
テイカ	10,800	2,071.00	22,366,800
石原産業	25,400	1,094.00	27,787,600
片倉コープアグリ	3,800	1,166.00	4,430,800
日本曹達	20,900	2,774.00	57,976,600
東ソー	204,300	1,506.00	307,675,800
トクヤマ	38,100	2,809.00	107,022,900
セントラル硝子	28,800	2,492.00	71,769,600
東亜合成	83,000	1,206.00	100,098,000
大阪ソーダ	14,600	2,949.00	43,055,400
関東電化工業	31,300	913.00	28,576,900
デンカ	51,900	3,075.00	159,592,500
信越化学工業	232,900	12,005.00	2,795,964,500
日本カーバイド工業	4,500	1,288.00	5,796,000
堺化学工業	8,800	2,650.00	23,320,000
第一稀元素化学工業	14,300	816.00	11,668,800
エア・ウォーター	108,200	2,009.00	217,373,800
大陽日酸	108,900	2,498.00	272,032,200
日本化学工業	4,500	3,370.00	15,165,000
東邦アセチレン	2,000	1,337.00	2,674,000
日本パーカライズニング	72,200	1,241.00	89,600,200
高压ガス工業	21,000	849.00	17,829,000
チタン工業	1,600	2,453.00	3,924,800
四国化成工業	22,200	1,206.00	26,773,200
戸田工業	2,800	2,180.00	6,104,000
ステラ ケミファ	7,800	2,934.00	22,885,200
保土谷化学工業	4,600	3,955.00	18,193,000
日本触媒	22,200	6,580.00	146,076,000
大日精化工業	10,900	3,235.00	35,261,500

カネカ	34,200	3,555.00	121,581,000
三菱瓦斯化学	134,400	1,524.00	204,825,600
三井化学	120,000	2,579.00	309,480,000
J S R	132,600	1,829.00	242,525,400
東京応化工業	22,700	4,255.00	96,588,500
大阪有機化学工業	12,200	1,131.00	13,798,200
三菱ケミカルホールディングス	883,600	823.50	727,644,600
K Hネオケム	23,300	2,510.00	58,483,000
ダイセル	194,700	939.00	182,823,300
住友ベークライト	22,900	4,440.00	101,676,000
積水化学工業	284,200	1,750.00	497,350,000
日本ゼオン	119,200	1,372.00	163,542,400
アイカ工業	39,600	3,440.00	136,224,000
宇部興産	66,700	2,276.00	151,809,200
積水樹脂	21,800	2,140.00	46,652,000
タキロンシーアイ	28,600	650.00	18,590,000
旭有機材	9,100	1,421.00	12,931,100
日立化成	61,100	3,540.00	216,294,000
ニチバン	7,000	1,737.00	12,159,000
リケンテクノス	36,000	498.00	17,928,000
大倉工業	6,200	1,947.00	12,071,400
積水化成品工業	19,700	776.00	15,287,200
群栄化学工業	3,400	2,411.00	8,197,400
タイガースポリマー	7,000	608.00	4,256,000
ミライアル	3,800	1,537.00	5,840,600
ダイキアクシス	4,700	884.00	4,154,800
ダイキョーニシカワ	27,900	821.00	22,905,900
竹本容器	4,700	991.00	4,657,700
森六ホールディングス	7,100	2,338.00	16,599,800
日本化薬	81,800	1,332.00	108,957,600
カーリットホールディングス	14,100	620.00	8,742,000
日本精化	10,600	1,230.00	13,038,000
扶桑化学工業	13,400	2,699.00	36,166,600
トリケミカル研究所	2,900	7,060.00	20,474,000
A D E K A	65,100	1,478.00	96,217,800
日油	49,800	3,580.00	178,284,000
新日本理化	23,400	208.00	4,867,200
ハリマ化成グループ	10,900	1,242.00	13,537,800
花王	323,100	8,290.00	2,678,499,000
第一工業製薬	4,900	3,320.00	16,268,000
石原ケミカル	3,300	1,672.00	5,517,600
日華化学	4,500	889.00	4,000,500

ニイタカ	2,100	1,643.00	3,450,300
三洋化成工業	8,900	5,130.00	45,657,000
有機合成薬品工業	10,100	236.00	2,383,600
大日本塗料	14,900	1,085.00	16,166,500
日本ペイントホールディングス	109,100	6,200.00	676,420,000
関西ペイント	148,500	2,621.00	389,218,500
神東塗料	10,400	195.00	2,028,000
中国塗料	43,400	958.00	41,577,200
日本特殊塗料	9,900	1,140.00	11,286,000
藤倉化成	17,800	543.00	9,665,400
太陽ホールディングス	10,900	3,785.00	41,256,500
D I C	55,800	3,105.00	173,259,000
サカタインクス	28,900	1,191.00	34,419,900
東洋インキS Cホールディングス	27,900	2,603.00	72,623,700
T & K T O K A	10,200	1,002.00	10,220,400
富士フィルムホールディングス	280,300	4,699.00	1,317,129,700
資生堂	268,200	8,563.00	2,296,596,600
ライオン	175,500	2,170.00	380,835,000
高砂香料工業	9,300	2,648.00	24,626,400
マンダム	30,300	2,688.00	81,446,400
ミルボン	18,000	5,530.00	99,540,000
ファンケル	60,100	2,764.00	166,116,400
コーセー	22,800	18,560.00	423,168,000
コタ	7,100	1,285.00	9,123,500
シーボン	1,600	2,420.00	3,872,000
ポーラ・オルビスホールディングス	57,600	2,505.00	144,288,000
ノエビアホールディングス	12,900	5,580.00	71,982,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	946.00	2,838,000
エステー	9,600	1,535.00	14,736,000
アグロ カネショウ	4,200	1,537.00	6,455,400
コニシ	23,900	1,515.00	36,208,500
長谷川香料	17,900	1,990.00	35,621,000
星光P M C	7,700	833.00	6,414,100
小林製薬	37,800	8,590.00	324,702,000
荒川化学工業	12,100	1,698.00	20,545,800
メック	9,300	1,806.00	16,795,800
日本高純度化学	3,700	2,536.00	9,383,200
タカラバイオ	35,300	2,170.00	76,601,000
J C U	17,500	2,528.00	44,240,000
新田ゼラチン	8,500	688.00	5,848,000
O A T アグリオ	2,300	1,624.00	3,735,200
デクセリアルズ	34,800	827.00	28,779,600

アース製薬	10,200	5,580.00	56,916,000
北興化学工業	13,800	544.00	7,507,200
大成ラミック	4,400	2,890.00	12,716,000
クミアイ化学工業	55,800	980.00	54,684,000
日本農薬	24,000	554.00	13,296,000
アキレス	9,300	1,849.00	17,195,700
有沢製作所	21,300	1,074.00	22,876,200
日東電工	93,100	5,551.00	516,798,100
レック	14,400	1,051.00	15,134,400
三光合成	15,400	391.00	6,021,400
きもと	22,900	170.00	3,893,000
藤森工業	12,100	3,465.00	41,926,500
前澤化成工業	9,200	1,147.00	10,552,400
未来工業	7,200	2,083.00	14,997,600
ウェーブロックホールディングス	3,700	811.00	3,000,700
J S P	7,900	1,866.00	14,741,400
エフピコ	14,800	6,620.00	97,976,000
天馬	9,000	1,990.00	17,910,000
信越ポリマー	24,200	825.00	19,965,000
東リ	33,600	262.00	8,803,200
ニフコ	54,100	2,636.00	142,607,600
バルカー	11,000	2,405.00	26,455,000
ユニ・チャーム	260,100	3,496.00	909,309,600
ショーエイコーポレーション	1,100	730.00	803,000
協和キリン	135,800	2,033.00	276,081,400
武田薬品工業	1,178,200	3,797.00	4,473,625,400
アステラス製薬	1,187,100	1,708.50	2,028,160,350
大日本住友製薬	100,000	1,750.00	175,000,000
塩野義製薬	172,600	6,003.00	1,036,117,800
田辺三菱製薬	141,100	1,229.00	173,411,900
わかもと製薬	16,100	264.00	4,250,400
あすか製薬	16,600	1,109.00	18,409,400
日本新薬	35,300	9,230.00	325,819,000
バイオフェルミン製薬	2,300	2,200.00	5,060,000
中外製薬	140,700	8,300.00	1,167,810,000
科研製薬	23,100	5,110.00	118,041,000
エーザイ	161,500	5,534.00	893,741,000
ロート製薬	69,300	3,140.00	217,602,000
小野薬品工業	318,700	1,916.00	610,629,200
久光製薬	39,900	4,945.00	197,305,500
持田製薬	20,400	4,095.00	83,538,000
参天製薬	251,300	1,860.00	467,418,000

扶桑薬品工業	4,800	2,067.00	9,921,600
日本ケミファ	1,800	2,805.00	5,049,000
ツムラ	41,800	2,930.00	122,474,000
日医工	35,500	1,236.00	43,878,000
キッセイ薬品工業	23,900	2,694.00	64,386,600
生化学工業	26,200	1,164.00	30,496,800
栄研化学	23,700	1,583.00	37,517,100
日水製薬	5,700	1,257.00	7,164,900
鳥居薬品	8,400	2,784.00	23,385,600
JCRファーマ	9,500	8,110.00	77,045,000
東和薬品	19,400	2,540.00	49,276,000
富士製薬工業	9,200	1,335.00	12,282,000
沢井製薬	27,700	5,700.00	157,890,000
ゼリア新薬工業	26,700	1,931.00	51,557,700
第一三共	386,200	6,632.00	2,561,278,400
キョーリン製薬ホールディングス	29,800	1,835.00	54,683,000
大幸薬品	6,000	2,840.00	17,040,000
ダイト	7,900	2,965.00	23,423,500
大塚ホールディングス	257,100	4,345.00	1,117,099,500
大正製薬ホールディングス	28,500	7,790.00	222,015,000
ペプチドリーム	68,300	4,935.00	337,060,500
日本コークス工業	114,000	84.00	9,576,000
ニチレキ	17,300	1,166.00	20,171,800
ユシロ化学工業	7,000	1,372.00	9,604,000
ビーピー・カストロール	4,800	1,450.00	6,960,000
富士石油	32,800	251.00	8,232,800
MORESCO	4,900	1,298.00	6,360,200
出光興産	155,800	3,120.00	486,096,000
JXTGホールディングス	2,232,600	508.00	1,134,160,800
コスモエネルギーホールディングス	39,100	2,318.00	90,633,800
横浜ゴム	78,100	2,288.00	178,692,800
TOYO TIRE	77,500	1,407.00	109,042,500
ブリヂストン	414,800	4,347.00	1,803,135,600
住友ゴム工業	121,200	1,357.00	164,468,400
藤倉コンポジット	11,800	429.00	5,062,200
オカモト	9,000	4,070.00	36,630,000
フコク	5,900	712.00	4,200,800
ニッタ	15,200	2,973.00	45,189,600
住友理工	26,200	918.00	24,051,600
三ツ星ベルト	17,800	2,033.00	36,187,400
バンドー化学	25,700	885.00	22,744,500
日東紡績	20,100	3,120.00	62,712,000

A G C	133,400	3,530.00	470,902,000
日本板硝子	64,500	675.00	43,537,500
石塚硝子	2,200	2,149.00	4,727,800
日本山村硝子	5,600	1,266.00	7,089,600
日本電気硝子	54,200	2,420.00	131,164,000
オハラ	5,400	1,526.00	8,240,400
住友大阪セメント	27,300	4,900.00	133,770,000
太平洋セメント	85,200	3,070.00	261,564,000
日本ヒューム	13,600	796.00	10,825,600
日本コンクリート工業	29,200	306.00	8,935,200
三谷セキサン	6,300	3,390.00	21,357,000
アジアパイルホールディングス	19,200	554.00	10,636,800
東海カーボン	141,400	1,118.00	158,085,200
日本カーボン	7,000	3,980.00	27,860,000
東洋炭素	7,900	2,449.00	19,347,100
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	4,380.00	35,478,000
T O T O	103,800	4,230.00	439,074,000
日本碍子	164,700	1,549.00	255,120,300
日本特殊陶業	113,800	2,084.00	237,159,200
M A R U W A	4,700	7,320.00	34,404,000
品川リフラクトリーズ	3,600	2,823.00	10,162,800
黒崎播磨	2,700	6,000.00	16,200,000
ヨータイ	11,900	704.00	8,377,600
イソライト工業	7,000	526.00	3,682,000
東京窯業	17,300	305.00	5,276,500
ニッカトー	6,200	780.00	4,836,000
フジインコーポレーテッド	12,000	2,750.00	33,000,000
クニミネ工業	6,100	949.00	5,788,900
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,072.00	2,787,200
ニチアス	37,000	2,158.00	79,846,000
ニチハ	18,800	3,055.00	57,434,000
日本製鉄	620,200	1,546.00	958,829,200
神戸製鋼所	244,400	574.00	140,285,600
中山製鋼所	18,600	468.00	8,704,800
合同製鐵	6,500	2,342.00	15,223,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	360,500	1,334.50	481,087,250
東京製鐵	71,500	891.00	63,706,500
共英製鋼	15,100	2,079.00	31,392,900
大和工業	28,400	2,832.00	80,428,800
東京鐵鋼	5,500	1,380.00	7,590,000
大阪製鐵	8,900	1,403.00	12,486,700
淀川製鋼所	18,000	2,055.00	36,990,000

丸一鋼管	47,300	2,903.00	137,311,900
モリ工業	4,000	2,144.00	8,576,000
大同特殊鋼	21,900	4,620.00	101,178,000
日本高周波鋼業	5,100	414.00	2,111,400
日本冶金工業	11,000	2,360.00	25,960,000
山陽特殊製鋼	16,800	1,501.00	25,216,800
愛知製鋼	7,500	3,435.00	25,762,500
日立金属	143,800	1,247.00	179,318,600
日本金属	3,100	887.00	2,749,700
大平洋金属	9,000	2,497.00	22,473,000
新日本電工	86,300	182.00	15,706,600
栗本鐵工所	6,800	1,710.00	11,628,000
虹技	2,000	1,473.00	2,946,000
三菱製鋼	9,900	1,150.00	11,385,000
日亜鋼業	19,700	331.00	6,520,700
日本精線	1,900	2,527.00	4,801,300
エンビプロ・ホールディングス	5,100	649.00	3,309,900
シンニッタン	20,900	435.00	9,091,500
新家工業	3,100	1,531.00	4,746,100
大紀アルミニウム工業所	22,100	727.00	16,066,700
日本軽金属ホールディングス	364,400	205.00	74,702,000
三井金属鉱業	36,100	2,815.00	101,621,500
東邦亜鉛	7,500	2,118.00	15,885,000
三菱マテリアル	88,200	2,975.00	262,395,000
住友金属鉱山	182,800	3,349.00	612,197,200
D O W Aホールディングス	31,200	3,745.00	116,844,000
古河機械金属	22,100	1,515.00	33,481,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	1,674.00	25,947,000
東邦チタニウム	24,100	878.00	21,159,800
U A C J	20,300	1,948.00	39,544,400
C Kサンエツ	2,600	2,950.00	7,670,000
古河電気工業	38,500	2,853.00	109,840,500
住友電気工業	499,100	1,406.00	701,734,600
フジクラ	161,500	457.00	73,805,500
昭和電線ホールディングス	15,500	930.00	14,415,000
東京特殊電線	1,800	2,126.00	3,826,800
タツタ電線	26,700	518.00	13,830,600
カナレ電気	2,300	1,882.00	4,328,600
平河ヒューテック	5,700	1,077.00	6,138,900
リョービ	16,500	1,898.00	31,317,000
アーレスティ	16,600	525.00	8,715,000
アサヒホールディングス	25,100	2,278.00	57,177,800

稲葉製作所	7,500	1,432.00	10,740,000
宮地エンジニアリンググループ	4,100	1,771.00	7,261,100
トーカロ	34,500	1,018.00	35,121,000
アルファC o	4,700	1,239.00	5,823,300
SUMCO	159,800	1,796.00	287,000,800
川田テクノロジーズ	3,000	6,970.00	20,910,000
RS Technologies	3,800	4,140.00	15,732,000
信和	7,100	960.00	6,816,000
東洋製罐グループホールディングス	85,000	1,750.00	148,750,000
ホッカンホールディングス	6,800	1,718.00	11,682,400
コロナ	7,400	1,120.00	8,288,000
横河ブリッジホールディングス	24,800	1,754.00	43,499,200
駒井ハルテック	2,500	1,733.00	4,332,500
高田機工	1,200	2,567.00	3,080,400
三和ホールディングス	137,900	1,255.00	173,064,500
文化シャッター	39,400	950.00	37,430,000
三協立山	18,500	1,185.00	21,922,500
アルインコ	10,600	1,155.00	12,243,000
東洋シャッター	3,200	709.00	2,268,800
LIXILグループ	196,900	2,017.00	397,147,300
日本フィルコン	10,300	503.00	5,180,900
ノーリツ	27,700	1,316.00	36,453,200
長府製作所	13,600	2,471.00	33,605,600
リンナイ	23,800	7,570.00	180,166,000
ダイニチ工業	7,200	695.00	5,004,000
日東精工	18,500	584.00	10,804,000
三洋工業	1,800	1,958.00	3,524,400
岡部	27,100	889.00	24,091,900
ジーテクト	14,700	1,735.00	25,504,500
東プレ	24,900	1,782.00	44,371,800
高周波熱錬	25,700	930.00	23,901,000
東京製綱	8,200	1,081.00	8,864,200
サンコール	7,500	467.00	3,502,500
モリテック スチール	10,500	344.00	3,612,000
パイオラックス	21,400	1,992.00	42,628,800
エイチワン	13,100	669.00	8,763,900
日本発條	133,000	858.00	114,114,000
中央発條	1,600	2,799.00	4,478,400
アドバネクス	1,800	1,700.00	3,060,000
立川ブラインド工業	5,900	1,400.00	8,260,000
三益半導体工業	11,900	2,050.00	24,395,000
日本ドライケミカル	3,700	1,174.00	4,343,800

日本製鋼所	40,500	2,252.00	91,206,000
三浦工業	57,800	3,195.00	184,671,000
タクマ	48,800	1,264.00	61,683,200
ツガミ	30,100	924.00	27,812,400
オークマ	17,000	6,210.00	105,570,000
東芝機械	15,100	2,280.00	34,428,000
アマダホールディングス	200,600	1,193.00	239,315,800
アイダエンジニアリング	36,200	886.00	32,073,200
滝澤鉄工所	4,200	1,269.00	5,329,800
F U J I	53,400	1,698.00	90,673,200
牧野フライス製作所	15,700	5,120.00	80,384,000
オーエスジー	61,700	2,158.00	133,148,600
ダイジェット工業	1,600	1,584.00	2,534,400
旭ダイヤモンド工業	35,200	655.00	23,056,000
D M G 森精機	84,500	1,618.00	136,721,000
ソディック	31,500	831.00	26,176,500
ディスコ	18,100	21,680.00	392,408,000
日東工器	7,400	2,265.00	16,761,000
日進工具	4,000	2,068.00	8,272,000
パンチ工業	9,500	519.00	4,930,500
富士ダイス	6,100	633.00	3,861,300
豊和工業	7,500	761.00	5,707,500
O K K	5,600	721.00	4,037,600
東洋機械金属	9,800	594.00	5,821,200
津田駒工業	2,700	1,223.00	3,302,100
エンシュウ	3,600	1,125.00	4,050,000
島精機製作所	18,400	2,645.00	48,668,000
オプトラン	14,900	3,290.00	49,021,000
N C ホールディングス	4,600	494.00	2,272,400
イワキポンプ	5,800	1,011.00	5,863,800
フリー	10,800	948.00	10,238,400
ヤマシンフィルタ	23,300	906.00	21,109,800
日阪製作所	16,600	909.00	15,089,400
やまびこ	26,000	1,195.00	31,070,000
平田機工	6,300	7,670.00	48,321,000
ペガサスミシン製造	12,700	523.00	6,642,100
マルマエ	5,600	1,036.00	5,801,600
タツモ	6,300	1,275.00	8,032,500
ナプテスコ	78,700	3,340.00	262,858,000
三井海洋開発	14,200	2,763.00	39,234,600
レオン自動機	13,200	1,598.00	21,093,600
S M C	39,500	45,970.00	1,815,815,000

ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,400	523.00	5,439,200
ホソカワミクロン	4,700	3,890.00	18,283,000
ユニオンツール	5,000	3,530.00	17,650,000
オイレス工業	18,800	1,601.00	30,098,800
日精エー・エス・ビー機械	4,500	3,765.00	16,942,500
サトーホールディングス	16,100	2,981.00	47,994,100
技研製作所	11,700	3,700.00	43,290,000
日本エアーテック	4,400	637.00	2,802,800
カワタ	3,800	1,124.00	4,271,200
日精樹脂工業	11,300	1,047.00	11,831,100
オカダアイヨン	4,700	1,312.00	6,166,400
ワイエイシイホールディングス	5,300	796.00	4,218,800
小松製作所	611,100	2,490.00	1,521,639,000
住友重機械工業	77,300	3,235.00	250,065,500
日立建機	54,100	2,599.00	140,605,900
日工	18,600	682.00	12,685,200
巴工業	5,800	2,390.00	13,862,000
井関農機	13,600	1,602.00	21,787,200
TOWA	11,700	983.00	11,501,100
丸山製作所	3,000	1,210.00	3,630,000
北川鉄工所	6,100	2,034.00	12,407,400
ローツェ	5,900	3,880.00	22,892,000
タカキタ	4,900	545.00	2,670,500
クボタ	723,100	1,739.50	1,257,832,450
荏原実業	3,400	2,134.00	7,255,600
三菱化工機	4,700	1,790.00	8,413,000
月島機械	26,800	1,595.00	42,746,000
帝国電機製作所	9,500	1,232.00	11,704,000
新東工業	32,100	1,008.00	32,356,800
澁谷工業	11,800	2,911.00	34,349,800
アイチ コーポレーション	23,500	723.00	16,990,500
小森コーポレーション	34,300	1,214.00	41,640,200
鶴見製作所	10,600	2,084.00	22,090,400
住友精密工業	2,300	3,185.00	7,325,500
日本ギア工業	4,300	427.00	1,836,100
酒井重工業	2,600	2,815.00	7,319,000
荏原製作所	59,900	3,125.00	187,187,500
石井鐵工所	2,100	2,540.00	5,334,000
西島製作所	13,900	1,029.00	14,303,100
北越工業	14,000	1,230.00	17,220,000
ダイキン工業	184,200	14,720.00	2,711,424,000
オルガノ	4,900	5,470.00	26,803,000

トーヨーカネツ	5,100	1,974.00	10,067,400
栗田工業	73,100	2,924.00	213,744,400
椿本チエイン	17,700	3,550.00	62,835,000
大同工業	6,600	826.00	5,451,600
木村化工機	11,500	394.00	4,531,000
アネスト岩田	21,100	1,018.00	21,479,800
ダイフク	74,300	5,840.00	433,912,000
サムコ	3,800	1,082.00	4,111,600
加藤製作所	7,000	1,960.00	13,720,000
油研工業	2,300	1,660.00	3,818,000
タダノ	65,200	1,067.00	69,568,400
フジテック	49,100	1,481.00	72,717,100
C K D	37,600	1,496.00	56,249,600
キトー	10,300	1,589.00	16,366,700
平和	37,700	2,188.00	82,487,600
理想科学工業	12,000	1,733.00	20,796,000
S A N K Y O	33,800	3,755.00	126,919,000
日本金銭機械	15,100	948.00	14,314,800
マースグループホールディングス	8,600	1,986.00	17,079,600
福島工業	8,400	3,305.00	27,762,000
オーイズミ	5,900	525.00	3,097,500
ダイコク電機	6,300	1,513.00	9,531,900
竹内製作所	22,700	1,672.00	37,954,400
アマノ	38,600	3,175.00	122,555,000
J U K I	18,800	950.00	17,860,000
蛇の目マシン工業	12,600	410.00	5,166,000
マックス	20,700	1,912.00	39,578,400
グローリー	37,400	3,050.00	114,070,000
新晃工業	12,600	1,788.00	22,528,800
大和冷機工業	19,600	1,183.00	23,186,800
セガサミーホールディングス	133,900	1,555.00	208,214,500
日本ピストンリング	5,000	1,309.00	6,545,000
リケン	6,300	3,975.00	25,042,500
T P R	18,200	1,841.00	33,506,200
ツバキ・ナカシマ	27,600	1,745.00	48,162,000
ホシザキ	39,500	8,870.00	350,365,000
大豊工業	11,200	802.00	8,982,400
日本精工	277,300	989.00	274,249,700
N T N	290,400	325.00	94,380,000
ジェイテクト	129,600	1,289.00	167,054,400
不二越	12,600	5,040.00	63,504,000
日本トムソン	40,300	454.00	18,296,200

THK	78,600	2,876.00	226,053,600
ユーシン精機	10,600	1,002.00	10,621,200
前澤給装工業	5,300	2,105.00	11,156,500
イーグル工業	16,800	1,019.00	17,119,200
前澤工業	9,300	393.00	3,654,900
日本ピラー工業	13,700	1,431.00	19,604,700
キッツ	54,900	721.00	39,582,900
マキタ	164,300	3,440.00	565,192,000
日立造船	107,300	354.00	37,984,200
三菱重工業	226,200	4,361.00	986,458,200
IHI	103,700	2,591.00	268,686,700
スター精密	21,200	1,628.00	34,513,600
日清紡ホールディングス	90,100	876.00	78,927,600
イビデン	82,800	2,316.00	191,764,800
コニカミノルタ	295,500	784.00	231,672,000
ブラザー工業	176,000	1,992.00	350,592,000
ミネベアミツミ	250,800	1,882.00	472,005,600
日立製作所	607,600	4,129.00	2,508,780,400
三菱電機	1,349,600	1,515.00	2,044,644,000
富士電機	87,600	3,375.00	295,650,000
東洋電機製造	5,400	1,644.00	8,877,600
安川電機	156,500	3,985.00	623,652,500
シンフォニアテクノロジー	18,800	1,274.00	23,951,200
明電舎	26,800	1,967.00	52,715,600
オリジン	3,800	1,426.00	5,418,800
山洋電気	6,600	5,030.00	33,198,000
デンヨー	12,500	1,790.00	22,375,000
東芝テック	16,900	3,715.00	62,783,500
芝浦メカトロニクス	2,600	3,380.00	8,788,000
マブチモーター	37,500	4,015.00	150,562,500
日本電産	162,400	15,170.00	2,463,608,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,300	501.00	3,657,300
トレックス・セミコンダクター	6,400	1,418.00	9,075,200
東光高岳	7,200	1,203.00	8,661,600
ダイヘン	14,800	3,375.00	49,950,000
ヤーマン	20,300	688.00	13,966,400
JVCケンウッド	104,700	308.00	32,247,600
ミマキエンジニアリング	13,000	542.00	7,046,000
第一精工	5,100	2,538.00	12,943,800
日新電機	31,700	1,370.00	43,429,000
大崎電気工業	27,000	708.00	19,116,000
オムロン	143,500	6,310.00	905,485,000

日東工業	21,700	2,125.00	46,112,500
I D E C	18,200	2,117.00	38,529,400
正興電機製作所	3,800	805.00	3,059,000
不二電機工業	1,900	1,235.00	2,346,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,800	1,909.00	93,159,200
サクサホールディングス	3,500	1,849.00	6,471,500
メルコホールディングス	5,800	2,762.00	16,019,600
テクノメディカ	3,300	2,123.00	7,005,900
日本電気	174,700	4,585.00	800,999,500
富士通	130,100	8,795.00	1,144,229,500
沖電気工業	58,600	1,455.00	85,263,000
岩崎通信機	6,300	820.00	5,166,000
電気興業	7,100	3,425.00	24,317,500
サンケン電気	15,800	2,438.00	38,520,400
ナカヨ	2,700	1,589.00	4,290,300
アイホン	7,700	1,698.00	13,074,600
ルネサスエレクトロニクス	643,500	723.00	465,250,500
セイコーエプソン	167,500	1,506.00	252,255,000
ワコム	98,900	409.00	40,450,100
アルバック	26,900	4,780.00	128,582,000
アクセル	6,500	592.00	3,848,000
E I Z O	12,400	3,905.00	48,422,000
日本信号	34,500	1,227.00	42,331,500
京三製作所	29,300	454.00	13,302,200
能美防災	18,100	2,082.00	37,684,200
ホーチキ	8,900	1,452.00	12,922,800
星和電機	8,100	526.00	4,260,600
エレコム	12,900	4,120.00	53,148,000
パナソニック	1,541,900	894.60	1,379,383,740
シャープ	134,000	1,254.00	168,036,000
アンリツ	86,900	2,185.00	189,876,500
富士通ゼネラル	41,300	1,818.00	75,083,400
ソニー	906,000	6,460.00	5,852,760,000
T D K	70,600	10,520.00	742,712,000
帝国通信工業	6,400	1,206.00	7,718,400
タムラ製作所	52,300	605.00	31,641,500
アルプスアルパイン	140,700	2,119.00	298,143,300
池上通信機	4,300	1,115.00	4,794,500
鈴木	8,000	635.00	5,080,000
日本トリム	2,600	4,810.00	12,506,000
ローランド ディー . ジー .	7,700	2,071.00	15,946,700
フォスター電機	15,300	2,024.00	30,967,200

S M K	3,800	2,803.00	10,651,400
ヨコオ	9,800	3,190.00	31,262,000
ホシデン	40,200	1,064.00	42,772,800
ヒロセ電機	19,300	13,430.00	259,199,000
日本航空電子工業	31,000	1,703.00	52,793,000
T O A	14,600	1,218.00	17,782,800
マクセルホールディングス	29,400	1,529.00	44,952,600
古野電気	17,800	1,058.00	18,832,400
ユニデンホールディングス	4,000	1,998.00	7,992,000
スミダコーポレーション	10,800	1,081.00	11,674,800
アイコム	7,500	2,382.00	17,865,000
リオン	6,400	2,598.00	16,627,200
本多通信工業	12,500	507.00	6,337,500
横河電機	135,100	1,923.00	259,797,300
新電元工業	4,800	3,590.00	17,232,000
アズビル	85,200	2,949.00	251,254,800
東亜ディーケーケー	7,200	840.00	6,048,000
日本光電工業	59,600	3,140.00	187,144,000
チノー	4,800	1,412.00	6,777,600
共和電業	14,400	423.00	6,091,200
日本電子材料	5,600	622.00	3,483,200
堀場製作所	26,800	6,900.00	184,920,000
アドバンテスト	92,000	5,300.00	487,600,000
小野測器	6,600	521.00	3,438,600
エスペック	12,200	1,931.00	23,558,200
キーエンス	66,200	66,880.00	4,427,456,000
日置電機	7,200	3,665.00	26,388,000
シスメックス	105,200	6,780.00	713,256,000
日本マイクロニクス	24,000	951.00	22,824,000
メガチップス	10,900	1,759.00	19,173,100
O B A R A G R O U P	7,100	3,830.00	27,193,000
澤藤電機	1,900	1,789.00	3,399,100
原田工業	6,000	872.00	5,232,000
コーセル	16,900	1,174.00	19,840,600
イリソ電子工業	12,500	5,380.00	67,250,000
オブテックスグループ	22,400	1,682.00	37,676,800
千代田インテグレ	6,500	2,326.00	15,119,000
アイ・オー・データ機器	5,500	894.00	4,917,000
レーザーテック	27,700	7,490.00	207,473,000
スタンレー電気	95,400	2,947.00	281,143,800
岩崎電気	5,600	1,381.00	7,733,600
ウシオ電機	78,700	1,588.00	124,975,600

岡谷電機産業	10,900	383.00	4,174,700
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	592.00	7,873,600
エノモト	4,200	1,093.00	4,590,600
日本セラミック	13,900	2,752.00	38,252,800
遠藤照明	7,500	675.00	5,062,500
古河電池	10,400	628.00	6,531,200
双信電機	7,700	418.00	3,218,600
山一電機	10,100	1,412.00	14,261,200
図研	9,000	1,989.00	17,901,000
日本電子	26,800	2,857.00	76,567,600
カシオ計算機	119,500	1,735.00	207,332,500
ファナック	128,200	20,925.00	2,682,585,000
日本シイエムケイ	35,100	645.00	22,639,500
エンプラス	6,200	3,835.00	23,777,000
大真空	5,400	1,056.00	5,702,400
ローム	64,600	8,820.00	569,772,000
浜松ホトニクス	96,900	4,030.00	390,507,000
三井ハイテック	15,100	1,814.00	27,391,400
新光電気工業	45,800	1,076.00	49,280,800
京セラ	205,800	6,923.00	1,424,753,400
太陽誘電	60,200	2,868.00	172,653,600
村田製作所	424,800	5,837.00	2,479,557,600
双葉電子工業	21,700	1,370.00	29,729,000
北陸電気工業	5,500	1,127.00	6,198,500
ニチコン	43,000	1,036.00	44,548,000
日本ケミコン	9,600	1,707.00	16,387,200
K O A	20,700	1,356.00	28,069,200
市光工業	20,800	831.00	17,284,800
小糸製作所	80,900	5,560.00	449,804,000
ミツバ	25,600	684.00	17,510,400
S C R E E Nホールディングス	23,400	7,640.00	178,776,000
キャノン電子	14,400	1,921.00	27,662,400
キャノン	726,500	2,914.00	2,117,021,000
リコー	405,900	967.00	392,505,300
象印マホービン	39,900	1,535.00	61,246,500
M U T O Hホールディングス	2,100	1,695.00	3,559,500
東京エレクトロン	90,000	21,775.00	1,959,750,000
トヨタ紡織	47,200	1,523.00	71,885,600
芦森工業	2,900	1,445.00	4,190,500
ユニプレス	26,200	1,715.00	44,933,000
豊田自動織機	109,200	6,230.00	680,316,000
モリタホールディングス	23,600	1,832.00	43,235,200

三櫻工業	17,200	888.00	15,273,600
デンソー	297,100	4,832.00	1,435,587,200
東海理化電機製作所	35,600	1,910.00	67,996,000
三井E & Sホールディングス	48,700	1,006.00	48,992,200
川崎重工業	105,000	2,535.00	266,175,000
名村造船所	40,500	305.00	12,352,500
日本車輛製造	4,900	2,549.00	12,490,100
三菱ロジスネクスト	22,300	1,052.00	23,459,600
近畿車輛	2,000	1,632.00	3,264,000
日産自動車	1,591,600	682.60	1,086,426,160
いすゞ自動車	426,600	1,249.00	532,823,400
トヨタ自動車	1,503,900	7,400.00	11,128,860,000
日野自動車	168,500	944.00	159,064,000
三菱自動車工業	499,500	486.00	242,757,000
エフテック	9,500	689.00	6,545,500
レシップホールディングス	4,800	674.00	3,235,200
G M B	2,700	803.00	2,168,100
ファルテック	2,500	778.00	1,945,000
武蔵精密工業	32,800	1,407.00	46,149,600
日産車体	26,400	929.00	24,525,600
新明和工業	56,500	1,288.00	72,772,000
極東開発工業	26,900	1,389.00	37,364,100
日信工業	24,700	1,559.00	38,507,300
トピー工業	11,100	2,102.00	23,332,200
ティラド	4,900	2,040.00	9,996,000
曙ブレーキ工業	74,100	214.00	15,857,400
タチエス	22,200	1,393.00	30,924,600
N O K	72,600	1,686.00	122,403,600
フタバ産業	37,600	754.00	28,350,400
K Y B	14,000	3,350.00	46,900,000
大同メタル工業	22,000	658.00	14,476,000
プレス工業	67,100	458.00	30,731,800
ミクニ	17,400	327.00	5,689,800
太平洋工業	28,300	1,610.00	45,563,000
ケーヒン	31,000	1,714.00	53,134,000
河西工業	16,700	855.00	14,278,500
アイシン精機	111,100	3,675.00	408,292,500
マツダ	423,600	987.40	418,262,640
今仙電機製作所	12,600	884.00	11,138,400
本田技研工業	1,138,500	2,895.00	3,295,957,500
スズキ	246,900	4,934.00	1,218,204,600
S U B A R U	419,000	3,038.00	1,272,922,000

安永	6,600	1,298.00	8,566,800
ヤマハ発動機	176,000	2,100.00	369,600,000
ショーワ	31,900	1,672.00	53,336,800
T B K	16,200	426.00	6,901,200
エクセディ	18,400	2,179.00	40,093,600
豊田合成	43,600	2,226.00	97,053,600
愛三工業	21,200	922.00	19,546,400
盟和産業	2,100	1,108.00	2,326,800
日本プラスト	10,700	698.00	7,468,600
ヨロズ	12,700	1,370.00	17,399,000
エフ・シー・シー	24,300	2,142.00	52,050,600
シマノ	50,500	15,760.00	795,880,000
テイ・エス テック	31,400	3,345.00	105,033,000
ジャムコ	6,800	1,500.00	10,200,000
テルモ	381,900	3,488.00	1,332,067,200
クリエートメディック	4,500	988.00	4,446,000
日機装	40,500	1,161.00	47,020,500
日本エム・ディ・エム	7,800	1,887.00	14,718,600
島津製作所	173,700	2,706.00	470,032,200
J M S	12,500	655.00	8,187,500
長野計器	10,600	697.00	7,388,200
ブイ・テクノロジー	6,300	6,470.00	40,761,000
東京計器	8,600	925.00	7,955,000
愛知時計電機	1,800	4,045.00	7,281,000
インターアクション	7,300	1,887.00	13,775,100
オーバル	13,300	242.00	3,218,600
東京精密	24,500	3,390.00	83,055,000
マニー	53,800	2,600.00	139,880,000
ニコン	235,200	1,360.00	319,872,000
トプコン	72,500	1,416.00	102,660,000
オリンパス	804,200	1,469.00	1,181,369,800
理研計器	11,900	2,129.00	25,335,100
タムロン	10,900	2,321.00	25,298,900
H O Y A	271,700	9,176.00	2,493,119,200
シード	5,800	900.00	5,220,000
ノーリツ鋼機	10,600	1,530.00	16,218,000
エー・アンド・デイ	12,300	815.00	10,024,500
朝日インテック	114,500	2,840.00	325,180,000
シチズン時計	147,700	553.00	81,678,100
リズム時計工業	4,600	1,024.00	4,710,400
大研医器	10,700	527.00	5,638,900
メニコン	18,500	3,685.00	68,172,500

シンシア	1,500	628.00	942,000
松風	6,600	1,570.00	10,362,000
セイコーホールディングス	20,800	2,518.00	52,374,400
ニプロ	93,400	1,242.00	116,002,800
中本パックス	3,800	1,405.00	5,339,000
スノーピーク	6,200	1,110.00	6,882,000
パラマウントベッドホールディングス	15,500	4,110.00	63,705,000
トランザクション	8,600	914.00	7,860,400
S H O - B I	3,900	381.00	1,485,900
ニホンフラッシュ	5,800	2,717.00	15,758,600
前田工織	14,900	1,707.00	25,434,300
永大産業	17,600	344.00	6,054,400
アートネイチャー	14,400	659.00	9,489,600
バンダイナムコホールディングス	139,500	6,950.00	969,525,000
アイフィスジャパン	3,400	812.00	2,760,800
共立印刷	22,500	160.00	3,600,000
S H O E I	6,500	4,585.00	29,802,500
フランスベッドホールディングス	19,100	997.00	19,042,700
パイロットコーポレーション	23,500	4,090.00	96,115,000
萩原工業	7,500	1,656.00	12,420,000
トッパン・フォームズ	28,900	1,041.00	30,084,900
フジシールインターナショナル	30,200	2,723.00	82,234,600
タカラトミー	56,500	1,179.00	66,613,500
廣済堂	12,500	708.00	8,850,000
エステールホールディングス	3,600	637.00	2,293,200
アーク	51,500	96.00	4,944,000
タカノ	5,300	799.00	4,234,700
プロネクサス	11,600	1,161.00	13,467,600
ホクシン	8,300	172.00	1,427,600
ウッドワン	4,500	1,163.00	5,233,500
大建工業	10,200	1,945.00	19,839,000
凸版印刷	200,600	1,985.00	398,191,000
大日本印刷	190,200	2,809.00	534,271,800
共同印刷	4,200	2,683.00	11,268,600
N I S S H A	27,700	1,154.00	31,965,800
光村印刷	1,200	1,788.00	2,145,600
宝印刷	6,500	1,717.00	11,160,500
アシックス	111,400	1,910.00	212,774,000
ツツミ	4,200	1,993.00	8,370,600
小松ウオール工業	4,100	2,040.00	8,364,000
ヤマハ	80,300	5,040.00	404,712,000
河合楽器製作所	4,200	3,100.00	13,020,000

クリナップ	12,600	577.00	7,270,200
ピジョン	81,600	4,700.00	383,520,000
兼松サステック	900	1,767.00	1,590,300
キングジム	11,200	872.00	9,766,400
リンテック	32,100	2,256.00	72,417,600
イトーキ	28,700	469.00	13,460,300
任天堂	77,200	38,550.00	2,976,060,000
三菱鉛筆	22,200	1,779.00	39,493,800
タカラスタANDARD	27,900	1,860.00	51,894,000
コクヨ	64,700	1,566.00	101,320,200
ナカバヤシ	13,300	529.00	7,035,700
グローブライド	6,500	2,758.00	17,927,000
オカムラ	47,100	1,070.00	50,397,000
美津濃	13,400	2,830.00	37,922,000
東京電力ホールディングス	1,077,300	538.00	579,587,400
中部電力	412,900	1,631.50	673,646,350
関西電力	550,700	1,256.00	691,679,200
中国電力	186,600	1,444.00	269,450,400
北陸電力	132,200	757.00	100,075,400
東北電力	316,100	1,099.00	347,393,900
四国電力	121,500	1,055.00	128,182,500
九州電力	278,200	1,085.00	301,847,000
北海道電力	126,300	583.00	73,632,900
沖縄電力	25,000	1,790.00	44,750,000
電源開発	107,400	2,615.00	280,851,000
エフオン	6,300	722.00	4,548,600
イーレックス	23,400	1,379.00	32,268,600
レノバ	22,200	940.00	20,868,000
東京瓦斯	259,500	2,701.00	700,909,500
大阪瓦斯	261,900	2,073.00	542,918,700
東邦瓦斯	66,800	4,230.00	282,564,000
北海道瓦斯	7,200	1,583.00	11,397,600
広島ガス	27,800	349.00	9,702,200
西部瓦斯	15,200	2,431.00	36,951,200
静岡ガス	38,300	919.00	35,197,700
メタウォーター	6,500	3,755.00	24,407,500
SBSホールディングス	11,600	1,699.00	19,708,400
東武鉄道	142,300	3,590.00	510,857,000
相鉄ホールディングス	46,300	2,867.00	132,742,100
東急	366,500	2,070.00	758,655,000
京浜急行電鉄	184,900	2,150.00	397,535,000
小田急電鉄	216,200	2,675.00	578,335,000

京王電鉄	75,400	6,820.00	514,228,000
京成電鉄	101,100	4,525.00	457,477,500
富士急行	18,400	4,390.00	80,776,000
新京成電鉄	3,500	2,147.00	7,514,500
東日本旅客鉄道	237,500	10,000.00	2,375,000,000
西日本旅客鉄道	120,300	9,284.00	1,116,865,200
東海旅客鉄道	120,800	22,590.00	2,728,872,000
西武ホールディングス	167,200	1,911.00	319,519,200
鴻池運輸	21,500	1,650.00	35,475,000
西日本鉄道	37,400	2,478.00	92,677,200
ハマキョウレックス	10,400	3,540.00	36,816,000
サカイ引越センター	7,100	6,440.00	45,724,000
近鉄グループホールディングス	127,800	5,820.00	743,796,000
阪急阪神ホールディングス	170,500	4,285.00	730,592,500
南海電気鉄道	57,000	2,777.00	158,289,000
京阪ホールディングス	56,900	5,010.00	285,069,000
神戸電鉄	3,300	3,915.00	12,919,500
名古屋鉄道	105,100	3,395.00	356,814,500
山陽電気鉄道	9,800	2,140.00	20,972,000
日本通運	49,300	5,620.00	277,066,000
ヤマトホールディングス	224,100	1,782.50	399,458,250
山九	35,500	5,820.00	206,610,000
丸運	7,300	269.00	1,963,700
丸全昭和運輸	10,400	3,045.00	31,668,000
センコーグループホールディングス	70,500	859.00	60,559,500
トナミホールディングス	3,100	4,805.00	14,895,500
ニッコンホールディングス	48,600	2,574.00	125,096,400
日本石油輸送	1,500	2,806.00	4,209,000
福山通運	16,400	3,815.00	62,566,000
セイノーホールディングス	95,700	1,351.00	129,290,700
エスライン	3,800	915.00	3,477,000
神奈川中央交通	3,200	3,895.00	12,464,000
日立物流	28,100	3,185.00	89,498,500
丸和運輸機関	13,500	2,761.00	37,273,500
C & F ロジホールディングス	12,900	1,314.00	16,950,600
九州旅客鉄道	107,300	3,480.00	373,404,000
S Gホールディングス	120,700	2,641.00	318,768,700
日本郵船	107,400	1,933.00	207,604,200
商船三井	76,100	2,940.00	223,734,000
川崎汽船	39,400	1,514.00	59,651,600
N S ユナイテッド海運	7,400	2,389.00	17,678,600
飯野海運	63,000	364.00	22,932,000

共栄タンカー	1,700	1,486.00	2,526,200
乾汽船	11,500	1,162.00	13,363,000
日本航空	234,000	3,350.00	783,900,000
A N Aホールディングス	233,600	3,715.00	867,824,000
パスコ	2,500	1,045.00	2,612,500
ランコム	3,600	6,260.00	22,536,000
日新	11,000	1,645.00	18,095,000
三菱倉庫	44,200	2,741.00	121,152,200
三井倉庫ホールディングス	15,600	1,714.00	26,738,400
住友倉庫	47,100	1,463.00	68,907,300
澁澤倉庫	7,000	1,998.00	13,986,000
東陽倉庫	23,100	328.00	7,576,800
日本トランスシティ	28,100	532.00	14,949,200
ケイヒン	2,500	1,290.00	3,225,000
中央倉庫	7,800	1,160.00	9,048,000
川西倉庫	2,600	1,108.00	2,880,800
安田倉庫	10,500	944.00	9,912,000
ファイズホールディングス	2,300	731.00	1,681,300
東洋埠頭	3,900	1,363.00	5,315,700
宇徳	10,900	531.00	5,787,900
上組	78,800	2,404.00	189,435,200
サンリツ	3,000	665.00	1,995,000
キムラユニティー	3,400	1,017.00	3,457,800
キューソー流通システム	3,200	1,835.00	5,872,000
近鉄エクスプレス	24,100	1,598.00	38,511,800
東海運	7,300	284.00	2,073,200
エーアイティー	8,300	971.00	8,059,300
内外トランスライン	4,500	1,370.00	6,165,000
日本コンセプト	4,100	1,401.00	5,744,100
N E C ネットエスアイ	14,700	3,085.00	45,349,500
クロスキャット	3,800	1,005.00	3,819,000
システナ	47,400	1,593.00	75,508,200
デジタルアーツ	7,100	6,570.00	46,647,000
日鉄ソリューションズ	19,900	3,635.00	72,336,500
キューブシステム	7,400	767.00	5,675,800
エイジア	2,800	1,223.00	3,424,400
コア	5,800	1,348.00	7,818,400
ソリトンシステムズ	6,100	958.00	5,843,800
ソフトクリエイイトホールディングス	5,900	1,800.00	10,620,000
T I S	44,200	6,610.00	292,162,000
ネオス	5,300	721.00	3,821,300
電算システム	5,100	2,956.00	15,075,600

グリー	91,900	491.00	45,122,900
コーエーテクモホールディングス	27,200	2,424.00	65,932,800
三菱総合研究所	5,800	3,685.00	21,373,000
電算	1,600	2,077.00	3,323,200
A G S	7,900	704.00	5,561,600
ファインデックス	11,400	962.00	10,966,800
ブレインパッド	2,600	5,700.00	14,820,000
K L a b	25,400	970.00	24,638,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	17,800	1,026.00	18,262,800
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	1,781.00	4,096,300
ネクソン	376,200	1,246.00	468,745,200
アイスタイル	34,400	715.00	24,596,000
エムアップ	4,700	1,933.00	9,085,100
エイチーム	9,400	1,076.00	10,114,400
エニグモ	9,700	972.00	9,428,400
テクノスジャパン	11,600	523.00	6,066,800
コロプラ	43,500	1,399.00	60,856,500
ブロードリーフ	66,100	593.00	39,197,300
クロス・マーケティンググループ	6,700	357.00	2,391,900
デジタルハーツホールディングス	6,300	894.00	5,632,200
システム情報	7,000	907.00	6,349,000
メディアドゥホールディングス	4,800	3,535.00	16,968,000
じげん	19,200	566.00	10,867,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	743.00	1,560,300
サイバーリンクス	2,300	1,137.00	2,615,100
フィックスターズ	14,300	1,504.00	21,507,200
C A R T A H O L D I N G S	6,700	1,154.00	7,731,800
オブティム	5,900	2,706.00	15,965,400
セレス	4,600	1,243.00	5,717,800
ティーガイア	9,500	2,253.00	21,403,500
セック	2,200	3,060.00	6,732,000
日本アジアグループ	14,000	355.00	4,970,000
豆蔵ホールディングス	9,200	1,737.00	15,980,400
テクマトリックス	9,500	2,276.00	21,622,000
プロシップ	4,000	1,280.00	5,120,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32,000	2,291.00	73,312,000
G M O ペイメントゲートウェイ	21,800	7,700.00	167,860,000
ザッパラス	7,600	377.00	2,865,200
システムリサーチ	3,700	1,808.00	6,689,600
インターネットイニシアティブ	21,700	2,538.00	55,074,600
さくらインターネット	16,200	614.00	9,946,800
ヴィンクス	4,000	1,120.00	4,480,000

GMOクラウド	2,600	2,604.00	6,770,400
SRAホールディングス	7,100	2,509.00	17,813,900
Minorityソリューションズ	2,700	1,894.00	5,113,800
システムインテグレータ	4,100	767.00	3,144,700
朝日ネット	11,200	650.00	7,280,000
eBASE	8,200	1,171.00	9,602,200
アバント	4,900	2,100.00	10,290,000
アドソル日進	4,800	2,250.00	10,800,000
フリービット	8,200	912.00	7,478,400
コムチュア	15,000	1,946.00	29,190,000
サイバーコム	2,500	1,918.00	4,795,000
アステリア	9,200	653.00	6,007,600
アイル	2,500	2,347.00	5,867,500
マークラインズ	6,800	1,886.00	12,824,800
メディカル・データ・ビジョン	10,300	1,159.00	11,937,700
ショーケース	3,500	725.00	2,537,500
モバイルファクトリー	3,100	1,499.00	4,646,900
テラスカイ	2,300	1,844.00	4,241,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,000	1,680.00	10,080,000
PCIホールディングス	2,800	2,005.00	5,614,000
パイプドHD	2,200	1,746.00	3,841,200
アイビーシー	2,600	1,133.00	2,945,800
ネオジャパン	2,800	973.00	2,724,400
PR TIMES	1,200	2,609.00	3,130,800
ランドコンピュータ	2,300	1,048.00	2,410,400
ダブルスタンダード	1,200	5,230.00	6,276,000
オープンドア	6,700	1,995.00	13,366,500
マイネット	4,300	534.00	2,296,200
アカツキ	4,700	6,340.00	29,798,000
ベネフィットジャパン	1,200	1,608.00	1,929,600
Ubicomホールディングス	2,600	1,423.00	3,699,800
LINE	30,400	3,925.00	119,320,000
カナミックネットワーク	8,600	590.00	5,074,000
ノムラシステムコーポレーション	3,300	595.00	1,963,500
チェンジ	2,800	1,966.00	5,504,800
シンクロ・フード	6,200	486.00	3,013,200
オークネット	8,300	1,374.00	11,404,200
セグエグループ	1,300	1,386.00	1,801,800
エイトレッド	1,600	1,744.00	2,790,400
AOI TYO Holdings	13,800	632.00	8,721,600
マクロミル	24,000	905.00	21,720,000
ビーグリー	2,900	950.00	2,755,000

オロ	3,600	2,832.00	10,195,200
テモナ	2,300	483.00	1,110,900
ニーズウェル	2,000	699.00	1,398,000
サインポスト	2,200	1,907.00	4,195,400
ソルクシーズ	5,900	948.00	5,593,200
フェイス	5,600	796.00	4,457,600
プロトコーポレーション	12,100	1,139.00	13,781,900
ハイマックス	1,700	1,831.00	3,112,700
野村総合研究所	252,800	2,295.00	580,176,000
サイバネットシステム	9,800	688.00	6,742,400
C Eホールディングス	8,300	415.00	3,444,500
日本システム技術	2,300	1,221.00	2,808,300
インタージホールディングス	16,800	948.00	15,926,400
東邦システムサイエンス	4,200	1,000.00	4,200,000
ソースネクスト	51,900	484.00	25,119,600
インフォコム	14,600	2,378.00	34,718,800
ラクスル	7,100	3,155.00	22,400,500
F I G	15,200	314.00	4,772,800
システムサポート	1,300	1,323.00	1,719,900
アルテリア・ネットワークス	14,900	1,450.00	21,605,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,200	1,656.00	5,299,200
フォーカスシステムズ	9,200	879.00	8,086,800
クレスコ	4,100	3,370.00	13,817,000
フジ・メディア・ホールディングス	137,600	1,399.00	192,502,400
オービック	45,900	12,300.00	564,570,000
ジャストシステム	18,900	4,275.00	80,797,500
T D Cソフト	11,900	851.00	10,126,900
Zホールディングス	864,300	333.00	287,811,900
トレンドマイクロ	58,900	5,310.00	312,759,000
I Dホールディングス	5,300	1,244.00	6,593,200
日本オラクル	26,900	8,950.00	240,755,000
アルファシステムズ	4,200	2,792.00	11,726,400
フューチャー	16,100	1,932.00	31,105,200
C A C Holdings	8,800	1,324.00	11,651,200
S Bテクノロジー	5,800	1,926.00	11,170,800
トーセ	3,900	841.00	3,279,900
オービックビジネスコンサルタント	13,600	4,340.00	59,024,000
伊藤忠テクノソリューションズ	60,400	2,868.00	173,227,200
アイティフォー	16,400	867.00	14,218,800
東計電算	2,000	3,270.00	6,540,000
エクスネット	2,700	975.00	2,632,500
大塚商会	71,700	4,025.00	288,592,500

サイボウズ	15,700	1,067.00	16,751,900
ソフトブレーン	8,200	727.00	5,961,400
電通国際情報サービス	8,300	3,515.00	29,174,500
デジタルガレージ	25,900	3,465.00	89,743,500
E Mシステムズ	10,900	1,775.00	19,347,500
ウェザーニューズ	4,500	3,355.00	15,097,500
C I J	10,200	833.00	8,496,600
ビジネスエンジニアリング	1,400	2,923.00	4,092,200
日本エンタープライズ	14,700	227.00	3,336,900
WOWOW	6,500	2,581.00	16,776,500
スカラ	9,700	953.00	9,244,100
インテリジェント ウェイブ	5,300	745.00	3,948,500
I M A G I C A G R O U P	11,700	553.00	6,470,100
ネットワンシステムズ	46,900	2,918.00	136,854,200
システムソフト	34,000	107.00	3,638,000
アルゴグラフィックス	11,400	2,564.00	29,229,600
マーベラス	20,600	788.00	16,232,800
エイベックス	22,900	1,291.00	29,563,900
日本ユニシス	41,400	3,465.00	143,451,000
兼松エレクトロニクス	7,300	3,180.00	23,214,000
東京放送ホールディングス	88,000	1,703.00	149,864,000
日本テレビホールディングス	121,800	1,403.00	170,885,400
朝日放送グループホールディングス	13,500	727.00	9,814,500
テレビ朝日ホールディングス	36,500	1,689.00	61,648,500
スカパーJ S A Tホールディングス	87,800	446.00	39,158,800
テレビ東京ホールディングス	11,000	2,206.00	24,266,000
日本BS放送	4,700	1,080.00	5,076,000
ビジョン	12,500	1,689.00	21,112,500
スマートバリュー	4,200	747.00	3,137,400
ワイヤレスゲート	6,600	726.00	4,791,600
コネクシオ	9,600	1,396.00	13,401,600
クロップス	2,900	627.00	1,818,300
日本電信電話	905,800	5,329.00	4,827,008,200
K D D I	1,085,700	2,982.50	3,238,100,250
ソフトバンク	1,404,200	1,481.00	2,079,620,200
光通信	15,600	23,320.00	363,792,000
N T T ドコモ	838,600	2,870.00	2,406,782,000
エムティーアイ	13,200	732.00	9,662,400
G M O インターネット	52,400	1,800.00	94,320,000
ファイバーゲート	2,700	1,470.00	3,969,000
アイドママーケティングコミュニケーション	3,300	654.00	2,158,200
K A D O K A W A	38,800	1,498.00	58,122,400

学研ホールディングス	4,500	5,720.00	25,740,000	
ゼンリン	26,600	1,833.00	48,757,800	
昭文社	6,800	395.00	2,686,000	
インプレスホールディングス	11,000	150.00	1,650,000	
アイネット	7,700	1,370.00	10,549,000	
松竹	8,800	16,070.00	141,416,000	
東宝	87,200	4,565.00	398,068,000	
東映	5,600	15,060.00	84,336,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	352,800	1,433.00	505,562,400	
ピー・シー・エー	1,800	3,765.00	6,777,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,575.00	6,180,000	
D T S	29,700	2,307.00	68,517,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,700	4,965.00	306,340,500	
シーイーシー	14,300	1,976.00	28,256,800	
カプコン	56,900	2,789.00	158,694,100	
アイ・エス・ビー	2,700	1,603.00	4,328,100	
ジャステック	8,700	1,098.00	9,552,600	
S C S K	35,000	5,090.00	178,150,000	
日本システムウエア	4,500	2,345.00	10,552,500	
アイネス	17,000	1,154.00	19,618,000	
T K C	11,300	4,510.00	50,963,000	
富士ソフト	17,000	4,550.00	77,350,000	
N S D	21,800	3,115.00	67,907,000	
コナミホールディングス	54,200	4,910.00	266,122,000	
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,682.00	11,800,800	
J B C Cホールディングス	10,600	1,514.00	16,048,400	
ミロク情報サービス	13,200	2,880.00	38,016,000	
ソフトバンクグループ	1,050,800	4,298.00	4,516,338,400	
ハウスイ	1,100	844.00	928,400	
高千穂交易	5,100	1,121.00	5,717,100	
伊藤忠食品	3,300	4,945.00	16,318,500	
エレマテック	12,400	1,061.00	13,156,400	
J A L U X	3,800	2,470.00	9,386,000	
あらた	9,800	4,020.00	39,396,000	
トーメンデバイス	2,000	2,320.00	4,640,000	
東京エレクトロン デバイス	4,800	2,078.00	9,974,400	
フィールズ	11,600	529.00	6,136,400	
双日	734,100	336.00	246,657,600	
アルフレッサ ホールディングス	147,700	2,377.00	351,082,900	
横浜冷凍	37,300	1,087.00	40,545,100	
ラサ商事	7,100	850.00	6,035,000	
ラクーンホールディングス	6,400	704.00	4,505,600	

アルコニックス	14,100	1,349.00	19,020,900
神戸物産	22,900	5,980.00	136,942,000
あい ホールディングス	19,000	1,874.00	35,606,000
ディーブイエックス	5,200	873.00	4,539,600
ダイワボウホールディングス	12,100	4,765.00	57,656,500
マクニカ・富士エレホールディングス	36,900	1,547.00	57,084,300
ラクト・ジャパン	5,000	3,735.00	18,675,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,000	1,064.00	26,600,000
八洲電機	10,300	862.00	8,878,600
メディアスホールディングス	7,600	746.00	5,669,600
レスターホールディングス	14,600	1,840.00	26,864,000
ジューテックホールディングス	3,100	1,305.00	4,045,500
大光	5,700	671.00	3,824,700
OCHIホールディングス	3,900	1,334.00	5,202,600
TOKAIホールディングス	70,300	1,049.00	73,744,700
黒谷	3,100	452.00	1,401,200
Cominix	2,300	862.00	1,982,600
三洋貿易	6,700	2,173.00	14,559,100
ビューティガレージ	2,200	1,662.00	3,656,400
ウイン・パートナーズ	8,700	1,365.00	11,875,500
ミタチ産業	4,000	715.00	2,860,000
シップヘルスケアホールディングス	27,700	4,530.00	125,481,000
明治電機工業	4,200	1,372.00	5,762,400
デリカフーズホールディングス	4,700	695.00	3,266,500
スターティアホールディングス	2,600	570.00	1,482,000
コメダホールディングス	30,900	2,088.00	64,519,200
富士興産	5,200	671.00	3,489,200
協栄産業	1,600	1,431.00	2,289,600
小野建	11,900	1,392.00	16,564,800
南陽	2,700	1,619.00	4,371,300
佐島電機	9,800	866.00	8,486,800
エコートレーディング	3,100	531.00	1,646,100
伯東	9,100	1,267.00	11,529,700
コンドーテック	10,300	971.00	10,001,300
中山福	7,700	540.00	4,158,000
ナガイレーベン	19,200	2,514.00	48,268,800
三菱食品	14,600	2,766.00	40,383,600
松田産業	9,700	1,484.00	14,394,800
第一興商	19,800	5,060.00	100,188,000
メディバルホールディングス	143,500	2,384.00	342,104,000
SPK	2,900	2,590.00	7,511,000
萩原電気ホールディングス	4,900	2,778.00	13,612,200

アズワン	9,500	8,770.00	83,315,000
スズデン	4,600	1,347.00	6,196,200
尾家産業	4,300	1,301.00	5,594,300
シモジマ	8,200	1,175.00	9,635,000
ドウシシャ	12,500	1,720.00	21,500,000
小津産業	2,900	1,832.00	5,312,800
高速	7,900	1,315.00	10,388,500
たけびし	4,700	1,392.00	6,542,400
リックス	3,000	1,579.00	4,737,000
丸文	11,800	610.00	7,198,000
ハピネット	11,100	1,321.00	14,663,100
橋本総業ホールディングス	2,700	1,699.00	4,587,300
日本ライフライン	39,400	1,729.00	68,122,600
タカショー	6,500	471.00	3,061,500
エクセル	4,900	1,212.00	5,938,800
マルカ	4,700	2,202.00	10,349,400
I D O M	44,900	520.00	23,348,000
進和	7,900	2,341.00	18,493,900
エスケイジャパン	3,300	432.00	1,425,600
ダイトロン	5,600	1,451.00	8,125,600
シークス	16,900	1,611.00	27,225,900
田中商事	4,500	655.00	2,947,500
オーハシテクニカ	7,500	1,425.00	10,687,500
白銅	4,300	1,344.00	5,779,200
伊藤忠商事	929,700	2,276.00	2,115,997,200
丸紅	1,310,700	741.70	972,146,190
高島	2,100	1,714.00	3,599,400
長瀬産業	74,800	1,590.00	118,932,000
蝶理	8,500	1,688.00	14,348,000
豊田通商	148,400	3,625.00	537,950,000
三共生興	22,700	528.00	11,985,600
兼松	53,100	1,259.00	66,852,900
ツカモトコーポレーション	2,400	1,044.00	2,505,600
三井物産	1,095,100	1,792.50	1,962,966,750
日本紙パルプ商事	7,600	3,910.00	29,716,000
日立ハイテクノロジーズ	40,400	6,520.00	263,408,000
カメイ	17,400	1,211.00	21,071,400
東都水産	1,900	2,649.00	5,033,100
O U Gホールディングス	2,100	2,775.00	5,827,500
スターゼン	4,900	4,595.00	22,515,500
山善	51,900	968.00	50,239,200
椿本興業	3,000	3,895.00	11,685,000

住友商事	786,100	1,710.50	1,344,624,050
内田洋行	5,700	4,320.00	24,624,000
三菱商事	932,700	2,703.50	2,521,554,450
第一実業	6,000	3,300.00	19,800,000
キャノンマーケティングジャパン	38,000	2,325.00	88,350,000
西華産業	7,500	1,356.00	10,170,000
佐藤商事	11,900	842.00	10,019,800
菱洋エレクトロ	13,500	1,914.00	25,839,000
東京産業	13,300	570.00	7,581,000
ユアサ商事	13,600	3,250.00	44,200,000
神鋼商事	3,000	2,417.00	7,251,000
小林産業	8,000	315.00	2,520,000
阪和興業	23,100	3,080.00	71,148,000
正栄食品工業	8,600	3,335.00	28,681,000
カナデン	12,000	1,270.00	15,240,000
菱電商事	10,500	1,551.00	16,285,500
フルサト工業	7,300	1,617.00	11,804,100
岩谷産業	29,500	3,735.00	110,182,500
すてきナイスグループ	5,700	920.00	5,244,000
昭光通商	4,300	638.00	2,743,400
ニチモウ	2,100	1,862.00	3,910,200
極東貿易	4,100	1,827.00	7,490,700
イワキ	17,500	456.00	7,980,000
三愛石油	35,700	1,062.00	37,913,400
稲畑産業	32,000	1,369.00	43,808,000
G S Iクレオス	3,600	1,071.00	3,855,600
明和産業	12,300	533.00	6,555,900
クワザワ	4,800	559.00	2,683,200
ワキタ	28,400	1,069.00	30,359,600
東邦ホールディングス	39,400	2,485.00	97,909,000
サンゲツ	39,100	2,014.00	78,747,400
ミツウロコグループホールディングス	17,700	1,124.00	19,894,800
シナネンホールディングス	5,500	1,869.00	10,279,500
伊藤忠エネクス	29,400	860.00	25,284,000
サンリオ	41,100	2,130.00	87,543,000
サンワテクノス	8,100	899.00	7,281,900
リョーサン	14,700	2,816.00	41,395,200
新光商事	25,000	929.00	23,225,000
トーホー	6,000	1,746.00	10,476,000
三信電気	9,200	1,620.00	14,904,000
東陽テクニカ	15,300	1,089.00	16,661,700
モスフードサービス	17,400	2,686.00	46,736,400

加賀電子	13,200	2,090.00	27,588,000
ソーダニッカ	13,800	603.00	8,321,400
立花エレテック	9,800	1,775.00	17,395,000
フォーバル	5,800	996.00	5,776,800
PALTA C	24,000	5,140.00	123,360,000
三谷産業	15,600	309.00	4,820,400
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,515.00	8,436,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,362.00	1,498,200
国際紙パルプ商事	31,100	311.00	9,672,100
ヤマタネ	6,700	1,377.00	9,225,900
丸紅建材リース	1,300	1,759.00	2,286,700
日鉄物産	9,500	4,465.00	42,417,500
泉州電業	4,100	2,850.00	11,685,000
トラスコ中山	27,700	2,695.00	74,651,500
オートボックスセブン	52,800	1,754.00	92,611,200
モリト	9,700	795.00	7,711,500
加藤産業	20,800	3,465.00	72,072,000
北恵	2,500	1,031.00	2,577,500
イノテック	7,900	970.00	7,663,000
イエローハット	25,100	1,639.00	41,138,900
J Kホールディングス	12,100	539.00	6,521,900
日伝	11,000	2,064.00	22,704,000
北沢産業	10,100	273.00	2,757,300
杉本商事	7,200	1,959.00	14,104,800
因幡電機産業	18,900	4,825.00	91,192,500
東テク	4,400	2,115.00	9,306,000
ミスミグループ本社	166,500	2,495.00	415,417,500
アルテック	10,700	242.00	2,589,400
タキヒヨー	4,000	1,843.00	7,372,000
蔵王産業	2,200	1,440.00	3,168,000
スズケン	60,600	5,730.00	347,238,000
ジェコス	9,200	909.00	8,362,800
グローセル	12,300	428.00	5,264,400
ローソン	33,600	6,060.00	203,616,000
サンエー	10,100	5,020.00	50,702,000
カワチ薬品	10,400	2,144.00	22,297,600
エービーシー・マート	20,800	7,430.00	154,544,000
ハードオフコーポレーション	5,500	804.00	4,422,000
アスクル	13,900	2,863.00	39,795,700
ゲオホールディングス	20,400	1,348.00	27,499,200
アダストリア	18,500	2,608.00	48,248,000
ジーフット	8,300	617.00	5,121,100

くら寿司	7,000	4,490.00	31,430,000
キャンドウ	6,400	1,605.00	10,272,000
パルグループホールディングス	6,800	3,570.00	24,276,000
エディオン	56,500	1,063.00	60,059,500
サーラコーポレーション	27,200	624.00	16,972,800
ワッツ	6,100	610.00	3,721,000
ハローズ	5,100	2,510.00	12,801,000
フジオフードシステム	5,600	2,992.00	16,755,200
あみやき亭	2,900	3,405.00	9,874,500
ひらまつ	27,000	321.00	8,667,000
大黒天物産	3,200	3,435.00	10,992,000
ハニーズホールディングス	11,800	1,330.00	15,694,000
ファーマライズホールディングス	3,300	644.00	2,125,200
アルペン	10,300	1,720.00	17,716,000
ハブ	4,400	1,039.00	4,571,600
クオールホールディングス	19,700	1,488.00	29,313,600
ジinzホールディングス	7,100	6,280.00	44,588,000
ビックカメラ	79,000	1,152.00	91,008,000
D C Mホールディングス	71,800	1,066.00	76,538,800
ペッパーフードサービス	10,700	1,617.00	17,301,900
MonotaRO	94,500	2,975.00	281,137,500
東京一番フーズ	3,600	610.00	2,196,000
D Dホールディングス	5,900	1,617.00	9,540,300
きちりホールディングス	3,700	800.00	2,960,000
アークランドサービスホールディングス	9,800	1,900.00	18,620,000
J . フロント リテイリング	170,200	1,380.00	234,876,000
ドトール・日レスホールディングス	23,400	2,198.00	51,433,200
マツモトキヨシホールディングス	55,000	3,935.00	216,425,000
ブロンコビリー	7,000	2,536.00	17,752,000
Z O Z O	141,300	2,522.00	356,358,600
トレジャー・ファクトリー	4,000	1,147.00	4,588,000
物語コーポレーション	3,300	9,480.00	31,284,000
ココカラファイン	15,000	5,950.00	89,250,000
三越伊勢丹ホールディングス	249,000	875.00	217,875,000
H a m e e	4,200	1,099.00	4,615,800
ウエルシアホールディングス	35,200	6,320.00	222,464,000
クリエイトSDホールディングス	19,700	2,731.00	53,800,700
丸善C H Iホールディングス	15,500	367.00	5,688,500
ティーライフ	2,000	836.00	1,672,000
エー・ピーカンパニー	2,800	549.00	1,537,200
チムニー	4,100	2,388.00	9,790,800
シュッピン	9,200	1,076.00	9,899,200

ネクステージ	19,100	1,160.00	22,156,000
ジョイフル本田	39,000	1,387.00	54,093,000
鳥貴族	4,500	2,080.00	9,360,000
キリン堂ホールディングス	5,300	2,151.00	11,400,300
ホットランド	9,000	1,184.00	10,656,000
すかいらーくホールディングス	149,000	1,923.00	286,527,000
SFPホールディングス	5,700	2,150.00	12,255,000
綿半ホールディングス	5,000	1,993.00	9,965,000
ヨシックス	2,200	3,015.00	6,633,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,800	964.00	37,403,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,400	657.00	4,204,800
B E E N O S	4,800	1,272.00	6,105,600
あさひ	11,100	1,205.00	13,375,500
日本調剤	4,700	3,850.00	18,095,000
コスモス薬品	5,900	22,490.00	132,691,000
トーエル	6,600	810.00	5,346,000
オンリー	2,400	786.00	1,886,400
セブン&アイ・ホールディングス	557,200	4,299.00	2,395,402,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,800	1,865.00	66,767,000
ツルハホールディングス	28,900	12,370.00	357,493,000
サンマルクホールディングス	10,600	2,385.00	25,281,000
フェリシモ	3,100	1,048.00	3,248,800
トリドールホールディングス	16,500	2,341.00	38,626,500
T O K Y O B A S E	12,200	720.00	8,784,000
ウイルプラスホールディングス	2,200	769.00	1,691,800
ジャパンミート	6,800	2,208.00	15,014,400
サツドラホールディングス	2,100	1,750.00	3,675,000
デファクトスタンダード	1,600	327.00	523,200
アレンザホールディングス	7,300	800.00	5,840,000
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,420.00	5,082,000
パロックジャパンリミテッド	10,900	922.00	10,049,800
クスリのアオキホールディングス	13,200	7,600.00	100,320,000
力の源ホールディングス	5,200	820.00	4,264,000
スシローグローバルホールディングス	14,600	7,380.00	107,748,000
L I X I L ビバ	11,300	1,728.00	19,526,400
メディカルシステムネットワーク	14,400	531.00	7,646,400
はるやまホールディングス	6,400	817.00	5,228,800
ノジマ	23,700	1,870.00	44,319,000
カップ・クリエイト	18,600	1,388.00	25,816,800
ライトオン	9,900	587.00	5,811,300
良品計画	188,300	2,327.00	438,174,100

三城ホールディングス	17,000	280.00	4,760,000
アドヴァン	20,400	1,133.00	23,113,200
アルビス	5,100	2,434.00	12,413,400
コナカ	16,000	409.00	6,544,000
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,665.00	2,830,500
G - 7ホールディングス	4,000	3,610.00	14,440,000
イオン北海道	13,600	771.00	10,485,600
コジマ	23,200	434.00	10,068,800
ヒマラヤ	4,800	820.00	3,936,000
コーナン商事	17,500	2,512.00	43,960,000
エコス	5,000	1,713.00	8,565,000
ワタミ	17,600	1,417.00	24,939,200
マルシェ	3,700	773.00	2,860,100
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	318,500	1,695.00	539,857,500
西松屋チェーン	29,300	953.00	27,922,900
ゼンショーホールディングス	64,700	2,283.00	147,710,100
幸楽苑ホールディングス	8,500	2,122.00	18,037,000
ハークスレイ	2,900	1,033.00	2,995,700
サイゼリヤ	22,000	2,569.00	56,518,000
V Tホールディングス	60,400	467.00	28,206,800
魚力	3,800	1,500.00	5,700,000
フジ・コーポレーション	3,600	2,096.00	7,545,600
ユナイテッドアローズ	15,200	3,320.00	50,464,000
ハイデイ日高	19,300	2,086.00	40,259,800
京都きもの友禅	8,900	350.00	3,115,000
コロワイド	44,200	2,082.00	92,024,400
ピーシーデポコーポレーション	18,000	482.00	8,676,000
壱番屋	9,400	5,110.00	48,034,000
P L A N T	3,600	707.00	2,545,200
スギホールディングス	29,200	6,210.00	181,332,000
薬王堂ホールディングス	5,800	2,693.00	15,619,400
スクロール	20,900	337.00	7,043,300
ヨンドシーホールディングス	14,800	2,610.00	38,628,000
ファミリーマート	148,700	2,826.00	420,226,200
木曽路	16,300	2,721.00	44,352,300
S R Sホールディングス	15,800	1,044.00	16,495,200
タカキュー	11,100	187.00	2,075,700
ケーヨー	24,900	520.00	12,948,000
上新電機	15,700	2,242.00	35,199,400
日本瓦斯	21,100	3,240.00	68,364,000
ロイヤルホールディングス	23,300	2,701.00	62,933,300
いなげや	14,900	1,527.00	22,752,300

島忠	28,100	2,882.00	80,984,200
チヨダ	14,000	1,636.00	22,904,000
ライフコーポレーション	10,200	2,496.00	25,459,200
リンガーハット	16,400	2,420.00	39,688,000
MrMaxHD	18,600	477.00	8,872,200
テンアライド	12,300	430.00	5,289,000
AOKIホールディングス	26,700	1,098.00	29,316,600
オークワ	19,100	1,361.00	25,995,100
コメリ	20,600	2,276.00	46,885,600
青山商事	23,300	1,915.00	44,619,500
しまむら	15,500	9,200.00	142,600,000
はせがわ	7,400	401.00	2,967,400
高島屋	104,400	1,232.00	128,620,800
松屋	27,000	887.00	23,949,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,300	1,235.00	84,350,500
近鉄百貨店	5,100	3,335.00	17,008,500
パルコ	12,900	1,299.00	16,757,100
丸井グループ	112,500	2,416.00	271,800,000
アクシアル リテイリング	11,100	4,145.00	46,009,500
イオン	511,500	2,168.50	1,109,187,750
イズミ	27,100	4,245.00	115,039,500
平和堂	27,100	2,054.00	55,663,400
フジ	16,100	1,965.00	31,636,500
ヤオコー	15,100	5,020.00	75,802,000
ゼビオホールディングス	16,200	1,217.00	19,715,400
ケーズホールディングス	138,200	1,219.00	168,465,800
Olympicグループ	8,100	589.00	4,770,900
日産東京販売ホールディングス	20,000	298.00	5,960,000
Genky DrugStores	6,500	2,357.00	15,320,500
総合メディカルホールディングス	11,700	1,707.00	19,971,900
ブックオフグループホールディングス	6,900	1,138.00	7,852,200
アインホールディングス	17,800	6,140.00	109,292,000
元気寿司	3,800	2,668.00	10,138,400
ヤマダ電機	405,300	506.00	205,081,800
アークランドサカモト	22,700	1,261.00	28,624,700
ニトリホールディングス	57,600	16,090.00	926,784,000
グルメ杵屋	9,600	1,172.00	11,251,200
愛眼	10,600	244.00	2,586,400
ケーユーホールディングス	7,100	848.00	6,020,800
吉野家ホールディングス	46,500	2,610.00	121,365,000
松屋フーズホールディングス	6,400	3,910.00	25,024,000
サガミホールディングス	17,900	1,375.00	24,612,500

関西スーパーマーケット	10,200	1,092.00	11,138,400
王将フードサービス	9,800	6,660.00	65,268,000
プレナス	15,000	1,823.00	27,345,000
ミニストップ	10,000	1,469.00	14,690,000
アークス	25,000	2,288.00	57,200,000
パローホールディングス	28,800	1,852.00	53,337,600
ベルク	6,600	5,140.00	33,924,000
大庄	7,200	1,594.00	11,476,800
ファーストリテイリング	17,800	69,270.00	1,233,006,000
サンドラッグ	50,000	3,530.00	176,500,000
サックスパー ホールディングス	11,400	905.00	10,317,000
ヤマザワ	2,800	1,708.00	4,782,400
やまや	2,300	2,200.00	5,060,000
ベルーナ	32,800	691.00	22,664,800
島根銀行	4,200	672.00	2,822,400
じもとホールディングス	89,900	99.00	8,900,100
めぶきフィナンシャルグループ	695,200	266.00	184,923,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,600	1,420.00	26,412,000
九州フィナンシャルグループ	220,500	443.00	97,681,500
ゆうちょ銀行	378,000	1,057.00	399,546,000
富山第一銀行	34,700	315.00	10,930,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	837,300	422.00	353,340,600
西日本フィナンシャルホールディングス	85,000	781.00	66,385,000
関西みらいフィナンシャルグループ	63,800	692.00	44,149,600
三十三フィナンシャルグループ	12,100	1,714.00	20,739,400
第四北越フィナンシャルグループ	23,400	2,738.00	64,069,200
新生銀行	97,700	1,656.00	161,791,200
あおぞら銀行	74,300	2,679.00	199,049,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,162,800	555.30	5,088,102,840
りそなホールディングス	1,460,700	458.70	670,023,090
三井住友トラスト・ホールディングス	261,700	3,870.00	1,012,779,000
三井住友フィナンシャルグループ	938,100	3,759.00	3,526,317,900
千葉銀行	459,500	571.00	262,374,500
群馬銀行	268,900	362.00	97,341,800
武蔵野銀行	20,300	1,863.00	37,818,900
千葉興業銀行	39,600	314.00	12,434,400
筑波銀行	55,300	198.00	10,949,400
七十七銀行	42,300	1,648.00	69,710,400
青森銀行	10,700	2,832.00	30,302,400
秋田銀行	9,000	2,136.00	19,224,000
山形銀行	15,600	1,491.00	23,259,600
岩手銀行	9,700	2,519.00	24,434,300

東邦銀行	119,000	255.00	30,345,000
東北銀行	6,800	1,021.00	6,942,800
みちのく銀行	8,500	1,668.00	14,178,000
ふくおかフィナンシャルグループ	117,700	2,029.00	238,813,300
静岡銀行	330,800	815.00	269,602,000
十六銀行	18,300	2,384.00	43,627,200
八十二銀行	323,300	459.00	148,394,700
山梨中央銀行	16,900	1,056.00	17,846,400
大垣共立銀行	28,400	2,472.00	70,204,800
福井銀行	12,000	1,437.00	17,244,000
北國銀行	14,000	2,969.00	41,566,000
清水銀行	6,000	1,923.00	11,538,000
富山銀行	2,900	2,515.00	7,293,500
滋賀銀行	27,100	2,532.00	68,617,200
南都銀行	21,100	2,543.00	53,657,300
百五銀行	122,600	340.00	41,684,000
京都銀行	47,900	4,180.00	200,222,000
紀陽銀行	47,700	1,669.00	79,611,300
ほくほくフィナンシャルグループ	89,500	1,054.00	94,333,000
広島銀行	198,200	539.00	106,829,800
山陰合同銀行	80,400	654.00	52,581,600
中国銀行	115,500	1,036.00	119,658,000
鳥取銀行	5,200	1,428.00	7,425,600
伊予銀行	178,000	567.00	100,926,000
百十四銀行	14,600	2,170.00	31,682,000
四国銀行	19,800	999.00	19,780,200
阿波銀行	20,800	2,540.00	52,832,000
大分銀行	8,500	2,828.00	24,038,000
宮崎銀行	9,200	2,658.00	24,453,600
佐賀銀行	8,700	1,551.00	13,493,700
沖縄銀行	12,400	3,570.00	44,268,000
琉球銀行	31,500	1,174.00	36,981,000
セブン銀行	447,700	307.00	137,443,900
みずほフィナンシャルグループ	18,086,900	165.30	2,989,764,570
高知銀行	4,800	794.00	3,811,200
山口フィナンシャルグループ	167,400	742.00	124,210,800
長野銀行	4,900	1,671.00	8,187,900
名古屋銀行	11,100	3,165.00	35,131,500
北洋銀行	204,700	234.00	47,899,800
愛知銀行	5,100	3,580.00	18,258,000
中京銀行	5,900	2,116.00	12,484,400
大光銀行	5,100	1,654.00	8,435,400

愛媛銀行	19,400	1,124.00	21,805,600
トマト銀行	6,000	1,063.00	6,378,000
京葉銀行	58,200	654.00	38,062,800
栃木銀行	73,600	202.00	14,867,200
北日本銀行	4,700	1,818.00	8,544,600
東和銀行	23,400	849.00	19,866,600
福島銀行	11,600	214.00	2,482,400
大東銀行	6,400	576.00	3,686,400
トモニホールディングス	105,500	366.00	38,613,000
フィデアホールディングス	129,200	120.00	15,504,000
池田泉州ホールディングス	146,300	188.00	27,504,400
F P G	42,000	1,086.00	45,612,000
マーキュリアインベストメント	6,200	749.00	4,643,800
S B Iホールディングス	158,700	2,343.00	371,834,100
ジャフコ	21,900	4,350.00	95,265,000
大和証券グループ本社	1,068,500	495.30	529,228,050
野村ホールディングス	2,342,500	491.20	1,150,636,000
岡三証券グループ	114,000	385.00	43,890,000
丸三証券	40,000	525.00	21,000,000
東洋証券	48,800	169.00	8,247,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,600	302.00	46,387,200
光世証券	3,500	619.00	2,166,500
水戸証券	39,300	239.00	9,392,700
いちよし証券	27,000	694.00	18,738,000
松井証券	65,400	893.00	58,402,200
だいこう証券ビジネス	5,700	582.00	3,317,400
マネックスグループ	123,600	261.00	32,259,600
極東証券	18,100	818.00	14,805,800
岩井コスモホールディングス	13,800	1,131.00	15,607,800
藍澤證券	24,200	728.00	17,617,600
マネーパートナーズグループ	16,400	253.00	4,149,200
スパークス・グループ	53,500	253.00	13,535,500
かんぽ生命保険	47,100	1,723.00	81,153,300
S O M P Oホールディングス	234,600	4,251.00	997,284,600
アニコム ホールディングス	11,000	4,015.00	44,165,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	348,000	3,428.00	1,192,944,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	109,400	2,293.00	250,854,200
第一生命ホールディングス	753,100	1,754.00	1,320,937,400
東京海上ホールディングス	476,000	5,731.00	2,727,956,000
T & Dホールディングス	411,700	1,186.00	488,276,200
アドバンスクリエイト	3,100	1,850.00	5,735,000
全国保証	37,500	4,390.00	164,625,000

ジェイリース	3,700	315.00	1,165,500
イントラスト	3,700	715.00	2,645,500
日本モーゲージサービス	2,400	1,286.00	3,086,400
C a s a	6,000	1,211.00	7,266,000
アルヒ	12,100	2,353.00	28,471,300
プレミアグループ	7,600	1,864.00	14,166,400
クレディセゾン	93,200	1,514.00	141,104,800
芙蓉総合リース	15,200	7,130.00	108,376,000
みずほリース	25,000	3,015.00	75,375,000
東京センチュリー	26,800	5,050.00	135,340,000
日本証券金融	58,700	513.00	30,113,100
アイフル	203,100	254.00	51,587,400
リコーリース	10,500	3,500.00	36,750,000
イオンフィナンシャルサービス	85,000	1,648.00	140,080,000
アコム	267,500	435.00	116,362,500
ジャックス	14,700	2,418.00	35,544,600
オリエントコーポレーション	360,000	145.00	52,200,000
日立キャピタル	31,400	2,452.00	76,992,800
アプラスフィナンシャル	63,900	93.00	5,942,700
オリックス	888,000	1,652.00	1,466,976,000
三菱UFJリース	300,300	656.00	196,996,800
九州リースサービス	6,500	601.00	3,906,500
日本取引所グループ	359,600	1,773.00	637,570,800
イー・ギャランティ	12,500	1,454.00	18,175,000
アサックス	5,500	615.00	3,382,500
NECキャピタルソリューション	5,400	2,179.00	11,766,600
いちご	171,800	444.00	76,279,200
日本駐車場開発	153,000	163.00	24,939,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,883.00	14,122,500
ヒューリック	285,200	1,151.00	328,265,200
三栄建築設計	6,100	1,539.00	9,387,900
野村不動産ホールディングス	89,200	2,471.00	220,413,200
三重交通グループホールディングス	29,000	581.00	16,849,000
サムティ	19,500	1,979.00	38,590,500
ディア・ライフ	19,400	491.00	9,525,400
コーセーアールイー	5,500	742.00	4,081,000
エー・ディー・ワークス	230,300	31.00	7,139,300
日本商業開発	9,200	1,493.00	13,735,600
プレサンスコーポレーション	21,800	1,763.00	38,433,400
ユニゾホールディングス	20,300	4,960.00	100,688,000
ハウスコム	2,200	1,541.00	3,390,200
日本管理センター	9,600	1,437.00	13,795,200

サンセイランディック	5,200	883.00	4,591,600
エストラスト	1,800	750.00	1,350,000
フージャースホールディングス	28,900	657.00	18,987,300
オープンハウス	39,000	2,880.00	112,320,000
東急不動産ホールディングス	359,600	729.00	262,148,400
飯田グループホールディングス	111,700	1,762.00	196,815,400
イーランド	3,500	719.00	2,516,500
ムゲンエステート	10,900	672.00	7,324,800
ハウズドゥ	7,300	1,840.00	13,432,000
シーアールイー	4,400	1,045.00	4,598,000
ケイアイスター不動産	4,200	1,923.00	8,076,600
グッドコムアセット	3,700	1,800.00	6,660,000
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,860.00	7,776,000
テンポイノベーション	2,200	1,668.00	3,669,600
パーク24	71,900	2,614.00	187,946,600
パラカ	4,000	2,028.00	8,112,000
三井不動産	706,600	2,725.50	1,925,838,300
三菱地所	933,100	2,111.50	1,970,240,650
平和不動産	24,900	2,684.00	66,831,600
東京建物	146,200	1,520.00	222,224,000
ダイビル	40,100	1,204.00	48,280,400
京阪神ビルディング	24,100	1,332.00	32,101,200
住友不動産	299,500	4,069.00	1,218,665,500
テーオーシー	31,900	824.00	26,285,600
東京楽天地	2,100	5,930.00	12,453,000
スターツコーポレーション	18,500	2,753.00	50,930,500
フジ住宅	18,700	669.00	12,510,300
空港施設	17,700	538.00	9,522,600
明和地所	9,400	552.00	5,188,800
ゴールドクレスト	11,000	2,257.00	24,827,000
エスリード	5,900	1,754.00	10,348,600
日神不動産	22,000	488.00	10,736,000
日本エスコン	25,400	904.00	22,961,600
タカラレーベン	63,500	436.00	27,686,000
サンヨーハウジング名古屋	8,700	937.00	8,151,900
イオンモール	67,400	1,745.00	117,613,000
毎日コムネット	4,300	806.00	3,465,800
ファースト住建	6,500	1,351.00	8,781,500
カチタス	15,100	4,510.00	68,101,000
トーセイ	19,100	1,369.00	26,147,900
穴吹興産	1,900	2,820.00	5,358,000
サンフロンティア不動産	19,300	1,320.00	25,476,000

エフ・ジェー・ネクスト	12,700	1,092.00	13,868,400
インテリックス	5,300	752.00	3,985,600
ランドビジネス	5,600	763.00	4,272,800
日本社宅サービス	4,500	1,028.00	4,626,000
グランディハウス	14,000	482.00	6,748,000
日本空港ビルデング	42,700	5,290.00	225,883,000
日本工営	8,700	3,280.00	28,536,000
L I F U L L	45,200	665.00	30,058,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,012.00	17,504,400
日本M&Aセンター	97,400	3,005.00	292,687,000
メンバーズ	4,400	1,844.00	8,113,600
中広	1,600	554.00	886,400
アイティメディア	2,800	760.00	2,128,000
タケエイ	13,500	1,043.00	14,080,500
E・Jホールディングス	1,700	1,383.00	2,351,100
トラスト・テック	14,300	1,319.00	18,861,700
コシダカホールディングス	31,100	1,686.00	52,434,600
アルトナー	3,300	734.00	2,422,200
パソナグループ	15,800	1,455.00	22,989,000
C D S	3,300	1,362.00	4,494,600
リンクアンドモチベーション	28,700	580.00	16,646,000
G C A	15,400	840.00	12,936,000
エス・エム・エス	47,500	2,719.00	129,152,500
サニーサイドアップ	3,000	983.00	2,949,000
パーソルホールディングス	129,000	2,044.00	263,676,000
リニカル	7,400	961.00	7,111,400
クックパッド	45,500	308.00	14,014,000
エスクリ	3,700	851.00	3,148,700
アイ・ケイ・ケイ	6,500	692.00	4,498,000
学情	4,700	1,513.00	7,111,100
スタジオアリス	6,600	1,881.00	12,414,600
シミックホールディングス	7,200	1,740.00	12,528,000
エプコ	2,200	1,352.00	2,974,400
N J S	2,900	1,657.00	4,805,300
総合警備保障	51,300	5,600.00	287,280,000
カカクコム	96,600	2,442.00	235,897,200
アイロムグループ	5,000	1,534.00	7,670,000
セントケア・ホールディング	9,700	499.00	4,840,300
サイネックス	2,400	647.00	1,552,800
ルネサンス	7,300	1,662.00	12,132,600
ディップ	20,800	2,864.00	59,571,200
オプトホールディング	7,100	1,563.00	11,097,300

ツクイ	30,700	430.00	13,201,000
キャリアデザインセンター	3,400	1,379.00	4,688,600
ベネフィット・ワン	35,400	2,088.00	73,915,200
エムスリー	271,600	2,675.00	726,530,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,500	603.00	5,125,500
プラス	1,700	649.00	1,103,300
アウトソーシング	73,900	1,093.00	80,772,700
ウェルネット	12,400	721.00	8,940,400
ワールドホールディングス	4,400	1,733.00	7,625,200
ディー・エヌ・エー	69,600	1,895.00	131,892,000
博報堂D Yホールディングス	179,400	1,581.00	283,631,400
ぐるなび	18,600	737.00	13,708,200
タカミヤ	13,900	678.00	9,424,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	1,039.00	9,039,300
ファンコミュニケーションズ	35,800	518.00	18,544,400
ライク	5,200	1,804.00	9,380,800
ビジネス・ブレークスルー	5,800	362.00	2,099,600
エスプール	25,100	611.00	15,336,100
WDBホールディングス	5,900	2,724.00	16,071,600
ティア	7,800	598.00	4,664,400
C D G	1,300	1,377.00	1,790,100
バリューコマース	7,300	1,618.00	11,811,400
インフォマート	70,800	1,480.00	104,784,000
J Pホールディングス	37,400	297.00	11,107,800
エコナックホールディングス	24,600	126.00	3,099,600
E P Sホールディングス	19,500	1,281.00	24,979,500
レッグス	3,300	1,694.00	5,590,200
プレステージ・インターナショナル	48,400	925.00	44,770,000
アミューズ	7,900	2,848.00	22,499,200
ドリームインキュベータ	4,000	1,626.00	6,504,000
クイック	8,100	1,448.00	11,728,800
T A C	7,800	197.00	1,536,600
ケネディクス	123,000	588.00	72,324,000
電通	133,000	3,775.00	502,075,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	1,237.00	6,308,700
ぴあ	3,700	4,620.00	17,094,000
イオンファンタジー	4,200	3,105.00	13,041,000
シーティーエス	14,800	780.00	11,544,000
ネクシィーズグループ	4,600	2,048.00	9,420,800
みらかホールディングス	36,100	2,539.00	91,657,900
アルプス技研	11,500	1,565.00	17,997,500
ダイオーズ	3,100	1,375.00	4,262,500

日本空調サービス	14,900	709.00	10,564,100
オリエンタルランド	152,400	16,690.00	2,543,556,000
ダスキン	33,200	2,860.00	94,952,000
明光ネットワークジャパン	15,300	974.00	14,902,200
ファルコホールディングス	7,200	1,634.00	11,764,800
ラウンドワン	40,100	1,399.00	56,099,900
リゾートトラスト	54,700	1,752.00	95,834,400
ビー・エム・エル	16,700	3,145.00	52,521,500
ワタベウェディング	2,400	568.00	1,363,200
りらいあコミュニケーションズ	23,400	1,400.00	32,760,000
リソー教育	65,800	424.00	27,899,200
早稲田アカデミー	3,900	895.00	3,490,500
ユー・エス・エス	157,600	2,003.00	315,672,800
東京個別指導学院	4,700	897.00	4,215,900
サイバーエージェント	74,200	4,055.00	300,881,000
楽天	601,200	1,064.00	639,676,800
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,148.00	8,839,600
テー・オー・ダブリュー	11,500	761.00	8,751,500
山田コンサルティンググループ	6,300	1,794.00	11,302,200
セントラルスポーツ	4,900	3,200.00	15,680,000
フルキャストホールディングス	13,000	2,262.00	29,406,000
エン・ジャパン	18,800	4,350.00	81,780,000
リソルホールディングス	1,400	3,985.00	5,579,000
テクノプロ・ホールディングス	25,900	6,640.00	171,976,000
アトラ	3,400	359.00	1,220,600
インターワークス	2,800	510.00	1,428,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,300	3,815.00	20,219,500
K e e P e r 技研	4,800	1,468.00	7,046,400
ファーストロジック	3,200	621.00	1,987,200
三機サービス	2,900	952.00	2,760,800
G u n o s y	9,100	1,685.00	15,333,500
デザインワン・ジャパン	3,000	322.00	966,000
イー・ガーディアン	6,600	1,668.00	11,008,800
リブセンス	8,900	300.00	2,670,000
ジャパンマテリアル	35,400	1,517.00	53,701,800
ベクトル	16,200	1,026.00	16,621,200
ウチヤマホールディングス	6,700	505.00	3,383,500
チャーム・ケア・コーポレーション	4,200	2,261.00	9,496,200
ライクキッズ	3,300	898.00	2,963,400
キャリアリンク	5,000	597.00	2,985,000
I B J	8,900	971.00	8,641,900
アサンテ	5,300	2,029.00	10,753,700

N・フィールド	9,100	624.00	5,678,400
バリューHR	2,600	3,250.00	8,450,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,600	7,160.00	32,936,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,500	1,361.00	7,485,500
E R Iホールディングス	3,800	786.00	2,986,800
アシスト	2,100	2,617.00	5,495,700
シグマクシス	6,300	1,472.00	9,273,600
ウィルグループ	8,600	992.00	8,531,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,500	218.00	4,033,000
リクルートホールディングス	923,800	3,532.00	3,262,861,600
エラン	7,700	1,674.00	12,889,800
土木管理総合試験所	6,000	454.00	2,724,000
ネットマーケティング	4,800	845.00	4,056,000
日本郵政	1,057,100	994.00	1,050,757,400
ベルシステム24ホールディングス	21,700	1,734.00	37,627,800
鎌倉新書	9,700	1,470.00	14,259,000
S MN	1,800	750.00	1,350,000
一蔵	1,600	679.00	1,086,400
L I T A L I C O	3,000	2,137.00	6,411,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	827.00	1,736,700
エボラブルアジア	5,800	1,904.00	11,043,200
アトラエ	3,400	3,040.00	10,336,000
ストライク	4,900	3,620.00	17,738,000
ソラスト	31,700	1,189.00	37,691,300
セラク	4,300	722.00	3,104,600
インソース	6,300	2,663.00	16,776,900
ベikalレント・コンサルティング	9,100	5,260.00	47,866,000
Orchestra Holdings	2,700	1,101.00	2,972,700
アイモバイル	4,400	521.00	2,292,400
キャリアインデックス	4,800	545.00	2,616,000
MS - J a p a n	5,300	1,308.00	6,932,400
船場	2,300	955.00	2,196,500
グレイステクノロジー	4,700	2,900.00	13,630,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,200	2,833.00	28,896,600
フルテック	1,900	1,277.00	2,426,300
グリーンズ	5,000	1,298.00	6,490,000
ツナググループ・ホールディングス	1,800	586.00	1,054,800
GameWith	3,000	840.00	2,520,000
ソウルドアウト	2,100	1,364.00	2,864,400
MS & Consulting	2,100	1,045.00	2,194,500
日総工産	8,700	1,265.00	11,005,500
キュービーネットホールディングス	7,900	2,242.00	17,711,800

RPAホールディングス	5,600	1,220.00	6,832,000
スプリックス	4,400	1,464.00	6,441,600
アドバンテッジリスクマネジメント	5,300	867.00	4,595,100
リログループ	70,600	2,509.00	177,135,400
東祥	8,100	2,222.00	17,998,200
エイチ・アイ・エス	20,200	2,808.00	56,721,600
ラックランド	2,700	2,343.00	6,326,100
共立メンテナンス	19,800	4,745.00	93,951,000
イチネンホールディングス	13,500	1,295.00	17,482,500
建設技術研究所	9,000	1,713.00	15,417,000
スペース	8,500	1,278.00	10,863,000
長大	4,900	1,004.00	4,919,600
燦ホールディングス	5,800	1,078.00	6,252,400
スバル興業	900	6,980.00	6,282,000
東京テアトル	5,200	1,376.00	7,155,200
タナベ経営	2,600	1,247.00	3,242,200
ナガワ	3,600	6,030.00	21,708,000
よみうりランド	2,800	4,515.00	12,642,000
東京都競馬	8,500	3,410.00	28,985,000
カナモト	21,200	2,913.00	61,755,600
東京ドーム	48,400	957.00	46,318,800
西尾レントオール	13,100	2,916.00	38,199,600
トランス・コスモス	14,400	2,650.00	38,160,000
乃村工藝社	60,400	1,321.00	79,788,400
藤田観光	5,700	2,841.00	16,193,700
KNT-CTホールディングス	6,900	1,672.00	11,536,800
日本管財	13,900	1,919.00	26,674,100
トーカイ	12,500	2,412.00	30,150,000
白洋舎	1,500	2,863.00	4,294,500
セコム	136,900	9,897.00	1,354,899,300
セントラル警備保障	6,200	6,160.00	38,192,000
丹青社	24,500	1,138.00	27,881,000
メイテック	16,000	5,640.00	90,240,000
応用地質	14,000	1,201.00	16,814,000
船井総研ホールディングス	26,700	2,580.00	68,886,000
進学会ホールディングス	6,200	512.00	3,174,400
オオバ	10,300	720.00	7,416,000
いであ	2,500	1,369.00	3,422,500
学究社	4,400	1,232.00	5,420,800
ベネッセホールディングス	47,300	2,929.00	138,541,700
イオンディライト	15,900	3,645.00	57,955,500
ナック	8,300	980.00	8,134,000

ニチイ学館	18,400	1,828.00	33,635,200	
ダイセキ	21,700	2,921.00	63,385,700	
ステップ	4,800	1,427.00	6,849,600	
合 計	158,081,700		314,586,614,780	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【i - SMT TOPIXインデックス（ノーロード）】

【純資産額計算書】

(2019年11月29日現在)

資産総額	65,577,777円
負債総額	171,393円
純資産総額（ - ）	65,406,384円
発行済口数	69,248,302口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9445円
（1万口当たり純資産額）	（9,445円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2019年11月29日現在)

資産総額	325,909,328,011円
負債総額	878,019,589円
純資産総額（ - ）	325,031,308,422円
発行済口数	205,511,140,335口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5816円
（1万口当たり純資産額）	（15,816円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年11月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2020年 1月21日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年11月29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	538	12,742,439
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	311,227
単位型公社債投資信託	15	127,121
合計	640	13,180,787

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間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、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (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、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240

営業利益	5,516,262	8,554,888
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
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	300,000	350,000	350,000

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

	評価・換算差額等			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	1,134	-	1,134	21,847,309
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				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
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					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純 額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	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	182	-	182	25,592,216
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				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

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. 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。

4. 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。

5. 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。

6. 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。

7. 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。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

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

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

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

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

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度（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(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28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、当該投資信託を有価証券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有価証券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。

有価証券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6.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（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

(*) 負債に計上されているものについては、() で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(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	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

（*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、（2）未収委託者報酬、及び（3）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。

（4）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。

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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。

（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：千円）

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)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（2018年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5 年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585

合計	13,602,178	13,035,220	566,957
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538,203	46,789	34,437

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(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 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
香港ドル	560	-	4	4	
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

(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 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引				
株価指数先物取引				
売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計	6,739,103	-	8,766	8,766

(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 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建 ユーロ		6,313	-	86
			合計		8,643,951

(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. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"

退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	
有価証券評価差額	-		173,602	"
繰延ヘッジ損益	-		58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

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

(2)実施した会計処理の概要

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

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（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	4,679,437千円

[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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料等	9,571,581	未払 手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他 未払金	424,421

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（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（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	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。

(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（2018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（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）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

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
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

2019年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円）は、市場

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

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

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

（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	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(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。

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	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

(関連情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

略しております。

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(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)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年1月21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（2019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） （2019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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
a u カブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,944	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から

再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年12月19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

松崎雅則

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i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2018年10月23日から2019年10月21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、i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）の2019年10月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。