

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年9月25日提出
【計算期間】	第13期(自 2018年6月26日至 2019年6月25日)
【ファンド名】	日本株式インデックス・オープン（SMA専用）
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

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



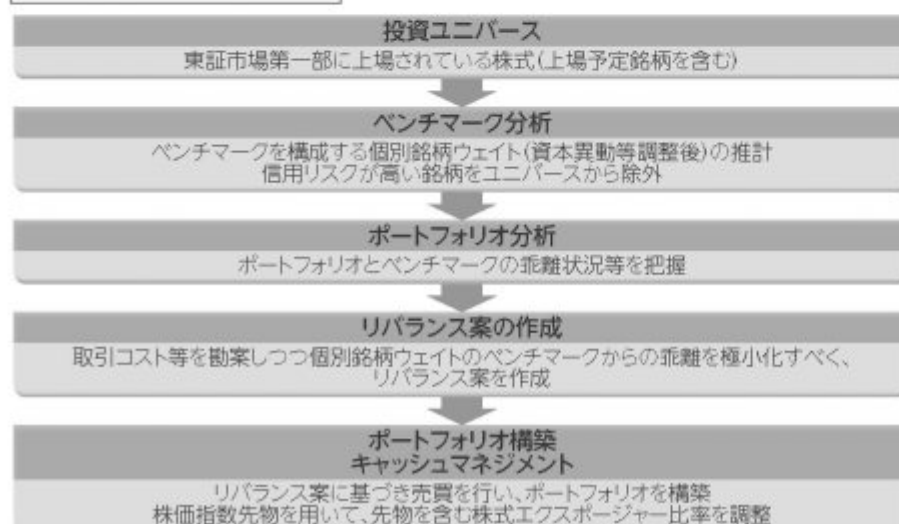
? ファミリーファンド方式とは

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

〈マザーファンドの概要〉

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

? TOPIX(東証株価指数)とは

インデックスの概要 (2019年7月末現在)		東証一部時価総額上位10銘柄		
構成国	1カ国(日本)	順位	銘柄名	時価総額(億円)
構成銘柄数	2,147銘柄	1	トヨタ自動車	126,056
時価総額	約361兆円	2	ソフトバンクグループ	70,569
※上記時価総額は浮動株ベース		3	ソニー	66,685
		4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	57,317
		5	日本電信電話	53,200
		6	武田薬品工業	51,106
		7	キーエンス	49,900
		8	三井住友フィナンシャルグループ	42,620
		9	リクルートホールディングス	40,986
		10	KDDI	36,966
		※上記時価総額は浮動株ベース		

(出所) 株式会社東京証券取引所のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

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

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

東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

分配方針

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

主な投資制限

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

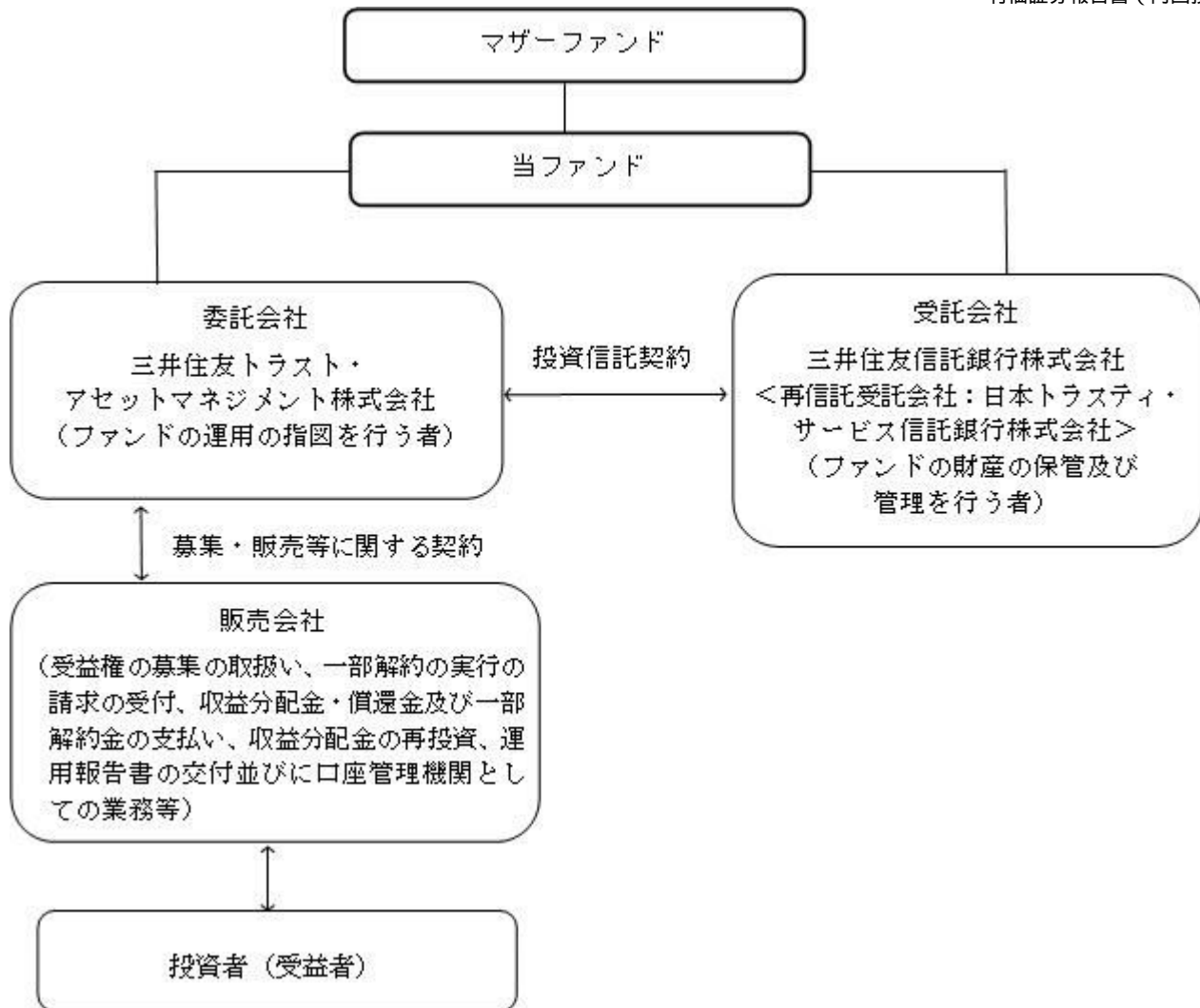
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

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

（ロ）運用方法

投資対象

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

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)株式以外の資産（他の投資信託受益証券（振替投資信託受益権を含む）を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。
- 5)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 6)国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

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

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

委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記（八）第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

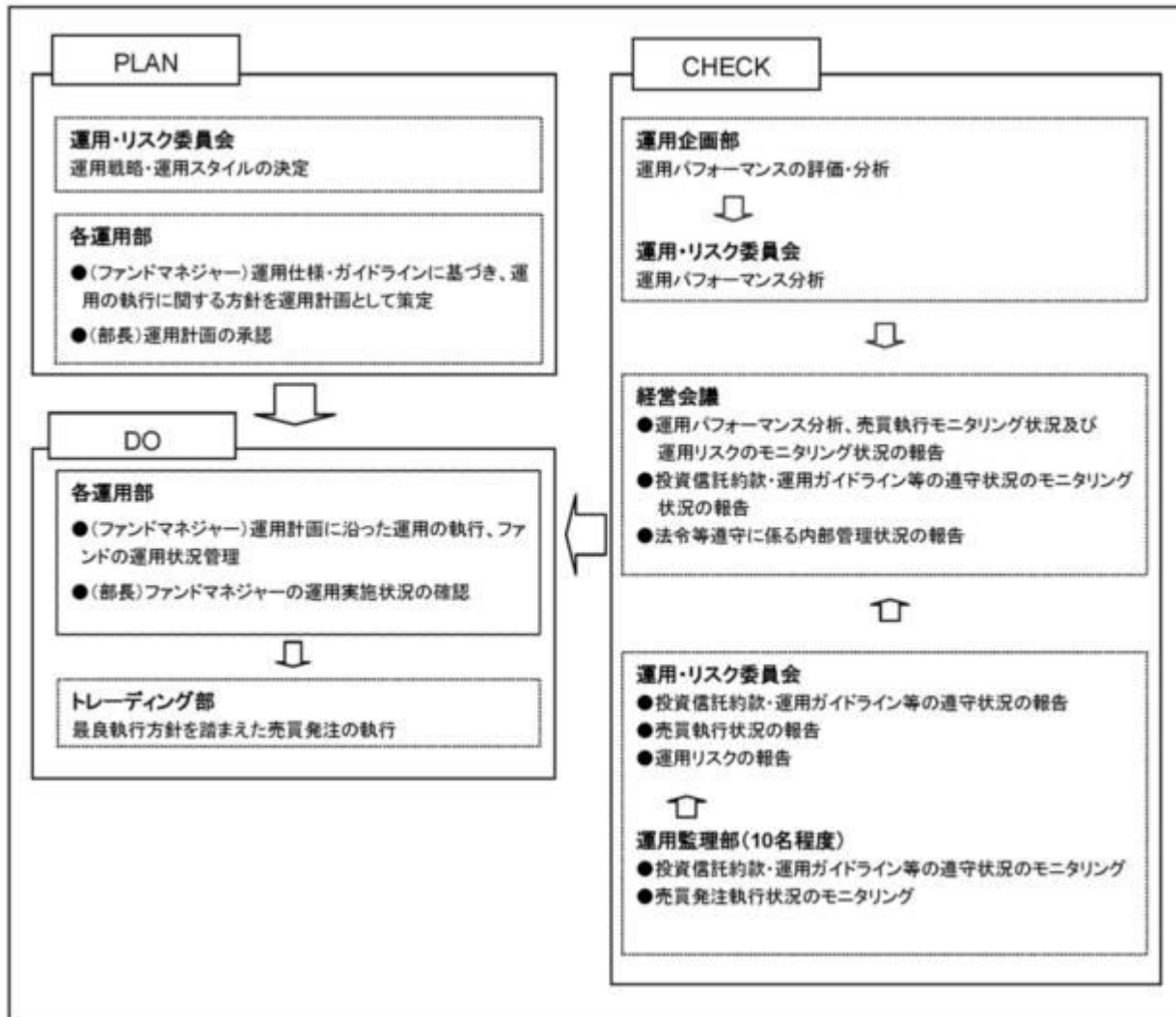
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に

したがいが当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

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

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

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

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

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

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

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

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第31条）

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

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

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

乗じて得た額をいいます。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻し

に相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

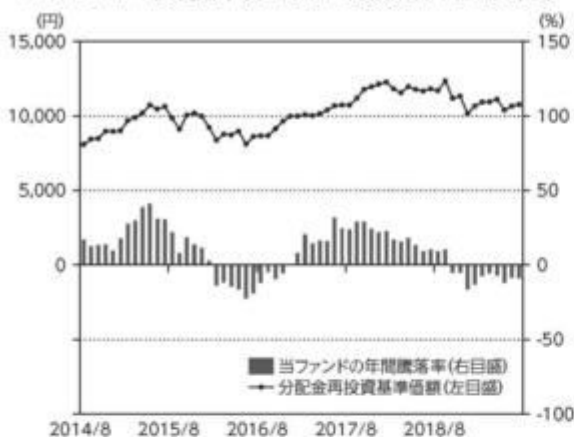
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

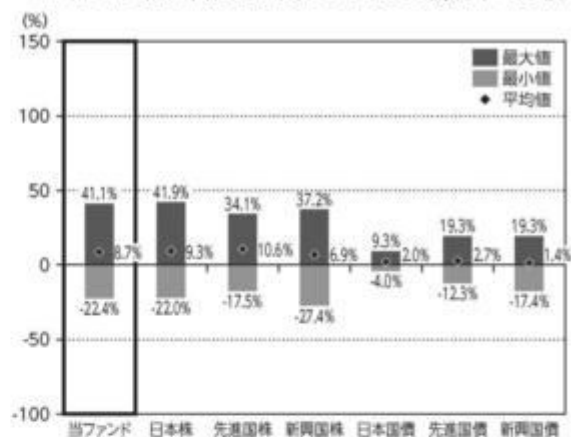
【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2014年8月～2019年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの発案、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Emerging Markets Bond Index (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0.3996%（*）（税抜 0.37%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

*消費税率が10%になった場合は、0.407%となります。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.132% (税抜 0.12%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.198% (税抜 0.18%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額について

は、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

2020年1月1日以降の分配時において、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7月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年7月31日現在の状況について記載してあります。

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	1,691,274,793	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		851,630	0.05

合計(純資産総額)	1,692,126,423	100.00
-----------	---------------	--------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,172,704,752	1.4209	1,666,296,183	1.4422	1,691,274,793	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4期計算期間末	(2010年 6月25日)	2,089,239,493	2,089,239,493	5,129	5,129
第5期計算期間末	(2011年 6月27日)	2,734,140,661	2,734,140,661	4,971	4,971
第6期計算期間末	(2012年 6月25日)	3,928,359,394	3,928,359,394	4,569	4,569
第7期計算期間末	(2013年 6月25日)	324,037,180	324,037,180	6,721	6,721
第8期計算期間末	(2014年 6月25日)	421,829,003	421,829,003	7,970	7,970

第9期計算期間末	(2015年 6月25日)	462,803,071	462,803,071	10,698	10,698
第10期計算期間末	(2016年 6月27日)	399,546,072	399,546,072	7,968	7,968
第11期計算期間末	(2017年 6月26日)	473,027,168	473,027,168	10,666	10,666
第12期計算期間末	(2018年 6月25日)	600,485,748	600,485,748	11,635	11,635
第13期計算期間末	(2019年 6月25日)	1,610,423,900	1,610,423,900	10,595	10,595
	2018年 7月末日	712,761,667		11,813	
	8月末日	701,045,577		11,692	
	9月末日	728,573,102		12,338	
	10月末日	771,714,478		11,174	
	11月末日	836,972,825		11,319	
	12月末日	805,118,266		10,157	
	2019年 1月末日	1,610,153,891		10,652	
	2月末日	1,664,782,284		10,925	
	3月末日	1,663,163,402		10,931	
	4月末日	1,652,587,500		11,109	
	5月末日	1,535,396,637		10,383	
	6月末日	1,684,976,056		10,664	
	7月末日	1,692,126,423		10,757	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	0
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	0
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	0
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	0
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	0
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	0
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	0
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	0
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	0
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	4.3
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	3.1
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	8.1
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	47.1
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	18.6

第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	34.2
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	25.5
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	33.9
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	9.1
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	8.9

(注1)収益率は、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4期計算期間	2009年 6月26日～2010年 6月25日	3,433,528,187	949,503,267	4,073,516,752
第5期計算期間	2010年 6月26日～2011年 6月27日	5,210,186,878	3,783,565,360	5,500,138,270
第6期計算期間	2011年 6月28日～2012年 6月25日	6,367,958,848	3,270,880,713	8,597,216,405
第7期計算期間	2012年 6月26日～2013年 6月25日	833,004,843	8,948,125,655	482,095,593
第8期計算期間	2013年 6月26日～2014年 6月25日	240,217,610	193,049,580	529,263,623
第9期計算期間	2014年 6月26日～2015年 6月25日	267,031,202	363,702,679	432,592,146
第10期計算期間	2015年 6月26日～2016年 6月27日	168,629,406	99,774,600	501,446,952
第11期計算期間	2016年 6月28日～2017年 6月26日	105,855,663	163,810,500	443,492,115
第12期計算期間	2017年 6月27日～2018年 6月25日	205,570,147	132,941,629	516,120,633
第13期計算期間	2018年 6月26日～2019年 6月25日	1,166,396,443	162,578,396	1,519,938,680

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	284,452,460,560	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,001,484,408	1.04
合計(純資産総額)		287,453,944,968	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		2,975,400,000	1.04
----------	----	----	--	---------------	------

(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	1,414,100	6,598.30	9,330,660,283	7,024.00	9,932,638,400	3.46
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	988,000	5,252.11	5,189,092,039	5,628.00	5,560,464,000	1.93
日本	株式	ソニー	電気機器	851,600	5,336.51	4,544,578,428	6,170.00	5,254,372,000	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,615,500	506.22	4,361,376,574	524.20	4,516,245,100	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	851,700	4,926.09	4,195,558,320	4,922.00	4,192,067,400	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,107,800	3,843.12	4,257,415,240	3,635.00	4,026,853,000	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	62,300	62,811.43	3,913,152,364	63,130.00	3,932,999,000	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	882,100	3,818.90	3,368,652,288	3,807.00	3,358,154,700	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	868,600	3,613.01	3,138,264,580	3,718.00	3,229,454,800	1.12
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,020,800	2,793.39	2,851,502,448	2,853.50	2,912,852,800	1.01
日本	株式	任天堂	その他製品	72,600	38,993.27	2,830,911,780	40,100.00	2,911,260,000	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,070,500	2,760.61	2,955,235,984	2,710.50	2,901,590,250	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,006,500	155.34	2,641,820,632	154.40	2,625,803,600	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	447,500	5,556.01	2,486,316,714	5,797.00	2,594,157,500	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	877,000	2,846.37	2,496,267,850	2,936.50	2,575,310,500	0.90
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	113,600	22,751.35	2,584,553,584	21,920.00	2,490,112,000	0.87
日本	株式	花王	化学	308,100	8,668.85	2,670,873,499	7,979.00	2,458,329,900	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	219,000	9,269.25	2,029,965,825	11,155.00	2,442,945,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	363,100	5,416.66	1,966,789,549	6,647.00	2,413,525,700	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	120,600	18,397.62	2,218,753,140	19,530.00	2,355,318,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	173,200	13,797.74	2,389,769,456	13,585.00	2,352,922,000	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	225,600	10,434.53	2,354,030,426	10,005.00	2,257,128,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	152,700	13,722.63	2,095,445,824	14,715.00	2,246,980,500	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	571,300	3,776.89	2,157,739,663	3,892.00	2,223,499,600	0.77
日本	株式	HOYA	精密機器	255,500	7,883.97	2,014,355,303	8,405.00	2,147,477,500	0.75
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	143,300	13,448.09	1,927,111,310	14,440.00	2,069,252,000	0.72
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	788,500	2,513.85	1,982,173,000	2,615.00	2,061,927,500	0.72
日本	株式	キヤノン	電気機器	683,200	3,077.16	2,102,317,380	2,970.50	2,029,445,600	0.71

日本	株式	資生堂	化学	252,100	8,051.78	2,029,854,104	8,046.00	2,028,396,600	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	523,900	3,757.41	1,968,509,591	3,728.00	1,953,099,200	0.68

(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	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.75
		食料品	3.99
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.26
		医薬品	5.53
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.58
		機械	4.99
		電気機器	13.72
		輸送用機器	7.66
		精密機器	2.12
		その他製品	2.17
		電気・ガス業	1.68
		陸運業	4.62
		海運業	0.17
		空運業	0.54
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.94
		卸売業	4.90
		小売業	4.59
		銀行業	5.75
		証券、商品先物取引業	0.71
		保険業	2.36
その他金融業	1.08		
不動産業	2.40		
サービス業	5.22		

	小計	98.96
合計		98.96

(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	190	円	2,941,494,290	2,975,400,000	1.04

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2007年2月16日

作成基準日：2019年7月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 10,757円

純資産総額 16.92億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年6月	0円
2016年6月	0円
2017年6月	0円
2018年6月	0円
2019年6月	0円

設定来
分配金合計額 0円

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

主要な資産の状況

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%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.9%
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%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.4%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.2%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.0%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

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

受益権取得申込者は、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限るものとし、販売会

社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2007年 2月16日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社

の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(2018年6月26日から2019年6月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2018年 6月25日現在）	第13期 （2019年 6月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,442,208	3,817,196
親投資信託受益証券	600,182,639	1,609,616,486
未収入金	19,187	46,346
流動資産合計	601,644,034	1,613,480,028
資産合計	601,644,034	1,613,480,028
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	213,826	566,828
未払委託者報酬	916,348	2,429,217
未払利息	3	8
その他未払費用	28,109	60,075
流動負債合計	1,158,286	3,056,128
負債合計	1,158,286	3,056,128
純資産の部		
元本等		
元本	516,120,633	1,519,938,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	84,365,115	90,485,220
（分配準備積立金）	105,618,481	114,541,355
元本等合計	600,485,748	1,610,423,900
純資産合計	600,485,748	1,610,423,900
負債純資産合計	601,644,034	1,613,480,028

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2017年 6月27日	至 2018年 6月25日	自 2018年 6月26日	至 2019年 6月25日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		42,758,123		56,815,341
営業収益合計		42,758,123		56,815,340
営業費用				
支払利息		421		1,283
受託者報酬		395,238		842,758
委託者報酬		1,693,779		3,611,721
その他費用		28,116		60,107
営業費用合計		2,117,554		4,515,869
営業利益又は営業損失（ ）		40,640,569		61,331,209
経常利益又は経常損失（ ）		40,640,569		61,331,209
当期純利益又は当期純損失（ ）		40,640,569		61,331,209
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（ ）		10,005,947		1,394,690
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		29,535,053		84,365,115
剰余金増加額又は欠損金減少額		35,025,348		84,750,368
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		35,025,348		84,750,368
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,829,908		18,693,744
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,829,908		18,693,744
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		84,365,115		90,485,220

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2018年 6月25日現在)	第13期 (2019年 6月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	516,120,633口	1,519,938,680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) 1.1635円 (11,635円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0595円 (10,595円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25日	第13期 自 2018年 6月26日 至 2019年 6月25日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>9,964,741円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>20,669,881円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>213,932,398円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>74,983,859円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>319,550,879円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>516,120,633口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>6,191円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	9,964,741円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,669,881円	収益調整金額	C	213,932,398円	分配準備積立金額	D	74,983,859円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	319,550,879円	当ファンドの期末残存口数	F	516,120,633口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,191円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>23,145,534円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>850,049,137円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>91,395,821円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>964,590,492円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,519,938,680口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>6,346円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	23,145,534円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	850,049,137円	分配準備積立金額	D	91,395,821円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	964,590,492円	当ファンドの期末残存口数	F	1,519,938,680口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,346円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	9,964,741円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,669,881円																																																											
収益調整金額	C	213,932,398円																																																											
分配準備積立金額	D	74,983,859円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	319,550,879円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	516,120,633口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,191円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	23,145,534円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	850,049,137円																																																											
分配準備積立金額	D	91,395,821円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	964,590,492円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,519,938,680口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	6,346円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2018年 6月26日 至 2019年 6月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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13期 (2019年 6月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期
	自 2017年 6月27日 至 2018年 6月25日	自 2018年 6月26日 至 2019年 6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	443,492,115円	516,120,633円
期中追加設定元本額	205,570,147円	1,166,396,443円
期中一部解約元本額	132,941,629円	162,578,396円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (2018年 6月25日現在)	第13期 (2019年 6月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	33,311,275	55,174,480
合計	33,311,275	55,174,480

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,133,532,737	1,609,616,486	
合計		1,133,532,737	1,609,616,486	

(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

	2019年 6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,474,765,510
株式	270,370,053,080
派生商品評価勘定	20,663,910
未収配当金	1,407,087,669
差入委託証拠金	113,520,000
流動資産合計	275,386,090,169
資産合計	275,386,090,169
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,455,940
前受金	16,219,310
未払解約金	52,037,182
未払利息	7,589
流動負債合計	72,720,021
負債合計	72,720,021
純資産の部	
元本等	
元本	193,887,535,122
剰余金	
剰余金又は欠損金()	81,425,835,026
元本等合計	275,313,370,148
純資産合計	275,313,370,148
負債純資産合計	275,386,090,169

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 6月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 6月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	193,887,535,122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 1.4200円 (1万口当たり純資産額) (14,200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 6月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2019年 6月25日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 6月26日
期首元本額	133,374,481,612円
期中追加設定元本額	76,513,096,153円
期中一部解約元本額	16,000,042,643円
期末元本額	193,887,535,122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）	610,681,953円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,008,048,562円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,932,856円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,927,096,544円
世界経済インデックスファンド	2,020,221,064円
日本株式インデックス・オープン	5,421,266,323円
D C マイセレクション 2 5	6,705,535,080円
D C マイセレクション 5 0	19,091,335,054円
D C マイセレクション 7 5	17,575,527,146円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,565,398,082円
D C マイセレクション S 2 5	2,713,800,314円
D C マイセレクション S 5 0	7,786,773,473円
D C マイセレクション S 7 5	5,044,007,914円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,381,233,270円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	377,272,450円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	642,391,863円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	421,940,171円
D C 世界経済インデックスファンド	1,766,148,760円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,133,532,737円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	16,342,633円

区分	2019年 6月25日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	43,826,513円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	38,593,956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)	299,057,363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)	108,683,569円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	370,846,435円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	64,480,138円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	538,721,923円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,894,521,098円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	756,173,518円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,359,628,948円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	678,573,094円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	48,391,972円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	846,436,755円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	39,847,094円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	479,417,502円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	600,404,002円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,015,261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)	910,201,805円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,162,966,236円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,376,393,422円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	1,030,901,947円
分散投資コア戦略ファンドS	2,177,045,792円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	234,385,981円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	264,089,346円
コア投資戦略ファンド(切替型)	544,973,808円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	225,195,225円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,245,259円
SMT インデックスバランス・オープン	76,410,015円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,813,502,948円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	673,595,588円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,535,989円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	54,489,721円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	8,078,226円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,278,764円
グローバル経済コア	321,473,819円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,378,493円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	46,023,767円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,249,108円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	148,867,684円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	25,167,567円

区分	2019年 6月25日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	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)	54,781,542,609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)	674,137,170円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2019年 6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,283,831,158	
合計	1,283,831,158	

(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 6月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,911,130,690	-	4,927,350,000	16,219,310
合計		4,911,130,690	-	4,927,350,000	16,219,310

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,400	2,807.00	15,157,800	

日本水産	165,700	681.00	112,841,700
マルハニチロ	23,900	3,160.00	75,524,000
カネコ種苗	5,000	1,320.00	6,600,000
サカタのタネ	20,200	3,200.00	64,640,000
ホクト	13,900	1,836.00	25,520,400
ホクリヨウ	2,200	598.00	1,315,600
住石ホールディングス	35,700	126.00	4,498,200
日鉄鉱業	3,800	4,655.00	17,689,000
三井松島ホールディングス	6,900	1,270.00	8,763,000
国際石油開発帝石	664,900	967.20	643,091,280
石油資源開発	23,800	2,507.00	59,666,600
K&Oエナジーグループ	8,000	1,560.00	12,480,000
ヒノキヤグループ	4,600	2,144.00	9,862,400
ショーボンドホールディングス	11,800	7,650.00	90,270,000
ミライト・ホールディングス	46,600	1,618.00	75,398,800
タマホーム	8,000	1,072.00	8,576,000
サンヨーホームズ	2,400	651.00	1,562,400
日本アクア	5,300	598.00	3,169,400
ファーストコーポレーション	5,100	753.00	3,840,300
ベステラ	3,200	1,271.00	4,067,200
TATERU	20,200	176.00	3,555,200
スペースバリューホールディングス	20,200	497.00	10,039,400
ダイセキ環境ソリューション	3,200	626.00	2,003,200
第一カッター興業	2,000	1,691.00	3,382,000
安藤・間	107,200	728.00	78,041,600
東急建設	49,400	723.00	35,716,200
コムシスホールディングス	58,800	2,721.00	159,994,800
ミサワホーム	13,700	1,011.00	13,850,700
ビーアールホールディングス	18,100	316.00	5,719,600
高松コンストラクショングループ	10,600	2,180.00	23,108,000
東建コーポレーション	5,200	6,110.00	31,772,000
ソネック	1,700	774.00	1,315,800
ヤマウラ	7,200	837.00	6,026,400
大成建設	136,300	3,900.00	531,570,000
大林組	410,700	1,052.00	432,056,400
清水建設	419,000	897.00	375,843,000
飛島建設	12,200	1,311.00	15,994,200
長谷工コーポレーション	171,500	1,089.00	186,763,500
松井建設	16,100	616.00	9,917,600
銭高組	1,700	4,480.00	7,616,000
鹿島建設	320,900	1,470.00	471,723,000
不動テトラ	9,800	1,316.00	12,896,800

大末建設	5,500	930.00	5,115,000
鉄建建設	8,500	3,005.00	25,542,500
西松建設	29,800	2,036.00	60,672,800
三井住友建設	98,600	599.00	59,061,400
大豊建設	9,500	2,722.00	25,859,000
前田建設工業	98,200	854.00	83,862,800
佐田建設	10,600	375.00	3,975,000
ナカノフード建設	11,900	430.00	5,117,000
奥村組	22,700	3,250.00	73,775,000
東鉄工業	16,400	2,939.00	48,199,600
イチケン	2,900	1,651.00	4,787,900
富士ピー・エス	5,600	459.00	2,570,400
浅沼組	5,000	3,435.00	17,175,000
戸田建設	160,000	583.00	93,280,000
熊谷組	19,700	3,065.00	60,380,500
青木あすなろ建設	7,500	813.00	6,097,500
北野建設	3,100	2,606.00	8,078,600
植木組	2,000	2,141.00	4,282,000
矢作建設工業	18,600	716.00	13,317,600
ピーエス三菱	15,400	597.00	9,193,800
日本ハウスホールディングス	26,100	421.00	10,988,100
大東建託	48,800	13,645.00	665,876,000
新日本建設	17,000	882.00	14,994,000
N I P P O	36,200	2,103.00	76,128,600
東亜道路工業	2,600	3,160.00	8,216,000
前田道路	42,800	2,230.00	95,444,000
日本道路	3,700	5,970.00	22,089,000
東亜建設工業	11,900	1,578.00	18,778,200
日本国土開発	22,300	511.00	11,395,300
若築建設	6,900	1,375.00	9,487,500
東洋建設	50,100	417.00	20,891,700
五洋建設	162,600	530.00	86,178,000
世紀東急工業	19,900	635.00	12,636,500
福田組	4,600	4,610.00	21,206,000
住友林業	97,400	1,262.00	122,918,800
日本基礎技術	14,000	346.00	4,844,000
巴コーポレーション	18,700	380.00	7,106,000
大和ハウス工業	378,800	3,130.00	1,185,644,000
ライト工業	26,300	1,377.00	36,215,100
積水ハウス	419,100	1,781.50	746,626,650
日特建設	11,600	588.00	6,820,800
北陸電気工事	6,600	875.00	5,775,000

ユアテック	21,900	732.00	16,030,800
四電工	2,100	2,662.00	5,590,200
中電工	17,600	2,208.00	38,860,800
関電工	62,200	887.00	55,171,400
きんでん	90,900	1,637.00	148,803,300
東京エネシス	14,100	899.00	12,675,900
トーエネック	3,800	3,050.00	11,590,000
住友電設	9,500	1,755.00	16,672,500
日本電設工業	23,300	2,143.00	49,931,900
協和エクシオ	53,600	2,657.00	142,415,200
新日本空調	11,700	1,710.00	20,007,000
九電工	27,000	3,155.00	85,185,000
三機工業	31,400	1,254.00	39,375,600
日揮	118,200	1,436.00	169,735,200
中外炉工業	4,200	1,605.00	6,741,000
ヤマト	13,400	558.00	7,477,200
太平電業	9,200	2,132.00	19,614,400
高砂熱学工業	33,600	1,774.00	59,606,400
三晃金属工業	1,900	2,408.00	4,575,200
朝日工業社	3,100	2,797.00	8,670,700
明星工業	24,800	719.00	17,831,200
大気社	18,800	3,255.00	61,194,000
ダイダン	9,400	2,270.00	21,338,000
日比谷総合設備	12,300	1,868.00	22,976,400
東芝プラントシステム	29,900	2,017.00	60,308,300
OSJBホールディングス	60,300	268.00	16,160,400
東洋エンジニアリング	16,100	487.00	7,840,700
新興プランテック	24,600	1,287.00	31,660,200
日本製粉	38,800	1,750.00	67,900,000
日清製粉グループ本社	138,400	2,513.00	347,799,200
日東富士製粉	900	5,720.00	5,148,000
昭和産業	11,200	3,100.00	34,720,000
鳥越製粉	10,900	879.00	9,581,100
中部飼料	15,000	1,308.00	19,620,000
フィード・ワン	82,300	195.00	16,048,500
東洋精糖	1,900	996.00	1,892,400
日本甜菜製糖	7,000	1,945.00	13,615,000
三井製糖	9,700	2,266.00	21,980,200
塩水港精糖	13,300	212.00	2,819,600
日新製糖	5,800	1,852.00	10,741,600
森永製菓	30,800	5,270.00	162,316,000
中村屋	3,200	4,150.00	13,280,000

江崎グリコ	36,800	4,845.00	178,296,000
名糖産業	5,900	1,450.00	8,555,000
井村屋グループ	5,200	2,083.00	10,831,600
不二家	6,800	1,950.00	13,260,000
山崎製パン	100,200	1,570.00	157,314,000
第一屋製パン	2,100	997.00	2,093,700
モロゾフ	2,100	4,970.00	10,437,000
亀田製菓	7,600	4,900.00	37,240,000
寿スピリッツ	13,000	5,190.00	67,470,000
カルビー	55,800	2,970.00	165,726,000
森永乳業	24,500	4,225.00	103,512,500
六甲バター	8,900	1,870.00	16,643,000
ヤクルト本社	90,700	6,380.00	578,666,000
明治ホールディングス	86,800	7,640.00	663,152,000
雪印メグミルク	29,500	2,333.00	68,823,500
プリマハム	17,200	2,060.00	35,432,000
日本ハム	50,700	4,655.00	236,008,500
林兼産業	4,100	654.00	2,681,400
丸大食品	13,100	1,988.00	26,042,800
S Foods	11,000	3,760.00	41,360,000
伊藤ハム米久ホールディングス	78,900	733.00	57,833,700
サッポロホールディングス	44,800	2,284.00	102,323,200
アサヒグループホールディングス	256,500	4,909.00	1,259,158,500
キリンホールディングス	554,100	2,342.50	1,297,979,250
宝ホールディングス	91,700	1,123.00	102,979,100
オエノンホールディングス	34,800	361.00	12,562,800
養命酒製造	3,800	2,001.00	7,603,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,800	2,741.00	257,105,800
サントリー食品インターナショナル	82,000	4,725.00	387,450,000
ダイトーグループホールディングス	6,900	4,630.00	31,947,000
伊藤園	37,200	5,130.00	190,836,000
キーコーヒー	12,000	2,105.00	25,260,000
ユニカフェ	3,400	982.00	3,338,800
ジャパンフーズ	1,700	1,196.00	2,033,200
日清オイリオグループ	15,800	3,015.00	47,637,000
不二製油グループ本社	29,900	3,045.00	91,045,500
かどや製油	1,300	3,895.00	5,063,500
J - オイルミルズ	6,300	3,850.00	24,255,000
キッコーマン	80,800	4,670.00	377,336,000
味の素	270,500	1,875.50	507,322,750
キューピー	68,200	2,402.00	163,816,400
ハウス食品グループ本社	45,800	4,130.00	189,154,000

カゴメ	49,100	2,477.00	121,620,700
焼津水産化学工業	5,900	1,095.00	6,460,500
アリアケジャパン	11,200	7,120.00	79,744,000
ピエトロ	1,600	1,608.00	2,572,800
エバラ食品工業	3,000	2,104.00	6,312,000
ニチレイ	63,600	2,559.00	162,752,400
東洋水産	63,000	4,475.00	281,925,000
イトアンド	4,200	1,621.00	6,808,200
大冷	1,400	1,840.00	2,576,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	906.00	2,989,800
日清食品ホールディングス	52,100	6,940.00	361,574,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,085.00	13,552,500
一正蒲鉾	4,800	1,089.00	5,227,200
フジッコ	13,300	2,058.00	27,371,400
ロック・フィールド	13,200	1,415.00	18,678,000
日本たばこ産業	707,300	2,502.50	1,770,018,250
ケンコーマヨネーズ	6,900	2,203.00	15,200,700
わらべや日洋ホールディングス	8,000	1,682.00	13,456,000
なとり	6,800	1,603.00	10,900,400
イフジ産業	2,100	667.00	1,400,700
ピクルスコーポレーション	2,900	2,027.00	5,878,300
北の達人コーポレーション	48,100	551.00	26,503,100
ユーグレナ	52,200	951.00	49,642,200
ミヨシ油脂	4,700	1,073.00	5,043,100
理研ビタミン	5,800	3,530.00	20,474,000
片倉工業	14,800	1,298.00	19,210,400
ゲンゼ	8,100	4,670.00	37,827,000
東洋紡	50,700	1,273.00	64,541,100
ユニチカ	35,300	379.00	13,378,700
富士紡ホールディングス	6,300	2,339.00	14,735,700
倉敷紡績	11,500	1,920.00	22,080,000
シキボウ	6,300	975.00	6,142,500
日本毛織	39,400	850.00	33,490,000
トーア紡コーポレーション	5,100	453.00	2,310,300
帝国繊維	13,500	2,156.00	29,106,000
帝人	97,600	1,805.00	176,168,000
東レ	927,400	825.70	765,754,180
サカイオーベックス	3,000	1,752.00	5,256,000
住江織物	3,500	2,941.00	10,293,500
日本フェルト	7,000	476.00	3,332,000
イチカワ	1,800	1,509.00	2,716,200
日東製網	1,400	1,522.00	2,130,800

アツギ	10,000	906.00	9,060,000
ダイニック	4,800	746.00	3,580,800
セーレン	29,500	1,470.00	43,365,000
ソトー	4,900	965.00	4,728,500
東海染工	1,700	1,132.00	1,924,400
小松マテーレ	19,800	797.00	15,780,600
ワコールホールディングス	34,900	2,835.00	98,941,500
ホギメディカル	14,900	3,275.00	48,797,500
レナウン	34,500	102.00	3,519,000
クラウドシアホールディングス	3,200	527.00	1,686,400
T S Iホールディングス	44,300	640.00	28,352,000
マツオカコーポレーション	3,800	2,666.00	10,130,800
ワールド	15,700	2,092.00	32,844,400
三陽商会	7,200	1,514.00	10,900,800
ナイガイ	4,600	471.00	2,166,600
オンワードホールディングス	72,000	592.00	42,624,000
ルックホールディングス	4,400	1,289.00	5,671,600
ゴールドウイン	10,800	14,390.00	155,412,000
デサント	29,200	1,886.00	55,071,200
キング	6,500	613.00	3,984,500
ヤマトインターナショナル	7,800	419.00	3,268,200
特種東海製紙	7,600	3,740.00	28,424,000
王子ホールディングス	538,100	622.00	334,698,200
日本製紙	57,300	1,877.00	107,552,100
三菱製紙	19,500	552.00	10,764,000
北越コーポレーション	79,300	569.00	45,121,700
中越パルプ工業	5,100	1,466.00	7,476,600
巴川製紙所	3,900	851.00	3,318,900
大王製紙	58,200	1,280.00	74,496,000
阿波製紙	3,100	434.00	1,345,400
レンゴー	123,200	885.00	109,032,000
トモク	7,300	1,686.00	12,307,800
ザ・パック	9,000	3,305.00	29,745,000
クラレ	201,700	1,287.00	259,587,900
旭化成	850,300	1,156.50	983,371,950
共和レザー	7,500	775.00	5,812,500
昭和電工	79,400	3,180.00	252,492,000
住友化学	940,900	486.00	457,277,400
住友精化	5,800	3,300.00	19,140,000
日産化学	73,400	4,885.00	358,559,000
ラサ工業	4,200	1,383.00	5,808,600
クレハ	11,000	7,300.00	80,300,000

多木化学	3,500	4,050.00	14,175,000
テイカ	9,700	2,427.00	23,541,900
石原産業	23,000	1,207.00	27,761,000
片倉コープアグリ	3,500	1,064.00	3,724,000
日本曹達	18,900	2,673.00	50,519,700
東ソー	184,800	1,475.00	272,580,000
トクヤマ	34,400	2,809.00	96,629,600
セントラル硝子	26,100	2,365.00	61,726,500
東亜合成	75,000	1,137.00	85,275,000
大阪ソーダ	12,900	2,704.00	34,881,600
関東電化工業	28,300	717.00	20,291,100
デンカ	47,000	3,240.00	152,280,000
信越化学工業	210,600	9,606.00	2,023,023,600
日本カーバイド工業	4,000	1,316.00	5,264,000
堺化学工業	8,000	2,502.00	20,016,000
第一稀元素化学工業	13,000	841.00	10,933,000
エア・ウォーター	97,900	1,815.00	177,688,500
大陽日酸	98,500	2,347.00	231,179,500
日本化学工業	4,100	2,015.00	8,261,500
東邦アセチレン	1,800	1,315.00	2,367,000
日本パーカライズン	65,300	1,185.00	77,380,500
高压ガス工業	19,000	840.00	15,960,000
チタン工業	1,500	2,927.00	4,390,500
四国化成工業	20,100	1,117.00	22,451,700
戸田工業	2,500	2,164.00	5,410,000
ステラ ケミファ	7,000	2,933.00	20,531,000
保土谷化学工業	4,100	2,748.00	11,266,800
日本触媒	20,100	7,080.00	142,308,000
大日精化工業	9,900	2,977.00	29,472,300
カネカ	30,900	3,980.00	122,982,000
三菱瓦斯化学	122,900	1,409.00	173,166,100
三井化学	108,500	2,622.00	284,487,000
J S R	119,900	1,619.00	194,118,100
東京応化工業	20,500	3,265.00	66,932,500
大阪有機化学工業	11,100	995.00	11,044,500
三菱ケミカルホールディングス	799,100	741.20	592,292,920
K Hネオケム	18,200	2,672.00	48,630,400
ダイセル	176,100	966.00	170,112,600
住友ベークライト	20,700	3,725.00	77,107,500
積水化学工業	261,300	1,600.00	418,080,000
日本ゼオン	107,800	1,168.00	125,910,400
アイカ工業	35,900	3,650.00	131,035,000

宇部興産	60,400	2,176.00	131,430,400
積水樹脂	19,700	2,076.00	40,897,200
タキロンシーアイ	25,900	664.00	17,197,600
旭有機材	8,300	1,386.00	11,503,800
日立化成	55,300	2,921.00	161,531,300
ニチバン	6,300	2,191.00	13,803,300
リケンテクノス	32,600	517.00	16,854,200
大倉工業	6,100	1,614.00	9,845,400
積水化成成品工業	17,800	752.00	13,385,600
群栄化学工業	3,100	2,509.00	7,777,900
タイガースポリマー	6,400	563.00	3,603,200
ミライアル	3,500	1,216.00	4,256,000
ダイキアクシス	4,300	873.00	3,753,900
ダイキョーニシカワ	25,300	838.00	21,201,400
竹本容器	4,300	1,207.00	5,190,100
森六ホールディングス	6,500	2,408.00	15,652,000
日本化薬	76,100	1,304.00	99,234,400
カーリットホールディングス	12,900	644.00	8,307,600
日本精化	9,600	1,228.00	11,788,800
扶桑化学工業	12,100	2,135.00	25,833,500
トリケミカル研究所	2,700	4,390.00	11,853,000
A D E K A	58,900	1,574.00	92,708,600
日油	45,000	3,990.00	179,550,000
新日本理化	21,600	211.00	4,557,600
ハリマ化成グループ	9,900	1,037.00	10,266,300
花王	296,300	8,392.00	2,486,549,600
第一工業製薬	4,500	3,550.00	15,975,000
石原ケミカル	3,100	1,561.00	4,839,100
日華化学	4,100	838.00	3,435,800
ニイタカ	1,900	1,446.00	2,747,400
三洋化成工業	8,000	5,650.00	45,200,000
有機合成薬品工業	9,400	224.00	2,105,600
大日本塗料	13,500	1,045.00	14,107,500
日本ペイントホールディングス	98,600	4,185.00	412,641,000
関西ペイント	134,300	2,248.00	301,906,400
神東塗料	9,800	175.00	1,715,000
中国塗料	39,300	906.00	35,605,800
日本特殊塗料	8,900	1,291.00	11,489,900
藤倉化成	16,100	571.00	9,193,100
太陽ホールディングス	9,800	3,220.00	31,556,000
D I C	54,100	2,839.00	153,589,900
サカタインクス	26,100	994.00	25,943,400

東洋インキＳＣホールディングス	25,300	2,295.00	58,063,500
T & K T O K A	9,300	968.00	9,002,400
富士フイルムホールディングス	253,500	5,410.00	1,371,435,000
資生堂	242,500	8,420.00	2,041,850,000
ライオン	170,000	2,005.00	340,850,000
高砂香料工業	8,400	3,005.00	25,242,000
マンダム	27,500	2,601.00	71,527,500
ミルボン	15,100	5,160.00	77,916,000
ファンケル	54,400	2,840.00	154,496,000
コーセー	20,700	17,920.00	370,944,000
コタ	6,400	1,158.00	7,411,200
シーボン	1,500	2,340.00	3,510,000
ポーラ・オルビスホールディングス	52,100	3,000.00	156,300,000
ノエビアホールディングス	11,700	5,850.00	68,445,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	930.00	2,604,000
エステー	8,700	1,701.00	14,798,700
アグロ カネショウ	5,000	1,970.00	9,850,000
コニシ	21,600	1,601.00	34,581,600
長谷川香料	16,200	1,883.00	30,504,600
星光PMC	8,200	764.00	6,264,800
小林製薬	34,200	7,830.00	267,786,000
荒川化学工業	11,000	1,373.00	15,103,000
メック	8,400	1,023.00	8,593,200
日本高純度化学	3,400	2,375.00	8,075,000
タカラバイオ	32,000	1,999.00	63,968,000
J C U	15,900	1,949.00	30,989,100
新田ゼラチン	7,700	676.00	5,205,200
O A T アグリオ	1,700	1,369.00	2,327,300
デクセリアルズ	31,500	691.00	21,766,500
アース製薬	9,200	4,745.00	43,654,000
北興化学工業	12,500	484.00	6,050,000
大成ラミック	4,000	2,799.00	11,196,000
クミアイ化学工業	50,500	736.00	37,168,000
日本農薬	21,700	410.00	8,897,000
アキレス	8,900	1,991.00	17,719,900
有沢製作所	19,200	854.00	16,396,800
日東電工	84,200	5,238.00	441,039,600
レック	13,100	1,127.00	14,763,700
三光合成	14,100	317.00	4,469,700
きもと	21,100	159.00	3,354,900
藤森工業	11,000	2,893.00	31,823,000
前澤化成工業	8,300	1,061.00	8,806,300

未来工業	6,600	1,988.00	13,120,800
ウェーブロックホールディングス	3,500	655.00	2,292,500
J S P	7,200	2,065.00	14,868,000
エフピコ	13,400	6,770.00	90,718,000
天馬	8,500	1,851.00	15,733,500
信越ポリマー	21,900	769.00	16,841,100
東リ	30,600	239.00	7,313,400
ニフコ	48,900	2,687.00	131,394,300
バルカー	9,900	2,223.00	22,007,700
ユニ・チャーム	258,800	3,235.00	837,218,000
ショーエイコーポレーション	1,100	747.00	821,700
協和発酵キリン	143,200	1,972.00	282,390,400
武田薬品工業	1,065,500	3,792.00	4,040,376,000
アステラス製薬	1,125,200	1,473.00	1,657,419,600
大日本住友製薬	90,500	2,008.00	181,724,000
塩野義製薬	156,000	6,251.00	975,156,000
田辺三菱製薬	127,600	1,211.00	154,523,600
わかもと製薬	14,500	266.00	3,857,000
あすか製薬	15,100	1,224.00	18,482,400
日本新薬	31,900	7,830.00	249,777,000
ピオフェルミン製薬	2,100	2,239.00	4,701,900
中外製薬	127,200	7,030.00	894,216,000
科研製薬	22,000	5,150.00	113,300,000
エーザイ	146,100	6,170.00	901,437,000
ロート製薬	62,600	2,976.00	186,297,600
小野薬品工業	288,200	1,858.50	535,619,700
久光製薬	36,100	4,235.00	152,883,500
持田製薬	18,500	4,705.00	87,042,500
参天製薬	227,200	1,743.00	396,009,600
扶桑薬品工業	4,300	1,890.00	8,127,000
日本ケミファ	1,600	2,943.00	4,708,800
ツムラ	37,800	2,998.00	113,324,400
日医工	32,100	1,183.00	37,974,300
キッセイ薬品工業	21,600	2,697.00	58,255,200
生化学工業	23,700	1,236.00	29,293,200
栄研化学	21,400	1,737.00	37,171,800
日水製薬	5,100	1,210.00	6,171,000
鳥居薬品	6,500	2,700.00	17,550,000
J C R ファーマ	8,600	6,410.00	55,126,000
東和薬品	17,600	2,785.00	49,016,000
富士製薬工業	8,300	1,406.00	11,669,800
沢井製薬	25,100	5,800.00	145,580,000

ゼリア新薬工業	24,200	2,238.00	54,159,600
第一三共	349,200	5,752.00	2,008,598,400
キョーリン製薬ホールディングス	26,900	1,860.00	50,034,000
大幸薬品	5,400	2,079.00	11,226,600
ダイト	7,100	3,340.00	23,714,000
大塚ホールディングス	232,500	3,565.00	828,862,500
大正製薬ホールディングス	27,300	8,350.00	227,955,000
ペプチドリーム	61,100	5,450.00	332,995,000
日本コークス工業	103,100	91.00	9,382,100
ニチレキ	15,600	1,018.00	15,880,800
ユシロ化学工業	6,300	1,323.00	8,334,900
ビーピー・カストロール	4,400	1,440.00	6,336,000
富士石油	29,600	262.00	7,755,200
MORESCO	4,400	1,462.00	6,432,800
出光興産	140,900	3,230.00	455,107,000
JXTGホールディングス	2,052,700	526.50	1,080,746,550
コスモエネルギーホールディングス	35,300	2,416.00	85,284,800
横浜ゴム	70,700	1,984.00	140,268,800
TOYO TIRE	62,600	1,456.00	91,145,600
ブリヂストン	375,100	4,268.00	1,600,926,800
住友ゴム工業	109,600	1,247.00	136,671,200
藤倉コンポジット	10,700	430.00	4,601,000
オカモト	8,500	4,750.00	40,375,000
フコク	5,300	726.00	3,847,800
ニッタ	13,800	2,925.00	40,365,000
住友理工	23,700	818.00	19,386,600
三ツ星ベルト	16,100	1,876.00	30,203,600
バンドー化学	23,300	965.00	22,484,500
日東紡績	18,200	2,218.00	40,367,600
AGC	120,700	3,720.00	449,004,000
日本板硝子	58,400	713.00	41,639,200
石塚硝子	2,000	2,146.00	4,292,000
日本山村硝子	5,100	1,391.00	7,094,100
日本電気硝子	52,800	2,712.00	143,193,600
オハラ	4,900	1,404.00	6,879,600
住友大阪セメント	24,600	4,350.00	107,010,000
太平洋セメント	77,100	3,250.00	250,575,000
日本ヒューム	12,300	698.00	8,585,400
日本コンクリート工業	26,400	285.00	7,524,000
三谷セキサン	5,700	2,747.00	15,657,900
アジアパイルホールディングス	17,300	585.00	10,120,500
東海カーボン	110,800	1,133.00	125,536,400

日本カーボン	5,800	4,235.00	24,563,000
東洋炭素	7,200	2,137.00	15,386,400
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	4,455.00	32,521,500
TOTO	93,900	4,190.00	393,441,000
日本碍子	149,000	1,533.00	228,417,000
日本特殊陶業	102,900	1,939.00	199,523,100
MARUWA	4,200	5,370.00	22,554,000
品川リフラクトリーズ	3,200	2,959.00	9,468,800
黒崎播磨	2,400	6,080.00	14,592,000
ヨータイ	10,700	542.00	5,799,400
イソライト工業	6,300	447.00	2,816,100
東京窯業	15,600	293.00	4,570,800
ニッカトー	5,600	656.00	3,673,600
フジインコーポレーテッド	10,900	2,134.00	23,260,600
クニミネ工業	5,500	819.00	4,504,500
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,027.00	2,464,800
ニチアス	33,400	1,927.00	64,361,800
ニチハ	17,000	2,999.00	50,983,000
日本製鉄	560,800	1,848.00	1,036,358,400
神戸製鋼所	220,900	693.00	153,083,700
中山製鋼所	16,800	463.00	7,778,400
合同製鐵	5,900	1,949.00	11,499,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	325,900	1,572.00	512,314,800
東京製鐵	64,700	803.00	51,954,100
共英製鋼	13,600	1,843.00	25,064,800
大和工業	25,600	3,085.00	78,976,000
東京鐵鋼	5,000	1,222.00	6,110,000
大阪製鐵	8,000	1,683.00	13,464,000
淀川製鋼所	16,300	2,100.00	34,230,000
丸一鋼管	42,700	2,947.00	125,836,900
モリ工業	3,600	1,914.00	6,890,400
大同特殊鋼	19,800	4,035.00	79,893,000
日本高周波鋼業	4,500	453.00	2,038,500
日本冶金工業	99,900	216.00	21,578,400
山陽特殊製鋼	15,200	1,479.00	22,480,800
愛知製鋼	6,800	3,095.00	21,046,000
日立金属	130,000	1,224.00	159,120,000
日本金属	2,800	882.00	2,469,600
大平洋金属	8,200	2,190.00	17,958,000
新日本電工	72,400	208.00	15,059,200
栗本鐵工所	6,100	1,433.00	8,741,300
虹技	1,800	1,269.00	2,284,200

三菱製鋼	9,000	1,218.00	10,962,000
日亜鋼業	17,700	340.00	6,018,000
日本精線	1,700	2,533.00	4,306,100
エンビプロ・ホールディングス	4,600	619.00	2,847,400
シンニッタン	18,800	322.00	6,053,600
新家工業	2,800	1,469.00	4,113,200
大紀アルミニウム工業所	20,100	744.00	14,954,400
日本軽金属ホールディングス	329,500	232.00	76,444,000
三井金属鉱業	32,600	2,562.00	83,521,200
東邦亜鉛	6,800	2,518.00	17,122,400
三菱マテリアル	79,800	3,065.00	244,587,000
住友金属鉱山	165,300	3,136.00	518,380,800
D O W Aホールディングス	28,200	3,515.00	99,123,000
古河機械金属	20,000	1,399.00	27,980,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,000	1,739.00	24,346,000
東邦チタニウム	21,700	1,107.00	24,021,900
U A C J	18,400	1,841.00	33,874,400
C Kサンエツ	2,300	2,895.00	6,658,500
古河電気工業	34,900	3,050.00	106,445,000
住友電気工業	451,300	1,379.00	622,342,700
フジクラ	146,100	388.00	56,686,800
昭和電線ホールディングス	14,000	822.00	11,508,000
東京特殊電線	1,600	1,687.00	2,699,200
タツタ電線	24,300	478.00	11,615,400
カナレ電気	2,100	1,928.00	4,048,800
平河ヒューテック	5,100	1,198.00	6,109,800
リョービ	14,900	1,995.00	29,725,500
アーレスティ	15,100	543.00	8,199,300
アサヒホールディングス	22,700	2,220.00	50,394,000
稲葉製作所	6,800	1,440.00	9,792,000
宮地エンジニアリンググループ	3,700	1,738.00	6,430,600
トーカロ	31,200	765.00	23,868,000
アルファC o	4,300	1,217.00	5,233,100
S U M C O	133,400	1,224.00	163,281,600
川田テクノロジーズ	2,700	8,220.00	22,194,000
R S Technologies	2,400	2,695.00	6,468,000
信和	6,400	951.00	6,086,400
東洋製罐グループホールディングス	76,900	2,215.00	170,333,500
ホッカンホールディングス	6,100	1,743.00	10,632,300
コロナ	6,700	982.00	6,579,400
横河ブリッジホールディングス	22,500	1,679.00	37,777,500
駒井ハルテック	2,300	1,700.00	3,910,000

高田機工	1,100	2,504.00	2,754,400
三和ホールディングス	124,700	1,154.00	143,903,800
文化シャッター	35,600	810.00	28,836,000
三協立山	16,800	1,202.00	20,193,600
アルインコ	9,600	985.00	9,456,000
東洋シャッター	2,900	656.00	1,902,400
LIXILグループ	178,100	1,478.00	263,231,800
日本フィルコン	9,300	504.00	4,687,200
ノーリツ	27,000	1,285.00	34,695,000
長府製作所	12,300	2,172.00	26,715,600
リンナイ	21,500	6,730.00	144,695,000
ダイニチ工業	6,500	609.00	3,958,500
日東精工	16,700	572.00	9,552,400
三洋工業	1,600	1,768.00	2,828,800
岡部	24,500	951.00	23,299,500
ジーテクト	13,300	1,494.00	19,870,200
東プレ	22,500	1,721.00	38,722,500
高周波熱錬	23,300	854.00	19,898,200
東京製綱	7,400	1,010.00	7,474,000
サンコール	6,800	507.00	3,447,600
モリテック スチール	9,500	376.00	3,572,000
パイオラックス	19,300	1,849.00	35,685,700
エイチワン	11,900	758.00	9,020,200
日本発條	120,200	816.00	98,083,200
中央発條	1,500	2,921.00	4,381,500
アドバネクス	1,600	1,679.00	2,686,400
立川ブラインド工業	5,300	1,326.00	7,027,800
三益半導体工業	10,800	1,572.00	16,977,600
日本ドライケミカル	3,400	1,104.00	3,753,600
日本製鋼所	36,700	1,774.00	65,105,800
三浦工業	52,300	3,380.00	176,774,000
タクマ	44,200	1,333.00	58,918,600
ツガミ	27,300	873.00	23,832,900
オークマ	15,400	5,390.00	83,006,000
東芝機械	13,700	2,448.00	33,537,600
アマダホールディングス	181,500	1,209.00	219,433,500
アイダエンジニアリング	32,800	809.00	26,535,200
滝澤鉄工所	3,800	1,402.00	5,327,600
F U J I	48,300	1,275.00	61,582,500
牧野フライス製作所	14,200	4,185.00	59,427,000
オーエスジー	59,500	2,052.00	122,094,000
ダイジェット工業	1,500	1,244.00	1,866,000

旭ダイヤモンド工業	32,000	646.00	20,672,000
D M G 森精機	76,500	1,592.00	121,788,000
ソディック	26,400	932.00	24,604,800
ディスコ	16,300	15,910.00	259,333,000
日東工器	6,700	2,159.00	14,465,300
日進工具	3,600	2,075.00	7,470,000
パンチ工業	8,600	526.00	4,523,600
富士ダイス	5,500	563.00	3,096,500
豊和工業	6,900	878.00	6,058,200
O K K	5,200	760.00	3,952,000
東洋機械金属	8,800	590.00	5,192,000
津田駒工業	2,700	1,559.00	4,209,300
島精機製作所	16,700	3,065.00	51,185,500
オプトラン	11,800	2,137.00	25,216,600
N C ホールディングス	4,100	487.00	1,996,700
イワキポンプ	5,200	1,031.00	5,361,200
フリュー	9,700	1,162.00	11,271,400
ヤマシンフィルタ	21,100	629.00	13,271,900
日阪製作所	15,000	868.00	13,020,000
やまびこ	23,500	919.00	21,596,500
平田機工	5,700	5,840.00	33,288,000
ペガサスミシン製造	11,500	553.00	6,359,500
マルマエ	5,100	661.00	3,371,100
タツモ	5,100	759.00	3,870,900
ナプテスコ	66,400	2,865.00	190,236,000
三井海洋開発	12,900	3,035.00	39,151,500
レオン自動機	11,900	1,806.00	21,491,400
S M C	35,700	39,000.00	1,392,300,000
新川	9,100	368.00	3,348,800
ホソカワミクロン	4,300	4,395.00	18,898,500
ユニオンツール	5,300	2,725.00	14,442,500
オイレス工業	17,000	1,553.00	26,401,000
日精エー・エス・ビー機械	4,100	2,525.00	10,352,500
サトーホールディングス	14,600	2,737.00	39,960,200
技研製作所	10,600	3,300.00	34,980,000
日本エアーテック	4,000	570.00	2,280,000
カワタ	3,400	985.00	3,349,000
日精樹脂工業	10,300	931.00	9,589,300
オカダアイヨン	4,200	1,212.00	5,090,400
ワイエイシイホールディングス	4,800	876.00	4,204,800
小松製作所	552,600	2,539.50	1,403,327,700
住友重機械工業	69,900	3,640.00	254,436,000

日立建機	49,000	2,798.00	137,102,000
日工	3,400	2,762.00	9,390,800
巴工業	5,200	2,361.00	12,277,200
井関農機	12,300	1,533.00	18,855,900
TOWA	10,600	770.00	8,162,000
丸山製作所	2,800	1,114.00	3,119,200
北川鉄工所	5,600	2,095.00	11,732,000
ローツェ	5,400	2,156.00	11,642,400
タカキタ	4,400	550.00	2,420,000
クボタ	653,900	1,775.00	1,160,672,500
荏原実業	3,700	2,040.00	7,548,000
三菱化工機	4,300	1,649.00	7,090,700
月島機械	24,300	1,282.00	31,152,600
帝国電機製作所	8,600	1,241.00	10,672,600
新東工業	29,200	936.00	27,331,200
澁谷工業	10,700	2,892.00	30,944,400
アイチ コーポレーション	21,300	671.00	14,292,300
小森コーポレーション	32,900	1,171.00	38,525,900
鶴見製作所	9,600	1,970.00	18,912,000
住友精密工業	2,000	2,783.00	5,566,000
酒井重工業	2,300	2,492.00	5,731,600
荏原製作所	54,200	2,934.00	159,022,800
石井鐵工所	2,000	1,999.00	3,998,000
西島製作所	12,600	1,031.00	12,990,600
北越工業	12,700	1,191.00	15,125,700
ダイキン工業	166,600	13,850.00	2,307,410,000
オルガノ	4,400	3,585.00	15,774,000
トーヨーカネツ	4,700	2,062.00	9,691,400
栗田工業	66,100	2,658.00	175,693,800
椿本チエイン	16,000	3,420.00	54,720,000
大同工業	6,000	852.00	5,112,000
木村化工機	10,700	330.00	3,531,000
アネスト岩田	19,100	963.00	18,393,300
ダイフク	67,200	5,970.00	401,184,000
サムコ	3,500	808.00	2,828,000
加藤製作所	6,300	1,946.00	12,259,800
油研工業	2,200	1,646.00	3,621,200
タダノ	59,100	1,108.00	65,482,800
フジテック	44,400	1,400.00	62,160,000
C K D	34,000	1,028.00	34,952,000
キトー	9,300	1,643.00	15,279,900
平和	34,100	2,244.00	76,520,400

理想科学工業	10,800	1,658.00	17,906,400
SANKYO	30,600	3,960.00	121,176,000
日本金銭機械	13,600	1,097.00	14,919,200
マースグループホールディングス	7,800	2,025.00	15,795,000
福島工業	7,600	3,525.00	26,790,000
オーイズミ	5,400	373.00	2,014,200
ダイコク電機	5,700	1,316.00	7,501,200
竹内製作所	20,500	1,869.00	38,314,500
アマノ	34,900	2,975.00	103,827,500
JUKI	17,000	960.00	16,320,000
蛇の目ミシン工業	11,300	443.00	5,005,900
マックス	18,700	1,521.00	28,442,700
グローリー	33,800	2,827.00	95,552,600
新晃工業	11,400	1,538.00	17,533,200
大和冷機工業	17,700	1,114.00	19,717,800
セガサミーホールディングス	121,100	1,309.00	158,519,900
日本ピストンリング	4,500	1,399.00	6,295,500
リケン	5,700	4,080.00	23,256,000
T P R	16,500	1,802.00	29,733,000
ツバキ・ナカシマ	18,700	1,757.00	32,855,900
ホシザキ	35,700	8,040.00	287,028,000
大豊工業	10,100	831.00	8,393,100
日本精工	250,800	923.00	231,488,400
NTN	262,600	309.00	81,143,400
ジェイテクト	117,100	1,253.00	146,726,300
不二越	11,400	4,300.00	49,020,000
日本トムソン	36,400	471.00	17,144,400
THK	76,100	2,470.00	187,967,000
ユーシン精機	9,500	946.00	8,987,000
前澤給装工業	4,800	1,941.00	9,316,800
イーグル工業	15,200	1,026.00	15,595,200
前澤工業	8,400	356.00	2,990,400
日本ピラー工業	12,400	1,037.00	12,858,800
キッツ	49,600	732.00	36,307,200
マキタ	148,600	3,435.00	510,441,000
日立造船	97,300	388.00	37,752,400
三菱重工業	204,600	4,807.00	983,512,200
I H I	93,800	2,556.00	239,752,800
スター精密	20,900	1,372.00	28,674,800
日清紡ホールディングス	68,000	818.00	55,624,000
イビデン	74,900	1,818.00	136,168,200
コニカミノルタ	267,000	1,049.00	280,083,000

ブラザー工業	159,100	1,985.00	315,813,500
ミネベアミツミ	226,700	1,726.00	391,284,200
日立製作所	549,500	3,905.00	2,145,797,500
三菱電機	1,220,500	1,400.00	1,708,700,000
富士電機	79,200	3,685.00	291,852,000
東洋電機製造	4,900	1,302.00	6,379,800
安川電機	141,500	3,390.00	479,685,000
シンフォニアテクノロジー	17,100	1,191.00	20,366,100
明電舎	24,300	1,656.00	40,240,800
オリジン	3,400	1,408.00	4,787,200
山洋電気	6,000	4,125.00	24,750,000
デンヨー	11,400	1,447.00	16,495,800
東芝テック	15,300	2,982.00	45,624,600
芝浦メカトロニクス	2,300	2,627.00	6,042,100
マブチモーター	33,900	3,685.00	124,921,500
日本電産	146,900	14,265.00	2,095,528,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,900	1,315.00	9,073,500
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,159.00	6,606,300
東光高岳	6,400	1,197.00	7,660,800
ダブル・スコープ	18,000	1,453.00	26,154,000
ダイヘン	13,400	3,060.00	41,004,000
ヤーマン	18,000	881.00	15,858,000
JVCケンウッド	94,600	237.00	22,420,200
ミマキエンジニアリング	11,500	619.00	7,118,500
第一精工	5,300	1,225.00	6,492,500
日新電機	28,700	1,159.00	33,263,300
大崎電気工業	24,500	708.00	17,346,000
オムロン	129,700	5,450.00	706,865,000
日東工業	19,600	1,936.00	37,945,600
I D E C	16,400	1,986.00	32,570,400
正興電機製作所	2,600	790.00	2,054,000
不二電機工業	1,600	1,250.00	2,000,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,000	2,041.00	89,804,000
サクサホールディングス	3,200	1,867.00	5,974,400
メルコホールディングス	5,200	3,060.00	15,912,000
テクノメディカ	2,900	2,163.00	6,272,700
日本電気	157,900	4,080.00	644,232,000
富士通	117,700	7,602.00	894,755,400
沖電気工業	53,000	1,317.00	69,801,000
岩崎通信機	5,700	792.00	4,514,400
電気興業	6,500	3,210.00	20,865,000
サンケン電気	14,300	2,173.00	31,073,900

ナカヨ	2,500	1,592.00	3,980,000
アイホン	7,000	1,668.00	11,676,000
ルネサスエレクトロニクス	128,800	509.00	65,559,200
セイコーエプソン	151,500	1,705.00	258,307,500
ワコム	89,300	352.00	31,433,600
アルバック	24,400	3,335.00	81,374,000
アクセル	5,700	585.00	3,334,500
E I Z O	11,200	3,830.00	42,896,000
日本信号	31,200	1,181.00	36,847,200
京三製作所	26,600	369.00	9,815,400
能美防災	16,300	2,330.00	37,979,000
ホーチキ	8,000	1,330.00	10,640,000
星和電機	7,200	507.00	3,650,400
エレコム	11,700	3,520.00	41,184,000
パナソニック	1,394,400	884.90	1,233,904,560
シャープ	121,200	1,145.00	138,774,000
アンリツ	78,600	1,841.00	144,702,600
富士通ゼネラル	37,400	1,674.00	62,607,600
ソニー	818,900	5,631.00	4,611,225,900
T D K	63,900	7,800.00	498,420,000
帝国通信工業	5,700	1,153.00	6,572,100
タムラ製作所	47,300	556.00	26,298,800
アルプスアルパイン	127,200	1,782.00	226,670,400
池上通信機	3,900	1,126.00	4,391,400
鈴木	7,100	607.00	4,309,700
日本トリム	2,400	5,280.00	12,672,000
ローランド ディー . ジー .	6,400	2,399.00	15,353,600
フォスター電機	13,900	1,502.00	20,877,800
S M K	3,500	2,671.00	9,348,500
ヨコオ	8,800	2,096.00	18,444,800
ホシデン	36,200	1,151.00	41,666,200
ヒロセ電機	17,500	11,840.00	207,200,000
日本航空電子工業	28,100	1,517.00	42,627,700
T O A	13,200	1,293.00	17,067,600
マクセルホールディングス	26,500	1,679.00	44,493,500
古野電気	16,100	990.00	15,939,000
ユニデンホールディングス	3,700	1,828.00	6,763,600
スミダコーポレーション	10,700	1,117.00	11,951,900
アイコム	6,800	2,351.00	15,986,800
リオン	5,700	2,034.00	11,593,800
本多通信工業	11,100	491.00	5,450,100
横河電機	122,200	2,102.00	256,864,400

新電元工業	4,400	3,575.00	15,730,000
アズビル	78,800	2,599.00	204,801,200
東亜ディーケーケー	6,400	848.00	5,427,200
日本光電工業	53,900	2,913.00	157,010,700
チノー	4,300	1,219.00	5,241,700
共和電業	13,100	418.00	5,475,800
日本電子材料	5,100	496.00	2,529,600
堀場製作所	24,200	5,430.00	131,406,000
アドバンテスト	83,200	2,687.00	223,558,400
小野測器	6,100	552.00	3,367,200
エスベック	11,000	2,314.00	25,454,000
キーエンス	59,900	65,440.00	3,919,856,000
日置電機	6,500	3,495.00	22,717,500
シスメックス	95,100	7,289.00	693,183,900
日本マイクロニクス	21,600	925.00	19,980,000
メガチップス	9,900	1,316.00	13,028,400
O B A R A G R O U P	6,400	3,615.00	23,136,000
澤藤電機	1,700	1,662.00	2,825,400
原田工業	5,400	771.00	4,163,400
コーセル	15,800	1,102.00	17,411,600
イリソ電子工業	11,200	5,340.00	59,808,000
オブテックスグループ	21,700	1,304.00	28,296,800
千代田インテグレ	5,300	1,997.00	10,584,100
アイ・オー・データ機器	4,800	986.00	4,732,800
レーザーテック	25,100	4,010.00	100,651,000
スタンレー電気	86,400	2,553.00	220,579,200
岩崎電気	5,000	1,306.00	6,530,000
ウシオ電機	71,100	1,370.00	97,407,000
岡谷電機産業	9,500	372.00	3,534,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	616.00	7,268,800
エノモト	3,800	751.00	2,853,800
日本セラミック	12,500	2,775.00	34,687,500
遠藤照明	6,600	735.00	4,851,000
古河電池	9,200	651.00	5,989,200
双信電機	6,700	510.00	3,417,000
山一電機	9,200	909.00	8,362,800
図研	8,100	1,681.00	13,616,100
日本電子	24,200	2,357.00	57,039,400
カシオ計算機	108,100	1,348.00	145,718,800
ファナック	116,000	19,725.00	2,288,100,000
日本シイエムケイ	31,500	606.00	19,089,000
エンプラス	5,600	3,175.00	17,780,000

大真空	4,800	1,079.00	5,179,200
ローム	58,400	6,720.00	392,448,000
浜松ホトニクス	87,600	4,175.00	365,730,000
三井ハイテック	13,800	1,117.00	15,414,600
新光電気工業	41,300	885.00	36,550,500
京セラ	186,000	6,976.00	1,297,536,000
太陽誘電	54,400	1,855.00	100,912,000
村田製作所	384,200	4,650.00	1,786,530,000
双葉電子工業	20,200	1,380.00	27,876,000
北陸電気工業	4,900	952.00	4,664,800
ニチコン	38,800	831.00	32,242,800
日本ケミコン	8,700	1,495.00	13,006,500
K O A	18,700	1,332.00	24,908,400
市光工業	18,800	668.00	12,558,400
小糸製作所	73,200	5,500.00	402,600,000
ミツバ	23,000	636.00	14,628,000
S C R E E Nホールディングス	21,200	4,115.00	87,238,000
キャノン電子	11,400	1,855.00	21,147,000
キャノン	657,000	3,229.00	2,121,453,000
リコー	367,100	1,090.00	400,139,000
象印マホービン	30,500	1,152.00	35,136,000
M U T O Hホールディングス	1,900	1,700.00	3,230,000
東京エレクトロン	81,400	14,320.00	1,165,648,000
トヨタ紡織	42,700	1,386.00	59,182,200
芦森工業	2,600	1,588.00	4,128,800
ユニプレス	23,700	1,717.00	40,692,900
豊田自動織機	98,800	5,830.00	576,004,000
モリタホールディングス	21,400	1,890.00	40,446,000
三櫻工業	15,700	446.00	7,002,200
デンソー	268,700	4,465.00	1,199,745,500
東海理化電機製作所	32,200	1,731.00	55,738,200
三井E & Sホールディングス	44,100	976.00	43,041,600
川崎重工業	95,000	2,501.00	237,595,000
名村造船所	36,700	301.00	11,046,700
日本車輛製造	4,400	2,528.00	11,123,200
三菱ロジスネクスト	14,500	1,157.00	16,776,500
近畿車輛	1,800	1,767.00	3,180,600
日産自動車	1,439,300	764.30	1,100,056,990
いすゞ自動車	385,800	1,217.00	469,518,600
トヨタ自動車	1,360,000	6,651.00	9,045,360,000
日野自動車	152,400	897.00	136,702,800
三菱自動車工業	451,700	510.00	230,367,000

エフテック	8,600	742.00	6,381,200
レシップホールディングス	4,400	774.00	3,405,600
G M B	2,500	853.00	2,132,500
ファルテック	2,200	792.00	1,742,400
武蔵精密工業	29,700	1,349.00	40,065,300
日産車体	23,800	1,028.00	24,466,400
新明和工業	51,100	1,361.00	69,547,100
極東開発工業	24,300	1,313.00	31,905,900
日信工業	22,400	1,489.00	33,353,600
トピー工業	10,100	2,464.00	24,886,400
ティラド	4,500	1,924.00	8,658,000
タチエス	20,100	1,356.00	27,255,600
N O K	65,700	1,542.00	101,309,400
フタバ産業	34,100	557.00	18,993,700
K Y B	12,700	2,917.00	37,045,900
大同メタル工業	19,900	656.00	13,054,400
プレス工業	60,600	470.00	28,482,000
ミクニ	15,700	377.00	5,918,900
太平洋工業	25,600	1,499.00	38,374,400
ケーヒン	28,100	1,505.00	42,290,500
河西工業	15,100	780.00	11,778,000
アイシン精機	100,500	3,610.00	362,805,000
マツダ	383,000	1,106.50	423,789,500
今仙電機製作所	11,400	920.00	10,488,000
本田技研工業	1,029,500	2,765.50	2,847,082,250
スズキ	223,300	4,947.00	1,104,665,100
S U B A R U	378,900	2,516.00	953,312,400
安永	5,900	1,406.00	8,295,400
ヤマハ発動機	172,400	1,897.00	327,042,800
ショーワ	28,900	1,394.00	40,286,600
T B K	14,700	391.00	5,747,700
エクセディ	16,600	2,120.00	35,192,000
豊田合成	39,400	2,044.00	80,533,600
愛三工業	19,200	665.00	12,768,000
盟和産業	1,900	1,023.00	1,943,700
日本プラスト	9,700	673.00	6,528,100
ヨロズ	11,500	1,326.00	15,249,000
エフ・シー・シー	22,000	2,227.00	48,994,000
シマノ	49,200	16,250.00	799,500,000
テイ・エス テック	28,400	2,838.00	80,599,200
ジャムコ	6,100	2,095.00	12,779,500
テルモ	345,300	3,198.00	1,104,269,400

クリエートメディック	4,100	938.00	3,845,800
日機装	39,400	1,381.00	54,411,400
島津製作所	157,100	2,772.00	435,481,200
JMS	11,300	690.00	7,797,000
長野計器	9,600	748.00	7,180,800
ブイ・テクノロジー	5,700	4,565.00	26,020,500
東京計器	7,800	938.00	7,316,400
愛知時計電機	1,600	4,160.00	6,656,000
インターアクション	6,600	1,373.00	9,061,800
オーバル	12,000	238.00	2,856,000
東京精密	22,100	2,633.00	58,189,300
マニー	16,200	7,000.00	113,400,000
ニコン	212,700	1,546.00	328,834,200
トプコン	65,600	1,323.00	86,788,800
オリンパス	727,200	1,209.00	879,184,800
理研計器	10,800	1,979.00	21,373,200
タムロン	10,800	2,244.00	24,235,200
HOYA	245,700	8,045.00	1,976,656,500
シード	5,200	1,044.00	5,428,800
ノーリツ鋼機	9,600	2,081.00	19,977,600
エー・アンド・デイ	11,200	766.00	8,579,200
朝日インテック	51,800	5,140.00	266,252,000
シチズン時計	133,600	536.00	71,609,600
リズム時計工業	4,200	1,331.00	5,590,200
大研医器	9,700	621.00	6,023,700
メニコン	16,700	3,700.00	61,790,000
シンシア	1,900	580.00	1,102,000
松風	6,000	1,378.00	8,268,000
セイコーホールディングス	18,800	2,174.00	40,871,200
ニプロ	84,500	1,172.00	99,034,000
中本パックス	3,400	1,468.00	4,991,200
スノーピーク	4,700	1,444.00	6,786,800
パラマウントベッドホールディングス	14,000	4,165.00	58,310,000
トランザクション	7,800	861.00	6,715,800
SHO-BI	3,600	365.00	1,314,000
ニホンフラッシュ	5,200	2,503.00	13,015,600
前田工織	13,400	1,955.00	26,197,000
永大産業	16,000	333.00	5,328,000
アートネイチャー	13,000	633.00	8,229,000
バンダイナムコホールディングス	126,200	5,220.00	658,764,000
アイフィスジャパン	2,700	645.00	1,741,500
共立印刷	20,300	178.00	3,613,400

SHOEI	5,900	4,350.00	25,665,000	
フランスベッドホールディングス	17,300	968.00	16,746,400	
パイロットコーポレーション	21,300	4,095.00	87,223,500	
萩原工業	6,800	1,333.00	9,064,400	
トッパン・フォームズ	26,100	860.00	22,446,000	
フジシールインターナショナル	27,400	3,265.00	89,461,000	
タカラトミー	51,100	1,310.00	66,941,000	
廣済堂	11,300	669.00	7,559,700	
エステールホールディングス	3,300	611.00	2,016,300	
アーク	46,600	101.00	4,706,600	
タカノ	4,800	784.00	3,763,200	
プロネクサス	10,500	1,125.00	11,812,500	
ホクシン	7,500	129.00	967,500	
ウッドワン	4,100	968.00	3,968,800	
大建工業	9,200	2,190.00	20,148,000	
凸版印刷	172,300	1,658.00	285,673,400	
大日本印刷	172,000	2,339.00	402,308,000	
図書印刷	11,400	1,326.00	15,116,400	
共同印刷	3,800	2,754.00	10,465,200	
NISSHA	25,000	1,093.00	27,325,000	
光村印刷	1,100	2,048.00	2,252,800	
宝印刷	5,900	1,613.00	9,516,700	
アシックス	115,100	1,171.00	134,782,100	
ツツミ	3,800	1,873.00	7,117,400	
小松ウオール工業	3,700	1,792.00	6,630,400	
ヤマハ	72,600	5,130.00	372,438,000	
河合楽器製作所	3,800	3,105.00	11,799,000	
クリナップ	11,300	548.00	6,192,400	
ピジョン	73,800	4,325.00	319,185,000	
兼松サステック	800	1,640.00	1,312,000	
キングジム	10,100	849.00	8,574,900	
リンテック	29,000	2,217.00	64,293,000	
イトーキ	22,500	447.00	10,057,500	
任天堂	69,800	38,150.00	2,662,870,000	
三菱鉛筆	20,100	1,793.00	36,039,300	
タカラスタANDARD	25,200	1,679.00	42,310,800	
コクヨ	58,500	1,498.00	87,633,000	
ナカバヤシ	12,000	532.00	6,384,000	
グローブライド	5,900	3,630.00	21,417,000	
オカムラ	42,600	1,040.00	44,304,000	
美津濃	12,100	2,439.00	29,511,900	
東京電力ホールディングス	974,200	562.00	547,500,400	

中部電力	373,400	1,516.00	566,074,400
関西電力	498,000	1,217.50	606,315,000
中国電力	168,700	1,370.00	231,119,000
北陸電力	119,500	780.00	93,210,000
東北電力	285,800	1,076.00	307,520,800
四国電力	109,900	984.00	108,141,600
九州電力	251,500	1,058.00	266,087,000
北海道電力	114,200	602.00	68,748,400
沖縄電力	22,600	1,655.00	37,403,000
電源開発	97,100	2,424.00	235,370,400
エフオン	5,700	796.00	4,537,200
イーレックス	21,200	1,124.00	23,828,800
レノバ	20,000	800.00	16,000,000
東京瓦斯	239,400	2,553.00	611,188,200
大阪瓦斯	236,800	1,890.00	447,552,000
東邦瓦斯	60,400	4,020.00	242,808,000
北海道瓦斯	6,600	1,445.00	9,537,000
広島ガス	25,100	333.00	8,358,300
西部瓦斯	13,700	2,080.00	28,496,000
静岡ガス	37,500	804.00	30,150,000
メタウォーター	5,900	3,350.00	19,765,000
SBSホールディングス	12,000	1,525.00	18,300,000
東武鉄道	128,700	3,140.00	404,118,000
相鉄ホールディングス	41,800	2,992.00	125,065,600
東京急行電鉄	331,500	1,943.00	644,104,500
京浜急行電鉄	167,200	1,860.00	310,992,000
小田急電鉄	195,500	2,684.00	524,722,000
京王電鉄	68,200	7,360.00	501,952,000
京成電鉄	91,500	3,980.00	364,170,000
富士急行	16,600	4,000.00	66,400,000
新京成電鉄	3,100	2,035.00	6,308,500
東日本旅客鉄道	217,000	10,090.00	2,189,530,000
西日本旅客鉄道	109,400	8,746.00	956,812,400
東海旅客鉄道	109,300	21,950.00	2,399,135,000
西武ホールディングス	151,200	1,800.00	272,160,000
鴻池運輸	19,400	1,700.00	32,980,000
西日本鉄道	33,800	2,303.00	77,841,400
ハマキョウレックス	9,400	3,750.00	35,250,000
サカイ引越センター	6,400	6,480.00	41,472,000
近鉄グループホールディングス	115,600	5,220.00	603,432,000
阪急阪神ホールディングス	154,200	3,810.00	587,502,000
南海電気鉄道	51,600	2,657.00	137,101,200

京阪ホールディングス	51,500	4,760.00	245,140,000
神戸電鉄	3,000	3,955.00	11,865,000
名古屋鉄道	94,900	3,040.00	288,496,000
山陽電気鉄道	8,900	2,093.00	18,627,700
日本通運	44,600	5,610.00	250,206,000
ヤマトホールディングス	202,600	2,196.50	445,010,900
山九	32,100	5,620.00	180,402,000
丸運	6,600	279.00	1,841,400
丸全昭和運輸	9,400	3,430.00	32,242,000
センコーグループホールディングス	63,700	858.00	54,654,600
トナミホールディングス	2,800	5,580.00	15,624,000
ニッコンホールディングス	44,000	2,511.00	110,484,000
日本石油輸送	1,400	2,806.00	3,928,400
福山通運	14,800	3,830.00	56,684,000
セイノーホールディングス	86,600	1,396.00	120,893,600
エスライン	3,500	977.00	3,419,500
神奈川中央交通	2,900	3,765.00	10,918,500
日立物流	25,400	3,470.00	88,138,000
丸和運輸機関	6,100	4,985.00	30,408,500
C & F ロジホールディングス	11,700	1,301.00	15,221,700
九州旅客鉄道	97,000	3,235.00	313,795,000
S Gホールディングス	109,200	3,100.00	338,520,000
日本郵船	97,100	1,670.00	162,157,000
商船三井	68,900	2,472.00	170,320,800
川崎汽船	35,600	1,251.00	44,535,600
N S ユナイテッド海運	6,700	2,195.00	14,706,500
飯野海運	56,800	350.00	19,880,000
共栄タンカー	1,500	1,446.00	2,169,000
乾汽船	10,400	838.00	8,715,200
日本航空	211,600	3,443.00	728,538,800
A N Aホールディングス	211,300	3,545.00	749,058,500
パスコ	2,200	806.00	1,773,200
トランコム	3,200	6,200.00	19,840,000
日新	10,000	1,772.00	17,720,000
三菱倉庫	40,000	3,070.00	122,800,000
三井倉庫ホールディングス	14,100	1,518.00	21,403,800
住友倉庫	42,600	1,353.00	57,637,800
澁澤倉庫	6,300	1,714.00	10,798,200
東陽倉庫	20,900	327.00	6,834,300
日本トランスシティ	25,400	474.00	12,039,600
ケイヒン	2,200	1,202.00	2,644,400
中央倉庫	7,000	1,032.00	7,224,000

川西倉庫	2,300	1,044.00	2,401,200
安田倉庫	9,500	865.00	8,217,500
ファイズ	2,000	724.00	1,448,000
東洋埠頭	3,500	1,363.00	4,770,500
宇徳	9,900	490.00	4,851,000
上組	71,300	2,527.00	180,175,100
サンリツ	2,700	638.00	1,722,600
キムラユニティー	3,100	1,071.00	3,320,100
キューソー流通システム	2,900	1,972.00	5,718,800
近鉄エクスプレス	21,800	1,395.00	30,411,000
東海運	6,600	256.00	1,689,600
エーアイティー	7,500	959.00	7,192,500
内外トランスライン	3,600	1,186.00	4,269,600
日本コンセプト	4,200	1,273.00	5,346,600
NEC ネットエスアイ	13,300	2,811.00	37,386,300
クロスキャット	3,400	935.00	3,179,000
システナ	42,800	1,806.00	77,296,800
デジタルアーツ	6,400	10,220.00	65,408,000
日鉄ソリューションズ	18,000	3,435.00	61,830,000
キューブシステム	6,600	790.00	5,214,000
エイジア	2,500	1,192.00	2,980,000
コア	5,200	1,614.00	8,392,800
ソリトンシステムズ	7,000	966.00	6,762,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,400	1,520.00	8,208,000
T I S	40,000	5,490.00	219,600,000
ネオス	4,800	802.00	3,849,600
電算システム	4,600	3,420.00	15,732,000
グリー	83,000	506.00	41,998,000
コーエーテクモホールディングス	24,600	1,970.00	48,462,000
三菱総合研究所	5,200	3,365.00	17,498,000
電算	1,400	2,012.00	2,816,800
A G S	7,100	702.00	4,984,200
ファインデックス	10,300	855.00	8,806,500
ブレインパッド	2,300	6,480.00	14,904,000
K L a b	21,500	904.00	19,436,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,100	1,144.00	18,418,400
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,254.00	4,508,000
ネクソン	305,600	1,564.00	477,958,400
アイスタイル	31,000	714.00	22,134,000
エムアップ	4,200	2,586.00	10,861,200
エイチーム	8,400	1,178.00	9,895,200
エニグモ	4,300	2,513.00	10,805,900

テクノスジャパン	10,400	566.00	5,886,400
コロプラ	39,500	661.00	26,109,500
ブロードリーフ	59,700	542.00	32,357,400
クロス・マーケティンググループ	5,000	359.00	1,795,000
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,076.00	6,025,600
システム情報	6,300	913.00	5,751,900
メディアドゥホールディングス	3,800	3,040.00	11,552,000
じげん	17,200	777.00	13,364,400
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	832.00	1,497,600
サイバーリンクス	2,000	1,139.00	2,278,000
フィックスターズ	12,800	1,970.00	25,216,000
CARTA HOLDINGS	5,900	1,355.00	7,994,500
オブティム	5,300	3,525.00	18,682,500
セレス	4,000	2,030.00	8,120,000
ティーガイア	12,100	1,975.00	23,897,500
セック	2,000	3,310.00	6,620,000
日本アジアグループ	12,600	341.00	4,296,600
豆蔵ホールディングス	8,300	1,290.00	10,707,000
テクマトリックス	8,500	2,069.00	17,586,500
プロシップ	3,600	1,159.00	4,172,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	289,200	301.00	87,049,200
GMOペイメントゲートウェイ	19,700	7,280.00	143,416,000
ザッパラス	6,800	365.00	2,482,000
システムリサーチ	1,700	3,660.00	6,222,000
インターネットイニシアティブ	19,600	2,045.00	40,082,000
さくらインターネット	14,700	504.00	7,408,800
ヴィンクス	4,200	1,195.00	5,019,000
GMOクラウド	2,700	3,005.00	8,113,500
SRAホールディングス	6,400	2,697.00	17,260,800
Minor iソリューションズ	2,500	1,902.00	4,755,000
システムインテグレータ	3,700	665.00	2,460,500
朝日ネット	10,100	706.00	7,130,600
eBASE	7,300	1,079.00	7,876,700
アバント	4,400	2,138.00	9,407,200
アドソル日進	4,400	1,562.00	6,872,800
フリービット	7,300	1,295.00	9,453,500
コムチュア	6,800	4,160.00	28,288,000
サイバーコム	2,200	1,980.00	4,356,000
アステリア	8,200	1,051.00	8,618,200
マークラインズ	5,600	1,854.00	10,382,400
メディカル・データ・ビジョン	10,800	1,245.00	13,446,000
ショーケース	3,000	524.00	1,572,000

モバイルファクトリー	3,500	1,422.00	4,977,000
テラスカイ	2,000	1,469.00	2,938,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,400	1,781.00	9,617,400
P C Iホールディングス	2,500	2,012.00	5,030,000
パイブドHD	2,000	1,248.00	2,496,000
アイビーシー	2,300	1,319.00	3,033,700
ネオジャパン	2,500	887.00	2,217,500
P R T I M E S	1,100	3,005.00	3,305,500
ランドコンピュータ	2,000	1,140.00	2,280,000
ダブルスタンダード	1,100	4,370.00	4,807,000
オープンドア	6,000	2,773.00	16,638,000
マイネット	4,100	710.00	2,911,000
アカツキ	4,300	5,660.00	24,338,000
ベネフィットジャパン	1,100	847.00	931,700
U b i c o mホールディングス	2,300	1,704.00	3,919,200
L I N E	36,500	3,035.00	110,777,500
カナミックネットワーク	2,500	2,347.00	5,867,500
ノムラシステムコーポレーション	1,600	734.00	1,174,400
チェンジ	2,400	2,469.00	5,925,600
シンクロ・フード	5,400	571.00	3,083,400
オークネット	6,400	1,305.00	8,352,000
エイトレッド	1,400	1,912.00	2,676,800
A O I T Y O H o l d i n g s	13,300	752.00	10,001,600
マクロミル	21,400	1,237.00	26,471,800
ビーグリー	3,300	812.00	2,679,600
オロ	3,200	2,457.00	7,862,400
テモナ	2,000	453.00	906,000
ソルクシーズ	5,400	862.00	4,654,800
フェイス	5,000	982.00	4,910,000
プロトコーポレーション	5,500	2,004.00	11,022,000
ハイマックス	1,500	1,727.00	2,590,500
野村総合研究所	76,200	5,360.00	408,432,000
サイバネットシステム	10,000	617.00	6,170,000
C Eホールディングス	3,700	940.00	3,478,000
日本システム技術	2,100	1,811.00	3,803,100
インテージホールディングス	15,500	978.00	15,159,000
東邦システムサイエンス	3,800	935.00	3,553,000
ソースネクスト	46,900	397.00	18,619,300
インフォコム	13,200	2,417.00	31,904,400
F I G	11,300	309.00	3,491,700
アルテリア・ネットワークス	13,400	1,215.00	16,281,000

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,904.00	5,331,200
フォーカスシステムズ	8,300	844.00	7,005,200
クレスコ	3,700	3,330.00	12,321,000
フジ・メディア・ホールディングス	124,400	1,493.00	185,729,200
オービック	41,500	12,770.00	529,955,000
ジャストシステム	17,100	3,535.00	60,448,500
TDCソフト	10,700	866.00	9,266,200
ヤフー	781,500	317.00	247,735,500
トレンドマイクロ	63,900	4,910.00	313,749,000
IDホールディングス	4,800	1,156.00	5,548,800
日本オラクル	24,300	7,690.00	186,867,000
アルファシステムズ	3,800	2,809.00	10,674,200
フューチャー	16,400	2,111.00	34,620,400
CAC Holdings	8,700	1,529.00	13,302,300
ソフトバンク・テクノロジー	5,200	2,375.00	12,350,000
トーセ	3,500	837.00	2,929,500
オービックビジネスコンサルタント	12,300	5,030.00	61,869,000
伊藤忠テクノソリューションズ	54,600	2,824.00	154,190,400
アイティフォー	14,700	826.00	12,142,200
東計電算	1,800	3,090.00	5,562,000
エクスネット	2,400	902.00	2,164,800
大塚商会	64,800	4,465.00	289,332,000
サイボウズ	14,200	1,383.00	19,638,600
ソフトブレーン	9,800	503.00	4,929,400
電通国際情報サービス	7,500	3,520.00	26,400,000
デジタルガレージ	23,400	3,400.00	79,560,000
EMシステムズ	9,900	1,653.00	16,364,700
ウェザーニューズ	4,100	3,340.00	13,694,000
C I J	9,600	1,007.00	9,667,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,300	2,034.00	2,644,200
日本エンタープライズ	13,600	166.00	2,257,600
WOWOW	5,800	2,680.00	15,544,000
スカラ	8,600	923.00	7,937,800
インテリジェント ウェイブ	4,800	867.00	4,161,600
I M A G I C A G R O U P	10,500	615.00	6,457,500
ネットワンシステムズ	42,400	3,155.00	133,772,000
システムソフト	30,500	92.00	2,806,000
アルゴグラフィックス	10,300	2,330.00	23,999,000
マーベラス	18,500	825.00	15,262,500
エイベックス	20,700	1,393.00	28,835,100
日本ユニシス	37,500	3,725.00	139,687,500
兼松エレクトロニクス	6,600	2,984.00	19,694,400

東京放送ホールディングス	79,600	1,834.00	145,986,400
日本テレビホールディングス	110,100	1,568.00	172,636,800
朝日放送グループホールディングス	12,200	723.00	8,820,600
テレビ朝日ホールディングス	33,000	1,728.00	57,024,000
スカパーJ S A Tホールディングス	91,900	426.00	39,149,400
テレビ東京ホールディングス	9,900	2,348.00	23,245,200
日本BS放送	4,200	1,064.00	4,468,800
ビジョン	3,800	4,805.00	18,259,000
スマートバリュー	3,800	681.00	2,587,800
ワイヤレスゲート	5,700	514.00	2,929,800
コネクシオ	8,600	1,341.00	11,532,600
クロップス	2,500	612.00	1,530,000
日本電信電話	819,100	4,993.00	4,089,766,300
K D D I	1,055,400	2,765.00	2,918,181,000
ソフトバンク	1,269,800	1,415.50	1,797,401,900
光通信	14,100	23,440.00	330,504,000
N T T ドコモ	758,300	2,518.50	1,909,778,550
エムティーアイ	11,900	777.00	9,246,300
G M O インターネット	43,700	1,927.00	84,209,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	590.00	1,711,000
カドカワ	35,100	1,461.00	51,281,100
学研ホールディングス	4,100	4,990.00	20,459,000
ゼンリン	24,000	1,940.00	46,560,000
昭文社	6,100	349.00	2,128,900
インプレスホールディングス	9,900	136.00	1,346,400
アイネット	6,900	1,180.00	8,142,000
松竹	7,900	12,430.00	98,197,000
東宝	78,800	4,785.00	377,058,000
東映	5,100	15,020.00	76,602,000
エヌ・ティ・ティ・データ	319,000	1,424.00	454,256,000
ピー・シー・エー	1,600	3,335.00	5,336,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,200	2,206.00	4,853,200
D T S	13,400	4,545.00	60,903,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,800	3,365.00	187,767,000
シーイーシー	12,900	2,418.00	31,192,200
カブコン	51,400	2,080.00	106,912,000
アイ・エス・ビー	2,500	1,633.00	4,082,500
ジャステック	7,200	960.00	6,912,000
S C S K	31,600	5,330.00	168,428,000
日本システムウエア	4,000	2,659.00	10,636,000
アイネス	15,400	1,159.00	17,848,600
T K C	10,200	4,715.00	48,093,000

富士ソフト	17,900	4,725.00	84,577,500
N S D	19,700	3,170.00	62,449,000
コナミホールディングス	49,000	5,090.00	249,410,000
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,509.00	10,036,000
J B C Cホールディングス	9,600	1,450.00	13,920,000
ミロク情報サービス	11,900	3,390.00	40,341,000
ソフトバンクグループ	1,001,000	5,099.00	5,104,099,000
ハウスイ	1,000	840.00	840,000
高千穂交易	4,600	977.00	4,494,200
伊藤忠食品	3,000	4,770.00	14,310,000
エレマテック	11,200	987.00	11,054,400
J A L U X	3,400	2,795.00	9,503,000
あらた	8,900	3,680.00	32,752,000
トーメンデバイス	1,800	2,272.00	4,089,600
東京エレクトロン デバイス	4,400	1,907.00	8,390,800
フィールズ	10,500	513.00	5,386,500
双日	663,900	348.00	231,037,200
アルフレッサ ホールディングス	133,600	2,663.00	355,776,800
横浜冷凍	33,700	986.00	33,228,200
神栄	1,700	764.00	1,298,800
ラサ商事	6,400	795.00	5,088,000
ラクーンホールディングス	5,800	638.00	3,700,400
アルコニックス	12,800	1,415.00	18,112,000
神戸物産	18,100	5,430.00	98,283,000
あい ホールディングス	17,200	1,751.00	30,117,200
ディーブイエックス	4,700	808.00	3,797,600
ダイワボウホールディングス	11,000	4,985.00	54,835,000
マクニカ・富士エレホールディングス	33,300	1,380.00	45,954,000
ラクト・ジャパン	5,200	3,615.00	18,798,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,600	1,026.00	23,187,600
八洲電機	9,300	856.00	7,960,800
メディアスホールディングス	6,800	721.00	4,902,800
レスターホールディングス	13,200	1,507.00	19,892,400
ジューテックホールディングス	2,800	959.00	2,685,200
大光	5,100	620.00	3,162,000
O C H Iホールディングス	3,500	1,211.00	4,238,500
T O K A Iホールディングス	63,500	895.00	56,832,500
黒谷	2,800	442.00	1,237,600
C o m i n i x	2,100	805.00	1,690,500
三洋貿易	6,100	2,372.00	14,469,200
ビューティガレージ	1,900	1,546.00	2,937,400
ウイン・パートナーズ	7,800	1,141.00	8,899,800

ミタチ産業	3,600	713.00	2,566,800	
シップヘルスケアホールディングス	25,000	4,715.00	117,875,000	
明治電機工業	3,800	1,414.00	5,373,200	
デリカフーズホールディングス	2,100	1,463.00	3,072,300	
スターティアホールディングス	2,400	517.00	1,240,800	
コメダホールディングス	27,800	2,025.00	56,295,000	
富士興産	4,700	948.00	4,455,600	
協栄産業	1,500	1,414.00	2,121,000	
小野建	10,800	1,390.00	15,012,000	
南陽	2,500	1,505.00	3,762,500	
佐島電機	8,900	862.00	7,671,800	
エコートレーディング	2,800	529.00	1,481,200	
伯東	8,200	1,201.00	9,848,200	
コンドーテック	9,300	941.00	8,751,300	
中山福	6,900	561.00	3,870,900	
ナガイレーベン	17,400	2,377.00	41,359,800	
三菱食品	13,200	2,785.00	36,762,000	
松田産業	8,800	1,506.00	13,252,800	
第一興商	17,900	5,020.00	89,858,000	
メディバルホールディングス	129,700	2,354.00	305,313,800	
S P K	2,600	2,387.00	6,206,200	
萩原電気ホールディングス	4,400	2,772.00	12,196,800	
アズワン	8,600	9,440.00	81,184,000	
スズデン	4,200	1,348.00	5,661,600	
尾家産業	3,900	1,325.00	5,167,500	
シモジマ	7,400	1,118.00	8,273,200	
ドウシシャ	11,300	1,740.00	19,662,000	
小津産業	2,600	1,661.00	4,318,600	
高速	7,200	1,156.00	8,323,200	
たけびし	4,200	1,354.00	5,686,800	
リックス	2,700	1,453.00	3,923,100	
丸文	10,700	557.00	5,959,900	
ハピネット	10,000	1,322.00	13,220,000	
橋本総業ホールディングス	2,400	1,554.00	3,729,600	
日本ライフライン	37,700	1,706.00	64,316,200	
タカショー	5,900	457.00	2,696,300	
エクセル	4,500	1,557.00	7,006,500	
マルカ	3,900	1,931.00	7,530,900	
I D O M	40,600	294.00	11,936,400	
日本エム・ディ・エム	7,000	1,431.00	10,017,000	
進和	7,100	2,184.00	15,506,400	
エスケイジャパン	2,900	511.00	1,481,900	

ダイترون	5,500	1,181.00	6,495,500
シークス	15,300	1,260.00	19,278,000
田中商事	4,100	596.00	2,443,600
オーハシテクニカ	6,800	1,428.00	9,710,400
白銅	3,900	1,337.00	5,214,300
伊藤忠商事	840,700	2,074.50	1,744,032,150
丸紅	1,185,300	725.60	860,053,680
高島	1,900	1,674.00	3,180,600
長瀬産業	67,600	1,603.00	108,362,800
蝶理	7,700	1,717.00	13,220,900
豊田通商	134,200	3,305.00	443,531,000
三共生興	20,500	526.00	10,783,000
兼松	48,000	1,211.00	58,128,000
ツカモトコーポレーション	2,200	1,053.00	2,316,600
三井物産	990,200	1,755.50	1,738,296,100
日本紙パルプ商事	6,800	3,605.00	24,514,000
日立ハイテクノロジーズ	36,500	5,510.00	201,115,000
カメイ	15,700	1,116.00	17,521,200
東都水産	1,700	2,595.00	4,411,500
OUGホールディングス	1,900	2,642.00	5,019,800
スターゼン	4,400	4,200.00	18,480,000
山善	47,000	1,050.00	49,350,000
椿本興業	2,700	3,225.00	8,707,500
住友商事	710,900	1,611.50	1,145,615,350
内田洋行	5,100	3,470.00	17,697,000
三菱商事	843,500	2,860.00	2,412,410,000
第一実業	5,500	3,035.00	16,692,500
キャノンマーケティングジャパン	34,400	2,353.00	80,943,200
西華産業	6,800	1,320.00	8,976,000
佐藤商事	10,800	889.00	9,601,200
菱洋エレクトロ	12,200	1,742.00	21,252,400
東京産業	12,000	484.00	5,808,000
ユアサ商事	12,300	2,985.00	36,715,500
神鋼商事	2,700	2,301.00	6,212,700
小林産業	7,200	322.00	2,318,400
阪和興業	20,900	2,839.00	59,335,100
正栄食品工業	8,400	3,275.00	27,510,000
カナデン	10,900	1,337.00	14,573,300
菱電商事	9,500	1,645.00	15,627,500
フルサト工業	6,600	1,419.00	9,365,400
岩谷産業	26,700	3,720.00	99,324,000
すてきナイスグループ	5,200	535.00	2,782,000

昭光通商	4,300	639.00	2,747,700
ニチモウ	1,900	1,730.00	3,287,000
極東貿易	3,700	1,461.00	5,405,700
イワキ	14,400	505.00	7,272,000
三愛石油	32,300	1,021.00	32,978,300
稲畑産業	28,900	1,361.00	39,332,900
G S I クレオス	3,200	1,185.00	3,792,000
明和産業	11,100	370.00	4,107,000
クワザワ	4,300	443.00	1,904,900
ワキタ	25,600	1,036.00	26,521,600
東邦ホールディングス	35,600	2,446.00	87,077,600
サンゲツ	35,700	2,065.00	73,720,500
ミツウロコグループホールディングス	16,000	806.00	12,896,000
シナネンホールディングス	5,000	1,831.00	9,155,000
伊藤忠エネクス	26,600	862.00	22,929,200
サンリオ	37,100	2,428.00	90,078,800
サンワテクノス	7,300	842.00	6,146,600
リョーサン	13,300	2,478.00	32,957,400
新光商事	11,300	1,864.00	21,063,200
トーホー	5,400	2,048.00	11,059,200
三信電気	8,300	1,784.00	14,807,200
東陽テクニカ	13,900	940.00	13,066,000
モスフードサービス	15,800	2,353.00	37,177,400
加賀電子	12,000	1,516.00	18,192,000
ソーダニッカ	12,400	591.00	7,328,400
立花エレテック	8,900	1,753.00	15,601,700
フォーバル	5,300	901.00	4,775,300
P A L T A C	21,700	5,770.00	125,209,000
三谷産業	14,100	279.00	3,933,900
西本Wismettacホールディングス	2,700	3,465.00	9,355,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,191.00	1,191,000
国際紙パルプ商事	28,100	279.00	7,839,900
ヤマタネ	6,000	1,332.00	7,992,000
丸紅建材リース	1,200	1,688.00	2,025,600
日鉄物産	8,600	4,395.00	37,797,000
泉州電業	4,000	2,734.00	10,936,000
トラスコ中山	25,000	2,288.00	57,200,000
オートバックスセブン	47,800	1,783.00	85,227,400
モリト	8,800	766.00	6,740,800
加藤産業	18,800	3,330.00	62,604,000
北恵	2,300	868.00	1,996,400
イノテック	7,200	847.00	6,098,400

イエローハット	22,700	1,457.00	33,073,900
J Kホールディングス	10,900	569.00	6,202,100
日伝	10,000	1,919.00	19,190,000
北沢産業	9,100	263.00	2,393,300
杉本商事	6,500	2,036.00	13,234,000
因幡電機産業	17,100	4,450.00	76,095,000
東テク	4,000	2,246.00	8,984,000
ミスミグループ本社	150,500	2,625.00	395,062,500
アルテック	8,900	213.00	1,895,700
タキヒヨー	3,600	1,867.00	6,721,200
蔵王産業	2,000	1,342.00	2,684,000
スズケン	54,800	6,450.00	353,460,000
ジェコス	8,300	958.00	7,951,400
ルネサスイーストン	11,100	454.00	5,039,400
ローソン	30,400	5,190.00	157,776,000
サンエー	9,100	4,385.00	39,903,500
カワチ薬品	9,400	1,948.00	18,311,200
エービーシー・マート	18,800	7,030.00	132,164,000
ハードオフコーポレーション	4,900	680.00	3,332,000
アスクル	12,600	2,449.00	30,857,400
ゲオホールディングス	18,400	1,393.00	25,631,200
アダストリア	16,700	2,407.00	40,196,900
ジーフット	7,500	646.00	4,845,000
くら寿司	7,100	4,540.00	32,234,000
キャンドゥ	5,800	1,623.00	9,413,400
パルグループホールディングス	6,200	3,210.00	19,902,000
エディオン	51,100	954.00	48,749,400
サーラコーポレーション	24,600	582.00	14,317,200
ワッツ	5,500	681.00	3,745,500
ハローズ	4,600	2,334.00	10,736,400
フジオフードシステム	5,100	2,712.00	13,831,200
あみやき亭	2,600	3,375.00	8,775,000
ひらまつ	24,300	348.00	8,456,400
大黒天物産	2,900	3,365.00	9,758,500
ハニーズホールディングス	10,700	1,032.00	11,042,400
ファーマライズホールディングス	3,000	510.00	1,530,000
アルペン	9,300	1,560.00	14,508,000
ハブ	3,900	1,215.00	4,738,500
クオールホールディングス	17,800	1,599.00	28,462,200
ジーンズ	6,400	5,960.00	38,144,000
ビックカメラ	71,400	1,080.00	77,112,000
D C Mホールディングス	64,900	1,057.00	68,599,300

ペッパーフードサービス	9,600	1,837.00	17,635,200
Monotaro	76,000	2,595.00	197,220,000
東京一番フーズ	3,300	604.00	1,993,200
DDホールディングス	2,700	2,168.00	5,853,600
きちりホールディングス	3,400	712.00	2,420,800
アークランドサービスホールディングス	8,800	1,850.00	16,280,000
J.フロント リテイリング	153,900	1,222.00	188,065,800
ドトール・日レスホールディングス	21,200	2,053.00	43,523,600
マツモトキヨシホールディングス	49,700	3,080.00	153,076,000
ブロンコビリー	6,300	2,205.00	13,891,500
ZOZO	130,000	1,945.00	252,850,000
トレジャー・ファクトリー	3,700	851.00	3,148,700
物語コーポレーション	3,000	8,270.00	24,810,000
ココカラファイン	13,500	5,550.00	74,925,000
三越伊勢丹ホールディングス	225,000	872.00	196,200,000
Hamee	3,900	722.00	2,815,800
ウエルシアホールディングス	31,800	4,290.00	136,422,000
クリエイトSDホールディングス	17,800	2,480.00	44,144,000
丸善CHIホールディングス	14,000	385.00	5,390,000
ティーライフ	1,800	905.00	1,629,000
エー・ピーカンパニー	2,500	465.00	1,162,500
チムニー	3,700	2,380.00	8,806,000
シュッピン	8,300	815.00	6,764,500
ネクステージ	19,400	1,140.00	22,116,000
ジョイフル本田	35,300	1,232.00	43,489,600
鳥貴族	4,000	2,132.00	8,528,000
麒麟堂ホールディングス	4,800	1,660.00	7,968,000
ホットランド	6,400	1,548.00	9,907,200
すかいらーくホールディングス	112,100	1,891.00	211,981,100
SFPホールディングス	5,200	1,775.00	9,230,000
綿半ホールディングス	4,500	2,475.00	11,137,500
ヨシックス	2,000	2,389.00	4,778,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,100	947.00	33,239,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,000	648.00	3,240,000
BEE NOS	4,300	1,689.00	7,262,700
あさひ	10,000	1,223.00	12,230,000
日本調剤	4,300	3,450.00	14,835,000
コスモス薬品	5,300	17,860.00	94,658,000
トーエル	6,000	737.00	4,422,000
オンリー	2,200	811.00	1,784,200
セブン&アイ・ホールディングス	503,800	3,634.00	1,830,809,200
薬王堂	5,300	2,339.00	12,396,700

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,400	1,352.00	43,804,800
ツルハホールディングス	26,100	9,780.00	255,258,000
サンマルクホールディングス	9,500	2,313.00	21,973,500
フェリシモ	2,800	1,012.00	2,833,600
トリドールホールディングス	14,900	1,981.00	29,516,900
T O K Y O B A S E	10,900	795.00	8,665,500
ウイルプラスホールディングス	2,000	812.00	1,624,000
ジャパンミート	6,100	1,731.00	10,559,100
サツドラホールディングス	1,900	1,870.00	3,553,000
デファクトスタンダード	1,400	345.00	483,000
アレンザホールディングス	6,600	851.00	5,616,600
パロックジャパンリミテッド	9,900	872.00	8,632,800
クスリのアオキホールディングス	12,000	7,410.00	88,920,000
力の源ホールディングス	4,700	711.00	3,341,700
スシローグローバルホールディングス	13,200	6,380.00	84,216,000
L I X I L ビバ	10,300	1,151.00	11,855,300
メディカルシステムネットワーク	13,000	503.00	6,539,000
はるやまホールディングス	5,800	821.00	4,761,800
ノジマ	21,400	1,716.00	36,722,400
カッパ・クリエイト	16,900	1,357.00	22,933,300
ライトオン	9,200	726.00	6,679,200
良品計画	17,000	18,840.00	320,280,000
三城ホールディングス	15,200	333.00	5,061,600
アドヴァン	18,500	1,056.00	19,536,000
アルビス	4,600	2,296.00	10,561,600
コナカ	14,500	417.00	6,046,500
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,635.00	2,616,000
G - 7ホールディングス	3,600	2,997.00	10,789,200
イオン北海道	12,300	735.00	9,040,500
コジマ	20,900	491.00	10,261,900
ヒマラヤ	4,400	850.00	3,740,000
コーナン商事	15,800	2,224.00	35,139,200
エコス	4,500	1,388.00	6,246,000
ワタミ	15,900	1,429.00	22,721,100
マルシェ	3,300	774.00	2,554,200
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	72,000	6,790.00	488,880,000
西松屋チェーン	26,500	825.00	21,862,500
ゼンショーホールディングス	56,800	2,142.00	121,665,600
幸楽苑ホールディングス	7,700	2,771.00	21,336,700
ハークスレイ	2,600	1,079.00	2,805,400
サイゼリヤ	19,900	2,371.00	47,182,900

V Tホールディングス	54,600	420.00	22,932,000
魚力	3,400	1,491.00	5,069,400
フジ・コーポレーション	3,200	2,064.00	6,604,800
ユナイテッドアローズ	13,800	3,265.00	45,057,000
ハイデイ日高	17,400	1,968.00	34,243,200
京都きもの友禅	8,000	349.00	2,792,000
コロワイド	40,000	2,018.00	80,720,000
ピーシーデポコーポレーション	16,300	427.00	6,960,100
巻番屋	8,500	4,700.00	39,950,000
P L A N T	3,200	802.00	2,566,400
スギホールディングス	26,400	5,090.00	134,376,000
スクロール	18,800	333.00	6,260,400
ヨンドシーホールディングス	13,400	2,486.00	33,312,400
ユニー・ファミリーマートホールディングス	134,500	2,635.00	354,407,500
木曽路	14,800	2,523.00	37,340,400
S R Sホールディングス	14,300	991.00	14,171,300
タカキュー	10,000	171.00	1,710,000
ケーヨー	22,500	472.00	10,620,000
上新電機	14,200	2,090.00	29,678,000
日本瓦斯	19,600	2,714.00	53,194,400
ロイヤルホールディングス	21,000	2,662.00	55,902,000
いなげや	13,500	1,366.00	18,441,000
島忠	25,500	2,417.00	61,633,500
チヨダ	12,700	1,592.00	20,218,400
ライフコーポレーション	9,200	2,112.00	19,430,400
リンガーハット	14,900	2,250.00	33,525,000
M r M a x H D	16,800	448.00	7,526,400
テンアライド	11,100	413.00	4,584,300
A O K Iホールディングス	24,200	1,068.00	25,845,600
オークワ	17,300	1,115.00	19,289,500
コメリ	18,600	2,212.00	41,143,200
青山商事	21,100	2,046.00	43,170,600
しまむら	14,000	7,840.00	109,760,000
はせがわ	6,700	402.00	2,693,400
高島屋	94,400	1,112.00	104,972,800
松屋	24,400	854.00	20,837,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,800	1,200.00	74,160,000
近鉄百貨店	4,600	3,210.00	14,766,000
パルコ	11,700	1,086.00	12,706,200
丸井グループ	101,800	2,231.00	227,115,800
アクシアル リテイリング	10,000	3,655.00	36,550,000
イオン	462,600	1,846.50	854,190,900

イズミ	24,500	4,315.00	105,717,500
平和堂	24,500	1,885.00	46,182,500
フジ	14,600	1,774.00	25,900,400
ヤオコー	13,700	4,880.00	66,856,000
ゼビオホールディングス	14,600	1,222.00	17,841,200
ケーズホールディングス	125,000	1,030.00	128,750,000
Olympicグループ	7,300	669.00	4,883,700
日産東京販売ホールディングス	18,100	277.00	5,013,700
Genky DrugStores	5,900	2,438.00	14,384,200
総合メディカルホールディングス	10,500	1,671.00	17,545,500
ブックオフグループホールディングス	6,200	1,098.00	6,807,600
アインホールディングス	16,100	6,090.00	98,049,000
元気寿司	3,400	3,170.00	10,778,000
ヤマダ電機	366,400	485.00	177,704,000
アークランドサカモト	20,500	1,325.00	27,162,500
ニトリホールディングス	52,000	13,720.00	713,440,000
グルメ杵屋	8,700	1,137.00	9,891,900
愛眼	9,600	242.00	2,323,200
ケーユーホールディングス	6,400	873.00	5,587,200
吉野家ホールディングス	42,000	1,826.00	76,692,000
松屋フーズホールディングス	5,800	3,300.00	19,140,000
サガミホールディングス	16,200	1,320.00	21,384,000
関西スーパーマーケット	9,200	1,093.00	10,055,600
王将フードサービス	8,800	6,470.00	56,936,000
プレナス	13,500	1,761.00	23,773,500
ミニストップ	9,000	1,559.00	14,031,000
アークス	22,600	2,123.00	47,979,800
パローホールディングス	26,000	2,199.00	57,174,000
ベルク	6,000	5,280.00	31,680,000
大庄	6,500	1,558.00	10,127,000
ファーストリテイリング	16,100	66,090.00	1,064,049,000
サンドラッグ	45,300	2,824.00	127,927,200
サックスパーホールディングス	10,300	966.00	9,949,800
ヤマザワ	2,600	1,644.00	4,274,400
やまや	2,100	2,080.00	4,368,000
ベルーナ	29,600	720.00	21,312,000
島根銀行	3,800	711.00	2,701,800
じもとホールディングス	81,300	97.00	7,886,100
めぶきフィナンシャルグループ	628,500	272.00	170,952,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,800	1,630.00	27,384,000
九州フィナンシャルグループ	199,400	425.00	84,745,000
ゆうちょ銀行	341,800	1,087.00	371,536,600

富山第一銀行	31,400	305.00	9,577,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	757,100	395.00	299,054,500
西日本フィナンシャルホールディングス	76,800	754.00	57,907,200
関西みらいフィナンシャルグループ	57,700	700.00	40,390,000
三十三フィナンシャルグループ	11,000	1,485.00	16,335,000
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	2,741.00	58,109,200
新生銀行	88,300	1,658.00	146,401,400
あおぞら銀行	67,200	2,585.00	173,712,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,285,800	503.70	4,173,557,460
りそなホールディングス	1,320,900	441.10	582,648,990
三井住友トラスト・ホールディングス	236,600	3,875.00	916,825,000
三井住友フィナンシャルグループ	848,400	3,752.00	3,183,196,800
千葉銀行	415,600	533.00	221,514,800
群馬銀行	242,900	377.00	91,573,300
武蔵野銀行	18,300	2,035.00	37,240,500
千葉興業銀行	36,400	270.00	9,828,000
筑波銀行	50,000	172.00	8,600,000
七十七銀行	38,300	1,517.00	58,101,100
青森銀行	9,600	2,652.00	25,459,200
秋田銀行	8,100	1,979.00	16,029,900
山形銀行	14,000	1,615.00	22,610,000
岩手銀行	8,700	2,884.00	25,090,800
東邦銀行	107,600	261.00	28,083,600
東北銀行	6,100	1,068.00	6,514,800
みちのく銀行	7,700	1,648.00	12,689,600
ふくおかフィナンシャルグループ	106,500	1,921.00	204,586,500
静岡銀行	304,000	783.00	238,032,000
十六銀行	16,500	2,146.00	35,409,000
八十二銀行	292,300	438.00	128,027,400
山梨中央銀行	15,100	1,173.00	17,712,300
大垣共立銀行	25,700	2,368.00	60,857,600
福井銀行	10,800	1,446.00	15,616,800
北國銀行	12,700	3,060.00	38,862,000
清水銀行	5,400	1,854.00	10,011,600
富山銀行	2,600	2,666.00	6,931,600
滋賀銀行	24,500	2,458.00	60,221,000
南都銀行	19,100	2,248.00	42,936,800
百五銀行	110,800	326.00	36,120,800
京都銀行	43,300	4,040.00	174,932,000
紀陽銀行	43,200	1,394.00	60,220,800
ほくほくフィナンシャルグループ	80,800	1,096.00	88,556,800
広島銀行	179,200	514.00	92,108,800

山陰合同銀行	72,500	688.00	49,880,000
中国銀行	104,400	956.00	99,806,400
鳥取銀行	4,700	1,428.00	6,711,600
伊予銀行	161,000	543.00	87,423,000
百十四銀行	13,200	2,124.00	28,036,800
四国銀行	17,900	912.00	16,324,800
阿波銀行	18,700	2,549.00	47,666,300
大分銀行	7,600	3,120.00	23,712,000
宮崎銀行	8,300	2,460.00	20,418,000
佐賀銀行	7,800	1,523.00	11,879,400
沖縄銀行	11,300	3,310.00	37,403,000
琉球銀行	28,500	1,148.00	32,718,000
セブン銀行	409,600	285.00	116,736,000
みずほフィナンシャルグループ	16,355,900	153.80	2,515,537,420
高知銀行	4,400	764.00	3,361,600
山口フィナンシャルグループ	151,300	726.00	109,843,800
長野銀行	4,500	1,750.00	7,875,000
名古屋銀行	10,000	3,380.00	33,800,000
北洋銀行	184,600	252.00	46,519,200
愛知銀行	4,600	3,595.00	16,537,000
中京銀行	5,300	2,219.00	11,760,700
大光銀行	4,600	1,677.00	7,714,200
愛媛銀行	17,600	1,068.00	18,796,800
トマト銀行	5,500	1,035.00	5,692,500
京葉銀行	54,400	615.00	33,456,000
栃木銀行	66,900	175.00	11,707,500
北日本銀行	4,200	1,664.00	6,988,800
東和銀行	21,100	688.00	14,516,800
福島銀行	10,500	255.00	2,677,500
大東銀行	5,800	561.00	3,253,800
トモニホールディングス	95,400	364.00	34,725,600
フィデアホールディングス	116,900	115.00	13,443,500
池田泉州ホールディングス	131,700	198.00	26,076,600
F P G	37,900	871.00	33,010,900
マーキュリアインベストメント	4,800	733.00	3,518,400
S B Iホールディングス	143,500	2,677.00	384,149,500
ジャフコ	19,800	3,910.00	77,418,000
大和証券グループ本社	966,100	472.00	455,999,200
野村ホールディングス	2,118,300	373.50	791,185,050
岡三証券グループ	102,900	392.00	40,336,800
丸三証券	36,000	562.00	20,232,000
東洋証券	44,000	118.00	5,192,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	143,900	323.00	46,479,700
光世証券	3,100	666.00	2,064,600
水戸証券	35,400	191.00	6,761,400
いちよし証券	25,400	723.00	18,364,200
松井証券	59,100	1,004.00	59,336,400
だいこう証券ビジネス	5,200	478.00	2,485,600
マネックスグループ	111,400	361.00	40,215,400
極東証券	16,300	886.00	14,441,800
岩井コスモホールディングス	12,400	1,163.00	14,421,200
藍澤証券	21,800	639.00	13,930,200
マネーパートナーズグループ	14,500	286.00	4,147,000
スパークス・グループ	48,200	228.00	10,989,600
かんぽ生命保険	45,500	2,007.00	91,318,500
S O M P Oホールディングス	212,200	4,135.00	877,447,000
アニコム ホールディングス	9,900	3,850.00	38,115,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	314,700	3,447.00	1,084,770,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	98,900	2,627.00	259,810,300
第一生命ホールディングス	681,000	1,585.50	1,079,725,500
東京海上ホールディングス	430,400	5,422.00	2,333,628,800
T & Dホールディングス	372,300	1,142.00	425,166,600
アドバンスクリエイト	2,800	1,749.00	4,897,200
全国保証	33,900	4,040.00	136,956,000
ジェイリース	3,300	312.00	1,029,600
イントラスト	3,400	507.00	1,723,800
日本モーゲージサービス	2,200	1,135.00	2,497,000
C a s a	5,400	1,089.00	5,880,600
アルヒ	10,900	2,070.00	22,563,000
プレミアグループ	6,900	1,971.00	13,599,900
クレディセゾン	84,300	1,252.00	105,543,600
芙蓉総合リース	13,800	5,980.00	82,524,000
興銀リース	22,600	2,667.00	60,274,200
東京センチュリー	24,200	4,450.00	107,690,000
日本証券金融	53,000	546.00	28,938,000
アイフル	183,600	213.00	39,106,800
リコーリース	9,500	3,310.00	31,445,000
イオンフィナンシャルサービス	76,900	1,690.00	129,961,000
アコム	241,900	371.00	89,744,900
ジャックス	13,300	2,018.00	26,839,400
オリエントコーポレーション	325,600	111.00	36,141,600
日立キャピタル	28,400	2,359.00	66,995,600
アプラスフィナンシャル	57,800	69.00	3,988,200
オリックス	803,000	1,587.00	1,274,361,000

三菱UFJリース	271,500	582.00	158,013,000
九州リースサービス	5,900	603.00	3,557,700
日本取引所グループ	325,200	1,718.00	558,693,600
イー・ギャランティ	11,300	1,325.00	14,972,500
アサックス	5,000	561.00	2,805,000
NECキャピタルソリューション	4,900	1,794.00	8,790,600
いちご	156,100	317.00	49,483,700
日本駐車場開発	138,000	170.00	23,460,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,400	1,543.00	9,875,200
ヒューリック	252,400	890.00	224,636,000
三栄建築設計	5,600	1,545.00	8,652,000
野村不動産ホールディングス	80,600	2,325.00	187,395,000
三重交通グループホールディングス	26,200	578.00	15,143,600
サムティ	17,400	1,647.00	28,657,800
ディア・ライフ	18,300	443.00	8,106,900
コーセーアールイー	5,200	774.00	4,024,800
エー・ディー・ワークス	185,500	34.00	6,307,000
日本商業開発	8,300	1,443.00	11,976,900
プレサンスコーポレーション	19,800	1,503.00	29,759,400
ユニゾホールディングス	18,700	1,843.00	34,464,100
日本管理センター	9,000	1,178.00	10,602,000
サンセイランディック	4,900	749.00	3,670,100
エストラスト	1,600	716.00	1,145,600
フージャースホールディングス	26,200	606.00	15,877,200
オープンハウス	17,700	4,525.00	80,092,500
東急不動産ホールディングス	325,400	603.00	196,216,200
飯田グループホールディングス	101,000	1,740.00	175,740,000
イーランド	3,600	684.00	2,462,400
ムゲンエステート	10,500	583.00	6,121,500
ファーストブラザーズ	4,400	982.00	4,320,800
ハウズドゥ	6,600	1,548.00	10,216,800
シーアールイー	4,200	1,027.00	4,313,400
ケイアイスター不動産	4,100	1,626.00	6,666,600
グッドコムアセット	3,600	1,426.00	5,133,600
ジェイ・エス・ビー	900	4,065.00	3,658,500
テンポイノベーション	2,200	1,522.00	3,348,400
パーク24	70,800	2,461.00	174,238,800
パラカ	3,700	2,020.00	7,474,000
三井不動産	639,000	2,638.00	1,685,682,000
三菱地所	843,700	2,053.50	1,732,537,950
平和不動産	23,200	2,228.00	51,689,600
東京建物	132,400	1,238.00	163,911,200

ダイビル	36,500	1,005.00	36,682,500
京阪神ビルディング	22,400	992.00	22,220,800
住友不動産	270,800	3,945.00	1,068,306,000
テオオーシー	29,200	648.00	18,921,600
東京楽天地	2,000	5,130.00	10,260,000
スターツコーポレーション	16,800	2,578.00	43,310,400
フジ住宅	16,800	714.00	11,995,200
空港施設	16,400	510.00	8,364,000
明和地所	8,900	551.00	4,903,900
ゴールドクレスト	10,100	1,909.00	19,280,900
日本エスリード	5,500	1,590.00	8,745,000
日神不動産	20,400	463.00	9,445,200
日本エスコン	23,400	665.00	15,561,000
タカラレーベン	57,800	382.00	22,079,600
サンヨーハウジング名古屋	8,100	899.00	7,281,900
イオンモール	61,000	1,628.00	99,308,000
毎日コムネット	4,200	715.00	3,003,000
ファースト住建	5,500	1,190.00	6,545,000
カチタス	13,700	4,010.00	54,937,000
トーセイ	17,800	982.00	17,479,600
穴吹興産	1,700	2,957.00	5,026,900
サンフロンティア不動産	17,700	1,026.00	18,160,200
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	1,111.00	12,998,700
インテリックス	5,100	661.00	3,371,100
ランドビジネス	5,100	784.00	3,998,400
グランディハウス	13,200	471.00	6,217,200
日本空港ビルデング	38,600	4,565.00	176,209,000
日本工営	7,900	2,405.00	18,999,500
LIFULL	40,900	472.00	19,304,800
ジェイエシーリクルートメント	9,400	2,504.00	23,537,600
日本M&Aセンター	87,000	2,617.00	227,679,000
メンバーズ	4,000	1,938.00	7,752,000
中広	1,500	583.00	874,500
アイティメディア	2,600	550.00	1,430,000
タケエイ	12,200	913.00	11,138,600
E・Jホールディングス	1,600	1,063.00	1,700,800
トラスト・テック	6,500	3,175.00	20,637,500
コシダカホールディングス	28,200	1,488.00	41,961,600
アルトナー	3,000	794.00	2,382,000
パソナグループ	14,300	1,546.00	22,107,800
CDS	3,000	1,336.00	4,008,000
リンクアンドモチベーション	21,700	587.00	12,737,900

G C A	12,000	716.00	8,592,000
エス・エム・エス	42,900	2,583.00	110,810,700
サニーサイドアップ	1,300	2,127.00	2,765,100
パーソルホールディングス	116,600	2,530.00	294,998,000
リニカル	6,700	984.00	6,592,800
クックパッド	37,100	299.00	11,092,900
エスクリ	3,400	757.00	2,573,800
アイ・ケイ・ケイ	5,900	707.00	4,171,300
学情	4,800	1,251.00	6,004,800
スタジオアリス	5,900	2,054.00	12,118,600
シミックホールディングス	6,500	1,995.00	12,967,500
N J S	2,600	1,746.00	4,539,600
総合警備保障	46,400	5,110.00	237,104,000
カカクコム	87,400	2,001.00	174,887,400
アイロムグループ	4,400	1,510.00	6,644,000
セントケア・ホールディング	8,800	460.00	4,048,000
サイネックス	2,200	625.00	1,375,000
ルネサンス	6,600	1,770.00	11,682,000
ディップ	18,900	1,772.00	33,490,800
オプトホールディング	7,200	1,644.00	11,836,800
ツクイ	27,700	511.00	14,154,700
キャリアデザインセンター	3,000	1,587.00	4,761,000
ベネフィット・ワン	32,400	1,885.00	61,074,000
エムスリー	245,600	1,977.00	485,551,200
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	600.00	4,560,000
プラス	1,500	670.00	1,005,000
アウトソーシング	61,600	1,290.00	79,464,000
ウェルネット	11,200	993.00	11,121,600
ワールドホールディングス	3,300	1,729.00	5,705,700
ディー・エヌ・エー	62,900	2,104.00	132,341,600
博報堂D Yホールディングス	162,200	1,826.00	296,177,200
ぐるなび	16,800	672.00	11,289,600
タカミヤ	12,200	782.00	9,540,400
ジャパンベストレスキューシステム	7,900	1,502.00	11,865,800
ファンコミュニケーションズ	32,300	552.00	17,829,600
ライク	4,700	1,340.00	6,298,000
ビジネス・ブレークスルー	5,300	357.00	1,892,100
W D Bホールディングス	5,400	2,721.00	14,693,400
ティア	7,000	631.00	4,417,000
C D G	1,200	1,360.00	1,632,000
バリューコマース	7,900	2,502.00	19,765,800
インフォマート	64,000	1,764.00	112,896,000

J Pホールディングス	33,800	289.00	9,768,200
エコナックホールディングス	22,200	123.00	2,730,600
E P Sホールディングス	17,600	1,675.00	29,480,000
レッグス	3,000	1,733.00	5,199,000
プレステージ・インターナショナル	21,900	1,731.00	37,908,900
アミューズ	7,100	2,444.00	17,352,400
ドリームインキュベータ	3,600	1,447.00	5,209,200
クイック	7,300	1,599.00	11,672,700
T A C	7,000	193.00	1,351,000
ケネディクス	102,700	529.00	54,328,300
電通	142,100	3,785.00	537,848,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,068.00	4,912,800
ぴあ	3,400	4,860.00	16,524,000
イオンファンタジー	3,800	2,198.00	8,352,400
シーティーエス	13,400	665.00	8,911,000
ネクシィーズグループ	4,100	2,212.00	9,069,200
みらかホールディングス	32,700	2,521.00	82,436,700
アルプス技研	10,300	1,842.00	18,972,600
ダイオーズ	2,800	1,375.00	3,850,000
日本空調サービス	13,400	696.00	9,326,400
オリエンタルランド	137,800	13,470.00	1,856,166,000
ダスキン	30,000	2,875.00	86,250,000
明光ネットワークジャパン	13,800	949.00	13,096,200
ファルコホールディングス	6,500	1,705.00	11,082,500
ラウンドワン	36,200	1,375.00	49,775,000
リゾートトラスト	49,400	1,644.00	81,213,600
ビー・エム・エル	15,100	3,145.00	47,489,500
ワタベウェディング	2,100	594.00	1,247,400
りらいあコミュニケーションズ	21,200	1,262.00	26,754,400
リソー教育	59,500	459.00	27,310,500
早稲田アカデミー	3,500	767.00	2,684,500
ユー・エス・エス	142,500	2,149.00	306,232,500
東京個別指導学院	4,300	910.00	3,913,000
サイバーエージェント	67,100	3,730.00	250,283,000
楽天	543,700	1,282.00	697,023,400
クリーク・アンド・リバー社	7,000	1,199.00	8,393,000
テー・オー・ダブリュー	10,400	799.00	8,309,600
山田コンサルティンググループ	5,700	2,041.00	11,633,700
セントラルスポーツ	4,400	3,125.00	13,750,000
フルキャストホールディングス	11,700	2,351.00	27,506,700
エン・ジャパン	17,000	4,115.00	69,955,000
リソルホールディングス	1,300	3,815.00	4,959,500

テクノプロ・ホールディングス	23,400	5,870.00	137,358,000
アトラ	2,800	275.00	770,000
インターワークス	2,500	679.00	1,697,500
アイ・アールジャパンホールディングス	4,800	2,624.00	12,595,200
K e e P e r 技研	4,400	1,289.00	5,671,600
ファーストロジック	2,900	618.00	1,792,200
三機サービス	2,500	1,204.00	3,010,000
G u n o s y	8,200	1,763.00	14,456,600
デザインワン・ジャパン	2,800	296.00	828,800
イー・ガーディアン	6,000	1,799.00	10,794,000
リブセンス	6,900	249.00	1,718,100
ジャパンマテリアル	32,000	1,413.00	45,216,000
ベクトル	14,300	1,002.00	14,328,600
ウチヤマホールディングス	6,000	534.00	3,204,000
チャーム・ケア・コーポレーション	3,800	1,657.00	6,296,600
ライクキッズネクスト	2,900	959.00	2,781,100
キャリアリンク	4,600	442.00	2,033,200
I B J	8,000	947.00	7,576,000
アサンテ	4,700	2,119.00	9,959,300
N・フィールド	7,700	701.00	5,397,700
バリューHR	2,600	3,345.00	8,697,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,200	6,460.00	27,132,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	1,199.00	5,875,100
E R Iホールディングス	3,400	929.00	3,158,600
アビスト	1,900	2,553.00	4,850,700
シグマクシス	5,700	1,239.00	7,062,300
ウィルグループ	7,700	891.00	6,860,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,600	257.00	4,266,200
日本ビューホテル	3,800	1,367.00	5,194,600
リクルートホールディングス	835,400	3,578.00	2,989,061,200
エラン	8,100	1,833.00	14,847,300
土木管理総合試験所	5,400	476.00	2,570,400
ネットマーケティング	4,400	481.00	2,116,400
日本郵政	955,900	1,207.00	1,153,771,300
ベルシステム24ホールディングス	19,600	1,514.00	29,674,400
鎌倉新書	8,600	1,415.00	12,169,000
ソネット・メディア・ネットワークス	1,600	755.00	1,208,000
一蔵	1,500	661.00	991,500
L I T A L I C O	2,700	1,877.00	5,067,900
グローバルキッズCOMPANY	1,900	964.00	1,831,600
エボラブルアジア	5,100	2,373.00	12,102,300
アトラエ	3,100	2,642.00	8,190,200

ストライク	4,500	2,053.00	9,238,500
ソラスト	28,700	950.00	27,265,000
セラク	3,900	617.00	2,406,300
インソース	4,600	2,466.00	11,343,600
ベikalレント・コンサルティング	8,300	3,925.00	32,577,500
Orchestra Holdings	2,100	1,473.00	3,093,300
アイモバイル	3,800	774.00	2,941,200
キャリアインデックス	4,200	807.00	3,389,400
MS - Japan	4,800	1,513.00	7,262,400
船場	2,000	940.00	1,880,000
グレイステクノロジー	4,200	2,733.00	11,478,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,200	2,731.00	25,125,200
フルテック	1,700	1,150.00	1,955,000
グリーンズ	4,500	1,533.00	6,898,500
ツナググループ・ホールディングス	1,700	575.00	977,500
ソウルドアウト	1,200	2,293.00	2,751,600
MS & Consulting	2,000	1,087.00	2,174,000
日総工産	7,800	1,460.00	11,388,000
キュービーネットホールディングス	7,100	2,193.00	15,570,300
RPAホールディングス	2,400	4,945.00	11,868,000
スプリックス	4,000	1,747.00	6,988,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	697.00	3,345,600
リログループ	63,800	2,828.00	180,426,400
東祥	7,300	2,758.00	20,133,400
エイチ・アイ・エス	20,800	2,668.00	55,494,400
ラックランド	2,400	2,439.00	5,853,600
共立メンテナンス	17,900	5,090.00	91,111,000
イチネンホールディングス	12,200	1,114.00	13,590,800
建設技術研究所	8,100	1,517.00	12,287,700
スペース	7,700	1,219.00	9,386,300
長大	4,800	721.00	3,460,800
燦ホールディングス	2,600	2,386.00	6,203,600
スバル興業	800	6,140.00	4,912,000
東京テアトル	4,700	1,331.00	6,255,700
タナベ経営	2,400	1,194.00	2,865,600
ナガワ	3,300	5,480.00	18,084,000
よみうりランド	2,600	5,100.00	13,260,000
東京都競馬	7,700	3,295.00	25,371,500
カナモト	17,500	2,763.00	48,352,500
東京ドーム	43,700	1,101.00	48,113,700
西尾レントオール	11,900	2,946.00	35,057,400
トランス・コスモス	13,000	2,426.00	31,538,000

乃村工藝社	54,600	1,351.00	73,764,600	
藤田観光	4,700	2,831.00	13,305,700	
KNT-CTホールディングス	6,200	1,382.00	8,568,400	
日本管財	12,600	1,862.00	23,461,200	
トーカイ	11,300	2,304.00	26,035,200	
白洋舎	1,400	2,962.00	4,146,800	
セコム	123,800	9,434.00	1,167,929,200	
セントラル警備保障	5,600	5,250.00	29,400,000	
丹青社	22,100	1,247.00	27,558,700	
メイテック	14,500	5,630.00	81,635,000	
応用地質	12,700	1,034.00	13,131,800	
船井総研ホールディングス	24,200	2,635.00	63,767,000	
進学会ホールディングス	5,500	594.00	3,267,000	
オオバ	9,400	614.00	5,771,600	
いであ	2,500	1,198.00	2,995,000	
学究社	3,900	1,287.00	5,019,300	
ベネッセホールディングス	42,800	2,472.00	105,801,600	
イオンディライト	14,400	3,125.00	45,000,000	
ナック	7,500	959.00	7,192,500	
ニチイ学館	16,700	1,612.00	26,920,400	
ダイセキ	19,600	2,695.00	52,822,000	
ステップ	4,400	1,486.00	6,538,400	
合 計	142,309,000		270,370,053,080	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【日本株式インデックス・オープン（SMA専用）】

【純資産額計算書】

(2019年 7月31日現在)

資産総額	1,692,807,213円
負債総額	680,790円
純資産総額（ - ）	1,692,126,423円
発行済口数	1,573,102,779口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0757円
（1万口当たり純資産額）	（10,757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 7月31日現在)

資産総額	289,464,789,619円
負債総額	2,010,844,651円
純資産総額（ - ）	287,453,944,968円
発行済口数	199,320,879,203口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4422円
（1万口当たり純資産額）	（14,422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。

第二部【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7月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2019年 9月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	520	12,316,102
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	89	366,936
単位型公社債投資信託	4	30,821
合計	613	12,713,859

3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（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。

(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】

	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

当事業年度

(自 2017年4月1日
至 2018年3月31日)(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	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
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	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		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)	
		千円		千円
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 其他有価証券	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 その他有価証券」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	-	82,081

(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の主な原因別の内訳

	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) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 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いません。

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	当事業年度 (自 2018年4月1日

	至 2018年3月31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

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)通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

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

2019年 9月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（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。

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 9月25日	有価証券届出書
2018年 9月25日	有価証券報告書
2019年 3月25日	有価証券届出書
2019年 3月25日	半期報告書

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8月23日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2018年6月26日から2019年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス・オープン（SMA専用）の2019年6月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。