

**【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10月25日提出
【計算期間】	第9期(自 2018年7月26日至 2019年7月25日)
【ファンド名】	インデックスコレクション（国内株式）
【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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

#### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

(1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ

ないファンドをいう。

- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## < ファンドの特色 >

### 東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

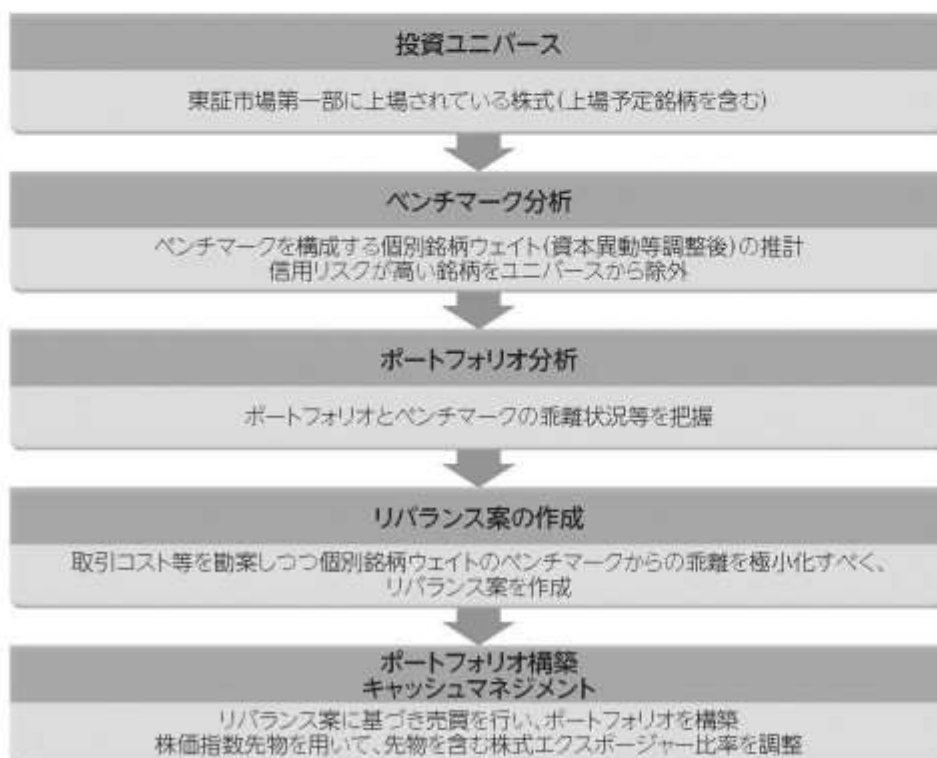
#### TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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。

#### TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

1. 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。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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。
6. 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。
7. 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。
8. 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。

#### 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。

### ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。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。



### 分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

※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。

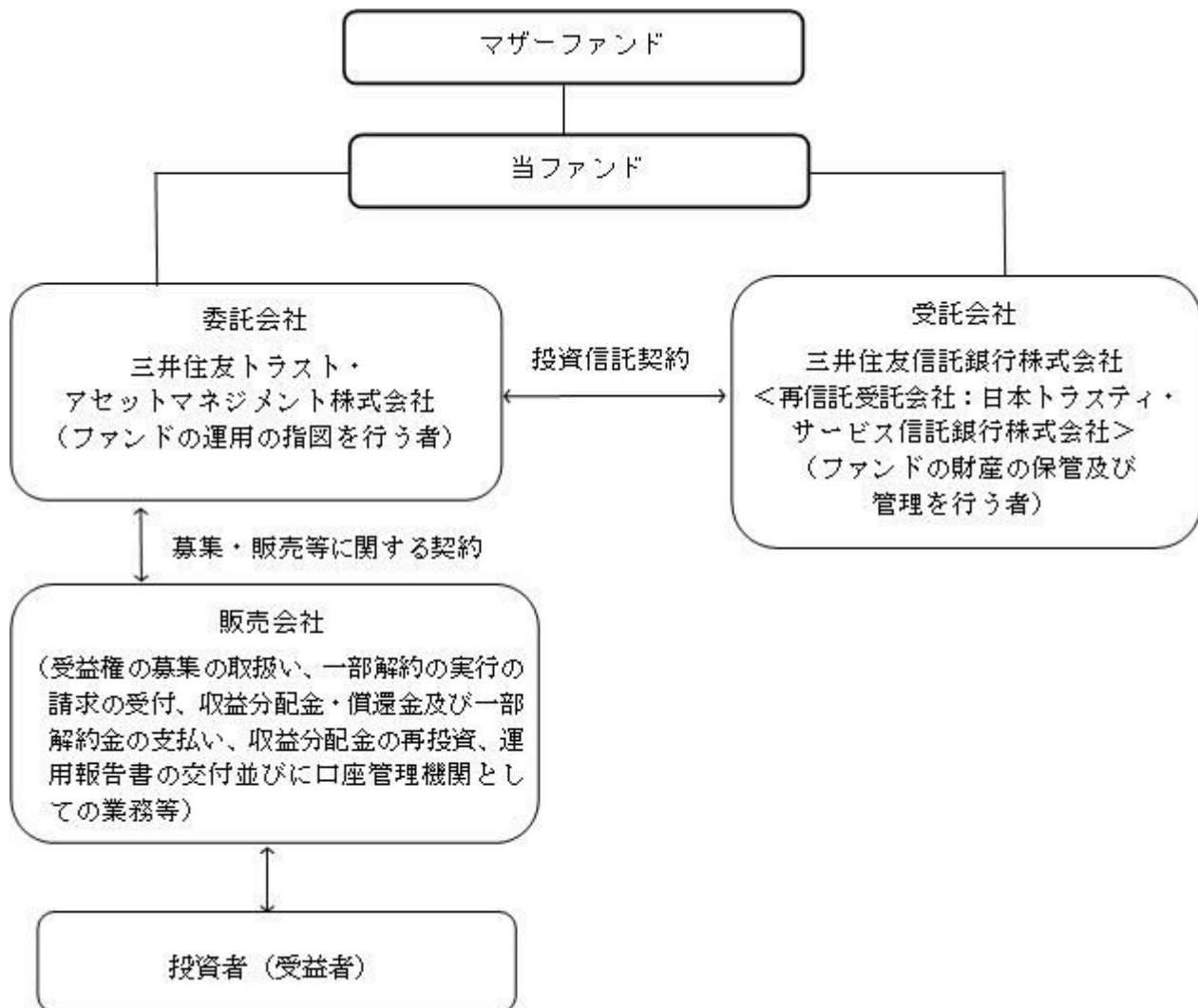
### (2) 【ファンドの沿革】

- 2010年10月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
- 2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継  
当ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（国内株式）からインデックスコレクション（国内株式）に変更  
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式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 8月30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】

#### 運用方針

当ファンドは、主としてわが国の金融商品取引所（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）で**有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。**）に上場されている株式に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- A．株式への実質投資は、原則として東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式への実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- D．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- E．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- F．国内において行われ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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

### （2）【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる**特定資産**（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - 1．有価証券
    - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
    - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
    - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - B．次に掲げる**特定資産以外の資産**
    - 1．為替手形
- 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者と  
し、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」の  
受益証券及び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きます。)(本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図し  
ます。

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

なお、上記1.の証券又は証書並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記1.の証券又は  
証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び  
17.の証券又は証書のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」とい  
い、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法  
第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用

することを指図することができます。

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

#### B．金融商品による運用の特例

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

### （参考）マザーファンドの概要

#### 「日本株式マザーファンド」の概要

##### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### 2．運用方法

###### （1）投資対象

わが国の金融商品取引所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

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためスワップ取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

##### 3．投資制限

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。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

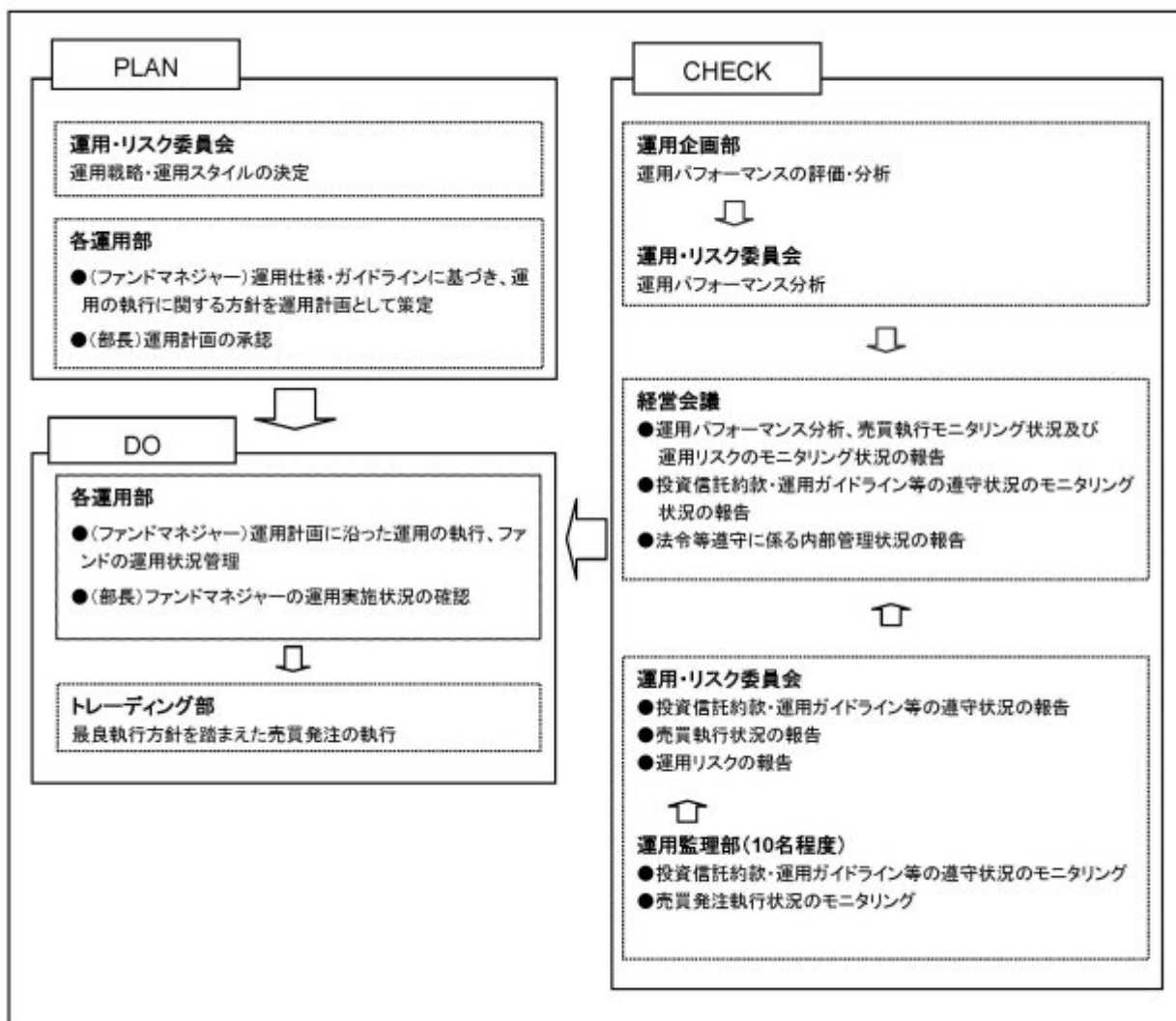
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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。

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

年１回の毎決算時（決算日は７月２５日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A．分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B．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。
- C．収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。  
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 >

- A．株式への投資割合  
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- B．外貨建資産への投資割合  
外貨建資産への投資は行いません。
- C．新株引受権証券等への投資割合  
新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- D．同一銘柄の株式への投資割合  
同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- E．同一銘柄の転換社債等への投資割合  
同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合  
同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- G．投資信託証券への投資割合  
投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- H．投資する株式等の範囲  
イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金

融商品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、金融商品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、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### I．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、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、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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るものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### L．金利先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### M．有価証券の貸付の指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の
- a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
  - a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債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、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 二．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q．再投資の指図
- 委託会社は、上記P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### S．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### T．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）の信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記I．からR．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記I．からR．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

ニ．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

U．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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。

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

#### < 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、配当込み）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。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリ

スクを実質的に負うこととなります。

## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

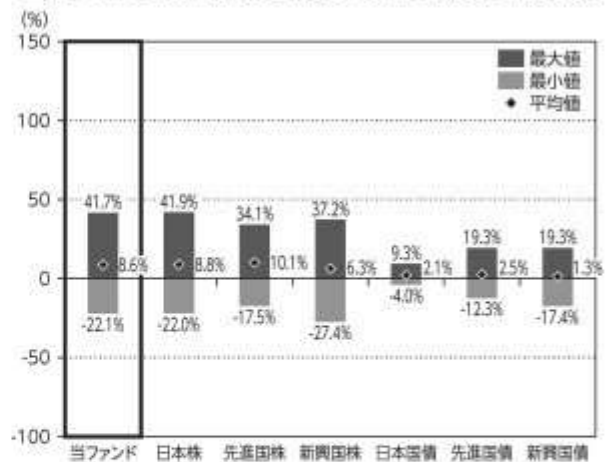
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドの年間騰落率は、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。

\*2014年9月～2019年8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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPSELガンガバント・インド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・デバース・インデックス(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>

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜0.14%）（ ）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 0.099% (税抜 0.09%)	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 0.033% (税抜 0.03%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.022% (税抜 0.02%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

##### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2019年 8月30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8月30日現在の状況について記載してあります。

#### 【インデックスコレクション（国内株式）】

##### （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	18,559,974,694	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,151,220	0.05
合計（純資産総額）		18,569,125,914	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	日本株式マザーファンド	11,491,532,843	1.6833	19,343,697,235	1.6151	18,559,974,694	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2011年 7月25日)	2,242,098,660	2,242,098,660	10,591	10,591
第2期計算期間末	(2012年 7月25日)	2,181,674,909	2,181,674,909	8,866	8,866
第3期計算期間末	(2013年 7月25日)	4,950,385,305	4,950,385,305	15,402	15,402
第4期計算期間末	(2014年 7月25日)	6,251,826,293	6,251,826,293	16,719	16,719
第5期計算期間末	(2015年 7月27日)	10,200,033,831	10,200,033,831	21,740	21,740
第6期計算期間末	(2016年 7月25日)	13,369,082,820	13,369,082,820	17,936	17,936
第7期計算期間末	(2017年 7月25日)	16,262,626,850	16,262,626,850	22,325	22,325
第8期計算期間末	(2018年 7月25日)	19,530,530,250	19,530,530,250	24,692	24,692
第9期計算期間末	(2019年 7月25日)	19,117,989,629	19,117,989,629	22,712	22,712

2018年 8月末日	19,526,670,563		24,440
9月末日	20,500,829,492		25,795
10月末日	18,937,867,386		23,368
11月末日	19,418,378,669		23,674
12月末日	17,541,468,923		21,247
2019年 1月末日	18,550,395,390		22,289
2月末日	19,075,561,911		22,864
3月末日	18,984,228,061		22,880
4月末日	19,065,289,808		23,257
5月末日	18,053,922,660		21,741
6月末日	18,885,022,937		22,332
7月末日	19,023,682,268		22,531
8月末日	18,569,125,914		21,768

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	5.9
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	16.3
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	73.7
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	8.6
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	30.0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	17.5
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	24.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	10.6
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年7月25日	2,143,063,857	26,011,252	2,117,052,605
第2期計算期間	2011年7月26日～2012年7月25日	741,819,458	398,079,618	2,460,792,445
第3期計算期間	2012年7月26日～2013年7月25日	2,497,513,783	1,744,270,721	3,214,035,507
第4期計算期間	2013年7月26日～2014年7月25日	2,209,325,421	1,683,922,165	3,739,438,763
第5期計算期間	2014年7月26日～2015年7月27日	3,196,935,023	2,244,613,052	4,691,760,734
第6期計算期間	2015年7月28日～2016年7月25日	4,461,283,277	1,699,251,185	7,453,792,826
第7期計算期間	2016年7月26日～2017年7月25日	2,054,493,182	2,223,946,014	7,284,339,994
第8期計算期間	2017年7月26日～2018年7月25日	2,213,016,681	1,587,730,357	7,909,626,318
第9期計算期間	2018年7月26日～2019年7月25日	1,929,446,327	1,421,681,154	8,417,391,491

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

#### 日本株式マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	211,870,208,455	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,448,646,805	1.14
合計(純資産総額)		214,318,855,260	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	2,340,500,000	1.09

(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	1,090,500	6,780.53	7,394,172,474	6,960.00	7,589,880,000	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	656,800	5,355.63	3,517,582,528	6,042.00	3,968,385,600	1.85
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	761,900	3,958.29	3,015,827,824	4,824.00	3,675,405,600	1.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,644,100	575.04	3,820,686,680	510.40	3,391,148,640	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	656,800	4,562.00	2,996,325,885	5,096.00	3,347,052,800	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	854,300	4,461.85	3,811,764,909	3,590.00	3,066,937,000	1.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	48,000	54,132.57	2,598,363,533	62,900.00	3,019,200,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	680,200	3,923.43	2,668,719,822	3,484.00	2,369,816,800	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	56,000	33,863.92	1,896,379,662	40,290.00	2,256,240,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	787,200	2,701.91	2,126,947,536	2,835.00	2,231,712,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	669,900	2,876.09	1,926,694,650	3,219.00	2,156,408,100	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	825,500	3,223.95	2,661,371,242	2,523.50	2,083,149,250	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,115,000	176.23	2,311,300,785	154.70	2,028,890,500	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	280,000	3,826.17	1,071,327,670	7,018.00	1,965,040,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	345,100	5,326.53	1,838,188,117	5,472.00	1,888,387,200	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,600	23,375.15	2,047,663,971	21,015.00	1,840,914,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	168,900	8,573.97	1,448,144,022	10,715.00	1,809,763,500	0.84
日本	株式	花王	化学	234,300	7,624.55	1,786,434,265	7,674.00	1,798,018,200	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	174,000	10,062.75	1,750,918,638	10,115.00	1,760,010,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	133,600	11,843.55	1,582,299,153	13,155.00	1,757,508,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	676,300	3,117.29	2,108,226,141	2,585.00	1,748,235,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	93,000	18,222.80	1,694,720,535	18,455.00	1,716,315,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,500	11,150.62	1,232,143,793	15,470.00	1,709,435,000	0.80
日本	株式	HOYA	精密機器	197,000	6,334.47	1,247,891,286	8,649.00	1,703,853,000	0.80
日本	株式	資生堂	化学	194,400	6,300.89	1,224,894,300	8,690.00	1,689,336,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	117,800	12,480.30	1,470,179,788	13,855.00	1,632,119,000	0.76
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	608,100	2,577.29	1,567,250,169	2,682.00	1,630,924,200	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	440,600	3,463.07	1,525,830,730	3,629.00	1,598,937,400	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	404,000	4,768.66	1,926,539,468	3,757.00	1,517,828,000	0.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,018,200	1,365.53	1,390,386,114	1,490.50	1,517,627,100	0.71

(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	2.81
		食料品	4.03
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.17
		医薬品	5.65
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.54
		機械	4.83
		電気機器	13.55
		輸送用機器	7.68
		精密機器	2.16
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.70
		陸運業	4.75
		海運業	0.15
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.97
		卸売業	4.83
		小売業	4.74
		銀行業	5.65
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.26
		その他金融業	1.11
		不動産業	2.53
		サービス業	5.21
	小計	98.86	
合計		98.86	

(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	155	円	2,370,616,500	2,340,500,000	1.09

(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：2010年10月20日

作成基準日：2019年 8月30日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 21,768円

純資産総額 185.69億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年7月	0円
2016年7月	0円
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7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%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.9%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.7%
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	1.6%
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	1.1%
任天堂	日本	株式	その他製品	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)**

※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

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。

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

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「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2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、金融商品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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込み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

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2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口以上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。

#### < 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、拠出することとなります。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

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

##### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）の評価方法  
計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

##### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

(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

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。(2010年10月20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】

当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2010年10月20日から2011年7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30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を



記載した書面決議の通知を發します。

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

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

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

#### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

##### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

##### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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ます。）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。

##### (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ます。）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、委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9期計算期間(2018年7月26日から2019年7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】

## 【インデックスコレクション（国内株式）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2018年 7月25日現在）	第9期 （2019年 7月25日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,324,258	-
コール・ローン	47,166,853	36,655,296
親投資信託受益証券	19,520,801,944	19,108,447,723
未収入金	19,419,819	16,189,866
流動資産合計	19,588,712,874	19,161,292,885
資産合計	19,588,712,874	19,161,292,885
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	41,168,547	26,685,996
未払受託者報酬	2,062,292	2,014,218
未払委託者報酬	14,435,986	14,099,460
未払利息	124	84
その他未払費用	515,675	503,498
流動負債合計	58,182,624	43,303,256
負債合計	58,182,624	43,303,256
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,909,626,318	8,417,391,491
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,620,903,932	10,700,598,138
（分配準備積立金）	3,797,810,814	3,607,981,519
元本等合計	19,530,530,250	19,117,989,629
純資産合計	19,530,530,250	19,117,989,629
負債純資産合計	19,588,712,874	19,161,292,885

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日		自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	
営業収益				
受取利息		29		22
有価証券売買等損益		1,765,795,599		1,519,258,706
営業収益合計		1,765,795,628		1,519,258,684
営業費用				
支払利息		33,535		33,489
受託者報酬		4,002,470		4,081,048
委託者報酬		28,017,191		28,567,189
その他費用		1,001,939		1,022,628
営業費用合計		33,055,135		33,704,354
営業利益又は営業損失（ ）		1,732,740,493		1,552,963,038
経常利益又は経常損失（ ）		1,732,740,493		1,552,963,038
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,732,740,493		1,552,963,038
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（ ）		282,419,770		189,991,857
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,978,286,856		11,620,903,932
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,187,237,649		2,511,506,305
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,187,237,649		2,511,506,305
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,994,941,296		2,068,840,918
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,994,941,296		2,068,840,918
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,620,903,932		10,700,598,138

## (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8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,909,626,318口	8,417,391,491口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4692円 (24,692円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2712円 (22,712円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	第9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <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>370,091,582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>1,080,229,141円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,823,093,118円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,347,490,091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>11,620,903,932円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,909,626,318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>14,692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	370,091,582円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,080,229,141円	収益調整金額	C	7,823,093,118円	分配準備積立金額	D	2,347,490,091円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,620,903,932円	当ファンドの期末残存口数	F	7,909,626,318口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,692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	<b>分配金の計算過程</b> <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>416,421,147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>7,824,452,363円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,191,560,372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>11,432,433,882円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>8,417,391,491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>13,581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	416,421,147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	7,824,452,363円	分配準備積立金額	D	3,191,560,372円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,432,433,882円	当ファンドの期末残存口数	F	8,417,391,491口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,581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	370,091,582円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,080,229,141円																																																											
収益調整金額	C	7,823,093,118円																																																											
分配準備積立金額	D	2,347,490,091円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,620,903,932円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,909,626,318口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,692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	416,421,147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	7,824,452,363円																																																											
分配準備積立金額	D	3,191,560,372円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,432,433,882円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	8,417,391,491口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,581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9期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7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9期 (2019年 7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8期	第9期
	自 2017年 7月26日 至 2018年 7月25日	自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,284,339,994円	7,909,626,318円
期中追加設定元本額	2,213,016,681円	1,929,446,327円
期中一部解約元本額	1,587,730,357円	1,421,681,154円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (2018年 7月25日現在)	第9期 (2019年 7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	1,689,681,657	1,409,686,067
合計	1,689,681,657	1,409,686,067

## （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	日本株式マザーファンド	11,340,998,115	19,108,447,723	
合計		11,340,998,115	19,108,447,723	

(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。

日本株式マザーファンド

### 貸借対照表

	2019年 7月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,825,635,236
株式	220,561,307,530
派生商品評価勘定	37,130,020
未収入金	3,398,290
未収配当金	324,488,494
差入委託証拠金	61,625,830
流動資産合計	222,813,585,400
資産合計	222,813,585,400
負債の部	
流動負債	
前受金	37,137,040
未払金	83,440
未払解約金	169,896,546
未払利息	4,223
その他未払費用	518
流動負債合計	207,121,767
負債合計	207,121,767
純資産の部	
元本等	
元本	132,121,145,523
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	90,485,318,110
元本等合計	222,606,463,633
純資産合計	222,606,463,633
負債純資産合計	222,813,585,400

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 7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 7月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,121,145,523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 1.6849円 (1万口当たり純資産額) (16,849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 7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 7月25日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 7月26日
期首元本額	129,074,910,769円
期中追加設定元本額	14,626,131,754円
期中一部解約元本額	11,579,897,000円
期末元本額	132,121,145,523円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	763,125,282円
D C 日本株式インデックスファンド	337,219,882円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,966,871,423円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,157,255,213円
D C バランスファンド 3 0	2,271,073,347円
D C バランスファンド 5 0	3,341,218,121円
D C バランスファンド 7 0	1,738,229,420円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	623,729,660円
日本株式インデックス e	1,832,744,496円
インデックスコレクション（国内株式）	11,340,998,115円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	7,089,844,624円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,061,326,285円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,561,609,617円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,417,984,330円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,291,813,622円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,672,639,934円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	127,481,985円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,257,699,890円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	135,583,395円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	725,574,041円

区分	2019年 7月25日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,591,192円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	880,417,586円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,379,974,040円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	648,793,863円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,005,079,208円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	903,489,587円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	161,625,610円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,819,573,975円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	49,277,886円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	219,695,790円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,775,759,281円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	87,874,358円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	87,640,685円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	1,233,468,803円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	972,521,351円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	19,497,089円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	465,311,084円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	7,290,425,933円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	128,278,703円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	65,186,884円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,933,163円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	190,678,951円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,027,819円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,957,284,567
合計	2,957,284,567

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2019年 7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	1,872,242,960	-	1,909,380,000	37,137,040
	合計	1,872,242,960	-	1,909,380,000	37,137,040

## (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	4,300	3,060.00	13,158,000	
日本水産	132,400	690.00	91,356,000	
マルハニチロ	19,100	3,135.00	59,878,500	
カネコ種苗	4,000	1,290.00	5,160,000	
サカタのタネ	16,100	3,485.00	56,108,500	
ホクト	11,100	1,846.00	20,490,600	
ホクリヨウ	1,800	611.00	1,099,800	
住石ホールディングス	28,500	133.00	3,790,500	
日鉄鉱業	3,000	4,785.00	14,355,000	
三井松島ホールディングス	5,500	1,307.00	7,188,500	
国際石油開発帝石	531,200	970.50	515,529,600	
石油資源開発	19,000	2,451.00	46,569,000	
K&Oエナジーグループ	6,400	1,463.00	9,363,200	
ヒノキヤグループ	3,700	2,034.00	7,525,800	
ショーボンドホールディングス	18,900	3,765.00	71,158,500	
ミライト・ホールディングス	37,300	1,639.00	61,134,700	
タマホーム	6,400	1,499.00	9,593,600	
サンヨーホームズ	1,900	698.00	1,326,200	
日本アクア	4,200	606.00	2,545,200	
ファーストコーポレーション	4,000	634.00	2,536,000	
ベステラ	2,500	1,358.00	3,395,000	
TATERU	16,100	194.00	3,123,400	
スペースバリューホールディングス	16,100	519.00	8,355,900	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	660.00	1,650,000	
第一カッター興業	1,600	1,762.00	2,819,200	
安藤・間	85,600	769.00	65,826,400	
東急建設	39,500	751.00	29,664,500	

コムシスホールディングス	47,000	2,797.00	131,459,000
ミサワホーム	10,900	1,099.00	11,979,100
ビーアールホールディングス	14,400	347.00	4,996,800
高松コンストラクショングループ	8,500	2,270.00	19,295,000
東建コーポレーション	4,200	6,280.00	26,376,000
ソネック	1,400	807.00	1,129,800
ヤマウラ	5,700	828.00	4,719,600
大成建設	108,900	3,770.00	410,553,000
大林組	328,100	1,053.00	345,489,300
清水建設	334,800	882.00	295,293,600
飛鳥建設	9,700	1,307.00	12,677,900
長谷工コーポレーション	137,000	1,152.00	157,824,000
松井建設	12,800	689.00	8,819,200
銭高組	1,300	4,595.00	5,973,500
鹿島建設	256,400	1,443.00	369,985,200
不動テトラ	7,900	1,333.00	10,530,700
大末建設	4,400	960.00	4,224,000
鉄建建設	6,800	2,945.00	20,026,000
西松建設	23,800	2,114.00	50,313,200
三井住友建設	78,800	569.00	44,837,200
大豊建設	7,600	2,759.00	20,968,400
前田建設工業	78,500	831.00	65,233,500
佐田建設	8,300	386.00	3,203,800
ナカノフドー建設	9,500	433.00	4,113,500
奥村組	18,100	3,325.00	60,182,500
東鉄工業	13,100	3,030.00	39,693,000
イチケン	2,300	1,710.00	3,933,000
富士ピー・エス	4,500	469.00	2,110,500
浅沼組	3,800	3,535.00	13,433,000
戸田建設	127,800	605.00	77,319,000
熊谷組	15,700	2,928.00	45,969,600
青木あすなろ建設	6,000	838.00	5,028,000
北野建設	2,500	2,598.00	6,495,000
植木組	1,600	2,266.00	3,625,600
矢作建設工業	14,900	712.00	10,608,800
ピーエス三菱	12,300	623.00	7,662,900
日本ハウスホールディングス	20,900	447.00	9,342,300
大東建託	39,000	14,420.00	562,380,000
新日本建設	13,600	897.00	12,199,200
N I P P O	28,900	2,128.00	61,499,200
東亜道路工業	2,100	3,330.00	6,993,000
前田道路	34,200	2,339.00	79,993,800



日本道路	3,000	6,100.00	18,300,000	
東亜建設工業	9,500	1,451.00	13,784,500	
日本国土開発	17,800	527.00	9,380,600	
若築建設	5,500	1,462.00	8,041,000	
東洋建設	40,000	442.00	17,680,000	
五洋建設	129,900	535.00	69,496,500	
世紀東急工業	15,900	630.00	10,017,000	
福田組	3,700	4,490.00	16,613,000	
住友林業	77,800	1,338.00	104,096,400	
日本基礎技術	11,200	341.00	3,819,200	
巴コーポレーション	14,900	404.00	6,019,600	
大和ハウス工業	302,700	3,123.00	945,332,100	
ライト工業	21,000	1,465.00	30,765,000	
積水ハウス	334,800	1,895.50	634,613,400	
日特建設	9,300	602.00	5,598,600	
北陸電気工事	5,300	879.00	4,658,700	
ユアテック	17,500	760.00	13,300,000	
四電工	1,700	2,677.00	4,550,900	
中電工	14,100	2,394.00	33,755,400	
関電工	49,700	938.00	46,618,600	
きんでん	72,600	1,648.00	119,644,800	
東京エネシス	11,300	935.00	10,565,500	
トーエネック	3,100	3,225.00	9,997,500	
住友電設	7,600	1,812.00	13,771,200	
日本電設工業	18,600	2,132.00	39,655,200	
協和エクシオ	42,800	2,629.00	112,521,200	
新日本空調	9,100	1,819.00	16,552,900	
九電工	21,500	3,305.00	71,057,500	
三機工業	25,100	1,276.00	32,027,600	
日揮	94,500	1,440.00	136,080,000	
中外炉工業	3,400	1,626.00	5,528,400	
ヤマト	10,700	578.00	6,184,600	
太平電業	7,400	2,232.00	16,516,800	
高砂熱学工業	26,900	1,740.00	46,806,000	
三晃金属工業	1,500	2,446.00	3,669,000	
朝日工業社	2,400	2,719.00	6,525,600	
明星工業	19,800	762.00	15,087,600	
大気社	15,000	3,330.00	49,950,000	
ダイダン	7,500	2,250.00	16,875,000	
日比谷総合設備	9,800	1,948.00	19,090,400	
東芝プラントシステム	23,900	1,930.00	46,127,000	
O S J Bホールディングス	48,200	251.00	12,098,200	

東洋エンジニアリング	12,800	545.00	6,976,000
レイズネクスト	19,600	1,169.00	22,912,400
日本製粉	31,000	1,771.00	54,901,000
日清製粉グループ本社	110,600	2,439.00	269,753,400
日東富士製粉	700	5,770.00	4,039,000
昭和産業	9,000	3,065.00	27,585,000
鳥越製粉	8,700	815.00	7,090,500
中部飼料	12,000	1,255.00	15,060,000
フィード・ワン	65,700	183.00	12,023,100
東洋精糖	1,500	1,020.00	1,530,000
日本甜菜製糖	5,600	2,052.00	11,491,200
三井製糖	7,700	2,302.00	17,725,400
塩水港精糖	10,600	211.00	2,236,600
日新製糖	4,600	1,985.00	9,131,000
森永製菓	24,600	5,130.00	126,198,000
中村屋	2,500	4,290.00	10,725,000
江崎グリコ	29,400	4,790.00	140,826,000
名糖産業	4,700	1,395.00	6,556,500
井村屋グループ	4,200	2,108.00	8,853,600
不二家	5,500	1,972.00	10,846,000
山崎製パン	80,000	1,684.00	134,720,000
第一屋製パン	1,700	984.00	1,672,800
モロゾフ	1,700	4,885.00	8,304,500
亀田製菓	6,100	4,995.00	30,469,500
寿スピリッツ	10,400	6,180.00	64,272,000
カルビー	44,600	2,976.00	132,729,600
森永乳業	19,600	4,275.00	83,790,000
六甲バター	7,100	1,785.00	12,673,500
ヤクルト本社	72,500	6,340.00	459,650,000
明治ホールディングス	69,300	7,510.00	520,443,000
雪印メグミルク	23,600	2,340.00	55,224,000
プリマハム	13,800	2,112.00	29,145,600
日本ハム	40,500	4,200.00	170,100,000
林兼産業	3,200	660.00	2,112,000
丸大食品	10,400	2,103.00	21,871,200
S Foods	8,800	3,460.00	30,448,000
伊藤ハム米久ホールディングス	63,000	728.00	45,864,000
サッポロホールディングス	35,800	2,410.00	86,278,000
アサヒグループホールディングス	205,000	4,641.00	951,405,000
キリンホールディングス	442,700	2,353.00	1,041,673,100
宝ホールディングス	73,300	1,113.00	81,582,900
オエノンホールディングス	27,800	375.00	10,425,000

養命酒製造	3,000	1,949.00	5,847,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,900	2,706.00	202,679,400	
サントリー食品インターナショナル	65,500	4,345.00	284,597,500	
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,310.00	23,705,000	
伊藤園	29,700	4,770.00	141,669,000	
キーコーヒー	9,600	2,101.00	20,169,600	
ユニカフェ	2,700	981.00	2,648,700	
ジャパンフーズ	1,400	1,219.00	1,706,600	
日清オイリオグループ	12,600	3,180.00	40,068,000	
不二製油グループ本社	23,900	3,340.00	79,826,000	
かどや製油	1,100	4,040.00	4,444,000	
J - オイルミルズ	5,100	4,030.00	20,553,000	
キッコーマン	64,600	5,180.00	334,628,000	
味の素	216,100	1,795.50	388,007,550	
キューピー	54,500	2,469.00	134,560,500	
ハウス食品グループ本社	36,600	4,045.00	148,047,000	
カゴメ	39,200	2,505.00	98,196,000	
焼津水産化学工業	4,700	1,085.00	5,099,500	
アリアケジャパン	8,900	6,740.00	59,986,000	
ピエトロ	1,300	1,608.00	2,090,400	
エバラ食品工業	2,400	2,115.00	5,076,000	
ニチレイ	50,800	2,604.00	132,283,200	
東洋水産	50,400	4,625.00	233,100,000	
イトアンド	3,400	1,684.00	5,725,600	
大冷	1,100	1,974.00	2,171,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,700	794.00	2,143,800	
日清食品ホールディングス	41,600	6,990.00	290,784,000	
永谷園ホールディングス	5,200	2,095.00	10,894,000	
一正蒲鉾	3,800	1,030.00	3,914,000	
フジッコ	10,600	2,020.00	21,412,000	
ロック・フィールド	10,500	1,418.00	14,889,000	
日本たばこ産業	565,100	2,427.00	1,371,497,700	
ケンコーマヨネーズ	5,500	2,432.00	13,376,000	
わらべや日洋ホールディングス	6,400	1,740.00	11,136,000	
なとり	5,500	1,588.00	8,734,000	
イフジ産業	1,700	674.00	1,145,800	
ピククルスコーポレーション	2,300	2,317.00	5,329,100	
北の達人コーポレーション	38,400	669.00	25,689,600	
ユーグレナ	41,700	1,041.00	43,409,700	
ミヨシ油脂	3,700	1,085.00	4,014,500	
理研ビタミン	4,600	3,385.00	15,571,000	
片倉工業	12,000	1,290.00	15,480,000	

グンゼ	6,500	4,930.00	32,045,000
東洋紡	40,700	1,385.00	56,369,500
ユニチカ	28,800	442.00	12,729,600
富士紡ホールディングス	5,100	2,394.00	12,209,400
倉敷紡績	9,300	2,043.00	18,999,900
シキボウ	5,000	1,012.00	5,060,000
日本毛織	31,800	898.00	28,556,400
トーア紡コーポレーション	4,100	458.00	1,877,800
帝国繊維	10,900	1,999.00	21,789,100
帝人	78,100	1,885.00	147,218,500
東レ	741,300	782.20	579,844,860
サカイオーベックス	2,500	1,766.00	4,415,000
住江織物	2,800	2,969.00	8,313,200
日本フェルト	6,100	465.00	2,836,500
イチカワ	1,500	1,585.00	2,377,500
日東製網	1,100	1,437.00	1,580,700
アツギ	8,000	932.00	7,456,000
ダイニック	3,900	753.00	2,936,700
セーレン	23,700	1,557.00	36,900,900
ソトー	3,900	981.00	3,825,900
東海染工	1,400	1,130.00	1,582,000
小松マテーレ	15,800	811.00	12,813,800
ワコールホールディングス	27,000	2,855.00	77,085,000
ホギメディカル	11,900	3,060.00	36,414,000
レナウン	27,600	124.00	3,422,400
クラウドシアホールディングス	2,500	527.00	1,317,500
T S Iホールディングス	35,400	621.00	21,983,400
マツオカコーポレーション	3,100	2,659.00	8,242,900
ワールド	12,500	2,170.00	27,125,000
三陽商会	5,800	1,544.00	8,955,200
ナイガイ	3,700	445.00	1,646,500
オンワードホールディングス	57,500	585.00	33,637,500
ルックホールディングス	3,600	1,235.00	4,446,000
ゴールドウイン	8,700	14,950.00	130,065,000
デサント	23,300	1,711.00	39,866,300
キング	5,200	670.00	3,484,000
ヤマトインターナショナル	6,000	424.00	2,544,000
特種東海製紙	6,100	3,775.00	23,027,500
王子ホールディングス	429,900	582.00	250,201,800
日本製紙	45,800	1,967.00	90,088,600
三菱製紙	15,600	586.00	9,141,600
北越コーポレーション	63,400	563.00	35,694,200

中越パルプ工業	4,000	1,581.00	6,324,000
巴川製紙所	3,100	946.00	2,932,600
大王製紙	46,500	1,302.00	60,543,000
阿波製紙	2,500	433.00	1,082,500
レンゴー	98,500	839.00	82,641,500
トーマク	5,900	1,781.00	10,507,900
ザ・パック	7,200	3,430.00	24,696,000
クラレ	161,100	1,312.00	211,363,200
旭化成	679,400	1,133.00	769,760,200
共和レザー	5,900	824.00	4,861,600
昭和電工	63,500	3,005.00	190,817,500
住友化学	751,800	494.00	371,389,200
住友精化	4,700	3,415.00	16,050,500
日産化学	58,200	4,680.00	272,376,000
ラサ工業	3,400	1,523.00	5,178,200
クレハ	8,800	7,190.00	63,272,000
多木化学	2,800	4,275.00	11,970,000
テイカ	7,800	2,381.00	18,571,800
石原産業	18,300	1,214.00	22,216,200
片倉コープアグリ	2,800	1,080.00	3,024,000
日本曹達	15,100	2,840.00	42,884,000
東ソー	147,600	1,563.00	230,698,800
トクヤマ	27,500	2,881.00	79,227,500
セントラル硝子	20,800	2,587.00	53,809,600
東亜合成	59,900	1,187.00	71,101,300
大阪ソーダ	10,300	2,649.00	27,284,700
関東電化工業	22,600	729.00	16,475,400
デンカ	37,500	3,150.00	118,125,000
信越化学工業	168,300	11,035.00	1,857,190,500
日本カーバイド工業	3,200	1,351.00	4,323,200
堺化学工業	6,400	2,529.00	16,185,600
第一稀元素化学工業	10,300	891.00	9,177,300
エア・ウォーター	78,200	1,817.00	142,089,400
大陽日酸	78,700	2,156.00	169,677,200
日本化学工業	3,200	2,210.00	7,072,000
東邦アセチレン	1,400	1,299.00	1,818,600
日本パーカライズン	52,200	1,237.00	64,571,400
高圧ガス工業	15,100	834.00	12,593,400
チタン工業	1,200	3,180.00	3,816,000
四国化成工業	16,100	1,122.00	18,064,200
戸田工業	2,000	2,326.00	4,652,000
ステラ ケミファ	5,600	2,885.00	16,156,000

保土谷化学工業	3,300	2,851.00	9,408,300
日本触媒	16,100	7,260.00	116,886,000
大日精化工業	7,900	2,944.00	23,257,600
カネカ	24,700	4,100.00	101,270,000
三菱瓦斯化学	97,100	1,463.00	142,057,300
三井化学	86,700	2,559.00	221,865,300
J S R	95,800	1,716.00	164,392,800
東京応化工業	16,400	3,560.00	58,384,000
大阪有機化学工業	8,800	1,027.00	9,037,600
三菱ケミカルホールディングス	638,400	745.80	476,118,720
K Hネオケム	14,500	2,823.00	40,933,500
ダイセル	140,700	956.00	134,509,200
住友ベークライト	16,500	3,815.00	62,947,500
積水化学工業	205,400	1,598.00	328,229,200
日本ゼオン	86,100	1,235.00	106,333,500
アイカ工業	28,600	3,550.00	101,530,000
宇部興産	48,200	2,299.00	110,811,800
積水樹脂	15,800	2,122.00	33,527,600
タキロンシーアイ	20,700	699.00	14,469,300
旭有機材	6,600	1,412.00	9,319,200
日立化成	44,200	2,990.00	132,158,000
ニチバン	5,000	1,923.00	9,615,000
リケンテクノス	26,000	524.00	13,624,000
大倉工業	4,900	1,792.00	8,780,800
積水化成成品工業	14,200	753.00	10,692,600
群栄化学工業	2,500	2,465.00	6,162,500
タイガースポリマー	5,000	565.00	2,825,000
ミライアル	2,800	1,497.00	4,191,600
ダイキアクシス	3,400	853.00	2,900,200
ダイキョーニシカワ	20,100	930.00	18,693,000
竹本容器	3,400	1,212.00	4,120,800
森六ホールディングス	5,100	2,544.00	12,974,400
日本化薬	59,100	1,362.00	80,494,200
カーリットホールディングス	10,200	639.00	6,517,800
日本精化	7,700	1,234.00	9,501,800
扶桑化学工業	9,700	2,270.00	22,019,000
トリケミカル研究所	2,100	5,550.00	11,655,000
A D E K A	47,100	1,642.00	77,338,200
日油	36,000	3,900.00	140,400,000
新日本理化	17,300	213.00	3,684,900
ハリマ化成グループ	7,900	1,145.00	9,045,500
花王	236,700	8,244.00	1,951,354,800

第一工業製薬	3,600	3,325.00	11,970,000
石原ケミカル	2,400	1,700.00	4,080,000
日華化学	3,200	838.00	2,681,600
ニイタカ	1,500	1,474.00	2,211,000
三洋化成工業	6,400	5,410.00	34,624,000
有機合成薬品工業	7,300	239.00	1,744,700
大日本塗料	10,800	1,006.00	10,864,800
日本ペイントホールディングス	78,800	4,615.00	363,662,000
関西ペイント	107,300	2,101.00	225,437,300
神東塗料	7,500	172.00	1,290,000
中国塗料	31,400	943.00	29,610,200
日本特殊塗料	7,100	1,351.00	9,592,100
藤倉化成	12,900	617.00	7,959,300
太陽ホールディングス	7,900	3,320.00	26,228,000
D I C	43,200	2,962.00	127,958,400
サカタインクス	20,800	1,066.00	22,172,800
東洋インキＳＣホールディングス	20,200	2,412.00	48,722,400
T & K T O K A	7,400	985.00	7,289,000
富士フィルムホールディングス	202,500	5,351.00	1,083,577,500
資生堂	193,800	8,102.00	1,570,167,600
ライオン	135,800	2,164.00	293,871,200
高砂香料工業	6,700	2,968.00	19,885,600
マンダム	21,900	2,660.00	58,254,000
ミルボン	12,000	5,520.00	66,240,000
ファンケル	43,400	2,692.00	116,832,800
コーセー	16,500	19,240.00	317,460,000
コタ	5,100	1,162.00	5,926,200
シーボン	1,200	2,410.00	2,892,000
ポーラ・オルビスホールディングス	41,600	2,930.00	121,888,000
ノエビアホールディングス	9,300	5,810.00	54,033,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	916.00	2,015,200
エステー	7,000	1,680.00	11,760,000
アグロ カネショウ	4,000	1,609.00	6,436,000
コニシ	17,300	1,570.00	27,161,000
長谷川香料	12,900	1,994.00	25,722,600
星光 P M C	6,500	761.00	4,946,500
小林製薬	27,300	7,980.00	217,854,000
荒川化学工業	8,800	1,510.00	13,288,000
メック	6,700	1,066.00	7,142,200
日本高純度化学	2,700	2,345.00	6,331,500
タカラバイオ	25,500	2,103.00	53,626,500
J C U	12,600	2,093.00	26,371,800

新田ゼラチン	6,100	710.00	4,331,000
O A T アグリオ	1,300	1,329.00	1,727,700
デクセリアルズ	25,100	730.00	18,323,000
アース製薬	7,300	4,645.00	33,908,500
北興化学工業	10,000	489.00	4,890,000
大成ラミック	3,200	2,839.00	9,084,800
クミアイ化学工業	40,300	880.00	35,464,000
日本農薬	17,400	446.00	7,760,400
アキレス	7,100	2,088.00	14,824,800
有沢製作所	15,400	930.00	14,322,000
日東電工	67,300	5,289.00	355,949,700
レック	10,400	1,273.00	13,239,200
三光合成	11,100	371.00	4,118,100
きもと	16,600	185.00	3,071,000
藤森工業	8,700	2,959.00	25,743,300
前澤化成工業	6,700	1,140.00	7,638,000
未来工業	5,200	2,041.00	10,613,200
ウェーブロックホールディングス	2,700	710.00	1,917,000
J S P	5,700	1,990.00	11,343,000
エフピコ	10,700	6,700.00	71,690,000
天馬	6,700	1,880.00	12,596,000
信越ポリマー	17,500	778.00	13,615,000
東リ	24,300	254.00	6,172,200
ニフコ	39,100	2,679.00	104,748,900
バルカー	7,900	2,221.00	17,545,900
ユニ・チャーム	206,700	3,195.00	660,406,500
ショーエイコーポレーション	800	803.00	642,400
協和キリン	114,400	1,774.00	202,945,600
武田薬品工業	851,300	3,689.00	3,140,445,700
アステラス製薬	857,700	1,531.00	1,313,138,700
大日本住友製薬	72,300	1,905.00	137,731,500
塩野義製薬	124,700	6,105.00	761,293,500
田辺三菱製薬	102,000	1,211.00	123,522,000
わかもと製薬	11,600	261.00	3,027,600
あすか製薬	12,000	1,281.00	15,372,000
日本新薬	25,500	7,870.00	200,685,000
ビオフェルミン製薬	1,700	2,162.00	3,675,400
中外製薬	101,700	7,200.00	732,240,000
科研製薬	16,700	5,410.00	90,347,000
エーザイ	116,700	5,835.00	680,944,500
ロート製薬	50,000	3,165.00	158,250,000
小野薬品工業	230,300	1,911.50	440,218,450



久光製薬	28,800	4,345.00	125,136,000
持田製薬	14,800	4,650.00	68,820,000
参天製薬	181,600	1,799.00	326,698,400
扶桑薬品工業	3,400	1,906.00	6,480,400
日本ケミファ	1,300	2,875.00	3,737,500
ツムラ	30,200	2,987.00	90,207,400
日医工	25,600	1,217.00	31,155,200
キッセイ薬品工業	17,300	2,695.00	46,623,500
生化学工業	18,900	1,224.00	23,133,600
栄研化学	17,100	1,860.00	31,806,000
日水製薬	4,100	1,202.00	4,928,200
鳥居薬品	5,200	2,705.00	14,066,000
JCRファーマ	6,900	7,180.00	49,542,000
東和薬品	14,000	2,790.00	39,060,000
富士製薬工業	6,600	1,422.00	9,385,200
沢井製薬	20,000	5,930.00	118,600,000
ゼリア新薬工業	19,300	2,014.00	38,870,200
第一三共	279,000	6,149.00	1,715,571,000
キョーリン製薬ホールディングス	21,500	1,804.00	38,786,000
大幸薬品	4,300	2,197.00	9,447,100
ダイト	5,700	3,045.00	17,356,500
大塚ホールディングス	185,800	3,866.00	718,302,800
大正製薬ホールディングス	21,800	8,200.00	178,760,000
ペプチドリーム	48,800	5,920.00	288,896,000
日本コークス工業	82,400	94.00	7,745,600
ニチレキ	12,500	1,078.00	13,475,000
ユシロ化学工業	5,000	1,334.00	6,670,000
ビーピー・カストロール	3,500	1,337.00	4,679,500
富士石油	23,700	257.00	6,090,900
MORESCO	3,500	1,485.00	5,197,500
出光興産	112,600	3,100.00	349,060,000
JXTGホールディングス	1,640,100	522.40	856,788,240
コスモエネルギーホールディングス	28,200	2,303.00	64,944,600
横浜ゴム	56,500	2,091.00	118,141,500
TOYO TIRE	50,100	1,466.00	73,446,600
ブリヂストン	299,700	4,258.00	1,276,122,600
住友ゴム工業	87,600	1,249.00	109,412,400
藤倉コンポジット	8,500	432.00	3,672,000
オカモト	6,500	5,170.00	33,605,000
フコク	4,300	742.00	3,190,600
ニッタ	11,000	3,040.00	33,440,000
住友理工	18,900	861.00	16,272,900

三ツ星ベルト	12,800	2,038.00	26,086,400
バンドー化学	18,600	956.00	17,781,600
日東紡績	14,500	2,558.00	37,091,000
A G C	96,400	3,740.00	360,536,000
日本板硝子	46,600	717.00	33,412,200
石塚硝子	1,600	2,081.00	3,329,600
日本山村硝子	4,100	1,406.00	5,764,600
日本電気硝子	42,200	2,787.00	117,611,400
オハラ	3,900	1,503.00	5,861,700
住友大阪セメント	19,700	4,190.00	82,543,000
太平洋セメント	61,600	3,160.00	194,656,000
日本ヒューム	9,800	719.00	7,046,200
日本コンクリート工業	21,100	289.00	6,097,900
三谷セキサン	4,500	2,936.00	13,212,000
アジアパイルホールディングス	13,900	554.00	7,700,600
東海カーボン	88,600	1,087.00	96,308,200
日本カーボン	4,700	4,270.00	20,069,000
東洋炭素	5,700	2,237.00	12,750,900
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,455.00	25,839,000
T O T O	75,000	4,385.00	328,875,000
日本碍子	119,000	1,581.00	188,139,000
日本特殊陶業	82,200	2,038.00	167,523,600
M A R U W A	3,400	5,970.00	20,298,000
品川リフラクトリーズ	2,600	2,974.00	7,732,400
黒崎播磨	1,900	6,180.00	11,742,000
ヨータイ	8,600	594.00	5,108,400
イソライト工業	5,100	467.00	2,381,700
東京窯業	12,500	308.00	3,850,000
ニッカトー	4,500	691.00	3,109,500
フジミインコーポレーテッド	8,700	2,367.00	20,592,900
クニミネ工業	4,400	877.00	3,858,800
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,020.00	1,938,000
ニチアス	26,700	1,940.00	51,798,000
ニチハ	13,600	3,020.00	41,072,000
日本製鉄	448,100	1,746.50	782,606,650
神戸製鋼所	176,600	694.00	122,560,400
中山製鋼所	13,500	487.00	6,574,500
合同製鐵	4,700	2,043.00	9,602,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	260,500	1,493.00	388,926,500
東京製鐵	51,700	809.00	41,825,300
共英製鋼	10,900	1,806.00	19,685,400
大和工業	20,500	2,843.00	58,281,500

東京鐵鋼	4,000	1,347.00	5,388,000
大阪製鐵	6,400	1,683.00	10,771,200
淀川製鋼所	13,000	2,037.00	26,481,000
丸一鋼管	34,200	2,903.00	99,282,600
モリ工業	2,900	1,995.00	5,785,500
大同特殊鋼	15,800	3,960.00	62,568,000
日本高周波鋼業	3,600	458.00	1,648,800
日本冶金工業	80,000	227.00	18,160,000
山陽特殊製鋼	12,200	1,443.00	17,604,600
愛知製鋼	5,400	3,295.00	17,793,000
日立金属	103,900	1,169.00	121,459,100
日本金属	2,200	913.00	2,008,600
大平洋金属	6,500	2,271.00	14,761,500
新日本電工	57,900	198.00	11,464,200
栗本鐵工所	4,900	1,500.00	7,350,000
虹技	1,500	1,338.00	2,007,000
三菱製鋼	7,200	1,241.00	8,935,200
日亜鋼業	14,200	332.00	4,714,400
日本精線	1,400	2,646.00	3,704,400
エンビプロ・ホールディングス	3,700	738.00	2,730,600
シンニッタン	15,100	348.00	5,254,800
新家工業	2,200	1,487.00	3,271,400
大紀アルミニウム工業所	16,000	802.00	12,832,000
日本輕金属ホールディングス	263,300	221.00	58,189,300
三井金属鋳業	26,100	2,558.00	66,763,800
東邦亜鉛	5,400	2,515.00	13,581,000
三菱マテリアル	63,700	3,070.00	195,559,000
住友金属鋳山	132,100	3,223.00	425,758,300
D O W A ホールディングス	22,600	3,520.00	79,552,000
古河機械金属	16,000	1,442.00	23,072,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	1,848.00	20,697,600
東邦チタニウム	17,400	1,036.00	18,026,400
U A C J	14,700	1,808.00	26,577,600
C K サンエツ	1,900	2,776.00	5,274,400
古河電気工業	27,800	3,130.00	87,014,000
住友電気工業	360,600	1,387.50	500,332,500
フジクラ	116,700	424.00	49,480,800
昭和電線ホールディングス	11,200	890.00	9,968,000
東京特殊電線	1,300	1,880.00	2,444,000
タツタ電線	19,300	495.00	9,553,500
カナレ電気	1,700	1,879.00	3,194,300
平河ヒューテック	4,100	1,268.00	5,198,800

リヨービ	11,900	2,083.00	24,787,700
アーレスティ	12,100	580.00	7,018,000
アサヒホールディングス	18,200	2,254.00	41,022,800
稲葉製作所	5,400	1,463.00	7,900,200
宮地エンジニアリンググループ	2,900	1,743.00	5,054,700
トーカロ	24,900	831.00	20,691,900
アルファC o	3,400	1,312.00	4,460,800
SUMCO	106,600	1,514.00	161,392,400
川田テクノロジーズ	2,100	7,340.00	15,414,000
RS Technologies	1,900	3,695.00	7,020,500
信和	5,100	926.00	4,722,600
東洋製罐グループホールディングス	61,400	1,937.00	118,931,800
ホッカカンホールディングス	4,900	1,710.00	8,379,000
コロナ	5,300	1,025.00	5,432,500
横河ブリッジホールディングス	17,900	1,719.00	30,770,100
駒井ハルテック	1,800	1,652.00	2,973,600
高田機工	900	2,531.00	2,277,900
三和ホールディングス	99,600	1,142.00	113,743,200
文化シャッター	28,400	900.00	25,560,000
三協立山	13,400	1,264.00	16,937,600
アルインコ	7,700	981.00	7,553,700
東洋シャッター	2,400	712.00	1,708,800
LIXILグループ	142,300	1,882.00	267,808,600
日本フィルコン	7,400	481.00	3,559,400
ノーリツ	21,500	1,346.00	28,939,000
長府製作所	9,800	2,340.00	22,932,000
リンナイ	17,200	7,300.00	125,560,000
ダイニチ工業	5,200	633.00	3,291,600
日東精工	13,400	584.00	7,825,600
三洋工業	1,300	1,820.00	2,366,000
岡部	19,600	898.00	17,600,800
ジーテクト	10,700	1,581.00	16,916,700
東プレ	18,000	1,749.00	31,482,000
高周波熱錬	18,600	878.00	16,330,800
東京製綱	5,900	938.00	5,534,200
サンコール	5,500	522.00	2,871,000
モリテック スチール	7,600	376.00	2,857,600
パイオラックス	15,500	1,931.00	29,930,500
エイチワン	9,500	747.00	7,096,500
日本発條	96,100	883.00	84,856,300
中央発條	1,200	2,878.00	3,453,600
アドバネクス	1,300	1,707.00	2,219,100

立川ブラインド工業	4,300	1,356.00	5,830,800
三益半導体工業	8,600	1,843.00	15,849,800
日本ドライケミカル	2,700	1,132.00	3,056,400
日本製鋼所	29,300	1,985.00	58,160,500
三浦工業	41,800	3,090.00	129,162,000
タクマ	35,200	1,322.00	46,534,400
ツガミ	21,700	988.00	21,439,600
オークマ	12,300	6,090.00	74,907,000
東芝機械	10,900	2,489.00	27,130,100
アマダホールディングス	145,000	1,237.00	179,365,000
アイダエンジニアリング	26,100	896.00	23,385,600
滝澤鉄工所	3,000	1,423.00	4,269,000
F U J I	38,600	1,493.00	57,629,800
牧野フライス製作所	11,300	4,710.00	53,223,000
オーエスジー	47,500	2,216.00	105,260,000
ダイジェット工業	1,100	1,606.00	1,766,600
旭ダイヤモンド工業	25,400	695.00	17,653,000
D M G 森精機	61,100	1,662.00	101,548,200
ソディック	21,100	992.00	20,931,200
ディスコ	13,100	21,630.00	283,353,000
日東工器	5,300	2,129.00	11,283,700
日進工具	2,900	2,048.00	5,939,200
パンチ工業	6,800	593.00	4,032,400
富士ダイス	4,400	636.00	2,798,400
豊和工業	5,400	855.00	4,617,000
O K K	4,100	809.00	3,316,900
東洋機械金属	7,000	594.00	4,158,000
津田駒工業	2,100	1,434.00	3,011,400
エンシュウ	2,600	1,214.00	3,156,400
島精機製作所	13,300	3,280.00	43,624,000
オプトラン	9,400	2,831.00	26,611,400
N C ホールディングス	3,300	475.00	1,567,500
イワキポンプ	4,200	1,183.00	4,968,600
フリー	7,800	1,075.00	8,385,000
ヤマシンフィルタ	16,900	621.00	10,494,900
日阪製作所	12,000	868.00	10,416,000
やまびこ	18,800	943.00	17,728,400
平田機工	4,600	6,730.00	30,958,000
ペガサスミシン製造	9,200	570.00	5,244,000
マルマエ	4,100	919.00	3,767,900
タツモ	4,100	940.00	3,854,000
ナブテスコ	53,100	3,035.00	161,158,500

三井海洋開発	10,300	2,950.00	30,385,000
レオン自動機	9,500	1,879.00	17,850,500
S M C	28,600	42,510.00	1,215,786,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	7,300	453.00	3,306,900
ホソカワミクロン	3,400	4,450.00	15,130,000
ユニオンツール	4,200	3,195.00	13,419,000
オイレス工業	13,600	1,610.00	21,896,000
日精エー・エス・ビー機械	3,300	2,766.00	9,127,800
サトーホールディングス	11,700	2,684.00	31,402,800
技研製作所	8,500	3,220.00	27,370,000
日本エアージェット	3,200	594.00	1,900,800
カワタ	2,700	1,076.00	2,905,200
日精樹脂工業	8,200	1,112.00	9,118,400
オカダアイヨン	3,400	1,304.00	4,433,600
ワイエイシイホールディングス	3,800	1,024.00	3,891,200
小松製作所	441,500	2,481.00	1,095,361,500
住友重機械工業	55,800	3,595.00	200,601,000
日立建機	39,100	2,686.00	105,022,600
日工	2,700	2,932.00	7,916,400
巴工業	4,200	2,384.00	10,012,800
井関農機	9,800	1,509.00	14,788,200
T O W A	8,400	880.00	7,392,000
丸山製作所	2,200	1,159.00	2,549,800
北川鉄工所	4,400	2,194.00	9,653,600
ローツェ	4,300	2,727.00	11,726,100
タカキタ	3,500	578.00	2,023,000
クボタ	522,500	1,697.50	886,943,750
荏原実業	2,900	1,989.00	5,768,100
三菱化工機	3,400	1,639.00	5,572,600
月島機械	19,400	1,297.00	25,161,800
帝国電機製作所	6,900	1,214.00	8,376,600
新東工業	23,200	946.00	21,947,200
澁谷工業	8,600	2,946.00	25,335,600
アイチ コーポレーション	17,000	715.00	12,155,000
小森コーポレーション	24,800	1,194.00	29,611,200
鶴見製作所	7,600	1,848.00	14,044,800
住友精密工業	1,600	2,773.00	4,436,800
酒井重工業	1,900	2,941.00	5,587,900
荏原製作所	43,300	3,080.00	133,364,000
石井鐵工所	1,500	2,015.00	3,022,500
西島製作所	10,000	1,043.00	10,430,000
北越工業	10,100	1,225.00	12,372,500

ダイキン工業	133,100	13,905.00	1,850,755,500
オルガノ	3,500	3,960.00	13,860,000
トーヨーカネツ	3,700	1,993.00	7,374,100
栗田工業	52,800	2,833.00	149,582,400
椿本チエイン	12,800	3,715.00	47,552,000
大同工業	4,700	900.00	4,230,000
木村化工機	8,400	366.00	3,074,400
アネスト岩田	15,200	970.00	14,744,000
ダイフク	53,700	6,150.00	330,255,000
サムコ	2,800	945.00	2,646,000
加藤製作所	5,000	1,961.00	9,805,000
油研工業	1,700	1,731.00	2,942,700
タダノ	47,100	1,025.00	48,277,500
フジテック	35,500	1,391.00	49,380,500
C K D	27,200	1,315.00	35,768,000
キトー	7,400	1,619.00	11,980,600
平和	27,200	2,183.00	59,377,600
理想科学工業	8,700	1,737.00	15,111,900
S A N K Y O	24,400	3,785.00	92,354,000
日本金銭機械	10,800	1,108.00	11,966,400
マースグループホールディングス	6,200	1,986.00	12,313,200
福島工業	6,000	3,380.00	20,280,000
オーイズミ	4,300	381.00	1,638,300
ダイコク電機	4,500	1,348.00	6,066,000
竹内製作所	16,400	1,712.00	28,076,800
アマノ	27,900	3,030.00	84,537,000
J U K I	13,600	1,032.00	14,035,200
蛇の目マシン工業	9,000	470.00	4,230,000
マックス	14,900	1,630.00	24,287,000
グローリー	27,000	2,968.00	80,136,000
新晃工業	9,100	1,597.00	14,532,700
大和冷機工業	14,200	1,054.00	14,966,800
セガサミーホールディングス	96,800	1,290.00	124,872,000
日本ピストンリング	3,600	1,445.00	5,202,000
リケン	4,500	4,325.00	19,462,500
T P R	13,200	1,960.00	25,872,000
ツバキ・ナカシマ	14,900	1,892.00	28,190,800
ホシザキ	28,500	7,690.00	219,165,000
大豊工業	8,000	822.00	6,576,000
日本精工	200,400	982.00	196,792,800
N T N	209,800	327.00	68,604,600
ジェイテクト	93,600	1,349.00	126,266,400

不二越	9,100	4,820.00	43,862,000
日本トムソン	29,100	525.00	15,277,500
T H K	60,800	2,893.00	175,894,400
ユーシン精機	7,600	1,001.00	7,607,600
前澤給装工業	3,900	1,978.00	7,714,200
イーグル工業	12,100	1,119.00	13,539,900
前澤工業	6,700	351.00	2,351,700
日本ピラー工業	9,900	1,070.00	10,593,000
キッツ	39,600	746.00	29,541,600
マキタ	118,700	3,670.00	435,629,000
日立造船	77,500	407.00	31,542,500
三菱重工業	163,400	4,622.00	755,234,800
I H I	75,000	2,742.00	205,650,000
スター精密	16,700	1,468.00	24,515,600
日清紡ホールディングス	54,300	846.00	45,937,800
イビデン	59,900	1,987.00	119,021,300
コニカミノルタ	213,300	1,025.00	218,632,500
ブラザー工業	127,200	2,030.00	258,216,000
ミネベアミツミ	181,200	1,882.00	341,018,400
日立製作所	439,000	3,977.00	1,745,903,000
三菱電機	975,200	1,469.50	1,433,056,400
富士電機	63,300	3,635.00	230,095,500
東洋電機製造	3,900	1,585.00	6,181,500
安川電機	113,100	3,790.00	428,649,000
シンフォニアテクノロジー	13,600	1,296.00	17,625,600
明電舎	19,400	1,729.00	33,542,600
オリジン	2,700	1,503.00	4,058,100
山洋電気	4,800	4,555.00	21,864,000
デンヨー	9,100	1,587.00	14,441,700
東芝テック	12,300	3,185.00	39,175,500
芝浦メカトロニクス	1,800	3,085.00	5,553,000
マブチモーター	27,100	3,805.00	103,115,500
日本電産	117,400	14,865.00	1,745,151,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,500	1,144.00	6,292,000
トレックス・セミコンダクター	4,600	1,206.00	5,547,600
東光高岳	5,200	1,188.00	6,177,600
ダブル・スコープ	14,200	1,178.00	16,727,600
ダイヘン	10,700	3,115.00	33,330,500
ヤーマン	14,500	926.00	13,427,000
J V C ケンウッド	75,800	249.00	18,874,200
ミマキエンジニアリング	9,200	625.00	5,750,000
第一精工	4,300	1,417.00	6,093,100



日新電機	23,000	1,262.00	29,026,000
大崎電気工業	19,600	686.00	13,445,600
オムロン	103,700	5,770.00	598,349,000
日東工業	15,700	2,117.00	33,236,900
I D E C	13,100	2,102.00	27,536,200
正興電機製作所	2,100	837.00	1,757,700
不二電機工業	1,300	1,249.00	1,623,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,200	2,061.00	72,547,200
サクサホールディングス	2,500	2,000.00	5,000,000
メルコホールディングス	4,100	3,235.00	13,263,500
テクノメディカ	2,300	2,227.00	5,122,100
日本電気	126,200	4,330.00	546,446,000
富士通	94,000	7,863.00	739,122,000
沖電気工業	42,300	1,391.00	58,839,300
岩崎通信機	4,600	785.00	3,611,000
電気興業	5,200	3,120.00	16,224,000
サンケン電気	11,500	2,443.00	28,094,500
ナカヨ	2,000	1,630.00	3,260,000
アイホン	5,600	1,697.00	9,503,200
ルネサスエレクトロニクス	103,000	639.00	65,817,000
セイコーエプソン	121,100	1,723.00	208,655,300
ワコム	71,500	384.00	27,456,000
アルバック	19,500	4,520.00	88,140,000
アクセル	4,500	705.00	3,172,500
E I Z O	9,000	4,060.00	36,540,000
日本信号	24,900	1,236.00	30,776,400
京三製作所	21,300	380.00	8,094,000
能美防災	13,000	2,269.00	29,497,000
ホーチキ	6,400	1,319.00	8,441,600
星和電機	5,800	522.00	3,027,600
エレコム	9,300	3,910.00	36,363,000
パナソニック	1,114,100	914.30	1,018,621,630
シャープ	96,800	1,367.00	132,325,600
アンリツ	62,800	2,032.00	127,609,600
富士通ゼネラル	29,900	1,635.00	48,886,500
ソニー	654,400	5,905.00	3,864,232,000
T D K	51,000	8,520.00	434,520,000
帝国通信工業	4,600	1,149.00	5,285,400
タムラ製作所	37,800	640.00	24,192,000
アルプスアルパイン	101,700	1,925.00	195,772,500
池上通信機	3,100	1,050.00	3,255,000
鈴木	5,700	658.00	3,750,600

日本トリム	1,900	4,645.00	8,825,500
ローランド ディー.ジー.	5,100	2,566.00	13,086,600
フォスター電機	11,100	1,796.00	19,935,600
S M K	2,800	2,879.00	8,061,200
ヨコオ	7,100	2,379.00	16,890,900
ホシデン	29,000	1,240.00	35,960,000
ヒロセ電機	14,000	11,920.00	166,880,000
日本航空電子工業	22,400	1,556.00	34,854,400
T O A	10,600	1,201.00	12,730,600
マクセルホールディングス	21,200	1,498.00	31,757,600
古野電気	12,900	973.00	12,551,700
ユニデンホールディングス	2,900	1,956.00	5,672,400
スミダコーポレーション	8,600	1,187.00	10,208,200
アイコム	5,400	2,236.00	12,074,400
リオン	4,600	2,155.00	9,913,000
本多通信工業	9,000	515.00	4,635,000
横河電機	97,700	2,025.00	197,842,500
新電元工業	3,500	3,670.00	12,845,000
アズビル	61,600	2,636.00	162,377,600
東亜ディーケーケー	5,200	829.00	4,310,800
日本光電工業	43,100	2,991.00	128,912,100
チノー	3,500	1,395.00	4,882,500
共和電業	10,500	416.00	4,368,000
日本電子材料	4,100	562.00	2,304,200
堀場製作所	19,300	6,190.00	119,467,000
アドバンテスト	66,500	4,160.00	276,640,000
小野測器	5,000	518.00	2,590,000
エスペック	8,800	2,287.00	20,125,600
キーエンス	47,900	67,270.00	3,222,233,000
日置電機	5,200	3,625.00	18,850,000
シスメックス	76,000	7,465.00	567,340,000
日本マイクロニクス	17,300	1,060.00	18,338,000
メガチップス	7,900	1,667.00	13,169,300
O B A R A G R O U P	5,100	3,835.00	19,558,500
澤藤電機	1,400	1,752.00	2,452,800
原田工業	4,300	841.00	3,616,300
コーセル	12,700	1,119.00	14,211,300
イリソ電子工業	9,000	5,310.00	47,790,000
オブテックスグループ	17,400	1,414.00	24,603,600
千代田インテグレ	4,200	2,167.00	9,101,400
アイ・オー・データ機器	3,900	938.00	3,658,200
レーザーテック	20,100	5,200.00	104,520,000

スタンレー電気	68,900	2,782.00	191,679,800
岩崎電気	4,000	1,332.00	5,328,000
ウシオ電機	56,900	1,454.00	82,732,600
岡谷電機産業	7,800	392.00	3,057,600
ハリオス テクノ ホールディング	9,500	657.00	6,241,500
エノモト	3,100	853.00	2,644,300
日本セラミック	10,000	2,892.00	28,920,000
遠藤照明	5,300	764.00	4,049,200
古河電池	7,400	652.00	4,824,800
双信電機	5,300	535.00	2,835,500
山一電機	7,400	1,215.00	8,991,000
図研	6,500	1,875.00	12,187,500
日本電子	19,400	2,483.00	48,170,200
カシオ計算機	86,400	1,263.00	109,123,200
ファナック	92,700	19,900.00	1,844,730,000
日本シイエムケイ	25,300	649.00	16,419,700
エンプラス	4,500	3,600.00	16,200,000
大真空	3,800	1,193.00	4,533,400
ローム	46,700	7,830.00	365,661,000
浜松ホトニクス	70,000	4,245.00	297,150,000
三井ハイテック	11,000	1,363.00	14,993,000
新光電気工業	33,100	1,002.00	33,166,200
京セラ	148,700	7,076.00	1,052,201,200
太陽誘電	43,500	2,301.00	100,093,500
村田製作所	307,000	4,924.00	1,511,668,000
双葉電子工業	16,200	1,446.00	23,425,200
北陸電気工業	3,900	1,057.00	4,122,300
ニチコン	31,100	939.00	29,202,900
日本ケミコン	6,900	1,735.00	11,971,500
K O A	14,900	1,396.00	20,800,400
市光工業	15,000	700.00	10,500,000
小糸製作所	58,500	6,020.00	352,170,000
ミツバ	18,400	678.00	12,475,200
S C R E E Nホールディングス	16,900	6,060.00	102,414,000
キャノン電子	9,100	1,866.00	16,980,600
キャノン	525,000	3,036.00	1,593,900,000
リコー	293,300	1,029.00	301,805,700
象印マホービン	24,400	1,325.00	32,330,000
M U T O Hホールディングス	1,500	1,721.00	2,581,500
東京エレクトロン	65,000	18,550.00	1,205,750,000
トヨタ紡織	34,300	1,478.00	50,695,400
芦森工業	2,200	1,580.00	3,476,000

ユニプレス	19,000	1,829.00	34,751,000
豊田自動織機	79,000	5,930.00	468,470,000
モリタホールディングス	17,200	1,796.00	30,891,200
三櫻工業	12,900	516.00	6,656,400
デンソー	214,700	4,892.00	1,050,312,400
東海理化電機製作所	25,800	1,842.00	47,523,600
三井E & Sホールディングス	35,200	1,002.00	35,270,400
川崎重工業	75,900	2,647.00	200,907,300
名村造船所	29,300	283.00	8,291,900
日本車輛製造	3,600	2,520.00	9,072,000
三菱ロジスネクスト	11,600	1,134.00	13,154,400
近畿車輛	1,500	1,699.00	2,548,500
日産自動車	1,150,000	765.60	880,440,000
いすゞ自動車	308,200	1,246.00	384,017,200
トヨタ自動車	1,086,600	7,222.00	7,847,425,200
日野自動車	121,800	867.00	105,600,600
三菱自動車工業	360,900	496.00	179,006,400
エフテック	7,100	754.00	5,353,400
レシップホールディングス	3,500	791.00	2,768,500
G M B	2,200	827.00	1,819,400
ファルテック	2,000	822.00	1,644,000
武蔵精密工業	23,800	1,485.00	35,343,000
日産車体	19,000	1,011.00	19,209,000
新明和工業	40,900	1,354.00	55,378,600
極東開発工業	19,400	1,381.00	26,791,400
日信工業	18,000	1,548.00	27,864,000
トピー工業	8,100	2,363.00	19,140,300
ティラド	3,700	1,924.00	7,118,800
タチエス	16,200	1,440.00	23,328,000
N O K	52,600	1,646.00	86,579,600
フタバ産業	27,500	703.00	19,332,500
K Y B	10,100	3,160.00	31,916,000
大同メタル工業	16,200	667.00	10,805,400
プレス工業	48,800	486.00	23,716,800
ミクニ	13,000	381.00	4,953,000
太平洋工業	20,600	1,603.00	33,021,800
ケーヒン	22,600	1,550.00	35,030,000
河西工業	12,300	881.00	10,836,300
アイシン精機	80,400	3,670.00	295,068,000
マツダ	306,000	1,112.00	340,272,000
今仙電機製作所	9,300	928.00	8,630,400
本田技研工業	822,600	2,843.00	2,338,651,800

スズキ	178,400	4,437.00	791,560,800
S U B A R U	302,700	2,683.50	812,295,450
安永	4,900	1,463.00	7,168,700
ヤマハ発動機	137,700	1,939.00	267,000,300
ショーワ	23,200	1,444.00	33,500,800
T B K	12,200	410.00	5,002,000
エクセディ	13,400	2,336.00	31,302,400
豊田合成	31,600	2,161.00	68,287,600
愛三工業	15,600	700.00	10,920,000
盟和産業	1,700	1,058.00	1,798,600
日本プラスト	8,000	723.00	5,784,000
ヨロズ	9,300	1,456.00	13,540,800
エフ・シー・シー	17,600	2,182.00	38,403,200
シマノ	39,300	15,410.00	605,613,000
テイ・エス テック	22,700	3,045.00	69,121,500
ジャムコ	5,000	2,029.00	10,145,000
テルモ	275,900	3,155.00	870,464,500
クリエートメディック	3,200	923.00	2,953,600
日機装	31,500	1,408.00	44,352,000
島津製作所	125,500	2,699.00	338,724,500
J M S	9,000	774.00	6,966,000
長野計器	7,700	813.00	6,260,100
ブイ・テクノロジー	4,600	5,390.00	24,794,000
東京計器	6,200	992.00	6,150,400
愛知時計電機	1,300	4,190.00	5,447,000
インターアクション	5,200	1,849.00	9,614,800
オーバル	9,600	254.00	2,438,400
東京精密	17,700	3,180.00	56,286,000
マニー	13,000	8,050.00	104,650,000
ニコン	169,900	1,542.00	261,985,800
トプコン	52,400	1,318.00	69,063,200
オリンパス	581,000	1,179.00	684,999,000
理研計器	8,600	1,957.00	16,830,200
タムロン	8,700	2,477.00	21,549,900
H O Y A	196,300	8,330.00	1,635,179,000
シード	4,200	1,096.00	4,603,200
ノーリツ鋼機	7,700	1,938.00	14,922,600
エー・アンド・デイ	8,900	812.00	7,226,800
朝日インテック	82,700	2,884.00	238,506,800
シチズン時計	106,700	562.00	59,965,400
リズム時計工業	3,300	1,268.00	4,184,400
大研医器	7,800	624.00	4,867,200

メニコン	13,400	3,900.00	52,260,000
シンシア	1,500	660.00	990,000
松風	4,800	1,374.00	6,595,200
セイコーホールディングス	15,100	2,259.00	34,110,900
ニプロ	67,500	1,217.00	82,147,500
中本パックス	2,700	1,481.00	3,998,700
スノーピーク	3,800	1,369.00	5,202,200
パラマウントベッドホールディングス	11,200	4,210.00	47,152,000
トランザクション	6,200	1,018.00	6,311,600
S H O - B I	2,800	371.00	1,038,800
ニホンフラッシュ	4,200	2,829.00	11,881,800
前田工織	10,700	2,000.00	21,400,000
永大産業	12,700	352.00	4,470,400
アートネイチャー	10,400	661.00	6,874,400
バンダイナムコホールディングス	100,800	5,880.00	592,704,000
アイフィスジャパン	2,200	619.00	1,361,800
共立印刷	16,200	190.00	3,078,000
S H O E I	4,700	4,770.00	22,419,000
フランスベッドホールディングス	13,800	994.00	13,717,200
パイロットコーポレーション	17,000	4,165.00	70,805,000
萩原工業	5,400	1,366.00	7,376,400
トッパン・フォームズ	20,900	945.00	19,750,500
フジシールインターナショナル	21,900	3,280.00	71,832,000
タカラトミー	40,800	1,363.00	55,610,400
廣済堂	9,100	707.00	6,433,700
エステールホールディングス	2,600	628.00	1,632,800
アーク	37,200	102.00	3,794,400
タカノ	3,800	797.00	3,028,600
プロネクサス	8,400	1,069.00	8,979,600
ホクシン	6,000	134.00	804,000
ウッドワン	3,300	996.00	3,286,800
大建工業	7,400	2,133.00	15,784,200
凸版印刷	137,600	1,781.00	245,065,600
大日本印刷	137,400	2,373.00	326,050,200
図書印刷	9,100	1,421.00	12,931,100
共同印刷	3,000	2,836.00	8,508,000
N I S S H A	20,000	1,275.00	25,500,000
光村印刷	800	1,950.00	1,560,000
宝印刷	4,700	1,666.00	7,830,200
アシックス	92,000	1,177.00	108,284,000
ツツミ	3,000	2,100.00	6,300,000
小松ウオール工業	3,000	1,963.00	5,889,000

ヤマハ	58,000	5,180.00	300,440,000
河合楽器製作所	3,000	3,110.00	9,330,000
クリナップ	9,100	554.00	5,041,400
ピジョン	58,900	4,120.00	242,668,000
兼松サステック	600	1,711.00	1,026,600
キングジム	8,100	824.00	6,674,400
リンテック	23,200	2,316.00	53,731,200
イトーキ	17,900	465.00	8,323,500
任天堂	55,800	40,180.00	2,242,044,000
三菱鉛筆	16,100	1,691.00	27,225,100
タカラスタンダード	20,100	1,734.00	34,853,400
コクヨ	46,800	1,507.00	70,527,600
ナカバヤシ	9,600	542.00	5,203,200
グローブライド	4,700	3,230.00	15,181,000
オカムラ	34,000	1,038.00	35,292,000
美津濃	9,700	2,462.00	23,881,400
東京電力ホールディングス	778,400	511.00	397,762,400
中部電力	298,300	1,493.50	445,511,050
関西電力	397,900	1,236.00	491,804,400
中国電力	134,800	1,357.00	182,923,600
北陸電力	95,500	750.00	71,625,000
東北電力	228,400	1,055.00	240,962,000
四国電力	87,800	973.00	85,429,400
九州電力	201,000	1,029.00	206,829,000
北海道電力	91,200	591.00	53,899,200
沖縄電力	18,100	1,724.00	31,204,400
電源開発	77,600	2,482.00	192,603,200
エフオン	4,600	815.00	3,749,000
イーレックス	16,900	1,098.00	18,556,200
レノバ	16,000	816.00	13,056,000
東京瓦斯	191,300	2,659.00	508,666,700
大阪瓦斯	189,200	1,948.00	368,561,600
東邦瓦斯	48,300	3,930.00	189,819,000
北海道瓦斯	5,200	1,477.00	7,680,400
広島ガス	20,100	334.00	6,713,400
西部瓦斯	11,000	2,209.00	24,299,000
静岡ガス	30,000	832.00	24,960,000
メタウォーター	4,700	3,515.00	16,520,500
SBSホールディングス	9,600	1,629.00	15,638,400
東武鉄道	102,800	3,105.00	319,194,000
相鉄ホールディングス	33,400	2,896.00	96,726,400
東京急行電鉄	264,800	1,906.00	504,708,800

京浜急行電鉄	133,600	1,821.00	243,285,600
小田急電鉄	156,200	2,503.00	390,968,600
京王電鉄	54,500	6,690.00	364,605,000
京成電鉄	73,100	3,950.00	288,745,000
富士急行	13,300	4,130.00	54,929,000
新京成電鉄	2,500	2,032.00	5,080,000
東日本旅客鉄道	173,400	9,923.00	1,720,648,200
西日本旅客鉄道	87,400	8,815.00	770,431,000
東海旅客鉄道	87,300	21,945.00	1,915,798,500
西武ホールディングス	120,800	1,708.00	206,326,400
鴻池運輸	15,500	1,707.00	26,458,500
西日本鉄道	27,000	2,341.00	63,207,000
ハマキョウレックス	7,500	4,030.00	30,225,000
サカイ引越センター	5,100	6,790.00	34,629,000
近鉄グループホールディングス	92,400	5,180.00	478,632,000
阪急阪神ホールディングス	123,200	3,810.00	469,392,000
南海電気鉄道	41,200	2,603.00	107,243,600
京阪ホールディングス	41,100	4,505.00	185,155,500
神戸電鉄	2,400	3,960.00	9,504,000
名古屋鉄道	75,900	3,015.00	228,838,500
山陽電気鉄道	7,100	2,124.00	15,080,400
日本通運	35,600	5,760.00	205,056,000
ヤマトホールディングス	161,900	2,192.50	354,965,750
山九	25,700	5,700.00	146,490,000
丸運	5,300	279.00	1,478,700
丸全昭和運輸	7,500	3,295.00	24,712,500
センコーグループホールディングス	50,900	877.00	44,639,300
トナミホールディングス	2,200	5,610.00	12,342,000
ニッコンホールディングス	35,100	2,588.00	90,838,800
日本石油輸送	1,100	2,892.00	3,181,200
福山通運	11,800	4,090.00	48,262,000
セイノーホールディングス	69,200	1,366.00	94,527,200
エスライン	2,800	973.00	2,724,400
神奈川中央交通	2,300	3,715.00	8,544,500
日立物流	20,300	3,425.00	69,527,500
丸和運輸機関	4,900	4,700.00	23,030,000
C & F ロジホールディングス	9,300	1,345.00	12,508,500
九州旅客鉄道	77,500	3,130.00	242,575,000
S Gホールディングス	87,200	3,010.00	262,472,000
日本郵船	77,600	1,867.00	144,879,200
商船三井	55,000	2,741.00	150,755,000
川崎汽船	28,400	1,420.00	40,328,000



N Sユニテッド海運	5,300	2,484.00	13,165,200
飯野海運	45,400	372.00	16,888,800
共栄タンカー	1,200	1,454.00	1,744,800
乾汽船	8,300	883.00	7,328,900
日本航空	169,100	3,449.00	583,225,900
A N Aホールディングス	168,800	3,637.00	613,925,600
パスコ	1,800	892.00	1,605,600
ランコム	2,600	6,010.00	15,626,000
日新	8,000	1,728.00	13,824,000
三菱倉庫	32,000	3,035.00	97,120,000
三井倉庫ホールディングス	11,300	1,561.00	17,639,300
住友倉庫	34,000	1,414.00	48,076,000
澁澤倉庫	5,100	1,777.00	9,062,700
東陽倉庫	16,700	323.00	5,394,100
日本トランスシティ	20,300	519.00	10,535,700
ケイヒン	1,800	1,240.00	2,232,000
中央倉庫	5,600	1,070.00	5,992,000
川西倉庫	1,900	1,058.00	2,010,200
安田倉庫	7,600	902.00	6,855,200
ファイズ	1,600	733.00	1,172,800
東洋埠頭	2,800	1,394.00	3,903,200
宇徳	7,900	482.00	3,807,800
上組	57,000	2,541.00	144,837,000
サンリツ	2,200	653.00	1,436,600
キムラユニティー	2,500	1,083.00	2,707,500
キューソー流通システム	2,300	1,963.00	4,514,900
近鉄エクスプレス	17,400	1,462.00	25,438,800
東海運	5,300	294.00	1,558,200
エーアイティー	6,000	1,023.00	6,138,000
内外トランスライン	2,900	1,343.00	3,894,700
日本コンセプト	3,400	1,230.00	4,182,000
N E C ネットエスアイ	10,600	2,724.00	28,874,400
クロスキャット	2,700	966.00	2,608,200
システナ	34,200	1,826.00	62,449,200
デジタルアーツ	5,200	11,010.00	57,252,000
日鉄ソリューションズ	14,400	3,420.00	49,248,000
キューブシステム	5,300	846.00	4,483,800
エイジア	2,000	1,259.00	2,518,000
コア	4,200	1,638.00	6,879,600
ソリトンシステムズ	5,600	1,094.00	6,126,400
ソフトクリエイトホールディングス	4,300	1,698.00	7,301,400
T I S	31,900	5,620.00	179,278,000

ネオス	3,800	808.00	3,070,400
電算システム	3,700	3,400.00	12,580,000
グリー	66,400	519.00	34,461,600
コーエーテクモホールディングス	19,700	2,077.00	40,916,900
三菱総合研究所	4,200	3,680.00	15,456,000
電算	1,100	2,030.00	2,233,000
A G S	5,700	671.00	3,824,700
ファインデックス	8,300	1,018.00	8,449,400
ブレインパッド	1,900	6,700.00	12,730,000
K L a b	17,100	874.00	14,945,400
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,900	1,158.00	14,938,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,394.00	3,830,400
ネクソン	244,300	1,727.00	421,906,100
アイスタイル	24,800	837.00	20,757,600
エムアップ	3,400	2,289.00	7,782,600
エイチーム	6,700	1,122.00	7,517,400
エニグモ	3,500	2,325.00	8,137,500
テクノスジャパン	8,400	583.00	4,897,200
コロプラ	31,600	662.00	20,919,200
ブロードリーフ	47,800	565.00	27,007,000
クロス・マーケティンググループ	4,000	374.00	1,496,000
デジタルハーツホールディングス	4,500	1,074.00	4,833,000
システム情報	5,000	1,118.00	5,590,000
メディアドゥホールディングス	3,000	3,470.00	10,410,000
じげん	13,800	796.00	10,984,800
エンカレッジ・テクノロジー	1,500	847.00	1,270,500
サイバーリンクス	1,600	1,190.00	1,904,000
フィックスターズ	10,300	1,817.00	18,715,100
C A R T A H O L D I N G S	4,800	1,243.00	5,966,400
オブティム	4,200	3,040.00	12,768,000
セレス	3,200	1,693.00	5,417,600
ティーガイア	6,900	2,079.00	14,345,100
セック	1,600	3,625.00	5,800,000
日本アジアグループ	10,100	343.00	3,464,300
豆蔵ホールディングス	6,600	1,391.00	9,180,600
テクマトリックス	6,800	2,156.00	14,660,800
プロシップ	2,900	1,249.00	3,622,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23,100	2,904.00	67,082,400
G M O ペイメントゲートウェイ	15,800	7,890.00	124,662,000
ザッパラス	5,500	344.00	1,892,000
システムリサーチ	1,300	3,710.00	4,823,000
インターネットイニシアティブ	15,700	2,118.00	33,252,600

さくらインターネット	11,700	576.00	6,739,200
ヴィンクス	3,400	1,122.00	3,814,800
GMOクラウド	2,200	3,215.00	7,073,000
SRAホールディングス	5,200	2,492.00	12,958,400
Minorityソリューションズ	2,000	1,912.00	3,824,000
システムインテグレータ	2,900	689.00	1,998,100
朝日ネット	8,000	698.00	5,584,000
eBASE	5,900	1,193.00	7,038,700
アバント	3,500	1,968.00	6,888,000
アドソル日進	3,500	1,908.00	6,678,000
フリービット	5,800	1,153.00	6,687,400
コムチュア	5,400	3,920.00	21,168,000
サイバーコム	1,800	1,965.00	3,537,000
アステリア	6,500	999.00	6,493,500
マークラインズ	4,500	1,852.00	8,334,000
メディカル・データ・ビジョン	8,600	1,110.00	9,546,000
ショーケース	2,400	599.00	1,437,600
モバイルファクトリー	2,800	1,369.00	3,833,200
テラスカイ	1,600	2,005.00	3,208,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,702.00	7,318,600
PCIホールディングス	2,000	2,247.00	4,494,000
パイプドHD	1,600	1,129.00	1,806,400
アイビーシー	1,900	1,306.00	2,481,400
ネオジャパン	2,000	1,020.00	2,040,000
PR TIMES	900	3,355.00	3,019,500
ランドコンピュータ	1,600	1,089.00	1,742,400
ダブルスタンダード	900	4,615.00	4,153,500
オープンドア	4,800	2,739.00	13,147,200
マイネット	3,300	666.00	2,197,800
アカツキ	3,400	7,150.00	24,310,000
ベネフィットジャパン	900	890.00	801,000
Ubicomホールディングス	1,800	1,727.00	3,108,600
LINE	29,200	3,415.00	99,718,000
カナミックネットワーク	2,000	2,213.00	4,426,000
ノムラシステムコーポレーション	1,300	929.00	1,207,700
チェンジ	2,000	2,255.00	4,510,000
シンクロ・フード	4,400	610.00	2,684,000
オークネット	5,200	1,283.00	6,671,600
エイトレッド	1,100	1,885.00	2,073,500
AOI TYO Holdings	10,700	702.00	7,511,400
マクロミル	17,100	1,280.00	21,888,000
ビーグリー	2,600	886.00	2,303,600

オロ	2,600	2,610.00	6,786,000
テモナ	1,600	477.00	763,200
サインポスト	1,500	2,381.00	3,571,500
ソルクシーズ	4,300	970.00	4,171,000
フェイス	3,900	775.00	3,022,500
プロトコーポレーション	8,800	1,045.00	9,196,000
ハイマックス	1,200	1,822.00	2,186,400
野村総合研究所	182,700	1,774.00	324,109,800
サイバネットシステム	8,100	656.00	5,313,600
C Eホールディングス	2,900	1,180.00	3,422,000
日本システム技術	1,600	1,680.00	2,688,000
インテージホールディングス	12,200	941.00	11,480,200
東邦システムサイエンス	3,000	1,013.00	3,039,000
ソースネクスト	37,600	401.00	15,077,600
インフォコム	10,500	2,510.00	26,355,000
F I G	9,100	347.00	3,157,700
アルテリア・ネットワークス	10,800	1,231.00	13,294,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,849.00	4,252,700
フォーカスシステムズ	6,600	856.00	5,649,600
クレスコ	3,000	3,780.00	11,340,000
フジ・メディア・ホールディングス	99,400	1,457.00	144,825,800
オービック	33,200	11,770.00	390,764,000
ジャストシステム	13,700	3,605.00	49,388,500
T D Cソフト	8,600	871.00	7,490,600
ヤフー	624,300	327.00	204,146,100
トレンドマイクロ	51,100	4,825.00	246,557,500
I Dホールディングス	3,800	1,204.00	4,575,200
日本オラクル	19,400	9,260.00	179,644,000
アルファシステムズ	3,000	2,738.00	8,214,000
フューチャー	13,100	2,093.00	27,418,300
C A C Holdings	7,000	1,370.00	9,590,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,200	2,308.00	9,693,600
トーセ	2,800	849.00	2,377,200
オービックビジネスコンサルタント	9,800	4,450.00	43,610,000
伊藤忠テクノソリューションズ	43,700	2,744.00	119,912,800
アイティフォー	11,800	914.00	10,785,200
東計電算	1,500	3,005.00	4,507,500
エクスネット	1,900	932.00	1,770,800
大塚商会	51,800	4,245.00	219,891,000
サイボウズ	11,300	1,283.00	14,497,900
ソフトブレーン	7,900	513.00	4,052,700
電通国際情報サービス	6,000	3,715.00	22,290,000

デジタルガレージ	18,700	3,655.00	68,348,500
E Mシステムズ	7,900	1,716.00	13,556,400
ウェザーニューズ	3,300	3,130.00	10,329,000
C I J	7,700	981.00	7,553,700
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,153.00	2,153,000
日本エンタープライズ	10,900	175.00	1,907,500
WOWOW	4,700	2,598.00	12,210,600
スカラ	6,900	935.00	6,451,500
インテリジェント ウェイブ	3,800	932.00	3,541,600
I M A G I C A G R O U P	8,400	525.00	4,410,000
ネットワンシステムズ	33,900	2,874.00	97,428,600
システムソフト	24,300	114.00	2,770,200
アルゴグラフィックス	8,200	2,437.00	19,983,400
マーベラス	14,900	798.00	11,890,200
エイベックス	16,500	1,407.00	23,215,500
日本ユニシス	29,900	3,490.00	104,351,000
兼松エレクトロニクス	5,300	3,040.00	16,112,000
東京放送ホールディングス	63,600	1,896.00	120,585,600
日本テレビホールディングス	88,000	1,670.00	146,960,000
朝日放送グループホールディングス	9,800	730.00	7,154,000
テレビ朝日ホールディングス	26,400	1,855.00	48,972,000
スカパーJ S A Tホールディングス	63,400	441.00	27,959,400
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,333.00	18,430,700
日本BS放送	3,400	1,068.00	3,631,200
ビジョン	3,000	5,160.00	15,480,000
スマートバリュー	3,100	735.00	2,278,500
ワイヤレスゲート	4,500	550.00	2,475,000
コネクシオ	6,900	1,390.00	9,591,000
クロップス	2,000	606.00	1,212,000
日本電信電話	654,500	5,041.00	3,299,334,500
K D D I	784,400	2,890.00	2,266,916,000
ソフトバンク	1,014,600	1,451.50	1,472,691,900
光通信	11,300	24,600.00	277,980,000
N T T ドコモ	605,900	2,644.50	1,602,302,550
エムティーアイ	9,500	789.00	7,495,500
G M O インターネット	35,000	1,779.00	62,265,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,400	679.00	1,629,600
K A D O K A W A	28,000	1,396.00	39,088,000
学研ホールディングス	3,200	4,940.00	15,808,000
ゼンリン	19,200	1,940.00	37,248,000
昭文社	4,900	372.00	1,822,800
インプレスホールディングス	7,900	139.00	1,098,100

アイネット	5,600	1,182.00	6,619,200
松竹	6,300	11,540.00	72,702,000
東宝	63,000	4,195.00	264,285,000
東映	4,000	15,020.00	60,080,000
エヌ・ティ・ティ・データ	254,900	1,390.00	354,311,000
ピー・シー・エー	1,300	3,615.00	4,699,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,286.00	3,886,200
D T S	21,500	2,314.00	49,751,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,600	3,625.00	161,675,000
シーイーシー	10,300	2,443.00	25,162,900
カプコン	41,100	2,206.00	90,666,600
アイ・エス・ピー	2,000	1,687.00	3,374,000
ジャステック	5,700	1,087.00	6,195,900
S C S K	25,300	5,280.00	133,584,000
日本システムウエア	3,200	2,615.00	8,368,000
アイネス	12,300	1,170.00	14,391,000
T K C	8,100	4,660.00	37,746,000
富士ソフト	14,300	4,930.00	70,499,000
N S D	15,800	3,300.00	52,140,000
コナミホールディングス	39,100	4,520.00	176,732,000
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,286.00	7,315,200
J B C Cホールディングス	7,700	1,472.00	11,334,400
ミロク情報サービス	9,500	3,340.00	31,730,000
ソフトバンクグループ	799,800	5,604.00	4,482,079,200
ハウスイ	800	829.00	663,200
高千穂交易	3,700	1,070.00	3,959,000
伊藤忠食品	2,400	4,445.00	10,668,000
エレマテック	9,000	1,067.00	9,603,000
J A L U X	2,700	2,639.00	7,125,300
あらた	7,100	3,570.00	25,347,000
トーメンデバイス	1,400	2,298.00	3,217,200
東京エレクトロン デバイス	3,500	2,054.00	7,189,000
フィールズ	8,400	497.00	4,174,800
双日	530,400	346.00	183,518,400
アルフレッサ ホールディングス	106,700	2,619.00	279,447,300
横浜冷凍	26,900	1,035.00	27,841,500
神栄	1,300	829.00	1,077,700
ラサ商事	5,100	810.00	4,131,000
ラクーンホールディングス	4,600	626.00	2,879,600
アルコニックス	10,200	1,338.00	13,647,600
神戸物産	14,500	5,810.00	84,245,000
あい ホールディングス	13,700	1,728.00	23,673,600

ディーブイエックス	3,800	799.00	3,036,200
ダイワボウホールディングス	8,800	5,190.00	45,672,000
マクニカ・富士エレホールディングス	26,600	1,632.00	43,411,200
ラクト・ジャパン	4,200	3,165.00	13,293,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,100	1,045.00	18,914,500
八洲電機	7,400	868.00	6,423,200
メディアスホールディングス	5,500	680.00	3,740,000
レスターホールディングス	10,500	1,706.00	17,913,000
ジュテックホールディングス	2,200	1,003.00	2,206,600
大光	4,100	674.00	2,763,400
OCHIホールディングス	2,800	1,178.00	3,298,400
TOKAIホールディングス	50,800	932.00	47,345,600
黒谷	2,200	475.00	1,045,000
Cominix	1,700	834.00	1,417,800
三洋貿易	4,800	2,435.00	11,688,000
ビューティガレージ	1,600	1,836.00	2,937,600
ウイン・パートナーズ	6,200	1,162.00	7,204,400
ミタチ産業	2,900	714.00	2,070,600
シップヘルスケアホールディングス	20,000	4,745.00	94,900,000
明治電機工業	3,000	1,406.00	4,218,000
デリカフーズホールディングス	1,700	1,470.00	2,499,000
スターティアホールディングス	1,900	556.00	1,056,400
コメダホールディングス	22,200	2,018.00	44,799,600
富士興産	3,700	896.00	3,315,200
協栄産業	1,200	1,424.00	1,708,800
小野建	8,600	1,370.00	11,782,000
南陽	2,000	1,635.00	3,270,000
佐島電機	7,100	911.00	6,468,100
エコートレーディング	2,200	543.00	1,194,600
伯東	6,600	1,263.00	8,335,800
コンドーテック	7,400	925.00	6,845,000
中山福	5,500	536.00	2,948,000
ナガイレーベン	13,900	2,317.00	32,206,300
三菱食品	10,600	2,807.00	29,754,200
松田産業	7,000	1,492.00	10,444,000
第一興商	14,300	4,625.00	66,137,500
メディバルホールディングス	103,600	2,352.00	243,667,200
SPK	2,100	2,529.00	5,310,900
萩原電気ホールディングス	3,600	2,897.00	10,429,200
アズワン	6,900	8,990.00	62,031,000
スズデン	3,300	1,342.00	4,428,600
尾家産業	3,100	1,301.00	4,033,100

シモジマ	5,900	1,115.00	6,578,500
ドウシシャ	9,100	1,691.00	15,388,100
小津産業	2,100	1,725.00	3,622,500
高速	5,700	1,247.00	7,107,900
たけびし	3,400	1,445.00	4,913,000
リックス	2,200	1,566.00	3,445,200
丸文	8,500	600.00	5,100,000
ハピネット	8,000	1,323.00	10,584,000
橋本総業ホールディングス	1,900	1,548.00	2,941,200
日本ライフライン	28,500	1,903.00	54,235,500
タカショー	4,700	453.00	2,129,100
エクセル	3,600	1,601.00	5,763,600
マルカ	3,100	1,962.00	6,082,200
I D O M	32,400	411.00	13,316,400
日本エム・ディ・エム	5,600	1,414.00	7,918,400
進和	5,700	2,281.00	13,001,700
エスケイジャパン	2,300	449.00	1,032,700
ダイترون	4,400	1,319.00	5,803,600
シークス	12,200	1,435.00	17,507,000
田中商事	3,200	633.00	2,025,600
オーハシテクニカ	5,400	1,490.00	8,046,000
白銅	3,100	1,397.00	4,330,700
伊藤忠商事	671,700	2,101.50	1,411,577,550
丸紅	947,100	722.60	684,374,460
高島	1,500	1,685.00	2,527,500
長瀬産業	54,000	1,632.00	88,128,000
蝶理	6,100	1,722.00	10,504,200
豊田通商	107,200	3,255.00	348,936,000
三共生興	16,400	517.00	8,478,800
兼松	38,400	1,246.00	47,846,400
ツカモトコーポレーション	1,700	1,056.00	1,795,200
三井物産	791,200	1,783.50	1,411,105,200
日本紙パルプ商事	5,500	3,715.00	20,432,500
日立ハイテクノロジーズ	29,200	5,780.00	168,776,000
カメイ	12,500	1,085.00	13,562,500
東都水産	1,300	2,595.00	3,373,500
O U Gホールディングス	1,500	2,657.00	3,985,500
スターゼン	3,500	4,210.00	14,735,000
山善	37,500	1,055.00	39,562,500
椿本興業	2,200	3,315.00	7,293,000
住友商事	568,000	1,628.50	924,988,000
内田洋行	4,100	3,490.00	14,309,000



三菱商事	673,900	2,943.00	1,983,287,700
第一実業	4,400	3,070.00	13,508,000
キヤノンマーケティングジャパン	27,500	2,181.00	59,977,500
西華産業	5,400	1,370.00	7,398,000
佐藤商事	8,600	921.00	7,920,600
菱洋エレクトロ	9,700	1,853.00	17,974,100
東京産業	9,600	504.00	4,838,400
ユアサ商事	9,800	3,130.00	30,674,000
神鋼商事	2,200	2,293.00	5,044,600
小林産業	5,800	298.00	1,728,400
阪和興業	16,700	2,974.00	49,665,800
正栄食品工業	6,700	3,155.00	21,138,500
カナデン	8,700	1,430.00	12,441,000
菱電商事	7,600	1,632.00	12,403,200
フルサト工業	5,300	1,470.00	7,791,000
岩谷産業	21,300	3,595.00	76,573,500
すてきナイスグループ	4,100	628.00	2,574,800
昭光通商	3,400	665.00	2,261,000
ニチモウ	1,500	1,763.00	2,644,500
極東貿易	3,000	1,795.00	5,385,000
イワキ	11,500	498.00	5,727,000
三愛石油	25,800	1,055.00	27,219,000
稲畑産業	23,100	1,404.00	32,432,400
G S Iクレオス	2,600	1,281.00	3,330,600
明和産業	8,900	390.00	3,471,000
クワザワ	3,400	492.00	1,672,800
ワキタ	20,500	1,094.00	22,427,000
東邦ホールディングス	28,400	2,387.00	67,790,800
サンゲツ	28,500	2,013.00	57,370,500
ミツウロコグループホールディングス	12,800	847.00	10,841,600
シナネンホールディングス	4,000	1,828.00	7,312,000
伊藤忠エネクス	21,300	865.00	18,424,500
サンリオ	29,700	2,233.00	66,320,100
サンワテクノス	5,800	892.00	5,173,600
リョーサン	10,600	2,610.00	27,666,000
新光商事	9,000	1,962.00	17,658,000
トーホー	4,300	1,999.00	8,595,700
三信電気	6,600	1,839.00	12,137,400
東陽テクニカ	11,100	1,043.00	11,577,300
モスフードサービス	12,600	2,456.00	30,945,600
加賀電子	9,600	1,651.00	15,849,600
ソーダニッカ	9,900	586.00	5,801,400

立花エレテック	7,100	1,725.00	12,247,500
フォーバル	4,200	931.00	3,910,200
PALTAC	17,300	5,860.00	101,378,000
三谷産業	11,300	284.00	3,209,200
西本Wismettacホールディングス	2,200	3,740.00	8,228,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,226.00	980,800
国際紙パルプ商事	22,500	332.00	7,470,000
ヤマタネ	4,800	1,422.00	6,825,600
丸紅建材リース	900	1,728.00	1,555,200
日鉄物産	6,900	4,445.00	30,670,500
泉州電業	3,200	2,781.00	8,899,200
トラスコ中山	20,000	2,280.00	45,600,000
オートバックスセブン	38,200	1,784.00	68,148,800
モリト	7,000	805.00	5,635,000
加藤産業	15,000	3,210.00	48,150,000
北恵	1,800	858.00	1,544,400
イノテック	5,700	932.00	5,312,400
イエローハット	18,100	1,384.00	25,050,400
JKホールディングス	8,700	559.00	4,863,300
日伝	8,000	1,898.00	15,184,000
北沢産業	7,300	260.00	1,898,000
杉本商事	5,200	2,101.00	10,925,200
因幡電機産業	13,700	4,740.00	64,938,000
東テク	3,200	2,370.00	7,584,000
ミスミグループ本社	120,300	2,554.00	307,246,200
アルテック	7,100	214.00	1,519,400
タキヒヨー	2,900	1,860.00	5,394,000
蔵王産業	1,600	1,330.00	2,128,000
スズケン	43,800	6,070.00	265,866,000
ジェコス	6,600	970.00	6,402,000
グローセル	8,800	438.00	3,854,400
ローソン	24,300	5,380.00	130,734,000
サンエー	7,300	4,410.00	32,193,000
カワチ薬品	7,500	2,017.00	15,127,500
エービーシー・マート	15,000	6,880.00	103,200,000
ハードオフコーポレーション	4,000	728.00	2,912,000
アスクル	10,100	2,704.00	27,310,400
ゲオホールディングス	14,700	1,458.00	21,432,600
アダストリア	13,300	2,188.00	29,100,400
ジーフット	6,000	651.00	3,906,000
くら寿司	5,700	4,415.00	25,165,500
キャンドウ	4,600	1,612.00	7,415,200

パルグループホールディングス	4,900	3,500.00	17,150,000
エディオン	40,800	1,068.00	43,574,400
サーラコーポレーション	19,700	589.00	11,603,300
ワッツ	4,400	701.00	3,084,400
ハローズ	3,700	2,245.00	8,306,500
フジオフードシステム	4,100	2,574.00	10,553,400
あみやき亭	2,100	3,490.00	7,329,000
ひらまつ	19,400	360.00	6,984,000
大黒天物産	2,300	3,285.00	7,555,500
ハニーズホールディングス	8,500	1,352.00	11,492,000
ファーマライズホールディングス	2,400	555.00	1,332,000
アルペン	7,400	1,549.00	11,462,600
ハブ	3,200	1,182.00	3,782,400
クオールホールディングス	14,200	1,613.00	22,904,600
ジーンズホールディングス	5,100	5,960.00	30,396,000
ビックカメラ	57,100	1,102.00	62,924,200
D C Mホールディングス	51,900	1,047.00	54,339,300
ペッパーフードサービス	7,700	1,691.00	13,020,700
MonotaRO	60,700	2,294.00	139,245,800
東京一番フーズ	2,600	609.00	1,583,400
DDホールディングス	2,100	2,975.00	6,247,500
きちりホールディングス	2,700	717.00	1,935,900
アークランドサービスホールディングス	7,100	1,918.00	13,617,800
J.フロント リテイリング	123,000	1,279.00	157,317,000
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,022.00	34,171,800
マツモトキヨシホールディングス	39,700	3,660.00	145,302,000
ブロンコビリー	5,100	2,260.00	11,526,000
Z O Z O	103,800	1,869.00	194,002,200
トレジャー・ファクトリー	2,900	1,216.00	3,526,400
物語コーポレーション	2,400	9,100.00	21,840,000
ココカラファイン	10,800	5,900.00	63,720,000
三越伊勢丹ホールディングス	179,800	883.00	158,763,400
Hamee	3,100	760.00	2,356,000
ウエルシアホールディングス	25,400	5,110.00	129,794,000
クリエイティブSDホールディングス	14,200	2,518.00	35,755,600
丸善C H Iホールディングス	11,200	385.00	4,312,000
ティーライフ	1,400	905.00	1,267,000
エー・ピーカンパニー	2,000	543.00	1,086,000
チムニー	3,000	2,417.00	7,251,000
シュッピン	6,700	750.00	5,025,000
ネクステージ	16,000	1,280.00	20,480,000
ジョイフル本田	28,200	1,241.00	34,996,200

鳥貴族	3,200	2,148.00	6,873,600
キリン堂ホールディングス	3,800	1,913.00	7,269,400
ホットランド	5,100	1,514.00	7,721,400
すかいらーくホールディングス	89,700	1,888.00	169,353,600
SFPホールディングス	4,100	2,097.00	8,597,700
綿半ホールディングス	3,600	2,550.00	9,180,000
ヨシックス	1,600	2,537.00	4,059,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,000	952.00	26,656,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,000	574.00	2,296,000
B E E N O S	3,400	1,507.00	5,123,800
あさひ	8,000	1,263.00	10,104,000
日本調剤	3,400	3,235.00	10,999,000
コスモス薬品	4,200	19,720.00	82,824,000
トーエル	4,800	714.00	3,427,200
オンリー	1,800	873.00	1,571,400
セブン&アイ・ホールディングス	402,600	3,795.00	1,527,867,000
薬王堂	4,200	2,415.00	10,143,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,900	1,623.00	42,035,700
ツルハホールディングス	20,900	10,950.00	228,855,000
サンマルクホールディングス	7,600	2,316.00	17,601,600
フェリシモ	2,200	1,018.00	2,239,600
トリドールホールディングス	11,900	2,465.00	29,333,500
T O K Y O B A S E	8,800	797.00	7,013,600
ウイルプラスホールディングス	1,600	805.00	1,288,000
ジャパンミート	4,900	1,878.00	9,202,200
サツドラホールディングス	1,500	1,898.00	2,847,000
デファクトスタンダード	1,100	358.00	393,800
アレンザホールディングス	5,300	842.00	4,462,600
パロックジャパンリミテッド	7,900	1,119.00	8,840,100
クスリのアオキホールディングス	9,600	7,170.00	68,832,000
力の源ホールディングス	3,700	956.00	3,537,200
スシローグローバルホールディングス	10,600	6,650.00	70,490,000
L I X I L ビバ	8,200	1,279.00	10,487,800
メディカルシステムネットワーク	10,400	548.00	5,699,200
はるやまホールディングス	4,600	815.00	3,749,000
ノジマ	17,100	1,782.00	30,472,200
カップ・クリエイト	13,500	1,392.00	18,792,000
ライトオン	7,200	718.00	5,169,600
良品計画	13,600	19,480.00	264,928,000
三城ホールディングス	12,200	340.00	4,148,000
アドヴァン	14,800	1,110.00	16,428,000

アルビス	3,700	2,766.00	10,234,200
コナカ	11,600	433.00	5,022,800
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,610.00	1,932,000
G - 7ホールディングス	2,900	2,872.00	8,328,800
イオン北海道	9,800	727.00	7,124,600
コジマ	16,700	492.00	8,216,400
ヒマラヤ	3,500	825.00	2,887,500
コーナン商事	12,600	2,389.00	30,101,400
エコス	3,600	1,472.00	5,299,200
ワタミ	12,700	1,522.00	19,329,400
マルシェ	2,700	771.00	2,081,700
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	57,500	6,900.00	396,750,000
西松屋チェーン	21,200	865.00	18,338,000
ゼンショーホールディングス	45,300	2,340.00	106,002,000
幸楽苑ホールディングス	6,100	2,947.00	17,976,700
ハークスレイ	2,100	1,061.00	2,228,100
サイゼリヤ	15,900	2,587.00	41,133,300
V Tホールディングス	43,600	425.00	18,530,000
魚力	2,700	1,518.00	4,098,600
フジ・コーポレーション	2,600	2,015.00	5,239,000
ユナイテッドアローズ	11,000	3,165.00	34,815,000
ハイデイ日高	13,900	2,097.00	29,148,300
京都きもの友禅	6,400	339.00	2,169,600
コロワイド	32,000	2,112.00	67,584,000
ピーシーデポコーポレーション	13,000	463.00	6,019,000
壱番屋	6,800	4,980.00	33,864,000
P L A N T	2,600	762.00	1,981,200
スギホールディングス	21,100	5,230.00	110,353,000
スクロール	15,100	347.00	5,239,700
ヨンドシーホールディングス	10,700	2,623.00	28,066,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	107,500	2,466.00	265,095,000
木曽路	11,800	2,621.00	30,927,800
S R Sホールディングス	11,400	1,010.00	11,514,000
タカキュー	8,000	180.00	1,440,000
ケーヨー	18,000	478.00	8,604,000
上新電機	11,400	2,107.00	24,019,800
日本瓦斯	15,200	2,965.00	45,068,000
ロイヤルホールディングス	16,800	2,709.00	45,511,200
いなげや	10,800	1,416.00	15,292,800
島忠	20,300	2,479.00	50,323,700
チヨダ	10,100	1,591.00	16,069,100
ライフコーポレーション	7,300	2,300.00	16,790,000

リンガーハット	11,900	2,573.00	30,618,700
MrMaxHD	13,400	457.00	6,123,800
テンアライド	8,900	425.00	3,782,500
AOKIホールディングス	19,300	1,060.00	20,458,000
オークワ	13,800	1,092.00	15,069,600
コメリ	14,900	2,262.00	33,703,800
青山商事	16,800	2,057.00	34,557,600
しまむら	11,200	7,860.00	88,032,000
はせがわ	5,400	405.00	2,187,000
高島屋	75,400	1,269.00	95,682,600
松屋	19,500	815.00	15,892,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,400	1,283.00	63,380,200
近鉄百貨店	3,700	3,140.00	11,618,000
パルコ	9,300	1,228.00	11,420,400
丸井グループ	81,300	2,348.00	190,892,400
アクシアル リテイリング	8,000	3,830.00	30,640,000
イオン	369,600	1,887.50	697,620,000
イズミ	19,600	4,220.00	82,712,000
平和堂	19,600	1,988.00	38,964,800
フジ	11,700	1,876.00	21,949,200
ヤオコー	10,900	4,930.00	53,737,000
ゼビオホールディングス	11,700	1,233.00	14,426,100
ケーズホールディングス	99,900	1,011.00	100,998,900
Olympicグループ	5,800	658.00	3,816,400
日産東京販売ホールディングス	14,500	280.00	4,060,000
Genky DrugStores	4,700	2,202.00	10,349,400
総合メディカルホールディングス	8,400	1,691.00	14,204,400
ブックオフグループホールディングス	5,000	1,267.00	6,335,000
アインホールディングス	12,900	6,040.00	77,916,000
元気寿司	2,700	3,150.00	8,505,000
ヤマダ電機	292,800	493.00	144,350,400
アークランドサカモト	16,400	1,334.00	21,877,600
ニトリホールディングス	41,600	14,720.00	612,352,000
グルメ杵屋	6,900	1,154.00	7,962,600
愛眼	7,700	262.00	2,017,400
ケーユーホールディングス	5,100	897.00	4,574,700
吉野家ホールディングス	33,600	2,171.00	72,945,600
松屋フーズホールディングス	4,600	3,415.00	15,709,000
サガミホールディングス	12,900	1,341.00	17,298,900
関西スーパーマーケット	7,300	1,094.00	7,986,200
王将フードサービス	7,100	6,390.00	45,369,000
プレナス	10,800	1,782.00	19,245,600

ミニストップ	7,200	1,495.00	10,764,000
アークス	18,100	2,211.00	40,019,100
パローホールディングス	20,800	2,297.00	47,777,600
ベルク	4,800	5,210.00	25,008,000
大庄	5,200	1,611.00	8,377,200
ファーストリテイリング	12,800	67,260.00	860,928,000
サンドラッグ	36,200	3,035.00	109,867,000
サクスパー ホールディングス	8,200	967.00	7,929,400
ヤマザワ	2,100	1,661.00	3,488,100
やまや	1,700	2,202.00	3,743,400
ペルーナ	23,700	701.00	16,613,700
島根銀行	2,900	708.00	2,053,200
じもとホールディングス	65,000	99.00	6,435,000
めぶきフィナンシャルグループ	502,000	274.00	137,548,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,400	1,498.00	20,073,200
九州フィナンシャルグループ	159,300	425.00	67,702,500
ゆうちょ銀行	273,100	1,078.00	294,401,800
富山第一銀行	25,000	309.00	7,725,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	604,900	402.00	243,169,800
西日本フィナンシャルホールディングス	61,300	782.00	47,936,600
関西みらいフィナンシャルグループ	46,000	746.00	34,316,000
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,610.00	14,007,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	2,851.00	48,181,900
新生銀行	70,600	1,683.00	118,819,800
あおぞら銀行	53,700	2,554.00	137,149,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,620,500	528.80	3,500,920,400
りそなホールディングス	1,055,400	447.90	472,713,660
三井住友トラスト・ホールディングス	189,100	3,900.00	737,490,000
三井住友フィナンシャルグループ	677,800	3,845.00	2,606,141,000
千葉銀行	331,900	549.00	182,213,100
群馬銀行	194,000	377.00	73,138,000
武蔵野銀行	14,600	2,097.00	30,616,200
千葉興業銀行	28,700	309.00	8,868,300
筑波銀行	40,000	173.00	6,920,000
七十七銀行	30,600	1,603.00	49,051,800
青森銀行	7,700	2,715.00	20,905,500
秋田銀行	6,500	2,047.00	13,305,500
山形銀行	11,200	1,622.00	18,166,400
岩手銀行	6,900	2,735.00	18,871,500
東邦銀行	86,000	265.00	22,790,000
東北銀行	4,900	1,045.00	5,120,500
みちのく銀行	6,200	1,678.00	10,403,600

ふくおかフィナンシャルグループ	85,000	2,020.00	171,700,000	
静岡銀行	238,900	806.00	192,553,400	
十六銀行	13,200	2,375.00	31,350,000	
八十二銀行	233,600	437.00	102,083,200	
山梨中央銀行	12,100	1,170.00	14,157,000	
大垣共立銀行	20,500	2,401.00	49,220,500	
福井銀行	8,700	1,418.00	12,336,600	
北國銀行	10,100	3,010.00	30,401,000	
清水銀行	4,300	1,868.00	8,032,400	
富山銀行	2,100	2,696.00	5,661,600	
滋賀銀行	19,500	2,437.00	47,521,500	
南都銀行	15,300	2,356.00	36,046,800	
百五銀行	88,500	325.00	28,762,500	
京都銀行	34,600	4,235.00	146,531,000	
紀陽銀行	34,500	1,434.00	49,473,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	64,600	1,148.00	74,160,800	
広島銀行	143,200	530.00	75,896,000	
山陰合同銀行	58,000	689.00	39,962,000	
中国銀行	83,400	964.00	80,397,600	
鳥取銀行	3,700	1,422.00	5,261,400	
伊予銀行	128,600	544.00	69,958,400	
百十四銀行	10,500	2,178.00	22,869,000	
四国銀行	14,300	943.00	13,484,900	
阿波銀行	15,000	2,528.00	37,920,000	
大分銀行	6,100	3,075.00	18,757,500	
宮崎銀行	6,700	2,563.00	17,172,100	
佐賀銀行	6,200	1,548.00	9,597,600	
沖縄銀行	9,000	3,410.00	30,690,000	
琉球銀行	22,800	1,135.00	25,878,000	
セブン銀行	327,100	295.00	96,494,500	
みずほフィナンシャルグループ	13,068,500	158.00	2,064,823,000	
高知銀行	3,500	758.00	2,653,000	
山口フィナンシャルグループ	120,900	764.00	92,367,600	
長野銀行	3,500	1,736.00	6,076,000	
名古屋銀行	8,000	3,385.00	27,080,000	
北洋銀行	147,500	250.00	36,875,000	
愛知銀行	3,700	3,730.00	13,801,000	
中京銀行	4,200	2,224.00	9,340,800	
大光銀行	3,700	1,758.00	6,504,600	
愛媛銀行	14,000	1,101.00	15,414,000	
トマト銀行	4,300	1,063.00	4,570,900	
京葉銀行	42,000	675.00	28,350,000	



栃木銀行	53,300	180.00	9,594,000
北日本銀行	3,400	1,826.00	6,208,400
東和銀行	16,900	726.00	12,269,400
福島銀行	8,400	250.00	2,100,000
大東銀行	4,600	555.00	2,553,000
トモニホールディングス	76,100	357.00	27,167,700
フィデアホールディングス	93,400	121.00	11,301,400
池田泉州ホールディングス	105,200	203.00	21,355,600
F P G	30,300	949.00	28,754,700
マーキュリアインベストメント	3,900	763.00	2,975,700
S B Iホールディングス	114,600	2,632.00	301,627,200
ジャフコ	15,800	4,140.00	65,412,000
大和証券グループ本社	772,000	477.80	368,861,600
野村ホールディングス	1,692,600	359.60	608,658,960
岡三証券グループ	82,300	402.00	33,084,600
丸三証券	28,800	557.00	16,041,600
東洋証券	35,400	129.00	4,566,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	115,100	331.00	38,098,100
光世証券	2,500	638.00	1,595,000
水戸証券	28,500	210.00	5,985,000
いちよし証券	20,400	742.00	15,136,800
松井証券	47,200	964.00	45,500,800
だいこう証券ビジネス	4,100	505.00	2,070,500
マネックスグループ	89,000	341.00	30,349,000
極東証券	13,000	900.00	11,700,000
岩井コスモホールディングス	10,000	1,180.00	11,800,000
藍澤証券	17,500	692.00	12,110,000
マネーパートナーズグループ	11,700	285.00	3,334,500
スパークス・グループ	38,600	228.00	8,800,800
かんぽ生命保険	34,100	1,823.00	62,164,300
S O M P Oホールディングス	169,500	4,409.00	747,325,500
アニコム ホールディングス	7,900	3,735.00	29,506,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	251,500	3,601.00	905,651,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	79,000	2,589.00	204,531,000
第一生命ホールディングス	544,100	1,596.50	868,655,650
東京海上ホールディングス	343,900	5,716.00	1,965,732,400
T & Dホールディングス	297,400	1,223.00	363,720,200
アドバンスクリエイト	2,200	1,843.00	4,054,600
全国保証	27,100	4,255.00	115,310,500
ジェイリース	2,700	337.00	909,900
イントラスト	2,700	649.00	1,752,300
日本モーゲージサービス	1,700	1,143.00	1,943,100

C a s a	4,300	1,223.00	5,258,900
アルヒ	8,700	2,050.00	17,835,000
プレミアグループ	5,500	1,974.00	10,857,000
クレディセゾン	67,400	1,296.00	87,350,400
芙蓉総合リース	11,000	6,460.00	71,060,000
興銀リース	18,100	2,720.00	49,232,000
東京センチュリー	19,400	4,520.00	87,688,000
日本証券金融	42,400	546.00	23,150,400
アイフル	146,700	217.00	31,833,900
リコーリース	7,600	3,320.00	25,232,000
イオンフィナンシャルサービス	61,400	1,758.00	107,941,200
アコム	193,300	376.00	72,680,800
ジャックス	10,600	2,191.00	23,224,600
オリエントコーポレーション	260,100	122.00	31,732,200
日立キャピタル	22,700	2,293.00	52,051,100
アプラスフィナンシャル	46,100	70.00	3,227,000
オリックス	641,600	1,658.00	1,063,772,800
三菱UFJリース	217,000	597.00	129,549,000
九州リースサービス	4,700	615.00	2,890,500
日本取引所グループ	259,800	1,684.00	437,503,200
イー・ギャランティ	9,000	1,235.00	11,115,000
アサックス	4,000	583.00	2,332,000
NECキャピタルソリューション	3,900	1,985.00	7,741,500
いちご	124,500	396.00	49,302,000
日本駐車場開発	109,400	180.00	19,692,000
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,605.00	7,704,000
ヒューリック	201,500	914.00	184,171,000
三栄建築設計	4,300	1,529.00	6,574,700
野村不動産ホールディングス	64,400	2,379.00	153,207,600
三重交通グループホールディングス	20,700	565.00	11,695,500
サムティ	14,100	1,687.00	23,786,700
ディア・ライフ	13,800	473.00	6,527,400
コーセーアールイー	3,800	751.00	2,853,800
エー・ディー・ワークス	297,400	34.00	10,111,600
日本商業開発	6,500	1,514.00	9,841,000
プレサンスコーポレーション	15,700	1,531.00	24,036,700
ユニゾホールディングス	15,000	3,285.00	49,275,000
日本管理センター	7,000	1,141.00	7,987,000
サンセイランディック	3,500	753.00	2,635,500
エストラスト	1,300	722.00	938,600
フージャースホールディングス	20,900	619.00	12,937,100
オープンハウス	14,100	4,770.00	67,257,000

東急不動産ホールディングス	259,800	642.00	166,791,600
飯田グループホールディングス	80,600	1,816.00	146,369,600
イーランド	2,400	703.00	1,687,200
ムゲンエステート	7,900	577.00	4,558,300
ファーストブラザーズ	3,300	1,065.00	3,514,500
ハウズドゥ	5,300	1,628.00	8,628,400
シーアールイー	3,000	1,186.00	3,558,000
ケイアイスター不動産	3,000	1,676.00	5,028,000
グッドコムアセット	2,700	1,525.00	4,117,500
ジェイ・エス・ビー	600	4,835.00	2,901,000
テンポイノベーション	1,500	1,625.00	2,437,500
パーク24	56,500	2,446.00	138,199,000
パラカ	2,800	2,073.00	5,804,400
三井不動産	510,500	2,491.50	1,271,910,750
三菱地所	674,100	1,981.50	1,335,729,150
平和不動産	18,000	2,334.00	42,012,000
東京建物	105,700	1,293.00	136,670,100
ダイビル	29,000	1,046.00	30,334,000
京阪神ビルディング	17,500	1,079.00	18,882,500
住友不動産	216,400	3,951.00	854,996,400
テーオーシー	23,100	704.00	16,262,400
東京楽天地	1,500	5,170.00	7,755,000
スターツコーポレーション	13,400	2,662.00	35,670,800
フジ住宅	13,200	748.00	9,873,600
空港施設	12,600	510.00	6,426,000
明和地所	6,500	563.00	3,659,500
ゴールドクレスト	8,000	1,972.00	15,776,000
日本エスリード	4,200	1,691.00	7,102,200
日神不動産	15,700	462.00	7,253,400
日本エスコン	18,400	681.00	12,530,400
タカラレーベン	45,800	397.00	18,182,600
サンヨーハウジング名古屋	6,200	950.00	5,890,000
イオンモール	48,600	1,697.00	82,474,200
毎日コムネット	3,000	748.00	2,244,000
ファースト住建	4,200	1,258.00	5,283,600
カチタス	10,900	4,225.00	46,052,500
トーセイ	13,900	1,179.00	16,388,100
穴吹興産	1,300	2,858.00	3,715,400
サンフロンティア不動産	13,900	1,099.00	15,276,100
エフ・ジェー・ネクスト	9,000	1,057.00	9,513,000
インテリックス	3,800	721.00	2,739,800
ランドビジネス	4,100	779.00	3,193,900

グランディハウス	9,900	488.00	4,831,200
日本空港ビルディング	30,900	4,395.00	135,805,500
日本工営	6,300	2,393.00	15,075,900
L I F U L L	32,700	519.00	16,971,300
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	2,533.00	18,997,500
日本M&Aセンター	69,500	2,778.00	193,071,000
メンバーズ	3,200	2,003.00	6,409,600
中広	1,100	610.00	671,000
アイティメディア	2,000	551.00	1,102,000
タケエイ	9,800	956.00	9,368,800
E・Jホールディングス	1,300	1,235.00	1,605,500
トラスト・テック	10,300	1,573.00	16,201,900
コシダカホールディングス	22,500	1,484.00	33,390,000
アルトナー	2,400	786.00	1,886,400
パソナグループ	11,400	1,702.00	19,402,800
C D S	2,400	1,342.00	3,220,800
リンクアンドモチベーション	17,300	556.00	9,618,800
G C A	9,600	727.00	6,979,200
エス・エム・エス	34,300	2,556.00	87,670,800
サニーサイドアップ	2,200	991.00	2,180,200
パーソルホールディングス	93,200	2,628.00	244,929,600
リニカル	5,400	1,021.00	5,513,400
クックパッド	29,600	312.00	9,235,200
エスクリ	2,700	748.00	2,019,600
アイ・ケイ・ケイ	4,700	704.00	3,308,800
学情	3,900	1,222.00	4,765,800
スタジオアリス	4,700	2,045.00	9,611,500
シミックホールディングス	5,200	2,069.00	10,758,800
N J S	2,100	1,702.00	3,574,200
総合警備保障	37,100	4,970.00	184,387,000
カカクコム	69,800	2,268.00	158,306,400
アイロムグループ	3,500	1,730.00	6,055,000
セントケア・ホールディング	7,000	510.00	3,570,000
サイネックス	1,700	652.00	1,108,400
ルネサンス	5,200	1,683.00	8,751,600
ディップ	15,100	2,206.00	33,310,600
オプトホールディング	5,800	1,666.00	9,662,800
ツクイ	22,200	513.00	11,388,600
キャリアデザインセンター	2,400	1,592.00	3,820,800
ベネフィット・ワン	25,900	1,882.00	48,743,800
エムスリー	196,200	1,973.00	387,102,600
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	568.00	3,464,800

プラス	1,200	748.00	897,600
アウトソーシング	49,200	1,381.00	67,945,200
ウェルネット	8,900	909.00	8,090,100
ワールドホールディングス	2,600	1,566.00	4,071,600
ディー・エヌ・エー	50,300	2,116.00	106,434,800
博報堂D Yホールディングス	129,600	1,738.00	225,244,800
ぐるなび	13,400	672.00	9,004,800
タカミヤ	9,800	778.00	7,624,400
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,412.00	8,895,600
ファンコミュニケーションズ	25,800	543.00	14,009,400
ライク	3,700	1,754.00	6,489,800
ビジネス・ブレークスルー	4,200	370.00	1,554,000
WDBホールディングス	4,300	2,806.00	12,065,800
ティア	5,600	650.00	3,640,000
C D G	900	1,391.00	1,251,900
バリューコマース	6,300	2,321.00	14,622,300
インフォマート	51,100	1,538.00	78,591,800
J Pホールディングス	27,000	275.00	7,425,000
エコナックホールディングス	17,700	128.00	2,265,600
E P Sホールディングス	14,100	1,660.00	23,406,000
レッグス	2,400	1,954.00	4,689,600
プレステージ・インターナショナル	17,500	1,668.00	29,190,000
アミューズ	5,700	2,446.00	13,942,200
ドリームインキュベータ	2,900	1,495.00	4,335,500
クイック	5,900	1,574.00	9,286,600
T A C	5,600	197.00	1,103,200
ケネディクス	82,000	570.00	46,740,000
電通	113,500	3,650.00	414,275,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,068.00	3,951,600
ぴあ	2,700	4,580.00	12,366,000
イオンファンタジー	3,000	2,988.00	8,964,000
シーティーエス	10,700	667.00	7,136,900
ネクシィーズグループ	3,300	2,037.00	6,722,100
みらかホールディングス	26,100	2,468.00	64,414,800
アルプス技研	9,000	1,685.00	15,165,000
ダイオーズ	2,200	1,459.00	3,209,800
日本空調サービス	10,700	724.00	7,746,800
オリエンタルランド	110,100	14,070.00	1,549,107,000
ダスキン	24,000	2,937.00	70,488,000
明光ネットワークジャパン	11,100	933.00	10,356,300
ファルコホールディングス	5,200	1,611.00	8,377,200
ラウンドワン	29,000	1,652.00	47,908,000

リゾートトラスト	39,500	1,578.00	62,331,000
ビー・エム・エル	12,000	3,015.00	36,180,000
ワタベウェディング	1,700	632.00	1,074,400
りらいあコミュニケーションズ	16,900	1,263.00	21,344,700
リソー教育	47,500	507.00	24,082,500
早稲田アカデミー	2,800	749.00	2,097,200
ユー・エス・エス	113,900	2,189.00	249,327,100
東京個別指導学院	3,400	918.00	3,121,200
サイバーエージェント	53,600	4,415.00	236,644,000
楽天	434,400	1,135.00	493,044,000
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,288.00	7,212,800
テー・オー・ダブリュー	8,300	753.00	6,249,900
山田コンサルティンググループ	4,600	1,940.00	8,924,000
セントラルスポーツ	3,500	3,085.00	10,797,500
フルキャストホールディングス	9,400	2,248.00	21,131,200
エン・ジャパン	13,600	4,545.00	61,812,000
リソルホールディングス	1,000	4,030.00	4,030,000
テクノプロ・ホールディングス	18,700	6,200.00	115,940,000
アトラ	2,300	280.00	644,000
インターワークス	1,900	727.00	1,381,300
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	2,822.00	10,723,600
K e e P e r 技研	3,500	1,276.00	4,466,000
ファーストロジック	2,300	595.00	1,368,500
三機サービス	2,000	975.00	1,950,000
G u n o s y	6,500	1,647.00	10,705,500
デザインワン・ジャパン	2,200	312.00	686,400
イー・ガーディアン	4,800	1,955.00	9,384,000
リブセンス	5,600	255.00	1,428,000
ジャパンマテリアル	25,500	1,520.00	38,760,000
ベクトル	11,700	896.00	10,483,200
ウチヤマホールディングス	4,800	517.00	2,481,600
チャーム・ケア・コーポレーション	3,000	1,795.00	5,385,000
ライクキッズネクスト	2,300	1,050.00	2,415,000
キャリアリンク	3,600	585.00	2,106,000
I B J	6,400	909.00	5,817,600
アサンテ	3,800	2,007.00	7,626,600
N・フィールド	6,200	694.00	4,302,800
バリューHR	2,100	3,525.00	7,402,500
M&Aキャピタルパートナーズ	3,300	6,750.00	22,275,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	1,369.00	5,476,000
E R Iホールディングス	2,700	799.00	2,157,300
アピスト	1,500	2,743.00	4,114,500

シグマクシス	4,500	1,421.00	6,394,500
ウィルグループ	6,200	894.00	5,542,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,200	239.00	3,154,800
日本ビューホテル	3,000	1,429.00	4,287,000
リクルートホールディングス	667,500	3,731.00	2,490,442,500
エラン	6,500	1,735.00	11,277,500
土木管理総合試験所	4,300	464.00	1,995,200
ネットマーケティング	3,500	550.00	1,925,000
日本郵政	763,800	1,096.00	837,124,800
ベルシステム24ホールディングス	15,700	1,563.00	24,539,100
鎌倉新書	6,900	1,487.00	10,260,300
ソネット・メディア・ネットワークス	1,300	876.00	1,138,800
一蔵	1,200	719.00	862,800
LITALICO	2,200	1,904.00	4,188,800
グローバルキッズCOMPANY	1,500	1,016.00	1,524,000
エボラブルアジア	4,200	2,568.00	10,785,600
アトラエ	2,500	2,508.00	6,270,000
ストライク	3,600	2,499.00	8,996,400
ソラスト	22,900	1,166.00	26,701,400
セラク	3,100	747.00	2,315,700
インソース	3,700	2,975.00	11,007,500
ベिकाレント・コンサルティング	6,600	5,000.00	33,000,000
Orchestra Holdings	1,700	1,283.00	2,181,100
アイモバイル	3,100	750.00	2,325,000
キャリアインデックス	3,300	762.00	2,514,600
MS - Japan	3,800	1,700.00	6,460,000
船場	1,600	964.00	1,542,400
グレイステクノロジー	3,400	2,884.00	9,805,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,400	2,659.00	19,676,600
フルテック	1,400	1,154.00	1,615,600
グリーンズ	3,600	1,501.00	5,403,600
ツナググループ・ホールディングス	1,300	626.00	813,800
ソウルドアウト	1,000	1,997.00	1,997,000
MS&Consulting	1,600	1,040.00	1,664,000
日総工産	6,200	1,508.00	9,349,600
キュービーネットホールディングス	5,700	2,299.00	13,104,300
RPAホールディングス	4,000	1,626.00	6,504,000
スプリックス	3,200	1,673.00	5,353,600
アドバンテッジリスクマネジメント	3,800	737.00	2,800,600
リログループ	51,000	2,846.00	145,146,000
東祥	5,800	2,487.00	14,424,600
エイチ・アイ・エス	16,600	2,625.00	43,575,000

ラックランド	1,900	2,265.00	4,303,500	
共立メンテナンス	14,300	4,725.00	67,567,500	
イチネンホールディングス	9,800	1,140.00	11,172,000	
建設技術研究所	6,500	1,600.00	10,400,000	
スペース	6,100	1,170.00	7,137,000	
長大	3,600	784.00	2,822,400	
燦ホールディングス	2,100	2,271.00	4,769,100	
スバル興業	700	6,310.00	4,417,000	
東京テアトル	3,700	1,362.00	5,039,400	
タナベ経営	1,900	1,215.00	2,308,500	
ナガワ	2,600	5,000.00	13,000,000	
よみうりランド	2,000	4,715.00	9,430,000	
東京都競馬	6,100	3,080.00	18,788,000	
カナモト	14,000	2,770.00	38,780,000	
東京ドーム	34,900	1,009.00	35,214,100	
西尾レントオール	9,500	3,025.00	28,737,500	
トランス・コスモス	10,400	2,287.00	23,784,800	
乃村工藝社	43,600	1,465.00	63,874,000	
藤田観光	3,700	2,824.00	10,448,800	
KNT-CTホールディングス	5,000	1,301.00	6,505,000	
日本管財	10,000	1,836.00	18,360,000	
トーカイ	9,100	2,215.00	20,156,500	
白洋舎	1,100	2,845.00	3,129,500	
セコム	98,900	8,566.00	847,177,400	
セントラル警備保障	4,500	4,750.00	21,375,000	
丹青社	17,700	1,315.00	23,275,500	
メイテック	11,600	5,780.00	67,048,000	
応用地質	10,100	1,114.00	11,251,400	
船井総研ホールディングス	19,300	2,484.00	47,941,200	
進学会ホールディングス	4,400	567.00	2,494,800	
オオバ	7,500	614.00	4,605,000	
いであ	2,000	1,203.00	2,406,000	
学究社	3,100	1,325.00	4,107,500	
ベネッセホールディングス	34,200	2,572.00	87,962,400	
イオンディライト	11,500	3,145.00	36,167,500	
ナック	6,000	975.00	5,850,000	
ニチイ学館	13,300	1,709.00	22,729,700	
ダイセキ	15,700	2,614.00	41,039,800	
ステップ	3,500	1,496.00	5,236,000	
合計	113,706,400		220,561,307,530	

## (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】

## 【インデックスコレクション（国内株式）】

## 【純資産額計算書】

（2019年 8月30日現在）

資産総額	18,599,103,278円
負債総額	29,977,364円
純資産総額（ - ）	18,569,125,914円
発行済口数	8,530,462,169口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1768円
（1万口当たり純資産額）	（21,768円）

（参考）

日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（2019年 8月30日現在）

資産総額	215,352,740,021円
負債総額	1,033,884,761円
純資産総額（ - ）	214,318,855,260円
発行済口数	132,699,524,487口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6151円
（1万口当たり純資産額）	（16,151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 8月30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年間ににお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10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8月30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	517	12,293,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	88	343,157
単位型公社債投資信託	7	58,802
合計	612	12,695,174

## 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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）を採用してはりましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

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

#### 表示方法の変更

##### (「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

##### (貸借対照表関係)

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

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

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

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

## 注記事項

（貸借対照表関係）

### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		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 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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



## （有価証券関係）

## １．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

## ２．その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

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

## ３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
--------------	------------------	---------	--------------	------------------------	------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	-	86
	合計		8,643,951	-	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)通常の見取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

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

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2019年10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10月25日	有価証券届出書
2018年10月25日	有価証券報告書
2019年 4月25日	有価証券届出書
2019年 4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9月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックスコレクション（国内株式）の2018年7月26日から2019年7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、インデックスコレクション（国内株式）の2019年7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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。