

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DC日本株式インデックス・オープンS
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックス・オープンS

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2020年 2月29日から2020年 8月28日までとします。

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

### （８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、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及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

ないかを明確に記載するものとする。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

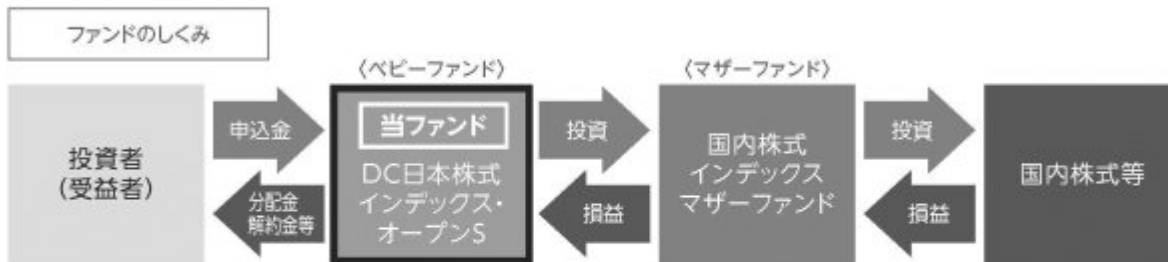
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。



- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## <ファンドの特色>

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



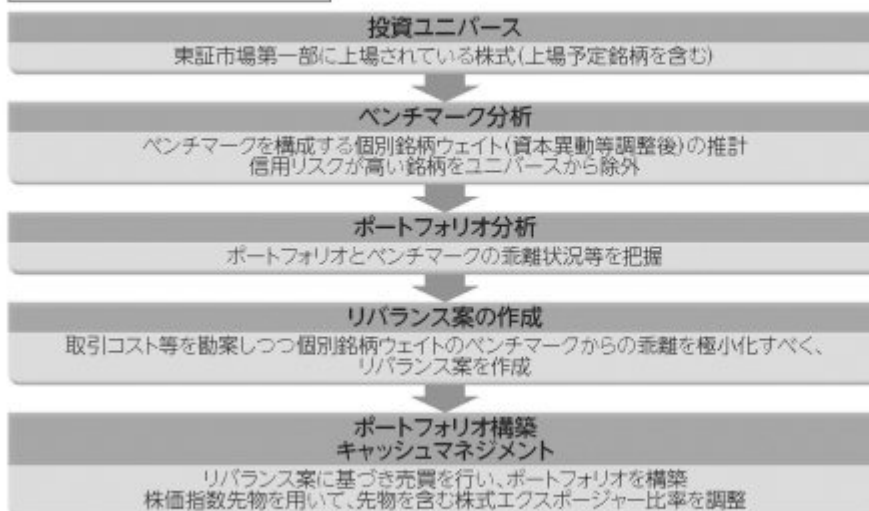
### ? ファミリーファンド方式とは

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

### <マザーファンドの概要>

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

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

### ? TOPIX(東証株価指数)とは

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

**分配方針**

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

**主な投資制限**

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

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

**(2) 【ファンドの沿革】**

2007年8月31日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月 1日	当ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープンS」から「DC日本株式インデックス・オープンS」に変更 当ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

**(3) 【ファンドの仕組み】**

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年12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】

### 基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 投資対象

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

### 投資態度

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

## （２）【投資対象】

### 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。

- 1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。）
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限ります。）
  - ハ．金銭債権
  - ニ．約束手形
- 2.次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

### 有価証券の指図範囲

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

- 1．株券又は新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引

受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

ロ．上記の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (参考)マザーファンドの概要

### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場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を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

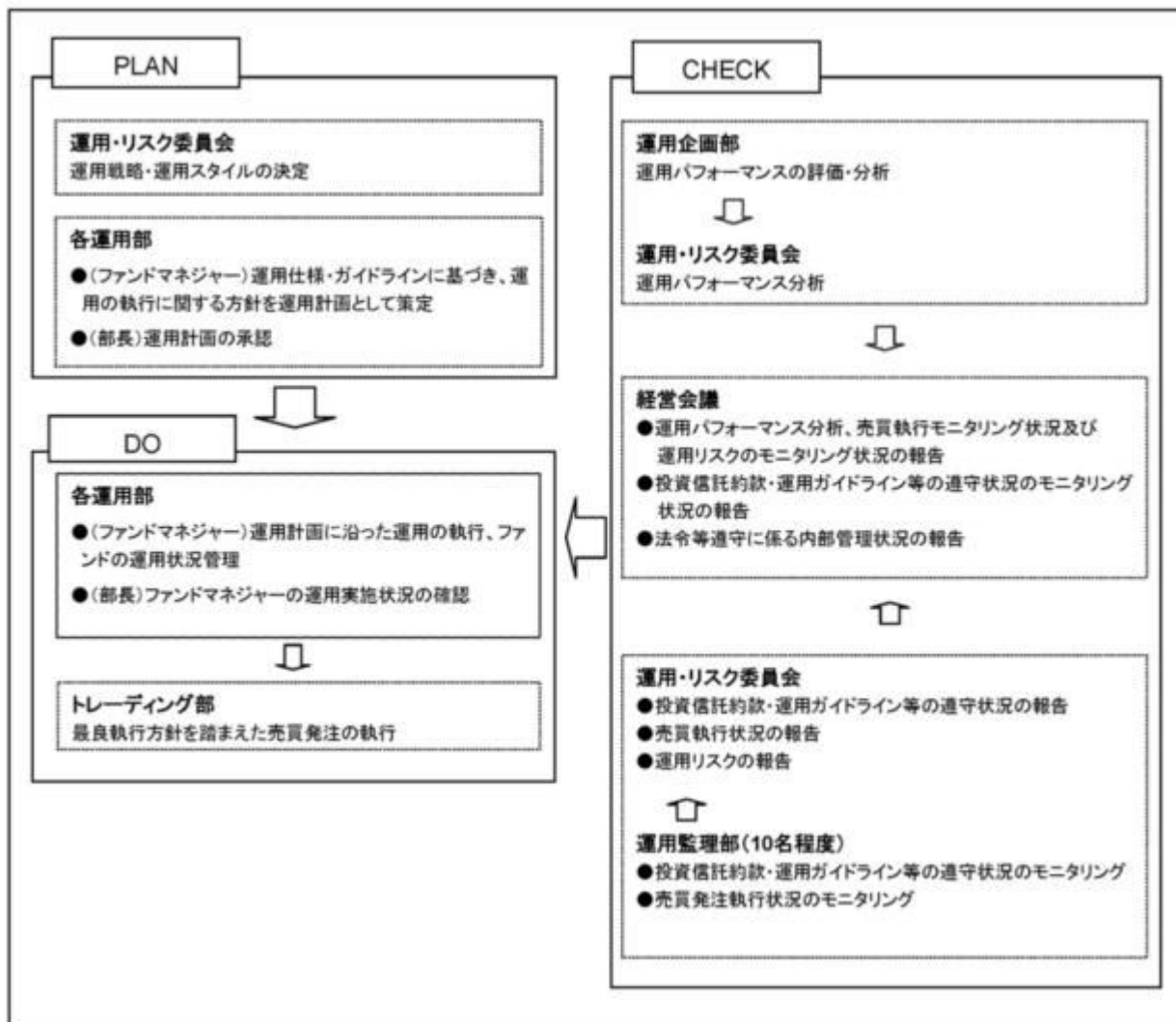
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財

産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### （３）【運用体制】

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



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

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



り受け取っております。

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・ 分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

- ・ 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

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。

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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。前文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。

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

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

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

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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】

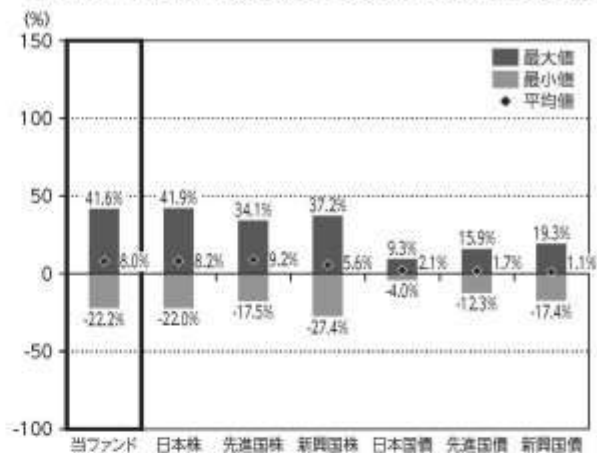
### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2015年1月～2019年12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、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動(サービス)に関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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、計算または選定につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index-EM Emerging Markets (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】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## (3) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.22%（税抜 0.2%）（ ）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 0.121%（税抜 0.11%）	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 0.066%（税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033%（税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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12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12月30日現在の状況について記載してあります。

#### 【DC日本株式インデックス・オープンS】

##### （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	10,678,758,895	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,378,612	0.05
合計(純資産総額)		10,684,137,507	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,655,920,528	1.4185	9,441,423,269	1.6044	10,678,758,895	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。

## □ 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3期計算期間末 (2010年 5月31日)	278,422,068	278,422,068	5,912	5,912
第4期計算期間末 (2011年 5月30日)	421,953,122	421,953,122	5,642	5,642
第5期計算期間末 (2012年 5月29日)	613,845,546	613,845,546	5,085	5,085
第6期計算期間末 (2013年 5月29日)	1,147,627,730	1,147,627,730	8,412	8,412
第7期計算期間末 (2014年 5月29日)	1,866,071,421	1,866,071,421	8,721	8,721
第8期計算期間末 (2015年 5月29日)	3,443,138,694	3,443,138,694	12,356	12,356
第9期計算期間末 (2016年 5月30日)	4,142,221,031	4,142,221,031	10,268	10,268
第10期計算期間末 (2017年 5月29日)	5,687,450,621	5,687,450,621	12,038	12,038
第11期計算期間末 (2018年 5月29日)	8,282,015,684	8,282,015,684	13,768	13,768
第12期計算期間末 (2019年 5月29日)	8,975,168,901	8,975,168,901	12,265	12,265
2018年12月末日	8,205,065,327		11,799	
2019年 1月末日	8,741,802,825		12,377	
2月末日	9,073,952,339		12,696	
3月末日	9,131,362,680		12,705	
4月末日	9,290,184,965		12,913	
5月末日	8,837,348,474		12,072	
6月末日	9,185,391,138		12,400	
7月末日	9,326,385,597		12,510	
8月末日	9,158,370,036		12,085	
9月末日	9,680,929,532		12,811	
10月末日	10,219,514,044		13,449	



11月末日	10,443,865,793		13,708	
12月末日	10,684,137,507		13,903	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2009年 5月30日～2010年 5月31日	0
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	0
第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	0
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	0
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	0
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	0
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	0
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	0
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	0
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2009年 5月30日～2010年 5月31日	0.2
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	4.6
第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	9.9
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	65.4
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	3.7
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	41.7
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	16.9
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	17.2
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	14.4
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	10.9
第13期中間計算期間	2019年 5月30日～2019年11月29日	11.8

(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3期計算期間	2009年 5月30日～2010年 5月31日	230,329,092	43,843,447	470,911,513
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	354,364,758	77,390,119	747,886,152

第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	576,981,785	117,785,884	1,207,082,053
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	463,692,194	306,529,942	1,364,244,305
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	1,119,419,055	344,003,784	2,139,659,576
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	1,337,445,052	690,529,107	2,786,575,521
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	2,058,315,332	810,869,903	4,034,020,950
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	1,869,056,255	1,178,642,386	4,724,434,819
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	2,181,025,603	889,936,203	6,015,524,219
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	2,438,617,340	1,136,275,137	7,317,866,422
第13期中間計算期間	2019年 5月30日～2019年11月29日	982,866,590	682,018,306	7,618,714,706

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	320,001,386,770	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,485,312,658	1.08
合計(純資産総額)		323,486,699,428	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,407,580,000	1.05

(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	1,468,300	6,651.56	9,766,485,548	7,714.00	11,326,466,200	3.50
日本	株式	ソニー	電気機器	832,700	5,414.15	4,508,362,705	7,401.00	6,162,812,700	1.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,945,600	509.04	4,553,668,224	593.20	5,306,529,920	1.64
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,025,900	5,183.40	5,317,650,060	4,756.00	4,879,180,400	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,728,400	2,470.20	4,269,502,322	2,757.00	4,765,198,800	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,096,200	3,830.72	4,199,235,264	4,332.00	4,748,738,400	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	119,400	31,482.29	3,758,985,426	38,490.00	4,595,706,000	1.42
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	901,900	3,595.75	3,243,006,925	4,099.00	3,696,888,100	1.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	902,400	3,802.89	3,431,728,620	4,038.00	3,643,891,200	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	80,800	39,075.84	3,157,327,872	43,970.00	3,552,776,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,037,400	2,753.92	2,856,916,608	3,099.00	3,214,902,600	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	963,600	2,793.08	2,691,411,888	3,253.00	3,134,590,800	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,658,100	155.90	2,752,897,790	168.30	2,971,858,230	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	633,100	3,822.54	2,420,050,074	4,626.00	2,928,720,600	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	955,100	2,591.23	2,474,883,773	3,038.00	2,901,593,800	0.90
日本	株式	花王	化学	315,500	8,599.83	2,713,246,365	9,025.00	2,847,387,500	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	464,700	5,569.19	2,588,002,593	6,119.00	2,843,499,300	0.88
日本	株式	HOYA	精密機器	263,100	7,988.60	2,101,800,660	10,450.00	2,749,395,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	377,000	5,573.93	2,101,371,610	7,228.00	2,724,956,000	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	221,600	9,465.15	2,097,477,240	12,060.00	2,672,496,000	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	910,600	2,830.47	2,577,425,982	2,900.00	2,640,740,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	387,200	4,700.12	1,819,886,464	6,746.00	2,612,051,200	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	167,900	13,804.62	2,317,795,698	15,450.00	2,594,055,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	125,200	18,496.72	2,315,789,344	20,330.00	2,545,316,000	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	109,500	22,633.35	2,478,351,825	22,000.00	2,409,000,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	158,600	13,793.56	2,187,658,616	15,005.00	2,379,793,000	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	907,600	2,023.31	1,836,356,156	2,534.50	2,300,312,200	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	231,900	10,401.73	2,412,161,187	9,858.00	2,286,070,200	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	1,140,600	1,686.29	1,923,382,374	1,946.00	2,219,607,600	0.69
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,159,000	1,540.72	1,785,694,480	1,870.00	2,167,330,000	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.76
		食料品	3.74

繊維製品	0.59
パルプ・紙	0.24
化学	7.06
医薬品	5.96
石油・石炭製品	0.49
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.84
鉄鋼	0.77
非鉄金属	0.77
金属製品	0.59
機械	5.06
電気機器	14.24
輸送用機器	7.63
精密機器	2.35
その他製品	2.31
電気・ガス業	1.52
陸運業	4.34
海運業	0.18
空運業	0.49
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.62
卸売業	4.94
小売業	4.59
銀行業	5.80
証券、商品先物取引業	0.82
保険業	2.29
その他金融業	1.17
不動産業	2.39
サービス業	5.12
小計	98.92
合計	98.92

(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	198	円	3,411,018,500	3,407,580,000	1.05

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2007年8月31日  
作成基準日：2019年12月30日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

基準価額 13,903円

純資産総額 106.84億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

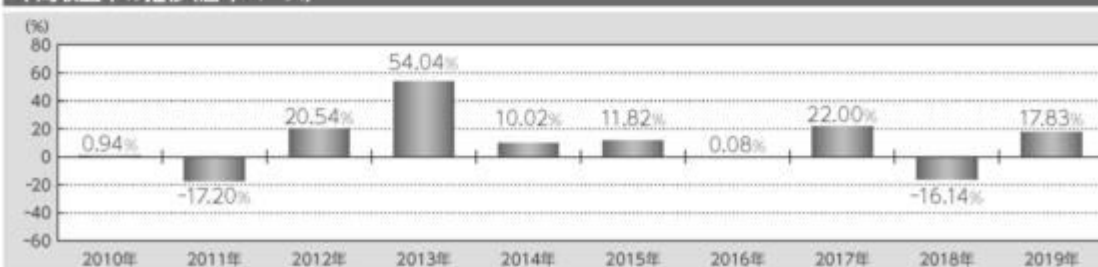
決算期	分配金
2015年5月	0円
2016年5月	0円
2017年5月	0円
2018年5月	0円
2019年5月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※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%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.5%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
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%

※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)**

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

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

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

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

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。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### < 一部解約代金の支払い >

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

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振り込まれることとなります。

#### < 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、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付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すこと



ができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2007年 8月31日設定）

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

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとします。ただし、第1計算期間は、2007年8月31日から2008年5月29日までとします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

## <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

## <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、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12期計算期間(2018年5月30日から2019年5月29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】

## 【DC日本株式インデックス・オープンS】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 (2018年 5月29日現在)	第12期 (2019年 5月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	18,368,444	24,070,653
親投資信託受益証券	8,277,854,338	8,970,638,831
未収入金	4,052,193	-
流動資産合計	8,300,274,975	8,994,709,484
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,492,981	9,595,970
未払受託者報酬	1,257,582	1,421,032
未払委託者報酬	7,126,228	8,052,450
未払利息	48	38
その他未払費用	382,452	471,093
流動負債合計	18,259,291	19,540,583
負債合計	18,259,291	19,540,583
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,015,524,219	7,317,866,422
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,266,491,465	1,657,302,479
(分配準備積立金)	1,503,189,659	1,270,070,296
元本等合計	8,282,015,684	8,975,168,901
純資産合計	8,282,015,684	8,975,168,901
負債純資産合計	8,300,274,975	8,994,709,484

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自 2017年 5月30日	至 2018年 5月29日	自 2018年 5月30日	至 2019年 5月29日
営業収益				
受取利息		9		1
有価証券売買等損益		869,824,827		966,220,436
営業収益合計		869,824,836		966,220,435
営業費用				
支払利息		9,928		13,705
受託者報酬		2,294,439		2,827,242
委託者報酬		13,001,679		16,020,921
その他費用		382,601		472,109
営業費用合計		15,688,647		19,333,977
営業利益又は営業損失（ ）		854,136,189		985,554,412
経常利益又は経常損失（ ）		854,136,189		985,554,412
当期純利益又は当期純損失（ ）		854,136,189		985,554,412
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（ ）		94,205,239		75,815,097
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		963,015,802		2,266,491,465
剰余金増加額又は欠損金減少額		741,288,697		716,589,067
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		741,288,697		716,589,067
剰余金減少額又は欠損金増加額		197,743,984		416,038,738
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		197,743,984		416,038,738
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,266,491,465		1,657,302,479



## (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11期 (2018年 5月29日現在)	第12期 (2019年 5月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,015,524,219口	7,317,866,422口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3768円 (13,768円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2265円 (12,265円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月29日	第12期 自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29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>- 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>759,935,689円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,180,984,823円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>743,253,970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>4,684,174,482円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,015,524,219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>7,786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	- 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	759,935,689円	収益調整金額	C	3,180,984,823円	分配準備積立金額	D	743,253,970円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,684,174,482円	当ファンドの期末残存口数	F	6,015,524,219口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786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>- 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>4,428,211,010円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,270,070,296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>5,698,281,306円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,317,866,422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>7,786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	- 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	4,428,211,010円	分配準備積立金額	D	1,270,070,296円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,698,281,306円	当ファンドの期末残存口数	F	7,317,866,422口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786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	- 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	759,935,689円																																																											
収益調整金額	C	3,180,984,823円																																																											
分配準備積立金額	D	743,253,970円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,684,174,482円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	6,015,524,219口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786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	- 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	4,428,211,010円																																																											
分配準備積立金額	D	1,270,070,296円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,698,281,306円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,317,866,422口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786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12期 自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29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12期 (2019年 5月29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11期	第12期
	自 2017年 5月30日 至 2018年 5月29日	自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,724,434,819円	6,015,524,219円
期中追加設定元本額	2,181,025,603円	2,438,617,340円
期中一部解約元本額	889,936,203円	1,136,275,137円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期	第12期
	(2018年 5月29日現在)	(2019年 5月29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	860,484,395	927,167,040
合計	860,484,395	927,167,040

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,346,850,737	8,970,638,831	
合計		6,346,850,737	8,970,638,831	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2019年 5月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,354,717,010
株式	266,318,229,660
未収配当金	2,872,624,071
前払金	215,021,130
差入委託証拠金	95,919,060
流動資産合計	273,856,510,931
資産合計	273,856,510,931
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	215,063,790
未払金	1,308,409,950
未払解約金	49,533,021
未払利息	6,987
流動負債合計	1,573,013,748
負債合計	1,573,013,748
純資産の部	
元本等	
元本	192,648,275,463
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	79,635,221,720
元本等合計	272,283,497,183
純資産合計	272,283,497,183
負債純資産合計	273,856,510,931

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 5月29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 5月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	192,648,275,463口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.4134円 (1万口当たり純資産額) (14,134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 5月29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 5月29日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 5月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 5月30日
期首元本額	130,081,844,048円
期中追加設定元本額	78,213,667,102円
期中一部解約元本額	15,647,235,687円
期末元本額	192,648,275,463円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	613,215,929円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,981,750,710円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,975,519円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,828,192,421円
世界経済インデックスファンド	1,996,308,744円
日本株式インデックス・オープン	5,482,756,725円
DCマイセレクション25	6,685,564,991円
DCマイセレクション50	19,055,041,347円
DCマイセレクション75	17,567,704,592円
DC日本株式インデックス・オープン	5,582,709,223円
DCマイセレクションS25	2,706,939,072円
DCマイセレクションS50	7,804,310,879円
DCマイセレクションS75	5,066,854,050円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,346,850,737円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	374,640,033円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	637,236,172円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	418,539,640円
DC世界経済インデックスファンド	1,743,123,347円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,102,902,132円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	16,342,633円

区分	2019年 5月29日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	43,826,513円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	41,876,524円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	305,739,372円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,717,839円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	109,865,200円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	386,110,619円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	62,323,726円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	541,672,429円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,917,782,245円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	759,211,959円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,401,733,668円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	665,753,754円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,311,082円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	854,353,577円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	39,847,094円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	482,126,942円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	603,647,048円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	56,058,768円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	910,370,976円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,162,966,236円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,376,660,216円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	1,010,794,099円
分散投資コア戦略ファンドS	2,122,008,187円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	228,819,377円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	259,488,312円
コア投資戦略ファンド（切替型）	792,730,531円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,294,636円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,124,471円
SMT インデックスバランス・オープン	75,994,654円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	12,820,304,270円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	673,595,588円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,653,766円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	53,418,854円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	7,828,524円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,128,834円
グローバル経済コア	322,166,096円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,885,413円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	45,259,456円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	885,656円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	253,531,829円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,222,871円



区分	2019年 5月29日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	53,382,133,848円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	669,509,904円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2019年 5月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	29,025,211,771	
合計	29,025,211,771	

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2019年 5月29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	6,094,061,130	-	5,879,040,000	215,021,130
合計		6,094,061,130	-	5,879,040,000	215,021,130

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,300	2,755.00	14,601,500	

日本水産	164,000	650.00	106,600,000
マルハニチロ	23,700	3,420.00	81,054,000
カネコ種苗	5,000	1,321.00	6,605,000
サカタのタネ	20,000	3,380.00	67,600,000
ホクト	13,800	1,812.00	25,005,600
ホクリヨウ	2,200	599.00	1,317,800
住石ホールディングス	35,200	114.00	4,012,800
日鉄鉱業	3,800	4,125.00	15,675,000
三井松島ホールディングス	6,900	1,221.00	8,424,900
国際石油開発帝石	658,000	901.10	592,923,800
石油資源開発	23,600	2,330.00	54,988,000
K&Oエナジーグループ	8,000	1,631.00	13,048,000
ヒノキヤグループ	4,600	2,090.00	9,614,000
ショーボンドホールディングス	11,700	7,560.00	88,452,000
ミライト・ホールディングス	46,100	1,687.00	77,770,700
タマホーム	7,900	1,018.00	8,042,200
サンヨーホームズ	2,400	674.00	1,617,600
日本アクア	5,200	466.00	2,423,200
ファーストコーポレーション	5,000	772.00	3,860,000
ベステラ	3,100	1,257.00	3,896,700
TATERU	14,200	233.00	3,308,600
スペースバリューホールディングス	19,900	548.00	10,905,200
ダイセキ環境ソリューション	3,100	615.00	1,906,500
第一カッター興業	2,000	1,657.00	3,314,000
安藤・間	105,900	706.00	74,765,400
東急建設	48,600	765.00	37,179,000
コムシスホールディングス	58,200	2,602.00	151,436,400
ミサワホーム	13,600	998.00	13,572,800
ビーアールホールディングス	17,800	316.00	5,624,800
高松コンストラクショングループ	10,400	2,330.00	24,232,000
東建コーポレーション	5,100	6,470.00	32,997,000
ソネック	1,700	731.00	1,242,700
ヤマウラ	7,000	843.00	5,901,000
大成建設	134,800	4,065.00	547,962,000
大林組	406,300	988.00	401,424,400
清水建設	414,500	877.00	363,516,500
飛島建設	12,000	1,282.00	15,384,000
長谷工コーポレーション	169,700	1,121.00	190,233,700
松井建設	15,700	622.00	9,765,400
銭高組	1,700	4,480.00	7,616,000
鹿島建設	317,500	1,492.00	473,710,000
不動テトラ	9,700	1,335.00	12,949,500

大末建設	5,400	919.00	4,962,600	
鉄建建設	8,400	2,963.00	24,889,200	
西松建設	29,400	2,074.00	60,975,600	
三井住友建設	95,800	605.00	57,959,000	
大豊建設	9,400	2,760.00	25,944,000	
前田建設工業	97,100	877.00	85,156,700	
佐田建設	10,200	355.00	3,621,000	
ナカノフード建設	11,500	431.00	4,956,500	
奥村組	22,400	3,405.00	76,272,000	
東鉄工業	16,200	3,085.00	49,977,000	
イチケン	2,800	1,683.00	4,712,400	
富士ピー・エス	5,600	440.00	2,464,000	
浅沼組	5,000	3,605.00	18,025,000	
戸田建設	158,200	592.00	93,654,400	
熊谷組	19,500	2,880.00	56,160,000	
青木あすなろ建設	7,300	820.00	5,986,000	
北野建設	3,000	2,691.00	8,073,000	
植木組	1,900	2,130.00	4,047,000	
矢作建設工業	18,300	729.00	13,340,700	
ピーエス三菱	15,000	630.00	9,450,000	
日本ハウスホールディングス	25,700	410.00	10,537,000	
大東建託	48,200	14,335.00	690,947,000	
新日本建設	16,700	899.00	15,013,300	
N I P P O	35,800	2,127.00	76,146,600	
東亜道路工業	2,500	2,951.00	7,377,500	
前田道路	42,400	2,186.00	92,686,400	
日本道路	3,700	6,200.00	22,940,000	
東亜建設工業	9,700	1,498.00	14,530,600	
日本国土開発	22,000	622.00	13,684,000	
若築建設	6,800	1,352.00	9,193,600	
東洋建設	49,300	396.00	19,522,800	
五洋建設	160,900	481.00	77,392,900	
世紀東急工業	19,600	615.00	12,054,000	
福田組	4,500	4,380.00	19,710,000	
住友林業	96,300	1,244.00	119,797,200	
日本基礎技術	13,800	358.00	4,940,400	
巴コーポレーション	18,500	343.00	6,345,500	
大和ハウス工業	374,900	3,342.00	1,252,915,800	
ライト工業	26,000	1,341.00	34,866,000	
積水ハウス	414,700	1,769.50	733,811,650	
日特建設	11,500	601.00	6,911,500	
北陸電気工事	6,500	830.00	5,395,000	

ユアテック	21,600	731.00	15,789,600
四電工	2,100	2,642.00	5,548,200
中電工	17,400	2,236.00	38,906,400
関電工	61,600	888.00	54,700,800
きんでん	90,000	1,665.00	149,850,000
東京エネシス	14,000	911.00	12,754,000
トーエネック	3,800	2,999.00	11,396,200
住友電設	9,400	1,656.00	15,566,400
日本電設工業	23,100	2,368.00	54,700,800
協和エクシオ	53,000	2,513.00	133,189,000
新日本空調	11,700	1,730.00	20,241,000
九電工	26,700	3,175.00	84,772,500
三機工業	31,000	1,242.00	38,502,000
日揮	117,000	1,446.00	169,182,000
中外炉工業	4,100	1,645.00	6,744,500
ヤマト	13,300	517.00	6,876,100
太平電業	9,200	2,057.00	18,924,400
高砂熱学工業	33,200	1,692.00	56,174,400
三晃金属工業	1,900	2,512.00	4,772,800
朝日工業社	3,000	2,449.00	7,347,000
明星工業	24,400	658.00	16,055,200
大気社	18,600	3,290.00	61,194,000
ダイダン	9,300	2,167.00	20,153,100
日比谷総合設備	12,200	1,849.00	22,557,800
東芝プラントシステム	29,600	1,933.00	57,216,800
OSJBホールディングス	59,700	276.00	16,477,200
東洋エンジニアリング	10,100	456.00	4,605,600
新興プランテック	24,300	1,207.00	29,330,100
日本製粉	38,400	1,818.00	69,811,200
日清製粉グループ本社	136,900	2,599.00	355,803,100
日東富士製粉	900	5,860.00	5,274,000
昭和産業	11,100	3,050.00	33,855,000
鳥越製粉	10,700	733.00	7,843,100
中部飼料	14,800	1,176.00	17,404,800
フィード・ワン	81,000	182.00	14,742,000
東洋精糖	1,800	971.00	1,747,800
日本甜菜製糖	6,900	1,930.00	13,317,000
三井製糖	9,600	2,322.00	22,291,200
塩水港精糖	13,100	208.00	2,724,800
日新製糖	5,700	1,837.00	10,470,900
森永製菓	30,500	4,990.00	152,195,000
中村屋	3,100	4,325.00	13,407,500

江崎グリコ	36,400	5,250.00	191,100,000
名糖産業	5,800	1,426.00	8,270,800
井村屋グループ	5,200	2,209.00	11,486,800
不二家	6,800	1,970.00	13,396,000
山崎製パン	99,100	1,665.00	165,001,500
第一屋製パン	2,100	993.00	2,085,300
モロゾフ	2,100	4,990.00	10,479,000
亀田製菓	7,500	4,745.00	35,587,500
寿スピリッツ	12,800	5,770.00	73,856,000
カルビー	55,200	3,190.00	176,088,000
森永乳業	24,300	4,080.00	99,144,000
六甲バター	8,800	2,031.00	17,872,800
ヤクルト本社	89,800	6,300.00	565,740,000
明治ホールディングス	85,900	7,790.00	669,161,000
雪印メグミルク	29,200	2,187.00	63,860,400
プリマハム	17,000	2,183.00	37,111,000
日本ハム	50,200	4,425.00	222,135,000
林兼産業	4,000	596.00	2,384,000
丸大食品	12,900	1,949.00	25,142,100
S Foods	10,900	3,750.00	40,875,000
伊藤ハム米久ホールディングス	78,000	668.00	52,104,000
サッポロホールディングス	44,300	2,319.00	102,731,700
アサヒグループホールディングス	253,800	4,782.00	1,213,671,600
キリンホールディングス	548,300	2,372.00	1,300,567,600
宝ホールディングス	90,800	1,268.00	115,134,400
オエノンホールディングス	34,300	371.00	12,725,300
養命酒製造	3,700	2,018.00	7,466,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	92,800	2,552.00	236,825,600
サントリー食品インターナショナル	81,100	4,610.00	373,871,000
ダイトーグループホールディングス	6,800	4,705.00	31,994,000
伊藤園	36,800	5,360.00	197,248,000
キーコーヒー	11,900	2,095.00	24,930,500
ユニカフェ	3,300	981.00	3,237,300
ジャパンフーズ	1,700	1,126.00	1,914,200
日清オイリオグループ	15,600	3,260.00	50,856,000
不二製油グループ本社	29,600	3,425.00	101,380,000
かどや製油	1,300	4,260.00	5,538,000
J - オイルミルズ	6,300	4,085.00	25,735,500
キッコーマン	80,000	4,810.00	384,800,000
味の素	267,700	1,914.50	512,511,650
キューピー	67,500	2,515.00	169,762,500
ハウス食品グループ本社	45,300	4,605.00	208,606,500

カゴメ	48,600	2,638.00	128,206,800
焼津水産化学工業	5,900	1,091.00	6,436,900
アリアケジャパン	11,100	7,240.00	80,364,000
ピエトロ	1,600	1,598.00	2,556,800
エバラ食品工業	2,900	2,100.00	6,090,000
ニチレイ	63,000	2,721.00	171,423,000
東洋水産	62,400	4,360.00	272,064,000
イトアンド	4,200	1,644.00	6,904,800
大冷	1,400	1,775.00	2,485,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	911.00	3,006,300
日清食品ホールディングス	51,500	6,610.00	340,415,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,182.00	14,183,000
一正蒲鉾	4,700	1,134.00	5,329,800
フジッコ	13,100	2,176.00	28,505,600
ロック・フィールド	13,100	1,617.00	21,182,700
日本たばこ産業	699,900	2,499.50	1,749,400,050
ケンコーマヨネーズ	6,800	2,429.00	16,517,200
わらべや日洋ホールディングス	7,900	1,732.00	13,682,800
なとり	6,800	1,569.00	10,669,200
イフジ産業	2,100	667.00	1,400,700
ピクルスコーポレーション	2,900	1,936.00	5,614,400
北の達人コーポレーション	47,600	551.00	26,227,600
ユーグレナ	51,700	874.00	45,185,800
ミヨシ油脂	4,600	1,129.00	5,193,400
理研ビタミン	5,700	3,490.00	19,893,000
片倉工業	14,600	1,219.00	17,797,400
ゲンゼ	8,000	4,750.00	38,000,000
東洋紡	50,200	1,201.00	60,290,200
ユニチカ	34,700	358.00	12,422,600
富士紡ホールディングス	6,200	2,341.00	14,514,200
倉敷紡績	11,300	1,957.00	22,114,100
シキボウ	6,200	929.00	5,759,800
日本毛織	39,000	842.00	32,838,000
トーア紡コーポレーション	5,000	440.00	2,200,000
ダイドーリミテッド	14,400	316.00	4,550,400
帝国繊維	13,300	2,279.00	30,310,700
帝人	96,500	1,780.00	171,770,000
東レ	917,700	748.10	686,531,370
サカイオーベックス	3,000	1,682.00	5,046,000
住江織物	3,500	2,829.00	9,901,500
日本フェルト	6,900	457.00	3,153,300
イチカワ	1,800	1,294.00	2,329,200

日東製紙	1,400	1,321.00	1,849,400
アツギ	9,900	916.00	9,068,400
ダイニック	4,800	723.00	3,470,400
セーレン	29,200	1,431.00	41,785,200
ソトー	4,800	947.00	4,545,600
東海染工	1,700	1,129.00	1,919,300
小松マテーレ	19,600	774.00	15,170,400
ワコールホールディングス	34,500	2,768.00	95,496,000
ホギメディカル	14,700	3,530.00	51,891,000
レナウン	34,000	98.00	3,332,000
クラウドIAホールディングス	3,100	502.00	1,556,200
T S Iホールディングス	43,800	644.00	28,207,200
マツオカコーポレーション	3,800	2,701.00	10,263,800
ワールド	15,500	2,342.00	36,301,000
三陽商会	7,200	1,724.00	12,412,800
ナイガイ	4,500	504.00	2,268,000
オンワードホールディングス	71,300	590.00	42,067,000
ルックホールディングス	4,400	1,405.00	6,182,000
ゴールドウイン	10,700	14,760.00	157,932,000
デサント	28,900	1,899.00	54,881,100
キング	6,400	632.00	4,044,800
ヤマトインターナショナル	7,800	406.00	3,166,800
特種東海製紙	7,500	3,770.00	28,275,000
王子ホールディングス	532,500	581.00	309,382,500
日本製紙	56,700	1,916.00	108,637,200
三菱製紙	19,200	567.00	10,886,400
北越コーポレーション	78,500	554.00	43,489,000
中越パルプ工業	5,000	1,416.00	7,080,000
巴川製紙所	3,900	909.00	3,545,100
大王製紙	57,600	1,304.00	75,110,400
阿波製紙	3,000	435.00	1,305,000
レンゴー	122,000	985.00	120,170,000
トーモク	7,300	1,771.00	12,928,300
ザ・パック	9,000	3,100.00	27,900,000
クラレ	199,600	1,231.00	245,707,600
旭化成	841,500	1,152.00	969,408,000
共和レザー	7,400	768.00	5,683,200
昭和電工	78,600	3,040.00	238,944,000
住友化学	931,100	475.00	442,272,500
住友精化	5,800	3,300.00	19,140,000
日産化学	72,600	4,560.00	331,056,000
ラサ工業	4,200	1,317.00	5,531,400

クレハ	10,900	7,000.00	76,300,000
多木化学	3,500	4,605.00	16,117,500
テイカ	9,600	2,311.00	22,185,600
石原産業	22,700	1,046.00	23,744,200
片倉コープアグリ	3,400	1,115.00	3,791,000
日東エフシー	7,400	1,199.00	8,872,600
日本曹達	18,700	2,652.00	49,592,400
東ソー	182,800	1,380.00	252,264,000
トクヤマ	34,100	2,448.00	83,476,800
セントラル硝子	25,800	2,471.00	63,751,800
東亜合成	74,200	1,198.00	88,891,600
大阪ソーダ	12,700	2,581.00	32,778,700
関東電化工業	27,900	689.00	19,223,100
デンカ	46,500	3,185.00	148,102,500
信越化学工業	208,400	9,224.00	1,922,281,600
日本カーバイド工業	4,000	1,330.00	5,320,000
堺化学工業	7,900	2,495.00	19,710,500
第一稀元素化学工業	12,800	747.00	9,561,600
エア・ウォーター	96,900	1,624.00	157,365,600
大陽日酸	97,400	2,100.00	204,540,000
日本化学工業	4,000	1,740.00	6,960,000
東邦アセチレン	1,800	1,319.00	2,374,200
日本パーカライズン	64,600	1,202.00	77,649,200
高压ガス工業	18,700	812.00	15,184,400
チタン工業	1,500	2,562.00	3,843,000
四国化成工業	19,900	1,034.00	20,576,600
戸田工業	2,500	2,090.00	5,225,000
ステラ ケミファ	6,900	2,619.00	18,071,100
保土谷化学工業	4,100	2,568.00	10,528,800
日本触媒	19,900	6,400.00	127,360,000
大日精化工業	9,800	2,880.00	28,224,000
カネカ	30,600	3,770.00	115,362,000
三菱瓦斯化学	121,600	1,354.00	164,646,400
三井化学	107,400	2,376.00	255,182,400
J S R	118,700	1,538.00	182,560,600
東京応化工業	20,300	3,115.00	63,234,500
大阪有機化学工業	11,000	987.00	10,857,000
三菱ケミカルホールディングス	790,800	711.70	562,812,360
K Hネオケム	18,000	2,885.00	51,930,000
ダイセル	174,200	945.00	164,619,000
住友ベークライト	20,500	3,755.00	76,977,500
積水化学工業	258,500	1,594.00	412,049,000



日本ゼオン	106,700	1,038.00	110,754,600
アイカ工業	35,500	3,695.00	131,172,500
宇部興産	59,700	2,092.00	124,892,400
積水樹脂	19,500	2,072.00	40,404,000
タキロンシーアイ	25,500	634.00	16,167,000
旭有機材	8,200	1,395.00	11,439,000
日立化成	54,700	2,923.00	159,888,100
ニチバン	6,200	2,355.00	14,601,000
リケンテクノス	32,100	486.00	15,600,600
大倉工業	6,100	1,752.00	10,687,200
積水化成成品工業	17,500	717.00	12,547,500
群栄化学工業	3,000	2,392.00	7,176,000
タイガースポリマー	6,300	580.00	3,654,000
ミライアル	3,500	1,055.00	3,692,500
ダイキアクシス	4,300	840.00	3,612,000
ダイキョーニシカワ	25,000	829.00	20,725,000
竹本容器	4,300	1,130.00	4,859,000
森六ホールディングス	6,400	2,410.00	15,424,000
日本化薬	75,300	1,240.00	93,372,000
カーリットホールディングス	12,700	660.00	8,382,000
日本精化	9,500	1,289.00	12,245,500
扶桑化学工業	12,000	1,927.00	23,124,000
トリケミカル研究所	2,600	4,890.00	12,714,000
A D E K A	58,300	1,557.00	90,773,100
日油	44,600	3,935.00	175,501,000
ハリマ化成グループ	9,800	996.00	9,760,800
花王	293,200	8,692.00	2,548,494,400
第一工業製薬	4,400	2,879.00	12,667,600
石原ケミカル	3,000	1,492.00	4,476,000
日華化学	4,100	907.00	3,718,700
ニイタカ	1,900	1,491.00	2,832,900
三洋化成工業	8,000	5,320.00	42,560,000
有機合成薬品工業	9,300	243.00	2,259,900
大日本塗料	13,400	963.00	12,904,200
日本ペイントホールディングス	97,600	4,405.00	429,928,000
関西ペイント	132,900	2,024.00	268,989,600
神東塗料	9,600	167.00	1,603,200
中国塗料	38,800	948.00	36,782,400
日本特殊塗料	8,900	1,165.00	10,368,500
藤倉化成	15,900	566.00	8,999,400
太陽ホールディングス	9,700	3,310.00	32,107,000
D I C	53,500	2,698.00	144,343,000

サカティンクス	25,800	959.00	24,742,200
東洋インキSCホールディングス	25,000	2,305.00	57,625,000
T&K TOKA	9,200	912.00	8,390,400
富士フィルムホールディングス	250,900	5,341.00	1,340,056,900
資生堂	240,000	8,051.00	1,932,240,000
ライオン	168,300	2,137.00	359,657,100
高砂香料工業	8,300	3,055.00	25,356,500
マンダム	27,200	2,666.00	72,515,200
ミルボン	14,900	5,330.00	79,417,000
ファンケル	53,800	2,891.00	155,535,800
コーセー	20,500	17,210.00	352,805,000
コタ	6,400	1,187.00	7,596,800
シーボン	1,500	2,404.00	3,606,000
ポーラ・オルビスホールディングス	51,600	3,040.00	156,864,000
ノエビアホールディングス	11,500	5,780.00	66,470,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	914.00	2,559,200
エステー	8,700	1,759.00	15,303,300
アグロ カネショウ	4,900	2,053.00	10,059,700
コニシ	21,400	1,558.00	33,341,200
長谷川香料	16,000	1,799.00	28,784,000
星光PMC	8,100	741.00	6,002,100
小林製薬	33,800	8,280.00	279,864,000
荒川化学工業	10,800	1,253.00	13,532,400
メック	8,300	1,000.00	8,300,000
日本高純度化学	3,300	2,284.00	7,537,200
タカラバイオ	31,600	2,462.00	77,799,200
JCU	15,700	1,973.00	30,976,100
新田ゼラチン	7,600	687.00	5,221,200
OATアグリオ	1,700	1,285.00	2,184,500
デクセリアルズ	31,200	693.00	21,621,600
アース製薬	9,100	5,050.00	45,955,000
北興化学工業	12,300	483.00	5,940,900
大成ラミック	4,000	2,850.00	11,400,000
クミアイ化学工業	49,900	737.00	36,776,300
日本農薬	21,400	406.00	8,688,400
アキレス	8,800	1,952.00	17,177,600
有沢製作所	18,900	751.00	14,193,900
日東電工	83,300	4,875.00	406,087,500
レック	12,900	1,260.00	16,254,000
三光合成	13,900	331.00	4,600,900
きもと	20,900	150.00	3,135,000
藤森工業	10,900	2,762.00	30,105,800

前澤化成工業	8,300	1,028.00	8,532,400
未来工業	6,500	2,142.00	13,923,000
ウェブロックホールディングス	3,400	649.00	2,206,600
J S P	7,100	1,983.00	14,079,300
エフピコ	13,300	6,420.00	85,386,000
天馬	8,400	1,802.00	15,136,800
信越ポリマー	21,600	754.00	16,286,400
東リ	30,200	250.00	7,550,000
ニフコ	48,400	2,778.00	134,455,200
バルカー	9,800	2,080.00	20,384,000
ユニ・チャーム	256,100	3,295.00	843,849,500
ショーエイコーポレーション	1,000	738.00	738,000
協和発酵キリン	141,700	2,102.00	297,853,400
武田薬品工業	1,054,400	3,850.00	4,059,440,000
アステラス製薬	1,113,500	1,538.00	1,712,563,000
大日本住友製薬	89,500	2,302.00	206,029,000
塩野義製薬	154,400	6,137.00	947,552,800
田辺三菱製薬	126,300	1,282.00	161,916,600
わかもと製薬	14,300	267.00	3,818,100
あすか製薬	14,900	1,175.00	17,507,500
日本新薬	31,600	7,920.00	250,272,000
バイオフェルミン製薬	2,100	2,294.00	4,817,400
中外製薬	125,900	7,240.00	911,516,000
科研製薬	21,800	5,210.00	113,578,000
エーザイ	144,600	6,551.00	947,274,600
ロート製薬	61,900	3,100.00	191,890,000
小野薬品工業	285,200	1,941.00	553,573,200
久光製薬	35,700	4,540.00	162,078,000
持田製薬	18,300	5,180.00	94,794,000
参天製薬	224,800	1,620.00	364,176,000
扶桑薬品工業	4,300	2,072.00	8,909,600
日本ケミファ	1,600	2,914.00	4,662,400
ツムラ	37,400	3,195.00	119,493,000
日医工	31,800	1,279.00	40,672,200
キッセイ薬品工業	21,400	2,658.00	56,881,200
生化学工業	23,400	1,229.00	28,758,600
栄研化学	21,200	1,900.00	40,280,000
日水製薬	5,100	1,196.00	6,099,600
鳥居薬品	6,500	2,311.00	15,021,500
J C R ファーマ	8,500	6,830.00	58,055,000
東和薬品	17,400	2,748.00	47,815,200
富士製薬工業	8,200	1,487.00	12,193,400

沢井製薬	24,800	5,870.00	145,576,000
ゼリア新薬工業	23,900	2,084.00	49,807,600
第一三共	345,600	5,382.00	1,860,019,200
キョーリン製薬ホールディングス	26,600	1,948.00	51,816,800
大幸薬品	5,400	1,922.00	10,378,800
ダイト	7,000	3,380.00	23,660,000
大塚ホールディングス	230,100	3,766.00	866,556,600
大正製薬ホールディングス	27,000	9,040.00	244,080,000
ペプチドリーム	60,500	5,400.00	326,700,000
日本コークス工業	101,500	95.00	9,642,500
ニチレキ	15,400	1,019.00	15,692,600
ユシロ化学工業	6,300	1,283.00	8,082,900
ビーピー・カストロール	4,300	1,474.00	6,338,200
富士石油	29,200	265.00	7,738,000
MORESCO	4,400	1,375.00	6,050,000
出光興産	139,400	3,070.00	427,958,000
JXTGホールディングス	2,031,300	522.70	1,061,760,510
コスモエネルギーホールディングス	35,000	2,163.00	75,705,000
横浜ゴム	69,900	1,874.00	130,992,600
TOYO TIRE	62,000	1,349.00	83,638,000
ブリヂストン	371,200	4,107.00	1,524,518,400
住友ゴム工業	108,500	1,220.00	132,370,000
藤倉コンポジット	10,500	384.00	4,032,000
オカモト	8,400	4,960.00	41,664,000
フコク	5,300	704.00	3,731,200
ニッタ	13,600	3,075.00	41,820,000
住友理工	23,300	815.00	18,989,500
三ツ星ベルト	15,900	2,065.00	32,833,500
バンドー化学	23,000	928.00	21,344,000
日東紡績	18,000	2,005.00	36,090,000
A G C	119,400	3,625.00	432,825,000
日本板硝子	53,000	730.00	38,690,000
石塚硝子	2,000	2,202.00	4,404,000
日本山村硝子	5,000	1,503.00	7,515,000
日本電気硝子	52,300	2,651.00	138,647,300
オハラ	4,800	1,311.00	6,292,800
住友大阪セメント	24,400	4,355.00	106,262,000
太平洋セメント	76,300	3,300.00	251,790,000
日本ヒューム	12,100	703.00	8,506,300
日本コンクリート工業	26,000	292.00	7,592,000
三谷セキサン	5,600	2,897.00	16,223,200
アジアパイルホールディングス	17,100	596.00	10,191,600

東海カーボン	109,700	1,066.00	116,940,200
日本カーボン	5,800	3,995.00	23,171,000
東洋炭素	7,100	2,026.00	14,384,600
ノリタケカンパニーリミテド	7,200	4,605.00	33,156,000
TOTO	92,900	4,095.00	380,425,500
日本碍子	147,400	1,500.00	221,100,000
日本特殊陶業	101,900	1,899.00	193,508,100
MARUWA	4,200	4,880.00	20,496,000
品川リフラクトリーズ	3,200	2,945.00	9,424,000
黒崎播磨	2,400	6,140.00	14,736,000
ヨータイ	10,600	554.00	5,872,400
イソライト工業	6,200	467.00	2,895,400
東京窯業	15,400	299.00	4,604,600
ニッカトー	5,500	680.00	3,740,000
フジインコーポレーテッド	10,800	2,057.00	22,215,600
クニミネ工業	5,400	809.00	4,368,600
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,018.00	2,341,400
ニチアス	33,100	1,888.00	62,492,800
ニチハ	16,800	2,812.00	47,241,600
日本製鉄	554,900	1,832.00	1,016,576,800
神戸製鋼所	218,600	681.00	148,866,600
中山製鋼所	16,500	478.00	7,887,000
合同製鐵	5,800	2,065.00	11,977,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	322,600	1,522.00	490,997,200
東京製鐵	64,000	858.00	54,912,000
共英製鋼	13,500	1,849.00	24,961,500
大和工業	25,400	3,110.00	78,994,000
東京鐵鋼	4,900	1,173.00	5,747,700
大阪製鐵	7,900	1,782.00	14,077,800
淀川製鋼所	16,100	2,005.00	32,280,500
丸一鋼管	42,300	2,830.00	119,709,000
モリ工業	3,600	1,820.00	6,552,000
大同特殊鋼	19,600	3,875.00	75,950,000
日本高周波鋼業	4,400	478.00	2,103,200
日本冶金工業	98,900	208.00	20,571,200
山陽特殊製鋼	15,100	1,487.00	22,453,700
愛知製鋼	6,700	3,245.00	21,741,500
日立金属	128,700	1,098.00	141,312,600
日本金属	2,800	849.00	2,377,200
大平洋金属	8,100	2,233.00	18,087,300
新日本電工	71,300	198.00	14,117,400
栗本鐵工所	6,000	1,348.00	8,088,000

虹技	1,800	1,243.00	2,237,400
三菱製鋼	8,900	1,141.00	10,154,900
日亜鋼業	17,500	327.00	5,722,500
日本精線	1,700	2,542.00	4,321,400
エンビプロ・ホールディングス	4,500	582.00	2,619,000
シンニッタン	18,500	343.00	6,345,500
新家工業	2,700	1,380.00	3,726,000
大紀アルミニウム工業所	19,800	669.00	13,246,200
日本軽金属ホールディングス	326,000	233.00	75,958,000
三井金属鉱業	32,300	2,223.00	71,802,900
東邦亜鉛	6,700	2,313.00	15,497,100
三菱マテリアル	78,900	2,827.00	223,050,300
住友金属鉱山	163,600	2,920.00	477,712,000
D O W A ホールディングス	27,900	3,415.00	95,278,500
古河機械金属	19,800	1,366.00	27,046,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	1,565.00	21,753,500
東邦チタニウム	21,500	1,067.00	22,940,500
U A C J	18,200	1,772.00	32,250,400
C K サンエツ	2,300	2,773.00	6,377,900
古河電気工業	34,500	2,855.00	98,497,500
住友電気工業	446,600	1,330.00	593,978,000
フジクラ	144,600	362.00	52,345,200
昭和電線ホールディングス	13,800	766.00	10,570,800
東京特殊電線	1,600	1,616.00	2,585,600
タツタ電線	23,900	444.00	10,611,600
カナレ電気	2,100	1,870.00	3,927,000
平河ヒューテック	5,100	1,094.00	5,579,400
リョービ	14,800	2,041.00	30,206,800
アーレスティ	14,900	529.00	7,882,100
アサヒホールディングス	22,500	2,055.00	46,237,500
稲葉製作所	6,700	1,428.00	9,567,600
宮地エンジニアリンググループ	3,600	1,736.00	6,249,600
トーカロ	30,700	700.00	21,490,000
アルファC o	4,200	1,191.00	5,002,200
S U M C O	132,000	1,203.00	158,796,000
川田テクノロジーズ	2,700	7,780.00	21,006,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,400	2,383.00	5,719,200
信和	6,300	993.00	6,255,900
東洋製罐グループホールディングス	76,100	2,090.00	159,049,000
ホッカンホールディングス	6,100	1,767.00	10,778,700
コロナ	6,600	1,010.00	6,666,000
横河ブリッジホールディングス	22,200	1,522.00	33,788,400

駒井ハルテック	2,300	1,602.00	3,684,600
高田機工	1,100	2,517.00	2,768,700
三和ホールディングス	123,400	1,098.00	135,493,200
文化シャッター	35,200	825.00	29,040,000
三協立山	16,600	1,176.00	19,521,600
アルインコ	9,500	961.00	9,129,500
東洋シャッター	2,900	547.00	1,586,300
LIXILグループ	176,200	1,379.00	242,979,800
日本フィルコン	9,100	500.00	4,550,000
ノーリツ	26,700	1,394.00	37,219,800
長府製作所	12,200	2,180.00	26,596,000
リンナイ	21,300	7,270.00	154,851,000
ダイニチ工業	6,400	626.00	4,006,400
日東精工	16,500	554.00	9,141,000
三洋工業	1,600	1,787.00	2,859,200
岡部	24,200	976.00	23,619,200
ジーテクト	13,200	1,477.00	19,496,400
東プレ	22,300	1,784.00	39,783,200
高周波熱錬	23,000	848.00	19,504,000
東京製綱	7,300	992.00	7,241,600
サンコール	6,700	503.00	3,370,100
モリテック スチール	9,300	350.00	3,255,000
パイオラックス	19,100	1,829.00	34,933,900
エイチワン	11,700	739.00	8,646,300
日本発條	119,000	805.00	95,795,000
中央発條	1,400	2,836.00	3,970,400
アドバネクス	1,600	1,705.00	2,728,000
立川ブラインド工業	5,300	1,222.00	6,476,600
三益半導体工業	10,700	1,477.00	15,803,900
日本ドライケミカル	3,300	1,098.00	3,623,400
日本製鋼所	36,300	1,651.00	59,931,300
三浦工業	51,700	3,385.00	175,004,500
タクマ	43,700	1,455.00	63,583,500
ツガミ	27,000	844.00	22,788,000
オークマ	15,200	5,280.00	80,256,000
東芝機械	13,600	2,243.00	30,504,800
アマダホールディングス	179,600	1,120.00	201,152,000
アイダエンジニアリング	32,500	735.00	23,887,500
滝澤鉄工所	3,800	1,405.00	5,339,000
F U J I	47,800	1,183.00	56,547,400
牧野フライス製作所	14,100	3,745.00	52,804,500
オーエスジー	58,900	2,030.00	119,567,000

ダイジェット工業	1,500	1,316.00	1,974,000	
旭ダイヤモンド工業	31,500	656.00	20,664,000	
D M G 森精機	75,700	1,332.00	100,832,400	
ソディック	26,200	921.00	24,130,200	
ディスコ	16,200	15,290.00	247,698,000	
日東工器	6,600	2,149.00	14,183,400	
日進工具	3,600	2,190.00	7,884,000	
パンチ工業	8,400	484.00	4,065,600	
富士ダイス	5,400	574.00	3,099,600	
豊和工業	6,800	856.00	5,820,800	
O K K	5,100	749.00	3,819,900	
東洋機械金属	8,700	568.00	4,941,600	
津田駒工業	2,700	1,590.00	4,293,000	
島精機製作所	16,500	2,988.00	49,302,000	
オプトラン	11,700	2,281.00	26,687,700	
N C ホールディングス	4,000	472.00	1,888,000	
イワキポンプ	5,200	977.00	5,080,400	
フリー	9,600	1,012.00	9,715,200	
ヤマシンフィルタ	20,800	541.00	11,252,800	
日阪製作所	14,800	902.00	13,349,600	
やまびこ	23,300	915.00	21,319,500	
平田機工	5,700	5,220.00	29,754,000	
ペガサスミシン製造	11,300	530.00	5,989,000	
マルマエ	5,000	759.00	3,795,000	
タツモ	5,100	740.00	3,774,000	
ナプテスコ	65,800	2,762.00	181,739,600	
三井海洋開発	12,700	2,722.00	34,569,400	
レオン自動機	11,800	1,611.00	19,009,800	
S M C	35,400	36,410.00	1,288,914,000	
新川	5,900	342.00	2,017,800	
ホソカワミクロン	4,200	4,665.00	19,593,000	
ユニオンツール	5,200	2,717.00	14,128,400	
オイレス工業	16,800	1,505.00	25,284,000	
日精エー・エス・ビー機械	4,100	2,831.00	11,607,100	
サトーホールディングス	14,400	2,716.00	39,110,400	
技研製作所	10,500	3,250.00	34,125,000	
日本エアテック	3,900	593.00	2,312,700	
カワタ	3,300	1,063.00	3,507,900	
日精樹脂工業	10,200	922.00	9,404,400	
オカダアイヨン	4,200	1,300.00	5,460,000	
ワイエイシイホールディングス	4,700	783.00	3,680,100	
小松製作所	546,900	2,408.50	1,317,208,650	



住友重機械工業	69,200	3,465.00	239,778,000
日立建機	48,500	2,561.00	124,208,500
日工	3,400	2,591.00	8,809,400
巴工業	5,200	2,303.00	11,975,600
井関農機	12,200	1,486.00	18,129,200
TOWA	10,400	755.00	7,852,000
丸山製作所	2,800	1,107.00	3,099,600
北川鉄工所	5,500	2,044.00	11,242,000
ローツェ	5,300	2,194.00	11,628,200
タカキタ	4,400	522.00	2,296,800
クボタ	647,100	1,646.00	1,065,126,600
荏原実業	3,600	1,881.00	6,771,600
三菱化工機	4,300	1,435.00	6,170,500
月島機械	24,100	1,349.00	32,510,900
帝国電機製作所	8,500	1,207.00	10,259,500
新東工業	28,800	932.00	26,841,600
澁谷工業	10,600	2,878.00	30,506,800
アイチ コーポレーション	21,000	657.00	13,797,000
小森コーポレーション	32,900	1,114.00	36,650,600
鶴見製作所	9,500	1,894.00	17,993,000
住友精密工業	2,000	2,837.00	5,674,000
酒井重工業	2,300	2,505.00	5,761,500
荏原製作所	53,600	2,770.00	148,472,000
石井鐵工所	1,900	1,946.00	3,697,400
西島製作所	12,500	991.00	12,387,500
北越工業	12,500	1,246.00	15,575,000
ダイキン工業	164,900	13,800.00	2,275,620,000
オルガノ	4,400	3,360.00	14,784,000
トーヨーカネツ	4,600	2,197.00	10,106,200
栗田工業	65,400	2,571.00	168,143,400
椿本チエイン	15,800	3,270.00	51,666,000
大同工業	5,900	816.00	4,814,400
木村化工機	10,600	339.00	3,593,400
アネスト岩田	18,900	919.00	17,369,100
ダイフク	66,500	5,410.00	359,765,000
サムコ	3,400	782.00	2,658,800
加藤製作所	6,300	2,007.00	12,644,100
油研工業	2,100	1,624.00	3,410,400
タダノ	58,400	1,023.00	59,743,200
フジテック	44,000	1,424.00	62,656,000
C K D	33,700	988.00	33,295,600
キトー	9,200	1,528.00	14,057,600

平和	33,700	2,233.00	75,252,100
理想科学工業	10,700	1,765.00	18,885,500
SANKYO	30,300	4,190.00	126,957,000
日本金銭機械	13,400	1,122.00	15,034,800
マースグループホールディングス	7,700	2,074.00	15,969,800
福島工業	7,500	3,535.00	26,512,500
オーイズミ	5,300	380.00	2,014,000
ダイコク電機	5,600	1,327.00	7,431,200
竹内製作所	20,300	1,813.00	36,803,900
アマノ	34,500	2,844.00	98,118,000
JUKI	16,800	899.00	15,103,200
蛇の目マシン工業	11,100	427.00	4,739,700
マックス	18,500	1,512.00	27,972,000
グローリー	33,500	2,754.00	92,259,000
新晃工業	11,300	1,601.00	18,091,300
大和冷機工業	17,500	1,200.00	21,000,000
セガサミーホールディングス	119,900	1,318.00	158,028,200
日本ピストンリング	4,500	1,371.00	6,169,500
リケン	5,600	4,560.00	25,536,000
T P R	16,300	1,828.00	29,796,400
ツバキ・ナカシマ	18,400	1,723.00	31,703,200
ホシザキ	35,300	7,980.00	281,694,000
大豊工業	10,000	819.00	8,190,000
日本精工	248,100	894.00	221,801,400
NTN	259,900	286.00	74,331,400
ジェイテクト	115,900	1,172.00	135,834,800
不二越	11,200	4,220.00	47,264,000
日本トムソン	35,900	441.00	15,831,900
THK	75,300	2,233.00	168,144,900
ユーシン精機	9,400	1,059.00	9,954,600
前澤給装工業	4,800	1,885.00	9,048,000
イーグル工業	15,000	1,037.00	15,555,000
前澤工業	8,300	340.00	2,822,000
日本ピラー工業	12,300	1,082.00	13,308,600
キッツ	49,100	704.00	34,566,400
マキタ	147,000	3,785.00	556,395,000
日立造船	96,200	361.00	34,728,200
三菱重工業	202,400	4,825.00	976,580,000
I H I	92,900	2,442.00	226,861,800
スター精密	20,700	1,338.00	27,696,600
日清紡ホールディングス	67,200	766.00	51,475,200
イビデン	74,100	1,697.00	125,747,700

コニカミノルタ	264,200	990.00	261,558,000
ブラザー工業	157,500	1,871.00	294,682,500
ミネベアミツミ	224,400	1,589.00	356,571,600
日立製作所	543,700	3,768.00	2,048,661,600
三菱電機	1,207,700	1,387.00	1,675,079,900
富士電機	78,400	3,605.00	282,632,000
東洋電機製造	4,900	1,274.00	6,242,600
安川電機	140,000	3,160.00	442,400,000
シンフォニアテクノロジー	16,900	1,198.00	20,246,200
明電舎	24,000	1,504.00	36,096,000
オリジン	3,400	1,429.00	4,858,600
山洋電気	5,900	3,870.00	22,833,000
デンヨー	11,200	1,343.00	15,041,600
東芝テック	15,200	2,718.00	41,313,600
芝浦メカトロニクス	2,200	2,664.00	5,860,800
マブチモーター	33,500	3,710.00	124,285,000
日本電産	145,300	13,690.00	1,989,157,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,800	1,136.00	7,724,800
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,120.00	6,384,000
東光高岳	6,400	1,139.00	7,289,600
ダブル・スコープ	17,800	1,384.00	24,635,200
ダイヘン	13,300	2,882.00	38,330,600
ヤーマン	17,800	970.00	17,266,000
JVCケンウッド	93,200	238.00	22,181,600
ミマキエンジニアリング	11,300	581.00	6,565,300
第一精工	5,300	1,375.00	7,287,500
日新電機	28,400	1,031.00	29,280,400
大崎電気工業	24,100	633.00	15,255,300
オムロン	128,400	5,160.00	662,544,000
日東工業	19,400	1,906.00	36,976,400
I D E C	16,300	1,896.00	30,904,800
正興電機製作所	2,600	771.00	2,004,600
不二電機工業	1,600	1,298.00	2,076,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,600	1,963.00	85,586,800
サクサホールディングス	3,100	1,830.00	5,673,000
メルコホールディングス	5,100	3,000.00	15,300,000
テクノメディカ	1,800	2,110.00	3,798,000
日本電気	156,300	4,075.00	636,922,500
富士通	116,400	7,503.00	873,349,200
沖電気工業	52,400	1,377.00	72,154,800
岩崎通信機	5,600	768.00	4,300,800
電気興業	6,400	2,647.00	16,940,800

サンケン電気	14,200	2,138.00	30,359,600
ナカヨ	2,500	1,488.00	3,720,000
アイホン	6,900	1,605.00	11,074,500
ルネサスエレクトロニクス	125,700	470.00	59,079,000
セイコーエプソン	149,900	1,610.00	241,339,000
ワコム	88,300	335.00	29,580,500
アルバック	24,100	3,060.00	73,746,000
アクセル	5,600	561.00	3,141,600
E I Z O	11,100	3,985.00	44,233,500
日本信号	30,900	1,105.00	34,144,500
京三製作所	26,200	361.00	9,458,200
能美防災	16,100	2,057.00	33,117,700
ホーチキ	7,900	1,172.00	9,258,800
星和電機	7,100	499.00	3,542,900
エレコム	11,500	3,590.00	41,285,000
パナソニック	1,379,800	889.00	1,226,642,200
シャープ	119,900	996.00	119,420,400
アンリツ	77,800	1,654.00	128,681,200
富士通ゼネラル	37,000	1,559.00	57,683,000
ソニー	810,300	5,314.00	4,305,934,200
T D K	63,200	7,430.00	469,576,000
帝国通信工業	5,600	1,148.00	6,428,800
タムラ製作所	46,800	519.00	24,289,200
アルプスアルパイン	125,900	1,800.00	226,620,000
池上通信機	3,800	1,115.00	4,237,000
鈴木	7,000	616.00	4,312,000
日本トリム	2,300	5,220.00	12,006,000
ローランド ディー . ジー .	6,300	2,400.00	15,120,000
フォスター電機	13,700	1,573.00	21,550,100
S M K	3,400	2,568.00	8,731,200
ヨコオ	8,800	1,993.00	17,538,400
ホシデン	35,800	1,071.00	38,341,800
ヒロセ電機	17,300	12,030.00	208,119,000
日本航空電子工業	27,800	1,519.00	42,228,200
T O A	13,100	1,266.00	16,584,600
マクセルホールディングス	26,200	1,810.00	47,422,000
古野電気	15,900	917.00	14,580,300
ユニデンホールディングス	3,600	1,800.00	6,480,000
スミダコーポレーション	10,500	1,121.00	11,770,500
アイコム	6,700	2,194.00	14,699,800
リオン	5,700	2,090.00	11,913,000
本多通信工業	10,900	480.00	5,232,000

横河電機	120,900	2,129.00	257,396,100	
新電元工業	4,300	3,520.00	15,136,000	
アズビル	78,000	2,584.00	201,552,000	
東亜ディーケーケー	6,400	828.00	5,299,200	
日本光電工業	53,300	3,070.00	163,631,000	
チノー	4,300	1,154.00	4,962,200	
共和電業	12,900	401.00	5,172,900	
日本電子材料	5,000	507.00	2,535,000	
堀場製作所	24,000	5,030.00	120,720,000	
アドバンテスト	82,400	2,575.00	212,180,000	
小野測器	6,100	579.00	3,531,900	
エスペック	10,800	2,239.00	24,181,200	
キーエンス	59,300	62,670.00	3,716,331,000	
日置電機	6,400	3,550.00	22,720,000	
シスメックス	94,100	7,724.00	726,828,400	
日本マイクロニクス	21,300	923.00	19,659,900	
メガチップス	9,700	1,200.00	11,640,000	
O B A R A G R O U P	6,200	3,645.00	22,599,000	
澤藤電機	1,700	1,699.00	2,888,300	
原田工業	5,300	735.00	3,895,500	
コーセル	15,600	1,046.00	16,317,600	
イリソ電子工業	11,100	5,060.00	56,166,000	
オブテックスグループ	21,400	1,325.00	28,355,000	
千代田インテグレ	5,200	1,977.00	10,280,400	
アイ・オー・データ機器	4,700	1,020.00	4,794,000	
レーザーテック	24,800	3,880.00	96,224,000	
スタンレー電気	85,500	2,554.00	218,367,000	
岩崎電気	4,900	1,365.00	6,688,500	
ウシオ電機	70,400	1,377.00	96,940,800	
岡谷電機産業	9,500	374.00	3,553,000	
ハリオス テクノ ホールディング	11,600	595.00	6,902,000	
エノモト	3,700	732.00	2,708,400	
日本セラミック	12,400	2,868.00	35,563,200	
遠藤照明	6,500	726.00	4,719,000	
古河電池	9,100	623.00	5,669,300	
双信電機	6,700	444.00	2,974,800	
山一電機	9,100	886.00	8,062,600	
図研	8,100	1,480.00	11,988,000	
日本電子	23,900	2,302.00	55,017,800	
カシオ計算機	106,900	1,238.00	132,342,200	
ファナック	114,800	18,335.00	2,104,858,000	
日本シイエムケイ	27,000	624.00	16,848,000	

エンプラス	5,600	3,055.00	17,108,000
大真空	4,700	1,024.00	4,812,800
ローム	57,800	6,480.00	374,544,000
浜松ホトニクス	86,700	3,950.00	342,465,000
三井ハイテック	13,600	1,041.00	14,157,600
新光電気工業	40,900	862.00	35,255,800
京セラ	184,100	6,712.00	1,235,679,200
太陽誘電	53,900	2,019.00	108,824,100
村田製作所	380,200	4,671.00	1,775,914,200
双葉電子工業	19,900	1,391.00	27,680,900
北陸電気工業	4,800	950.00	4,560,000
ニチコン	38,400	780.00	29,952,000
日本ケミコン	8,600	1,577.00	13,562,200
K O A	18,500	1,218.00	22,533,000
市光工業	18,500	591.00	10,933,500
小糸製作所	72,400	5,290.00	382,996,000
ミツバ	22,600	561.00	12,678,600
S C R E E Nホールディングス	21,000	3,805.00	79,905,000
キャノン電子	11,200	1,737.00	19,454,400
キャノン	650,200	3,076.00	2,000,015,200
リコー	363,200	1,056.00	383,539,200
象印マホービン	30,200	1,148.00	34,669,600
M U T O Hホールディングス	1,800	1,645.00	2,961,000
東京エレクトロン	80,500	14,685.00	1,182,142,500
トヨタ紡織	42,300	1,389.00	58,754,700
芦森工業	2,600	1,609.00	4,183,400
ユニプレス	23,400	1,738.00	40,669,200
豊田自動織機	97,800	5,560.00	543,768,000
モリタホールディングス	21,200	1,963.00	41,615,600
三櫻工業	15,400	393.00	6,052,200
デンソー	265,900	4,337.00	1,153,208,300
東海理化電機製作所	31,800	1,697.00	53,964,600
三井E & Sホールディングス	41,900	879.00	36,830,100
川崎重工業	94,000	2,463.00	231,522,000
名村造船所	36,100	298.00	10,757,800
日本車輛製造	4,400	2,498.00	10,991,200
三菱ロジスネクスト	14,400	1,148.00	16,531,200
近畿車輛	1,100	1,747.00	1,921,700
日産自動車	1,424,300	779.20	1,109,814,560
いすゞ自動車	381,700	1,235.00	471,399,500
トヨタ自動車	1,345,800	6,581.00	8,856,709,800
日野自動車	150,800	879.00	132,553,200

三菱自動車工業	447,000	529.00	236,463,000
エフテック	8,500	745.00	6,332,500
レシップホールディングス	4,300	727.00	3,126,100
G M B	2,400	771.00	1,850,400
ファルテック	2,200	758.00	1,667,600
武蔵精密工業	29,400	1,353.00	39,778,200
日産車体	23,600	1,010.00	23,836,000
新明和工業	50,600	1,291.00	65,324,600
極東開発工業	24,000	1,372.00	32,928,000
日信工業	22,100	1,393.00	30,785,300
トピー工業	10,000	2,239.00	22,390,000
ティラド	4,400	1,876.00	8,254,400
曙ブレーキ工業	65,100	109.00	7,095,900
タチエス	19,900	1,348.00	26,825,200
N O K	65,000	1,431.00	93,015,000
フタバ産業	33,600	546.00	18,345,600
K Y B	12,100	2,788.00	33,734,800
大同メタル工業	19,600	676.00	13,249,600
プレス工業	60,000	481.00	28,860,000
ミクニ	15,500	378.00	5,859,000
太平洋工業	25,300	1,447.00	36,609,100
ケーヒン	27,800	1,457.00	40,504,600
河西工業	14,800	760.00	11,248,000
アイシン精機	99,500	3,660.00	364,170,000
マツダ	379,000	1,157.50	438,692,500
今仙電機製作所	11,300	878.00	9,921,400
本田技研工業	1,018,800	2,759.00	2,810,869,200
スズキ	220,900	5,366.00	1,185,349,400
S U B A R U	374,900	2,617.50	981,300,750
安永	5,900	1,493.00	8,808,700
ヤマハ発動機	170,600	1,876.00	320,045,600
ショーワ	28,600	1,402.00	40,097,200
T B K	14,500	382.00	5,539,000
エクセディ	16,400	2,200.00	36,080,000
豊田合成	39,000	1,965.00	76,635,000
愛三工業	18,900	703.00	13,286,700
盟和産業	1,900	1,070.00	2,033,000
日本プラスト	9,500	696.00	6,612,000
ヨロズ	11,300	1,332.00	15,051,600
エフ・シー・シー	21,700	2,278.00	49,432,600
シマノ	48,700	16,760.00	816,212,000
テイ・エス テック	28,100	2,721.00	76,460,100

ジャムコ	6,100	2,212.00	13,493,200
テルモ	341,700	3,082.00	1,053,119,400
クリエートメディック	4,000	913.00	3,652,000
日機装	39,000	1,378.00	53,742,000
島津製作所	155,400	2,769.00	430,302,600
JMS	11,100	652.00	7,237,200
長野計器	9,500	692.00	6,574,000
ブイ・テクノロジー	5,600	4,685.00	26,236,000
東京計器	7,700	924.00	7,114,800
愛知時計電機	1,600	3,980.00	6,368,000
インターアクション	6,100	1,386.00	8,454,600
オーバル	11,800	232.00	2,737,600
東京精密	21,800	2,527.00	55,088,600
マニー	16,000	6,770.00	108,320,000
ニコン	210,500	1,548.00	325,854,000
トプコン	64,900	1,387.00	90,016,300
オリンパス	719,600	1,310.00	942,676,000
理研計器	10,700	1,913.00	20,469,100
タムロン	10,700	2,278.00	24,374,600
HOYA	243,100	7,870.00	1,913,197,000
シード	5,200	1,085.00	5,642,000
ノーリツ鋼機	9,500	1,745.00	16,577,500
エー・アンド・デイ	11,000	792.00	8,712,000
朝日インテック	51,200	5,740.00	293,888,000
シチズン時計	132,200	505.00	66,761,000
リズム時計工業	4,100	1,210.00	4,961,000
大研医器	9,600	576.00	5,529,600
メニコン	16,600	3,715.00	61,669,000
シンシア	1,800	586.00	1,054,800
松風	5,900	1,276.00	7,528,400
セイコーホールディングス	18,600	2,061.00	38,334,600
ニプロ	83,600	1,230.00	102,828,000
中本パックス	3,400	1,482.00	5,038,800
スノーピーク	4,600	1,444.00	6,642,400
パラマウントベッドホールディングス	13,900	4,460.00	61,994,000
トランザクション	7,600	803.00	6,102,800
SHO-BI	3,500	360.00	1,260,000
ニホンフラッシュ	5,200	2,570.00	13,364,000
前田工織	13,300	1,967.00	26,161,100
永大産業	15,700	332.00	5,212,400
アートネイチャー	12,800	623.00	7,974,400
バンダイナムコホールディングス	124,900	5,380.00	671,962,000



アイフィスジャパン	2,700	600.00	1,620,000
共立印刷	20,000	175.00	3,500,000
S H O E I	5,800	4,575.00	26,535,000
フランスベッドホールディングス	17,100	993.00	16,980,300
パイロットコーポレーション	21,100	4,025.00	84,927,500
萩原工業	6,700	1,299.00	8,703,300
トッパン・フォームズ	25,900	894.00	23,154,600
フジシールインターナショナル	27,100	3,760.00	101,896,000
タカラトミー	50,500	1,298.00	65,549,000
廣済堂	11,200	636.00	7,123,200
エステールホールディングス	3,200	602.00	1,926,400
アーク	45,900	102.00	4,681,800
タカノ	4,700	742.00	3,487,400
プロネクサス	10,400	1,251.00	13,010,400
ホクシン	7,400	126.00	932,400
ウッドワン	4,100	1,001.00	4,104,100
大建工業	9,100	2,200.00	20,020,000
凸版印刷	170,500	1,640.00	279,620,000
大日本印刷	170,200	2,416.00	411,203,200
図書印刷	11,300	1,308.00	14,780,400
共同印刷	3,700	2,655.00	9,823,500
N I S S H A	24,800	1,028.00	25,494,400
光村印刷	1,000	1,926.00	1,926,000
宝印刷	5,800	1,640.00	9,512,000
アシックス	113,900	1,293.00	147,272,700
ツツミ	3,800	1,899.00	7,216,200
小松ウオール工業	3,700	1,831.00	6,774,700
ヤマハ	71,800	5,020.00	360,436,000
河合楽器製作所	3,700	2,635.00	9,749,500
クリナップ	11,200	537.00	6,014,400
ビジョン	73,000	4,400.00	321,200,000
兼松サステック	800	1,579.00	1,263,200
キングジム	10,000	884.00	8,840,000
リンテック	28,700	2,173.00	62,365,100
イトーキ	22,100	407.00	8,994,700
任天堂	69,100	38,960.00	2,692,136,000
三菱鉛筆	19,900	1,980.00	39,402,000
タカラスタンダード	25,000	1,681.00	42,025,000
コクヨ	57,900	1,442.00	83,491,800
ナカバヤシ	11,800	501.00	5,911,800
グローブライド	5,800	3,350.00	19,430,000
オカムラ	42,100	1,081.00	45,510,100

美津濃	12,000	2,461.00	29,532,000
東京電力ホールディングス	964,100	582.00	561,106,200
中部電力	369,500	1,504.50	555,912,750
関西電力	492,800	1,302.00	641,625,600
中国電力	167,000	1,372.00	229,124,000
北陸電力	118,300	795.00	94,048,500
東北電力	282,800	1,111.00	314,190,800
四国電力	108,700	999.00	108,591,300
九州電力	248,900	1,071.00	266,571,900
北海道電力	113,000	597.00	67,461,000
沖縄電力	22,400	1,703.00	38,147,200
電源開発	96,100	2,367.00	227,468,700
エフオン	5,600	763.00	4,272,800
イーレックス	21,000	1,288.00	27,048,000
レノバ	19,800	878.00	17,384,400
東京瓦斯	236,900	2,697.50	639,037,750
大阪瓦斯	234,400	1,928.00	451,923,200
東邦瓦斯	59,800	4,200.00	251,160,000
北海道瓦斯	6,500	1,474.00	9,581,000
広島ガス	24,700	338.00	8,348,600
西部瓦斯	13,600	2,301.00	31,293,600
静岡ガス	37,100	835.00	30,978,500
メタウォーター	5,800	3,330.00	19,314,000
SBSホールディングス	11,900	1,735.00	20,646,500
東武鉄道	127,400	3,175.00	404,495,000
相鉄ホールディングス	41,400	3,060.00	126,684,000
東京急行電鉄	328,000	1,942.00	636,976,000
京浜急行電鉄	165,400	1,865.00	308,471,000
小田急電鉄	193,400	2,675.00	517,345,000
京王電鉄	67,500	7,270.00	490,725,000
京成電鉄	90,500	4,080.00	369,240,000
富士急行	16,500	4,100.00	67,650,000
新京成電鉄	3,100	2,059.00	6,382,900
東日本旅客鉄道	214,700	10,455.00	2,244,688,500
西日本旅客鉄道	108,300	8,612.00	932,679,600
東海旅客鉄道	108,100	22,790.00	2,463,599,000
西武ホールディングス	149,600	1,815.00	271,524,000
鴻池運輸	19,200	1,666.00	31,987,200
西日本鉄道	33,500	2,419.00	81,036,500
ハマキョウレックス	9,300	3,630.00	33,759,000
サカイ引越センター	6,300	6,710.00	42,273,000
近鉄グループホールディングス	114,400	5,210.00	596,024,000

阪急阪神ホールディングス	152,500	3,950.00	602,375,000
南海電気鉄道	51,000	2,880.00	146,880,000
京阪ホールディングス	50,900	4,700.00	239,230,000
神戸電鉄	2,900	4,005.00	11,614,500
名古屋鉄道	93,800	3,005.00	281,869,000
山陽電気鉄道	8,800	2,231.00	19,632,800
日本通運	44,100	5,650.00	249,165,000
ヤマトホールディングス	200,500	2,202.00	441,501,000
山九	31,800	5,540.00	176,172,000
丸運	6,500	278.00	1,807,000
丸全昭和運輸	9,300	3,215.00	29,899,500
センコーグループホールディングス	63,000	827.00	52,101,000
トナミホールディングス	2,700	5,670.00	15,309,000
ニッコンホールディングス	43,500	2,506.00	109,011,000
日本石油輸送	1,400	2,825.00	3,955,000
福山通運	14,600	3,890.00	56,794,000
セイノーホールディングス	85,700	1,408.00	120,665,600
エスライン	3,400	950.00	3,230,000
神奈川中央交通	2,800	3,860.00	10,808,000
日立物流	25,100	3,215.00	80,696,500
丸和運輸機関	6,000	3,985.00	23,910,000
C & F ロジホールディングス	11,600	1,363.00	15,810,800
九州旅客鉄道	96,000	3,340.00	320,640,000
S Gホールディングス	108,100	2,913.00	314,895,300
日本郵船	96,100	1,641.00	157,700,100
商船三井	68,200	2,331.00	158,974,200
川崎汽船	34,700	1,232.00	42,750,400
N S ユナイテッド海運	6,600	2,213.00	14,605,800
飯野海運	56,300	353.00	19,873,900
共栄タンカー	1,500	1,491.00	2,236,500
乾汽船	10,200	777.00	7,925,400
日本航空	209,400	3,461.00	724,733,400
A N A ホールディングス	209,100	3,663.00	765,933,300
パスコ	2,200	806.00	1,773,200
トランコム	3,200	6,480.00	20,736,000
日新	9,900	1,787.00	17,691,300
三菱倉庫	39,600	2,914.00	115,394,400
三井倉庫ホールディングス	14,000	1,623.00	22,722,000
住友倉庫	42,100	1,403.00	59,066,300
澁澤倉庫	6,300	1,790.00	11,277,000
東陽倉庫	20,500	309.00	6,334,500
日本トランスシティ	25,100	447.00	11,219,700

ケイヒン	2,200	1,191.00	2,620,200
中央倉庫	7,000	1,008.00	7,056,000
川西倉庫	2,300	1,053.00	2,421,900
安田倉庫	9,400	890.00	8,366,000
ファイズ	2,000	754.00	1,508,000
東洋埠頭	3,500	1,388.00	4,858,000
宇徳	9,700	511.00	4,956,700
上組	70,500	2,564.00	180,762,000
サンリツ	2,700	614.00	1,657,800
キムラユニティー	3,100	1,028.00	3,186,800
キューソー流通システム	2,900	1,945.00	5,640,500
近鉄エクスプレス	21,600	1,408.00	30,412,800
東海運	6,500	248.00	1,612,000
エーアイティー	7,400	1,012.00	7,488,800
内外トランスライン	3,600	1,180.00	4,248,000
日本コンセプト	4,200	1,175.00	4,935,000
NEC ネットズエスアイ	13,100	2,786.00	36,496,600
クロスキャット	3,300	1,024.00	3,379,200
システナ	42,400	1,598.00	67,755,200
デジタルアーツ	6,400	8,780.00	56,192,000
日鉄ソリューションズ	17,800	3,310.00	58,918,000
キューブシステム	6,500	960.00	6,240,000
エイジア	2,500	1,103.00	2,757,500
コア	5,100	1,492.00	7,609,200
ソリトンシステムズ	6,900	963.00	6,644,700
ソフトクリエイティブホールディングス	5,300	1,482.00	7,854,600
T I S	39,500	5,460.00	215,670,000
ネオス	2,600	840.00	2,184,000
電算システム	4,600	4,245.00	19,527,000
グリー	82,100	496.00	40,721,600
コーエーテクモホールディングス	24,300	1,991.00	48,381,300
三菱総合研究所	5,100	3,245.00	16,549,500
電算	1,400	1,925.00	2,695,000
A G S	6,900	689.00	4,754,100
ファインデックス	10,200	877.00	8,945,400
ブレインパッド	2,300	8,080.00	18,584,000
K L a b	21,200	916.00	19,419,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,900	1,065.00	16,933,500
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	2,227.00	4,454,000
ネクソン	302,400	1,653.00	499,867,200
アイスタイル	30,600	809.00	24,755,400
エムアップ	4,200	1,952.00	8,198,400

エイチーム	8,300	1,560.00	12,948,000
テクノスジャパン	10,200	570.00	5,814,000
コロプラ	39,100	701.00	27,409,100
ブロードリーフ	59,100	577.00	34,100,700
クロス・マーケティンググループ	4,900	358.00	1,754,200
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,028.00	5,756,800
システム情報	6,200	860.00	5,332,000
メディアドゥホールディングス	3,700	3,630.00	13,431,000
じげん	16,900	709.00	11,982,100
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	881.00	1,585,800
サイバーリンクス	2,000	1,113.00	2,226,000
フィックスターズ	12,700	1,834.00	23,291,800
CARTA HOLDINGS	5,800	1,668.00	9,674,400
オブティム	5,300	2,207.00	11,697,100
セレス	4,000	1,752.00	7,008,000
ティーガイア	12,000	1,788.00	21,456,000
セック	2,000	3,300.00	6,600,000
日本アジアグループ	12,400	357.00	4,426,800
豆蔵ホールディングス	8,200	1,290.00	10,578,000
テクマトリックス	8,400	1,877.00	15,766,800
プロシップ	3,600	1,145.00	4,122,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286,100	325.00	92,982,500
GMOペイメントゲートウェイ	19,500	7,400.00	144,300,000
ザッパラス	6,600	377.00	2,488,200
システムリサーチ	1,600	2,883.00	4,612,800
インターネットイニシアティブ	19,400	2,116.00	41,050,400
さくらインターネット	14,400	506.00	7,286,400
ヴィンクス	4,100	1,413.00	5,793,300
GMOクラウド	2,700	3,205.00	8,653,500
SRAホールディングス	6,400	2,459.00	15,737,600
Minor iソリューションズ	2,400	1,594.00	3,825,600
朝日ネット	9,900	574.00	5,682,600
eBASE	7,200	1,073.00	7,725,600
アバント	4,300	2,059.00	8,853,700
アドソル日進	4,300	1,700.00	7,310,000
フリービット	7,200	1,042.00	7,502,400
コムチュア	6,700	4,470.00	29,949,000
サイバーコム	2,200	1,988.00	4,373,600
アステリア	8,100	1,109.00	8,982,900
マークラインズ	5,500	1,996.00	10,978,000
メディカル・データ・ビジョン	10,600	1,482.00	15,709,200
ショーケース	2,900	557.00	1,615,300

モバイルファクトリー	3,400	1,547.00	5,259,800
テラスカイ	2,000	1,421.00	2,842,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,889.00	10,011,700
P C Iホールディングス	2,500	2,013.00	5,032,500
パイブドHD	2,000	1,141.00	2,282,000
アイビーシー	2,300	1,362.00	3,132,600
ネオジャパン	2,400	978.00	2,347,200
P R T I M E S	1,100	2,965.00	3,261,500
ランドコンピュータ	2,000	1,195.00	2,390,000
ダブルスタンダード	1,100	4,770.00	5,247,000
オープンドア	5,900	2,951.00	17,410,900
マイネット	4,000	780.00	3,120,000
アカツキ	4,200	5,850.00	24,570,000
ベネフィットジャパン	1,100	861.00	947,100
U b i c o mホールディングス	2,300	1,523.00	3,502,900
L I N E	36,200	3,275.00	118,555,000
カナミックネットワーク	2,500	2,260.00	5,650,000
ノムラシステムコーポレーション	1,500	756.00	1,134,000
チェンジ	2,200	2,689.00	5,915,800
シンクロ・フード	5,300	581.00	3,079,300
オークネット	6,400	1,267.00	8,108,800
エイトレッド	1,400	1,703.00	2,384,200
A O I T Y O H o l d i n g s	13,100	756.00	9,903,600
マクロミル	21,100	1,222.00	25,784,200
ビーグリー	3,200	889.00	2,844,800
オロ	3,200	2,810.00	8,992,000
ソルクシーズ	5,200	796.00	4,139,200
フェイス	4,900	796.00	3,900,400
プロトコーポレーション	5,400	1,884.00	10,173,600
ハイマックス	1,500	1,788.00	2,682,000
野村総合研究所	75,400	5,270.00	397,358,000
サイバネットシステム	10,000	661.00	6,610,000
C Eホールディングス	3,600	1,016.00	3,657,600
日本システム技術	2,000	1,530.00	3,060,000
インテージホールディングス	15,300	1,023.00	15,651,900
東邦システムサイエンス	3,700	914.00	3,381,800
ソースネクスト	46,400	451.00	20,926,400
インフォコム	13,000	2,296.00	29,848,000
F I G	11,000	308.00	3,388,000
アルテリア・ネットワークス	13,300	1,168.00	15,534,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,691.00	4,734,800

フォーカスシステムズ	8,100	869.00	7,038,900
クレスコ	3,700	3,505.00	12,968,500
フジ・メディア・ホールディングス	123,100	1,515.00	186,496,500
オービック	41,100	13,290.00	546,219,000
ジャストシステム	16,900	3,425.00	57,882,500
TDCソフト	10,500	817.00	8,578,500
ヤフー	773,300	309.00	238,949,700
トレンドマイクロ	63,200	4,955.00	313,156,000
IDホールディングス	4,700	1,079.00	5,071,300
日本オラクル	24,000	7,410.00	177,840,000
アルファシステムズ	3,800	2,790.00	10,602,000
フューチャー	16,200	1,975.00	31,995,000
CAC Holdings	8,600	1,757.00	15,110,200
ソフトバンク・テクノロジー	5,100	2,352.00	11,995,200
トーセ	3,400	878.00	2,985,200
オービックビジネスコンサルタント	12,100	4,935.00	59,713,500
伊藤忠テクノソリューションズ	54,100	2,701.00	146,124,100
アイティフォー	14,600	839.00	12,249,400
東計電算	1,800	3,055.00	5,499,000
エクスネット	2,400	925.00	2,220,000
大塚商会	64,200	4,255.00	273,171,000
サイボウズ	14,000	1,181.00	16,534,000
ソフトブレーン	9,700	481.00	4,665,700
電通国際情報サービス	7,400	3,560.00	26,344,000
デジタルガレージ	23,100	3,750.00	86,625,000
EMシステムズ	9,700	1,494.00	14,491,800
ウェザーニューズ	4,100	3,245.00	13,304,500
CIJ	9,400	1,028.00	9,663,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,300	2,179.00	2,832,700
日本エンタープライズ	13,300	163.00	2,167,900
WOWOW	5,800	2,709.00	15,712,200
スカラ	8,400	833.00	6,997,200
インテリジェント ウェイブ	4,700	813.00	3,821,100
IMAGICA GROUP	10,300	554.00	5,706,200
ネットワンシステムズ	42,000	2,983.00	125,286,000
システムソフト	29,800	96.00	2,860,800
アルゴグラフィックス	10,100	2,425.00	24,492,500
マーベラス	18,300	841.00	15,390,300
エイベックス	20,500	1,378.00	28,249,000
日本ユニシス	37,100	3,630.00	134,673,000
兼松エレクトロニクス	6,500	3,190.00	20,735,000
東京放送ホールディングス	78,700	1,819.00	143,155,300

日本テレビホールディングス	108,900	1,586.00	172,715,400
朝日放送グループホールディングス	12,000	731.00	8,772,000
テレビ朝日ホールディングス	32,700	1,779.00	58,173,300
スカパーJ S A Tホールディングス	90,900	420.00	38,178,000
テレビ東京ホールディングス	9,800	2,269.00	22,236,200
日本BS放送	4,200	1,063.00	4,464,600
ビジョン	3,700	5,660.00	20,942,000
スマートバリュー	3,700	758.00	2,804,600
ワイヤレスゲート	5,600	416.00	2,329,600
コネクシオ	8,500	1,346.00	11,441,000
クロップス	2,400	625.00	1,500,000
日本電信電話	810,600	4,920.00	3,988,152,000
K D D I	1,044,400	2,791.00	2,914,920,400
ソフトバンク	1,256,600	1,418.50	1,782,487,100
光通信	14,000	22,470.00	314,580,000
N T T ドコモ	750,400	2,510.00	1,883,504,000
エムティーアイ	11,700	651.00	7,616,700
G M O インターネット	43,300	1,753.00	75,904,900
アイドママーケティングコミュニケーション	2,900	640.00	1,856,000
カドカワ	34,700	1,455.00	50,488,500
学研ホールディングス	4,000	4,590.00	18,360,000
ゼンリン	23,700	2,072.00	49,106,400
昭文社	5,900	379.00	2,236,100
インプレスホールディングス	9,800	133.00	1,303,400
アイネット	6,900	1,276.00	8,804,400
松竹	7,900	12,950.00	102,305,000
東宝	78,000	4,770.00	372,060,000
東映	5,000	14,660.00	73,300,000
エヌ・ティ・ティ・データ	315,700	1,299.00	410,094,300
ピー・シー・エー	1,600	3,495.00	5,592,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	2,039.00	4,281,900
D T S	13,300	4,475.00	59,517,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,200	3,690.00	203,688,000
シーイーシー	12,800	2,014.00	25,779,200
カブコン	50,900	2,258.00	114,932,200
アイ・エス・ビー	2,400	1,641.00	3,938,400
ジャステック	7,100	904.00	6,418,400
S C S K	31,300	5,180.00	162,134,000
日本システムウエア	4,000	2,436.00	9,744,000
アイネス	15,200	1,231.00	18,711,200
T K C	10,100	4,465.00	45,096,500
富士ソフト	17,700	4,705.00	83,278,500



N S D	19,500	3,060.00	59,670,000
コナミホールディングス	48,500	5,140.00	249,290,000
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,487.00	9,948,000
J B C Cホールディングス	9,500	1,317.00	12,511,500
ミロク情報サービス	11,800	3,310.00	39,058,000
ソフトバンクグループ	495,200	10,500.00	5,199,600,000
ハウスイ	1,000	836.00	836,000
高千穂交易	4,600	972.00	4,471,200
伊藤忠食品	2,900	4,425.00	12,832,500
エレマテック	11,200	1,069.00	11,972,800
J A L U X	3,400	2,795.00	9,503,000
あらた	8,800	3,840.00	33,792,000
トーメンデバイス	1,800	2,265.00	4,077,000
東京エレクトロン デバイス	4,300	1,828.00	7,860,400
フィールズ	10,400	534.00	5,553,600
双日	656,900	356.00	233,856,400
アルフレッサ ホールディングス	132,200	2,783.00	367,912,600
横浜冷凍	33,400	964.00	32,197,600
神栄	1,600	775.00	1,240,000
ラサ商事	6,300	774.00	4,876,200
ラクーンホールディングス	5,700	646.00	3,682,200
アルコニックス	12,600	1,360.00	17,136,000
神戸物産	18,000	5,100.00	91,800,000
あい ホールディングス	17,000	1,770.00	30,090,000
ディーブイエックス	4,700	799.00	3,755,300
ダイワボウホールディングス	10,800	4,550.00	49,140,000
マクニカ・富士エレホールディングス	33,000	1,266.00	41,778,000
ラクト・ジャパン	5,000	4,435.00	22,175,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,400	1,061.00	23,766,400
八洲電機	9,200	819.00	7,534,800
メディアスホールディングス	6,700	740.00	4,958,000
レスターホールディングス	13,000	1,533.00	19,929,000
ジュテックホールディングス	2,700	916.00	2,473,200
大光	5,000	661.00	3,305,000
O C H Iホールディングス	3,500	1,123.00	3,930,500
T O K A Iホールディングス	62,900	904.00	56,861,600
黒谷	2,700	440.00	1,188,000
C o m i n i x	2,100	866.00	1,818,600
三洋貿易	6,000	2,209.00	13,254,000
ビューティガレージ	1,900	1,277.00	2,426,300
ウイン・パートナーズ	7,700	1,071.00	8,246,700
ミタチ産業	3,600	691.00	2,487,600

シップヘルスケアホールディングス	24,800	4,835.00	119,908,000
明治電機工業	3,700	1,300.00	4,810,000
デリカフーズホールディングス	2,100	1,500.00	3,150,000
スターティアホールディングス	2,300	533.00	1,225,900
コメダホールディングス	27,500	2,092.00	57,530,000
富士興産	4,600	689.00	3,169,400
協栄産業	1,400	1,500.00	2,100,000
小野建	10,700	1,365.00	14,605,500
南陽	2,400	1,556.00	3,734,400
佐島電機	8,800	880.00	7,744,000
エコトレーディング	2,700	536.00	1,447,200
伯東	8,200	1,176.00	9,643,200
コンドーテック	9,200	907.00	8,344,400
中山福	6,800	514.00	3,495,200
ナガイレーベン	17,200	2,427.00	41,744,400
三菱食品	13,100	2,886.00	37,806,600
松田産業	8,700	1,476.00	12,841,200
第一興商	17,700	4,980.00	88,146,000
メディパルホールディングス	128,400	2,395.00	307,518,000
S P K	2,600	2,354.00	6,120,400
萩原電気ホールディングス	4,400	2,652.00	11,668,800
アズワン	8,500	9,750.00	82,875,000
スズデン	4,100	1,360.00	5,576,000
尾家産業	3,800	1,257.00	4,776,600
シモジマ	7,300	1,058.00	7,723,400
ドウシシャ	11,200	1,767.00	19,790,400
小津産業	2,600	1,727.00	4,490,200
高速	7,100	1,104.00	7,838,400
たけびし	4,200	1,237.00	5,195,400
リックス	2,700	1,475.00	3,982,500
丸文	10,500	546.00	5,733,000
ハピネット	9,900	1,361.00	13,473,900
橋本総業ホールディングス	2,400	1,420.00	3,408,000
日本ライフライン	37,300	1,823.00	67,997,900
タカショー	5,800	461.00	2,673,800
エクセル	2,900	1,690.00	4,901,000
マルカ	3,900	1,851.00	7,218,900
I D O M	40,000	276.00	11,040,000
日本エム・ディ・エム	7,000	1,425.00	9,975,000
進和	7,000	2,123.00	14,861,000
エスケイジャパン	2,900	507.00	1,470,300
ダイトロン	5,500	1,143.00	6,286,500

シークス	15,100	1,277.00	19,282,700
田中商事	4,000	583.00	2,332,000
オーハシテクニカ	6,700	1,397.00	9,359,900
白銅	3,800	1,310.00	4,978,000
伊藤忠商事	832,000	2,003.00	1,666,496,000
丸紅	1,172,900	685.50	804,022,950
高島	1,900	1,657.00	3,148,300
長瀬産業	66,900	1,585.00	106,036,500
蝶理	7,600	1,580.00	12,008,000
豊田通商	132,800	3,175.00	421,640,000
三共生興	20,200	520.00	10,504,000
兼松	47,500	1,233.00	58,567,500
ツカモトコーポレーション	2,100	989.00	2,076,900
三井物産	979,900	1,663.50	1,630,063,650
日本紙パルプ商事	6,800	3,940.00	26,792,000
日立ハイテクノロジーズ	36,200	4,635.00	167,787,000
カメイ	15,500	1,162.00	18,011,000
東都水産	1,700	2,540.00	4,318,000
OUGホールディングス	1,900	2,560.00	4,864,000
スターゼン	4,400	3,960.00	17,424,000
山善	46,500	1,008.00	46,872,000
椿本興業	2,700	2,952.00	7,970,400
住友商事	703,500	1,562.00	1,098,867,000
内田洋行	5,100	3,605.00	18,385,500
三菱商事	834,700	2,843.00	2,373,052,100
第一実業	5,400	3,350.00	18,090,000
キャノンマーケティングジャパン	34,000	2,330.00	79,220,000
西華産業	6,700	1,270.00	8,509,000
佐藤商事	10,600	877.00	9,296,200
菱洋エレクトロ	12,100	1,630.00	19,723,000
東京産業	11,800	462.00	5,451,600
ユアサ商事	12,200	3,005.00	36,661,000
神鋼商事	2,700	2,282.00	6,161,400
小林産業	7,100	324.00	2,300,400
阪和興業	20,600	2,772.00	57,103,200
正栄食品工業	8,300	3,130.00	25,979,000
カナデン	10,700	1,289.00	13,792,300
菱電商事	9,400	1,568.00	14,739,200
フルサト工業	6,600	1,464.00	9,662,400
岩谷産業	26,400	3,625.00	95,700,000
すてきナイスグループ	5,000	602.00	3,010,000
昭光通商	4,200	635.00	2,667,000

ニチモウ	1,900	1,740.00	3,306,000
極東貿易	3,700	1,552.00	5,742,400
イワキ	14,200	458.00	6,503,600
三愛石油	32,000	943.00	30,176,000
稲畑産業	28,600	1,375.00	39,325,000
G S Iクレオス	3,200	1,141.00	3,651,200
明和産業	11,000	349.00	3,839,000
クワザワ	4,200	510.00	2,142,000
ワキタ	25,400	1,059.00	26,898,600
東邦ホールディングス	35,200	2,500.00	88,000,000
サンゲツ	35,400	2,097.00	74,233,800
ミツウロコグループホールディングス	15,700	769.00	12,073,300
シナネンホールディングス	4,900	1,869.00	9,158,100
伊藤忠エネクス	26,300	849.00	22,328,700
サンリオ	36,700	2,524.00	92,630,800
サンワテクノス	7,200	798.00	5,745,600
リョーサン	13,100	2,645.00	34,649,500
新光商事	11,200	1,858.00	20,809,600
トーヨー	5,400	2,205.00	11,907,000
三信電気	8,200	1,808.00	14,825,600
東陽テクニカ	13,700	900.00	12,330,000
モスフードサービス	15,600	2,416.00	37,689,600
加賀電子	11,800	1,636.00	19,304,800
ソーダニッカ	12,200	523.00	6,380,600
立花エレテック	8,800	1,530.00	13,464,000
フォーバル	5,200	927.00	4,820,400
P A L T A C	21,400	5,690.00	121,766,000
三谷産業	13,900	284.00	3,947,600
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,700	4,190.00	11,313,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,220.00	1,220,000
国際紙パルプ商事	27,700	269.00	7,451,300
ヤマタネ	6,000	1,370.00	8,220,000
丸紅建材リース	1,200	1,681.00	2,017,200
日鉄物産	8,500	4,195.00	35,657,500
泉州電業	4,000	2,378.00	9,512,000
トラスコ中山	24,800	2,408.00	59,718,400
オートバックスセブン	47,300	1,716.00	81,166,800
モリト	8,600	801.00	6,888,600
加藤産業	18,600	3,535.00	65,751,000
北恵	2,300	785.00	1,805,500
イノテック	7,100	820.00	5,822,000
イエローハット	22,500	1,389.00	31,252,500

J Kホールディングス	10,700	560.00	5,992,000	
日伝	9,900	1,651.00	16,344,900	
北沢産業	9,000	283.00	2,547,000	
杉本商事	6,400	2,072.00	13,260,800	
因幡電機産業	16,900	4,380.00	74,022,000	
東テク	3,900	2,060.00	8,034,000	
ミスミグループ本社	149,000	2,546.00	379,354,000	
アルテック	8,800	203.00	1,786,400	
タキヒヨー	3,600	1,761.00	6,339,600	
蔵王産業	2,000	1,307.00	2,614,000	
スズケン	54,300	6,790.00	368,697,000	
ジェコス	8,200	949.00	7,781,800	
ルネサスイーストン	10,900	442.00	4,817,800	
ローソン	30,100	5,160.00	155,316,000	
サンエー	9,000	4,375.00	39,375,000	
カワチ薬品	9,300	1,823.00	16,953,900	
エービーシー・マート	18,600	6,810.00	126,666,000	
ハードオフコーポレーション	4,900	704.00	3,449,600	
アスクル	12,500	2,818.00	35,225,000	
ゲオホールディングス	18,200	1,390.00	25,298,000	
アダストリア	16,500	2,921.00	48,196,500	
ジーフット	7,300	642.00	4,686,600	
くら寿司	7,000	4,375.00	30,625,000	
キャンドウ	5,700	1,657.00	9,444,900	
パルグループホールディングス	6,100	3,350.00	20,435,000	
エディオン	50,500	973.00	49,136,500	
サーラコーポレーション	24,400	569.00	13,883,600	
ワッツ	5,400	688.00	3,715,200	
ハローズ	4,500	2,244.00	10,098,000	
フジオフードシステム	5,000	2,816.00	14,080,000	
あみやき亭	2,600	3,375.00	8,775,000	
ひらまつ	23,900	344.00	8,221,600	
大黒天物産	2,900	3,505.00	10,164,500	
ハニーズホールディングス	10,600	1,012.00	10,727,200	
ファーマライズホールディングス	3,000	530.00	1,590,000	
アルペン	9,200	1,659.00	15,262,800	
ハブ	3,900	1,293.00	5,042,700	
クオールホールディングス	17,600	1,496.00	26,329,600	
ジンズ	6,300	6,570.00	41,391,000	
ビックカメラ	70,700	1,155.00	81,658,500	
D C Mホールディングス	64,300	1,102.00	70,858,600	
ペッパーフードサービス	9,500	1,903.00	18,078,500	

MonotaRO	75,200	2,260.00	169,952,000
東京一番フーズ	3,200	600.00	1,920,000
DDホールディングス	2,600	1,994.00	5,184,400
きちりホールディングス	3,300	747.00	2,465,100
アークランドサービスホールディングス	8,800	1,951.00	17,168,800
J．フロント リテイリング	152,300	1,179.00	179,561,700
ドトール・日レスホールディングス	20,900	2,100.00	43,890,000
マツモトキヨシホールディングス	49,200	3,200.00	157,440,000
ブロンコピリー	6,300	2,240.00	14,112,000
ZOZO	128,600	1,850.00	237,910,000
トレジャー・ファクトリー	3,600	709.00	2,552,400
物語コーポレーション	2,900	8,800.00	25,520,000
ココカラファイン	13,400	4,285.00	57,419,000
三越伊勢丹ホールディングス	222,700	908.00	202,211,600
Hamee	3,800	673.00	2,557,400
ウエルシアホールディングス	31,500	3,885.00	122,377,500
クリエイティブSDホールディングス	17,600	2,352.00	41,395,200
丸善CHIホールディングス	13,800	378.00	5,216,400
ティーライフ	1,700	861.00	1,463,700
エー・ピーカンパニー	2,500	431.00	1,077,500
チムニー	3,700	2,517.00	9,312,900
シュッピン	8,200	855.00	7,011,000
ネクステージ	18,600	1,167.00	21,706,200
ジョイフル本田	34,900	1,253.00	43,729,700
鳥貴族	4,000	1,961.00	7,844,000
キリン堂ホールディングス	4,800	1,654.00	7,939,200
ホットランド	6,300	1,592.00	10,029,600
すかいらーくホールディングス	110,900	1,992.00	220,912,800
SFPホールディングス	5,100	1,836.00	9,363,600
綿半ホールディングス	4,500	2,425.00	10,912,500
ヨシックス	2,000	2,540.00	5,080,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,700	960.00	33,312,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,000	711.00	3,555,000
BEE NOS	4,200	1,921.00	8,068,200
あさひ	9,900	1,348.00	13,345,200
日本調剤	4,200	3,605.00	15,141,000
コスモス薬品	5,300	17,870.00	94,711,000
トーエル	5,900	699.00	4,124,100
オンリー	2,200	798.00	1,755,600
セブン&アイ・ホールディングス	498,600	3,760.00	1,874,736,000
薬王堂	5,200	2,216.00	11,523,200

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,100	1,446.00	46,416,600
ツルハホールディングス	25,900	8,800.00	227,920,000
サンマルクホールディングス	9,400	2,410.00	22,654,000
フェリシモ	2,800	904.00	2,531,200
トリドールホールディングス	14,700	1,883.00	27,680,100
T O K Y O B A S E	10,800	833.00	8,996,400
ウイルプラスホールディングス	2,000	769.00	1,538,000
ジャパンミート	6,100	1,731.00	10,559,100
サツドラホールディングス	1,800	1,870.00	3,366,000
デファクトスタンダード	900	351.00	315,900
アレンザホールディングス	6,600	864.00	5,702,400
パロックジャパンリミテッド	9,800	927.00	9,084,600
クスリのアオキホールディングス	11,800	7,130.00	84,134,000
力の源ホールディングス	4,600	711.00	3,270,600
スシローグローバルホールディングス	13,100	7,740.00	101,394,000
L I X I L ビバ	10,200	1,257.00	12,821,400
メディカルシステムネットワーク	12,800	501.00	6,412,800
はるやまホールディングス	5,700	818.00	4,662,600
ノジマ	21,200	1,906.00	40,407,200
カッパ・クリエイト	16,700	1,397.00	23,329,900
ライトオン	9,000	707.00	6,363,000
良品計画	16,900	19,780.00	334,282,000
三城ホールディングス	15,000	333.00	4,995,000
アドヴァン	18,300	1,067.00	19,526,100
アルビス	4,600	2,416.00	11,113,600
コナカ	14,200	401.00	5,694,200
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,574.00	2,361,000
G - 7ホールディングス	3,500	3,015.00	10,552,500
イオン北海道	12,100	717.00	8,675,700
コジマ	20,600	492.00	10,135,200
ヒマラヤ	4,300	855.00	3,676,500
コーナン商事	15,700	2,306.00	36,204,200
エコス	4,500	1,427.00	6,421,500
ワタミ	15,700	1,416.00	22,231,200
マルシェ	3,300	776.00	2,560,800
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	71,200	6,880.00	489,856,000
西松屋チェーン	26,200	890.00	23,318,000
ゼンショーホールディングス	56,200	2,319.00	130,327,800
幸楽苑ホールディングス	7,600	3,100.00	23,560,000
ハークスレイ	2,600	1,021.00	2,654,600
サイゼリヤ	19,700	2,472.00	48,698,400

V Tホールディングス	54,000	451.00	24,354,000
魚力	3,400	1,484.00	5,045,600
フジ・コーポレーション	3,200	2,173.00	6,953,600
ユナイテッドアローズ	13,600	3,710.00	50,456,000
ハイデイ日高	17,200	2,042.00	35,122,400
京都きもの友禅	7,900	354.00	2,796,600
コロワイド	39,600	2,121.00	83,991,600
ピーシーデポコーポレーション	16,000	403.00	6,448,000
鳧番屋	8,400	4,625.00	38,850,000
P L A N T	3,200	760.00	2,432,000
スギホールディングス	26,100	5,170.00	134,937,000
スクロール	18,600	349.00	6,491,400
ヨンドシーホールディングス	13,300	2,436.00	32,398,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	133,100	2,725.00	362,697,500
木曽路	14,600	2,551.00	37,244,600
S R Sホールディングス	14,100	1,011.00	14,255,100
タカキュー	9,800	175.00	1,715,000
ケーヨー	22,200	497.00	11,033,400
上新電機	14,100	2,249.00	31,710,900
日本瓦斯	19,400	2,585.00	50,149,000
ロイヤルホールディングス	20,800	2,761.00	57,428,800
いなげや	13,400	1,371.00	18,371,400
島忠	25,200	2,513.00	63,327,600
チヨダ	12,600	1,661.00	20,928,600
ライフコーポレーション	9,100	2,126.00	19,346,600
リンガーハット	14,700	2,382.00	35,015,400
M r M a x H D	16,500	455.00	7,507,500
テンアライド	10,900	412.00	4,490,800
A O K Iホールディングス	23,900	1,031.00	24,640,900
オークワ	17,100	1,061.00	18,143,100
コメリ	18,400	2,160.00	39,744,000
青山商事	20,800	2,123.00	44,158,400
しまむら	13,900	8,290.00	115,231,000
はせがわ	6,600	393.00	2,593,800
高島屋	93,400	1,191.00	111,239,400
松屋	24,100	952.00	22,943,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,200	1,191.00	72,889,200
近鉄百貨店	4,600	3,295.00	15,157,000
パルコ	11,500	1,067.00	12,270,500
丸井グループ	100,700	2,253.00	226,877,100
アクシアル リテイリング	9,900	4,035.00	39,946,500
イオン	457,800	1,944.50	890,192,100



イズミ	24,200	4,670.00	113,014,000
平和堂	24,200	1,920.00	46,464,000
フジ	14,400	1,787.00	25,732,800
ヤオコー	13,500	5,340.00	72,090,000
ゼビオホールディングス	14,500	1,246.00	18,067,000
ケーズホールディングス	123,700	1,075.00	132,977,500
Olympicグループ	7,200	675.00	4,860,000
日産東京販売ホールディングス	17,900	281.00	5,029,900
Genky DrugStores	5,900	2,700.00	15,930,000
総合メディカルホールディングス	10,400	1,823.00	18,959,200
ブックオフグループホールディングス	6,200	858.00	5,319,600
アインホールディングス	16,000	8,400.00	134,400,000
元気寿司	3,400	3,695.00	12,563,000
ヤマダ電機	362,600	506.00	183,475,600
アークランドサカモト	20,300	1,371.00	27,831,300
ニトリホールディングス	51,500	13,000.00	669,500,000
グルメ杵屋	8,600	1,153.00	9,915,800
愛眼	9,400	251.00	2,359,400
ケーユーホールディングス	6,300	828.00	5,216,400
吉野家ホールディングス	41,600	1,815.00	75,504,000
松屋フーズホールディングス	5,800	3,390.00	19,662,000
サガミホールディングス	16,000	1,329.00	21,264,000
関西スーパーマーケット	9,100	1,086.00	9,882,600
王将フードサービス	8,700	6,920.00	60,204,000
プレナス	13,400	1,870.00	25,058,000
ミニストップ	8,900	1,681.00	14,960,900
アークス	22,400	2,145.00	48,048,000
パローホールディングス	25,700	2,292.00	58,904,400
ベルク	5,900	5,180.00	30,562,000
大庄	6,400	1,567.00	10,028,800
ファーストリテイリング	15,900	65,180.00	1,036,362,000
サンドラッグ	44,800	2,770.00	124,096,000
サックスパーホールディングス	10,200	1,011.00	10,312,200
ヤマザワ	2,500	1,619.00	4,047,500
やまや	2,100	2,011.00	4,223,100
ベルーナ	29,200	767.00	22,396,400
島根銀行	3,800	696.00	2,644,800
じもとホールディングス	80,100	89.00	7,128,900
めぶきフィナンシャルグループ	622,000	271.00	168,562,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,600	1,642.00	27,257,200
九州フィナンシャルグループ	197,400	431.00	85,079,400
ゆうちょ銀行	338,200	1,118.00	378,107,600

富山第一銀行	30,800	319.00	9,825,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	749,200	420.00	314,664,000
西日本フィナンシャルホールディングス	76,000	795.00	60,420,000
関西みらいフィナンシャルグループ	57,100	713.00	40,712,300
三十三フィナンシャルグループ	10,900	1,432.00	15,608,800
第四北越フィナンシャルグループ	21,000	2,823.00	59,283,000
新生銀行	87,400	1,559.00	136,256,600
あおぞら銀行	66,500	2,627.00	174,695,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,199,500	505.50	4,144,847,250
りそなホールディングス	1,307,100	465.30	608,193,630
三井住友トラスト・ホールディングス	234,100	3,975.00	930,547,500
三井住友フィナンシャルグループ	839,500	3,819.00	3,206,050,500
千葉銀行	411,300	526.00	216,343,800
群馬銀行	240,400	383.00	92,073,200
武蔵野銀行	18,100	2,037.00	36,869,700
千葉興業銀行	36,400	241.00	8,772,400
筑波銀行	49,300	170.00	8,381,000
七十七銀行	37,900	1,645.00	62,345,500
青森銀行	9,500	2,823.00	26,818,500
秋田銀行	8,000	2,171.00	17,368,000
山形銀行	13,900	1,640.00	22,796,000
岩手銀行	8,600	2,887.00	24,828,200
東邦銀行	106,500	253.00	26,944,500
東北銀行	6,100	1,052.00	6,417,200
みちのく銀行	7,600	1,657.00	12,593,200
ふくおかフィナンシャルグループ	105,300	1,915.00	201,649,500
静岡銀行	300,800	875.00	263,200,000
十六銀行	16,400	2,302.00	37,752,800
八十二銀行	289,300	451.00	130,474,300
山梨中央銀行	15,000	1,228.00	18,420,000
大垣共立銀行	25,400	2,444.00	62,077,600
福井銀行	10,700	1,543.00	16,510,100
北國銀行	12,500	3,030.00	37,875,000
清水銀行	5,400	1,735.00	9,369,000
富山銀行	2,600	2,487.00	6,466,200
滋賀銀行	24,200	2,608.00	63,113,600
南都銀行	19,000	2,129.00	40,451,000
百五銀行	109,700	325.00	35,652,500
京都銀行	42,900	4,230.00	181,467,000
紀陽銀行	42,700	1,492.00	63,708,400
ほくほくフィナンシャルグループ	80,000	1,181.00	94,480,000
広島銀行	177,300	561.00	99,465,300

山陰合同銀行	71,800	713.00	51,193,400
中国銀行	103,300	1,036.00	107,018,800
鳥取銀行	4,700	1,363.00	6,406,100
伊予銀行	159,300	563.00	89,685,900
百十四銀行	13,000	2,213.00	28,769,000
四国銀行	17,800	938.00	16,696,400
阿波銀行	18,500	2,703.00	50,005,500
大分銀行	7,600	3,245.00	24,662,000
宮崎銀行	8,300	2,587.00	21,472,100
佐賀銀行	7,700	1,637.00	12,604,900
沖縄銀行	11,100	3,460.00	38,406,000
琉球銀行	28,200	1,173.00	33,078,600
セブン銀行	405,300	283.00	114,699,900
みずほフィナンシャルグループ	16,185,500	155.30	2,513,608,150
高知銀行	4,300	712.00	3,061,600
山口フィナンシャルグループ	149,700	820.00	122,754,000
長野銀行	4,500	1,653.00	7,438,500
名古屋銀行	9,900	3,550.00	35,145,000
北洋銀行	182,900	255.00	46,639,500
愛知銀行	4,500	3,705.00	16,672,500
中京銀行	5,300	2,216.00	11,744,800
大光銀行	4,600	1,569.00	7,217,400
愛媛銀行	17,400	1,080.00	18,792,000
トマト銀行	5,500	1,010.00	5,555,000
京葉銀行	54,000	623.00	33,642,000
栃木銀行	66,300	177.00	11,735,100
北日本銀行	4,200	1,667.00	7,001,400
東和銀行	20,800	728.00	15,142,400
福島銀行	7,300	274.00	2,000,200
大東銀行	5,700	578.00	3,294,600
トモニホールディングス	94,400	346.00	32,662,400
フィデアホールディングス	115,100	119.00	13,696,900
池田泉州ホールディングス	130,400	218.00	28,427,200
F P G	37,500	893.00	33,487,500
マーキュリアインベストメント	4,700	671.00	3,153,700
S B Iホールディングス	142,000	2,587.00	367,354,000
ジャフコ	19,600	3,875.00	75,950,000
大和証券グループ本社	956,000	478.60	457,541,600
野村ホールディングス	2,096,200	350.40	734,508,480
岡三証券グループ	101,800	385.00	39,193,000
丸三証券	35,600	581.00	20,683,600
東洋証券	43,300	122.00	5,282,600

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142,400	341.00	48,558,400
光世証券	3,000	664.00	1,992,000
水戸証券	34,900	203.00	7,084,700
いちよし証券	25,000	777.00	19,425,000
松井証券	58,400	1,040.00	60,736,000
だいこう証券ビジネス	5,100	418.00	2,131,800
マネックスグループ	110,200	347.00	38,239,400
カブドットコム証券	86,900	558.00	48,490,200
極東証券	16,100	941.00	15,150,100
岩井コスモホールディングス	12,300	1,150.00	14,145,000
藍澤証券	21,600	698.00	15,076,800
マネーパートナーズグループ	14,300	291.00	4,161,300
スパークス・グループ	47,400	245.00	11,613,000
かんぽ生命保険	45,000	2,032.00	91,440,000
S O M P Oホールディングス	210,000	4,146.00	870,660,000
アニコム ホールディングス	9,800	3,540.00	34,692,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	311,400	3,433.00	1,069,036,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	97,900	2,410.00	235,939,000
第一生命ホールディングス	673,900	1,596.50	1,075,881,350
東京海上ホールディングス	425,900	5,553.00	2,365,022,700
T & Dホールディングス	368,400	1,149.50	423,475,800
アドバンスクリエイト	2,800	1,746.00	4,888,800
全国保証	33,600	4,105.00	137,928,000
ジェイリース	3,300	333.00	1,098,900
イントラスト	3,300	492.00	1,623,600
日本モーゲージサービス	2,100	1,135.00	2,383,500
C a s a	5,400	1,067.00	5,761,800
アルヒ	10,800	1,890.00	20,412,000
プレミアグループ	6,800	2,017.00	13,715,600
クレディセゾン	83,400	1,180.00	98,412,000
芙蓉総合リース	13,600	5,340.00	72,624,000
興銀リース	22,400	2,547.00	57,052,800
東京センチュリー	24,000	4,500.00	108,000,000
日本証券金融	52,500	572.00	30,030,000
アイフル	181,700	209.00	37,975,300
リコーリース	9,400	3,355.00	31,537,000
イオンフィナンシャルサービス	76,100	1,716.00	130,587,600
アコム	239,400	369.00	88,338,600
ジャックス	13,200	1,905.00	25,146,000
オリエントコーポレーション	322,200	114.00	36,730,800
日立キャピタル	28,100	2,328.00	65,416,800
アプラスフィナンシャル	56,900	74.00	4,210,600

オリックス	794,700	1,545.50	1,228,208,850
三菱UFJリース	268,700	552.00	148,322,400
九州リースサービス	5,800	631.00	3,659,800
日本取引所グループ	321,800	1,684.00	541,911,200
イー・ギャランティ	11,200	1,378.00	15,433,600
アサックス	4,900	549.00	2,690,100
NECキャピタルソリューション	4,800	1,780.00	8,544,000
いちご	155,200	332.00	51,526,400
日本駐車場開発	138,000	175.00	24,150,000
ヒューリック	250,000	872.00	218,000,000
三栄建築設計	5,600	1,471.00	8,237,600
スター・マイカ	6,400	1,264.00	8,089,600
野村不動産ホールディングス	79,900	2,272.00	181,532,800
三重交通グループホールディングス	26,200	600.00	15,720,000
サムティ	17,400	1,428.00	24,847,200
ディア・ライフ	18,300	420.00	7,686,000
コーセーアールイー	5,200	747.00	3,884,400
エー・ディー・ワークス	115,000	34.00	3,910,000
日本商業開発	8,300	1,480.00	12,284,000
プレサンスコーポレーション	19,800	1,395.00	27,621,000
ユニゾホールディングス	18,700	1,810.00	33,847,000
日本管理センター	9,000	1,110.00	9,990,000
サンセイランディック	4,900	723.00	3,542,700
エストラスト	1,200	702.00	842,400
フージャースホールディングス	21,200	599.00	12,698,800
オープンハウス	17,500	4,615.00	80,762,500
東急不動産ホールディングス	322,400	624.00	201,177,600
飯田グループホールディングス	100,100	1,757.00	175,875,700
イーランド	3,600	669.00	2,408,400
ムゲンエステート	10,500	575.00	6,037,500
ファーストブラザーズ	4,400	1,065.00	4,686,000
ハウズドゥ	6,600	1,399.00	9,233,400
シーアールイー	4,200	991.00	4,162,200
ケイアイスター不動産	4,100	1,517.00	6,219,700
グッドコムアセット	3,600	1,420.00	5,112,000
ジェイ・エス・ビー	900	3,495.00	3,145,500
テンポイノベーション	2,200	1,519.00	3,341,800
パーク24	70,200	2,157.00	151,421,400
パラカ	3,700	1,978.00	7,318,600
三井不動産	632,400	2,710.00	1,713,804,000
三菱地所	835,100	2,036.00	1,700,263,600
平和不動産	23,100	2,134.00	49,295,400

東京建物	131,200	1,196.00	156,915,200
ダイビル	36,400	960.00	34,944,000
京阪神ビルディング	22,400	1,009.00	22,601,600
住友不動産	268,100	4,096.00	1,098,137,600
テオオーシー	29,200	655.00	19,126,000
東京楽天地	2,000	5,100.00	10,200,000
スターツコーポレーション	16,700	2,587.00	43,202,900
フジ住宅	16,800	768.00	12,902,400
空港施設	16,400	520.00	8,528,000
明和地所	8,900	532.00	4,734,800
ゴールドクレスト	10,100	1,759.00	17,765,900
日本エスリード	5,500	1,535.00	8,442,500
日神不動産	20,400	436.00	8,894,400
日本エスコン	23,400	693.00	16,216,200
タカラレーベン	57,800	374.00	21,617,200
サンヨーハウジング名古屋	8,100	881.00	7,136,100
イオンモール	60,500	1,619.00	97,949,500
毎日コムネット	4,200	737.00	3,095,400
ファースト住建	5,500	1,138.00	6,259,000
カチタス	13,600	4,005.00	54,468,000
トーセイ	17,800	911.00	16,215,800
穴吹興産	1,700	3,015.00	5,125,500
サンフロンティア不動産	17,700	1,010.00	17,877,000
エフ・ジェー・ネクスト	11,700	980.00	11,466,000
インテリックス	5,100	690.00	3,519,000
ランドビジネス	5,000	779.00	3,895,000
グランディハウス	13,200	450.00	5,940,000
日本空港ビルデング	38,300	4,150.00	158,945,000
日本工営	7,800	2,407.00	18,774,600
L I F U L L	40,500	599.00	24,259,500
ジェイエイシーリクルートメント	9,300	2,681.00	24,933,300
日本M&Aセンター	86,100	2,968.00	255,544,800
メンバーズ	3,900	2,080.00	8,112,000
中広	1,500	551.00	826,500
アイティメディア	2,600	503.00	1,307,800
タケエイ	12,100	798.00	9,655,800
E・Jホールディングス	1,600	1,110.00	1,776,000
トラスト・テック	6,400	3,155.00	20,192,000
コシダカホールディングス	27,900	1,479.00	41,264,100
アルトナー	3,000	788.00	2,364,000
パソナグループ	14,200	1,705.00	24,211,000
C D S	3,000	1,322.00	3,966,000

リンクアンドモチベーション	21,400	620.00	13,268,000
G C A	11,800	727.00	8,578,600
エス・エム・エス	42,500	2,632.00	111,860,000
サニーサイドアップ	1,300	1,969.00	2,559,700
パーソルホールディングス	115,400	2,340.00	270,036,000
リニカル	6,600	1,198.00	7,906,800
クックパッド	36,500	306.00	11,169,000
エスクリ	3,300	793.00	2,616,900
アイ・ケイ・ケイ	5,800	680.00	3,944,000
学情	4,800	1,097.00	5,265,600
スタジオアリス	5,900	2,065.00	12,183,500
シミックホールディングス	6,500	2,013.00	13,084,500
N J S	2,600	1,621.00	4,214,600
総合警備保障	45,900	5,330.00	244,647,000
カカクコム	86,500	2,279.00	197,133,500
アイロムグループ	4,400	1,605.00	7,062,000
セントケア・ホールディング	8,700	478.00	4,158,600
サイネックス	2,200	650.00	1,430,000
ルネサンス	6,500	1,991.00	12,941,500
ディップ	18,700	1,629.00	30,462,300
オプトホールディング	7,200	1,400.00	10,080,000
ツクイ	27,500	543.00	14,932,500
キャリアデザインセンター	3,000	1,537.00	4,611,000
ベネフィット・ワン	32,000	2,165.00	69,280,000
エムスリー	243,000	2,138.00	519,534,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	622.00	4,727,200
プラス	1,500	623.00	934,500
アウトソーシング	61,000	1,143.00	69,723,000
ウェルネット	11,100	1,005.00	11,155,500
ワールドホールディングス	3,300	1,635.00	5,395,500
ディー・エヌ・エー	62,300	2,168.00	135,066,400
博報堂D Yホールディングス	160,500	1,732.00	277,986,000
ぐるなび	16,600	531.00	8,814,600
タカミヤ	12,100	744.00	9,002,400
ジャパンベストレスキューシステム	7,800	1,261.00	9,835,800
ファンコミュニケーションズ	31,900	520.00	16,588,000
ライク	4,700	1,267.00	5,954,900
ビジネス・ブレークスルー	5,200	344.00	1,788,800
W D Bホールディングス	5,300	2,726.00	14,447,800
ティア	6,900	651.00	4,491,900
C D G	1,200	1,248.00	1,497,600
バリューコマース	7,800	2,607.00	20,334,600

インフォマート	63,300	1,705.00	107,926,500
J Pホールディングス	33,300	286.00	9,523,800
エコナックホールディングス	21,900	124.00	2,715,600
E P Sホールディングス	17,400	1,802.00	31,354,800
レグス	3,000	1,358.00	4,074,000
プレステージ・インターナショナル	21,700	1,553.00	33,700,100
アミューズ	7,000	2,591.00	18,137,000
ドリームインキュベータ	3,600	1,707.00	6,145,200
クイック	7,200	1,758.00	12,657,600
T A C	7,000	197.00	1,379,000
ケネディクス	101,600	530.00	53,848,000
電通	140,600	3,640.00	511,784,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,089.00	4,900,500
ぴあ	3,300	4,915.00	16,219,500
イオンファンタジー	3,800	2,309.00	8,774,200
シーティーエス	13,200	678.00	8,949,600
ネクシィーズグループ	4,100	2,406.00	9,864,600
みらかホールディングス	32,300	2,584.00	83,463,200
アルプス技研	10,200	1,858.00	18,951,600
ダイオーズ	2,800	1,372.00	3,841,600
日本空調サービス	13,200	676.00	8,923,200
オリエンタルランド	136,400	13,430.00	1,831,852,000
ダスキン	29,700	2,876.00	85,417,200
明光ネットワークジャパン	13,700	963.00	13,193,100
ファルコホールディングス	6,400	1,633.00	10,451,200
ラウンドワン	35,900	1,641.00	58,911,900
リゾートトラスト	48,900	1,737.00	84,939,300
ビー・エム・エル	14,900	3,195.00	47,605,500
ワタベウェディング	2,100	586.00	1,230,600
りらいあコミュニケーションズ	21,000	1,222.00	25,662,000
リソー教育	58,900	441.00	25,974,900
早稲田アカデミー	3,500	779.00	2,726,500
ユー・エス・エス	141,000	2,041.00	287,781,000
東京個別指導学院	4,200	940.00	3,948,000
サイバーエージェント	66,400	4,270.00	283,528,000
楽天	538,000	1,150.00	618,700,000
クリーク・アンド・リバー社	6,900	1,249.00	8,618,100
テー・オー・ダブリュー	10,200	779.00	7,945,800
山田コンサルティンググループ	5,700	2,034.00	11,593,800
セントラルスポーツ	4,300	3,295.00	14,168,500
フルキャストホールディングス	11,600	2,171.00	25,183,600
エン・ジャパン	16,800	3,875.00	65,100,000



リゾルホールディングス	1,300	3,910.00	5,083,000
テクノプロ・ホールディングス	23,200	6,040.00	140,128,000
アトラ	2,800	288.00	806,400
インターワークス	2,400	603.00	1,447,200
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	2,697.00	12,675,900
K e e P e r 技研	4,300	1,391.00	5,981,300
ファーストロジック	2,900	550.00	1,595,000
三機サービス	2,500	1,213.00	3,032,500
G u n o s y	8,100	1,924.00	15,584,400
デザインワン・ジャパン	2,700	295.00	796,500
イー・ガーディアン	5,900	1,851.00	10,920,900
リブセンス	6,900	246.00	1,697,400
ジャパンマテリアル	31,700	1,333.00	42,256,100
ベクトル	14,200	1,214.00	17,238,800
ウチヤマホールディングス	5,900	535.00	3,156,500
チャーム・ケア・コーポレーション	3,800	1,719.00	6,532,200
ライクキッズネクスト	2,900	929.00	2,694,100
キャリアリンク	4,600	441.00	2,028,600
I B J	7,900	926.00	7,315,400
アサンテ	4,700	2,136.00	10,039,200
N・フィールド	7,600	756.00	5,745,600
バリューHR	2,500	3,345.00	8,362,500
M&Aキャピタルパートナーズ	4,100	6,480.00	26,568,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,900	1,207.00	5,914,300
E R Iホールディングス	3,400	914.00	3,107,600
アビスト	1,800	2,521.00	4,537,800
シグマクシス	5,600	1,371.00	7,677,600
ウィルグループ	7,700	892.00	6,868,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,300	274.00	4,466,200
日本ビューホテル	3,800	1,141.00	4,335,800
リクルートホールディングス	826,700	3,613.00	2,986,867,100
エラン	8,000	1,791.00	14,328,000
土木管理総合試験所	5,300	430.00	2,279,000
日本郵政	946,000	1,214.00	1,148,444,000
ベルシステム24ホールディングス	19,400	1,609.00	31,214,600
鎌倉新書	8,500	1,670.00	14,195,000
ソネット・メディア・ネットワークス	1,600	835.00	1,336,000
一蔵	1,500	605.00	907,500
L I T A L I C O	2,700	1,674.00	4,519,800
グローバルキッズCOMPANY	1,900	918.00	1,744,200
エボラブルアジア	5,000	2,177.00	10,885,000
アトラエ	3,000	3,140.00	9,420,000

ストライク	4,400	1,945.00	8,558,000
ソラスト	28,400	993.00	28,201,200
セラク	3,800	615.00	2,337,000
インソース	4,500	2,907.00	13,081,500
ベイクレント・コンサルティング	8,200	3,760.00	30,832,000
Orchestra Holdings	2,100	1,255.00	2,635,500
アイモバイル	3,800	812.00	3,085,600
キャリアインデックス	4,100	833.00	3,415,300
MS - Japan	4,800	1,586.00	7,612,800
船場	2,000	919.00	1,838,000
グレイステクノロジー	4,200	2,500.00	10,500,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,100	2,170.00	19,747,000
フルテック	1,700	1,178.00	2,002,600
グリーンズ	4,400	1,564.00	6,881,600
ツナググループ・ホールディングス	1,600	554.00	886,400
ソウルドアウト	1,200	2,383.00	2,859,600
MS & Consulting	2,000	1,008.00	2,016,000
日総工産	7,700	1,513.00	11,650,100
キュービーネットホールディングス	7,000	2,322.00	16,254,000
RPAホールディングス	2,300	6,130.00	14,099,000
スプリックス	3,900	1,812.00	7,066,800
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	714.00	3,355,800
リログループ	63,100	3,010.00	189,931,000
東祥	7,200	3,085.00	22,212,000
エイチ・アイ・エス	20,600	3,210.00	66,126,000
ラックランド	2,400	2,284.00	5,481,600
共立メンテナンス	17,700	5,710.00	101,067,000
イチネンホールディングス	12,100	1,131.00	13,685,100
建設技術研究所	8,100	1,480.00	11,988,000
スペース	7,600	1,182.00	8,983,200
長大	4,800	715.00	3,432,000
燦ホールディングス	2,600	2,289.00	5,951,400
スバル興業	800	5,360.00	4,288,000
東京テアトル	4,600	1,322.00	6,081,200
タナベ経営	2,300	1,201.00	2,762,300
ナガワ	3,200	5,720.00	18,304,000
よみうりランド	2,500	5,300.00	13,250,000
東京都競馬	7,600	3,375.00	25,650,000
カナモト	17,300	2,466.00	42,661,800
東京ドーム	43,300	1,116.00	48,322,800
西尾レントオール	11,800	2,845.00	33,571,000
トランス・コスモス	12,900	2,417.00	31,179,300

乃村工藝社	54,000	1,458.00	78,732,000	
藤田観光	4,600	2,620.00	12,052,000	
KNT-CTホールディングス	6,100	1,468.00	8,954,800	
日本管財	12,400	1,862.00	23,088,800	
トーカイ	11,200	2,533.00	28,369,600	
白洋舎	1,400	2,915.00	4,081,000	
セコム	122,500	9,633.00	1,180,042,500	
セントラル警備保障	5,600	5,800.00	32,480,000	
丹青社	21,900	1,142.00	25,009,800	
メイテック	14,300	5,270.00	75,361,000	
応用地質	12,500	1,068.00	13,350,000	
船井総研ホールディングス	23,900	2,693.00	64,362,700	
進学会ホールディングス	5,500	602.00	3,311,000	
オオバ	9,200	664.00	6,108,800	
いであ	2,400	1,135.00	2,724,000	
学究社	3,900	1,302.00	5,077,800	
ベネッセホールディングス	42,300	2,570.00	108,711,000	
イオンディライト	14,300	3,210.00	45,903,000	
ナック	7,400	928.00	6,867,200	
ニチイ学館	16,500	1,450.00	23,925,000	
ダイセキ	19,400	2,731.00	52,981,400	
ステップ	4,300	1,459.00	6,273,700	
合 計	140,334,200		266,318,229,660	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2019年5月30日から2019年11月29日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DC日本株式インデックス・オープンS】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2019年 5月29日現在)	第13期中間計算期間 (2019年11月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	24,070,653	33,135,622
親投資信託受益証券	8,970,638,831	10,438,617,174
流動資産合計	8,994,709,484	10,471,752,796
資産合計	8,994,709,484	10,471,752,796
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,595,970	17,257,018
未払受託者報酬	1,421,032	1,555,619
未払委託者報酬	8,052,450	8,815,114
未払利息	38	44
その他未払費用	471,093	259,208
流動負債合計	19,540,583	27,887,003
負債合計	19,540,583	27,887,003
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,317,866,422	7,618,714,706
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,657,302,479	2,825,151,087
(分配準備積立金)	1,270,070,296	1,159,586,393
元本等合計	8,975,168,901	10,443,865,793
純資産合計	8,975,168,901	10,443,865,793
負債純資産合計	8,994,709,484	10,471,752,796

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期中間計算期間 自 2018年 5月30日 至 2018年11月29日	第13期中間計算期間 自 2019年 5月30日 至 2019年11月29日
営業収益		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	417,969,760	1,104,473,813
営業収益合計	417,969,760	1,104,473,815
営業費用		
支払利息	7,024	5,096
受託者報酬	1,406,210	1,555,619
委託者報酬	7,968,471	8,815,114
その他費用	234,711	259,212
営業費用合計	9,616,416	10,635,041
営業利益又は営業損失（ ）	427,586,176	1,093,838,774
経常利益又は経常損失（ ）	427,586,176	1,093,838,774
中間純利益又は中間純損失（ ）	427,586,176	1,093,838,774
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,311,645	37,766,767
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,266,491,465	1,657,302,479
剰余金増加額又は欠損金減少額	449,112,554	266,956,668
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	449,112,554	266,956,668
剰余金減少額又は欠損金増加額	195,414,563	155,180,067
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	195,414,563	155,180,067
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,099,914,925	2,825,151,087

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	---------------------------------------

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第12期 (2019年 5月29日現在)	第13期中間計算期間 (2019年11月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,317,866,422口	7,618,714,706口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2265円 (12,265円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3708円 (13,708円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2019年11月29日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(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。

	第13期中間計算期間 (2019年11月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第12期 自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29日	第13期中間計算期間 自 2019年 5月30日 至 2019年11月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,015,524,219円	7,317,866,422円
期中追加設定元本額	2,438,617,340円	982,866,590円
期中一部解約元本額	1,136,275,137円	682,018,306円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年11月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,942,484,081
株式	319,091,943,500



	2019年11月29日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	214,985,960
未収入金	220,144,963
未収配当金	2,319,796,907
差入委託証拠金	119,972,600
流動資産合計	325,909,328,011
資産合計	325,909,328,011
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,906,350
前受金	213,105,300
未払金	53,363,460
未払解約金	609,638,933
未払利息	5,274
その他未払費用	272
流動負債合計	878,019,589
負債合計	878,019,589
純資産の部	
元本等	
元本	205,511,140,335
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,520,168,087
元本等合計	325,031,308,422
純資産合計	325,031,308,422
負債純資産合計	325,909,328,011

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年11月29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

	2019年11月29日現在
	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11月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	205,511,140,335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 1.5816円 (1万口当たり純資産額) (15,816円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年11月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2019年11月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月30日
期首元本額	192,648,275,463円
期中追加設定元本額	30,334,169,662円
期中一部解約元本額	17,471,304,790円
期末元本額	205,511,140,335円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	574,850,672円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,039,798,399円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,789,066円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,267,947,437円
世界経済インデックスファンド	2,073,755,895円
日本株式インデックス・オープン	4,808,598,329円
DCマイセレクション25	6,814,310,005円
DCマイセレクション50	19,262,513,208円
DCマイセレクション75	17,414,609,645円
DC日本株式インデックス・オープン	5,694,276,110円
DCマイセレクションS25	2,742,354,481円
DCマイセレクションS50	7,831,572,164円
DCマイセレクションS75	5,071,082,991円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,600,036,150円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	391,766,359円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	712,186,578円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	470,310,892円
DC世界経済インデックスファンド	1,896,621,728円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,076,552,640円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,112,186円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	36,456,712円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,943,720円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	280,715,693円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,582,381円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	80,841,365円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	320,137,924円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,243,673円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	432,271,824円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,685,426,286円

区分	2019年11月29日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	701,563,059円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,042,502,424円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	617,267,616円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	41,018,174円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	772,122,931円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	35,821,422円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	432,954,639円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	566,068,653円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,574,955円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	845,707,621円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,011,550,659円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,796,833円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,293,297,705円
分散投資コア戦略ファンドA	5,961,437,227円
分散投資コア戦略ファンドS	15,951,269,188円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	268,742,077円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	286,795,735円
コア投資戦略ファンド(切替型)	753,826,857円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	213,295,275円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,103,122円
SMT インデックスバランス・オープン	71,422,452円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,599,829,603円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	588,712,459円
SMT 世界経済インデックス・オープン	16,620,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	62,121,644円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	9,306,348円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,695,158円
グローバル経済コア	282,952,206円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,053,857円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	41,333,786円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,113,802円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	353,247,293円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	29,765,656円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	48,365,331,291円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	589,383,140円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	7,200,268円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2019年11月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,590,634,700	-	5,803,740,000	213,105,300
	合計	5,590,634,700	-	5,803,740,000	213,105,300

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【DC日本株式インデックス・オープンS】

## 【純資産額計算書】

(2019年12月30日現在)

資産総額	10,701,820,124円
負債総額	17,682,617円
純資産総額（ - ）	10,684,137,507円
発行済口数	7,684,753,954口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3903円
（1万口当たり純資産額）	（13,903円）

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年12月30日現在)

資産総額	323,711,310,253円
負債総額	224,610,825円
純資産総額（ - ）	323,486,699,428円
発行済口数	201,625,803,979口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6044円
（1万口当たり純資産額）	（16,044円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2019年12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年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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



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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2020年 2月28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12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	539	12,804,006
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	326,953
単位型公社債投資信託	17	140,733
合計	643	13,271,692

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		23,973,152	23,830,484
有価証券		-	2,268,127
前払費用		157,614	197,843
未収委託者報酬		5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬		-	5,525,778
未収収益		896	212,722
その他		8,946	2,261,900
流動資産合計		29,513,917	40,648,447
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	36,782	282,407
器具備品	1	79,655	564,981
その他	1	1,912	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】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. 引当金の計上基準

### (1) 貸倒引当金

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

### (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

### (3) 退職給付引当金

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

## 6. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

### （有形固定資産の減価償却方法の変更）

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

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

## 表示方法の変更

### （「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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



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

（貸借対照表関係）

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

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

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと

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

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

(\* ) 負債に計上されているものについては、( ) で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）有価証券及び投資有価証券

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

（5）未払金、及び（6）未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（7）デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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

（単位：千円）

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

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

## 1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

## 2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

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

#### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

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

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

## 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

## (注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

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

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

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

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

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

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

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

### (企業結合等関係)

#### 共通支配下の取引等

##### (1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

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

##### (2)実施した会計処理の概要

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

### (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

### (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報



## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継			
							(承継資産合計)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	無対価		

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

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

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

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

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

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

中間純利益

4,895

## 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

## 重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

### 有価証券

#### 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 4．固定資産の減価償却の方法

### (1)有形固定資産

定額法によっております。

### (2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

## 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 6．引当金の計上基準

### (1)貸倒引当金

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

### (2)賞与引当金

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

### (3)退職給付引当金

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

## 7．ヘッジ会計の会計処理

### (1)ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2)ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3)ヘッジ方針

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

### (4)ヘッジ有効性評価の方法

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

#### 8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

##### (2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

#### 注記事項

##### (中間貸借対照表関係)

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

##### (中間損益計算書関係)

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

##### (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 配当に関する事項

##### 配当金支払額

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

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

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

（単位：百万円）

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

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

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



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

(有価証券関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

1. 子会社株式

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

(単位: 百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

2. その他有価証券

(単位: 百万円)

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

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

(デリバティブ取引関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

## 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

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

## 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
合計			5,046	-	48

## (注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

(関連情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

略しております。

## (2)有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 2月28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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論

見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

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7月29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DC日本株式インデックス・オープンの2018年5月30日から2019年5月29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、DC日本株式インデックス・オープンの2019年5月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2019年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年1月29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DC日本株式インデックス・オープンの2019年5月30日から2019年11月29日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2019年11月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年5月30日から2019年11月29日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。