

## 【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6月30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】	D C日本株式インデックス・オープン
【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

### （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 7月 1日から2020年12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、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、

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並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &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、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の



資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

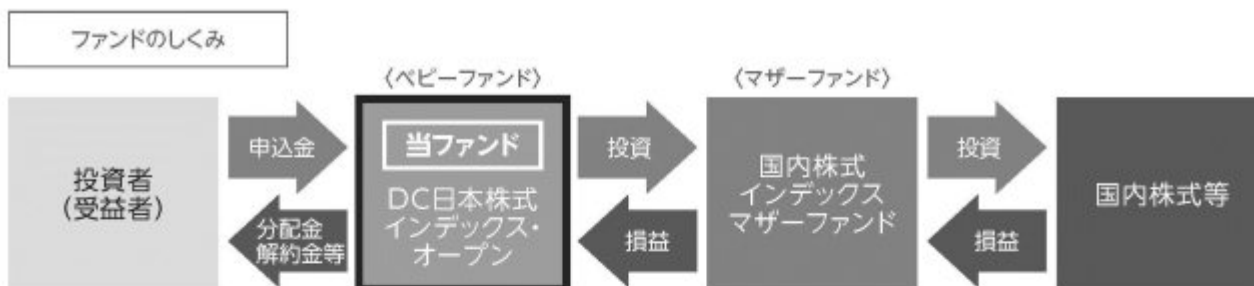
- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

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

#### < ファンドの特色 >

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



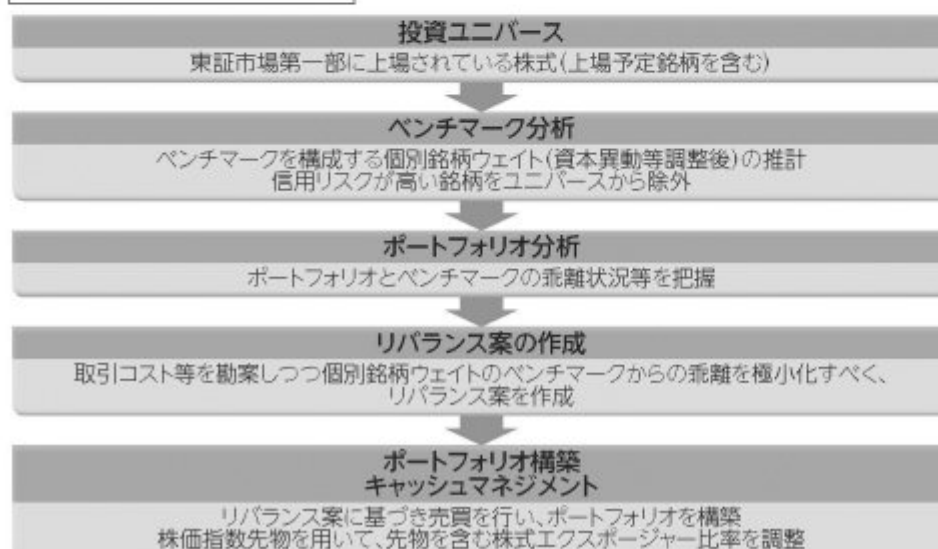
## ? ファミリーファンド方式とは

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)の著作権等について

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

ています。

- 2．東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- 3．東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 4．東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- 5．当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
- 6．東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 7．東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 8．以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 分配方針

- 原則として、毎年9月30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。

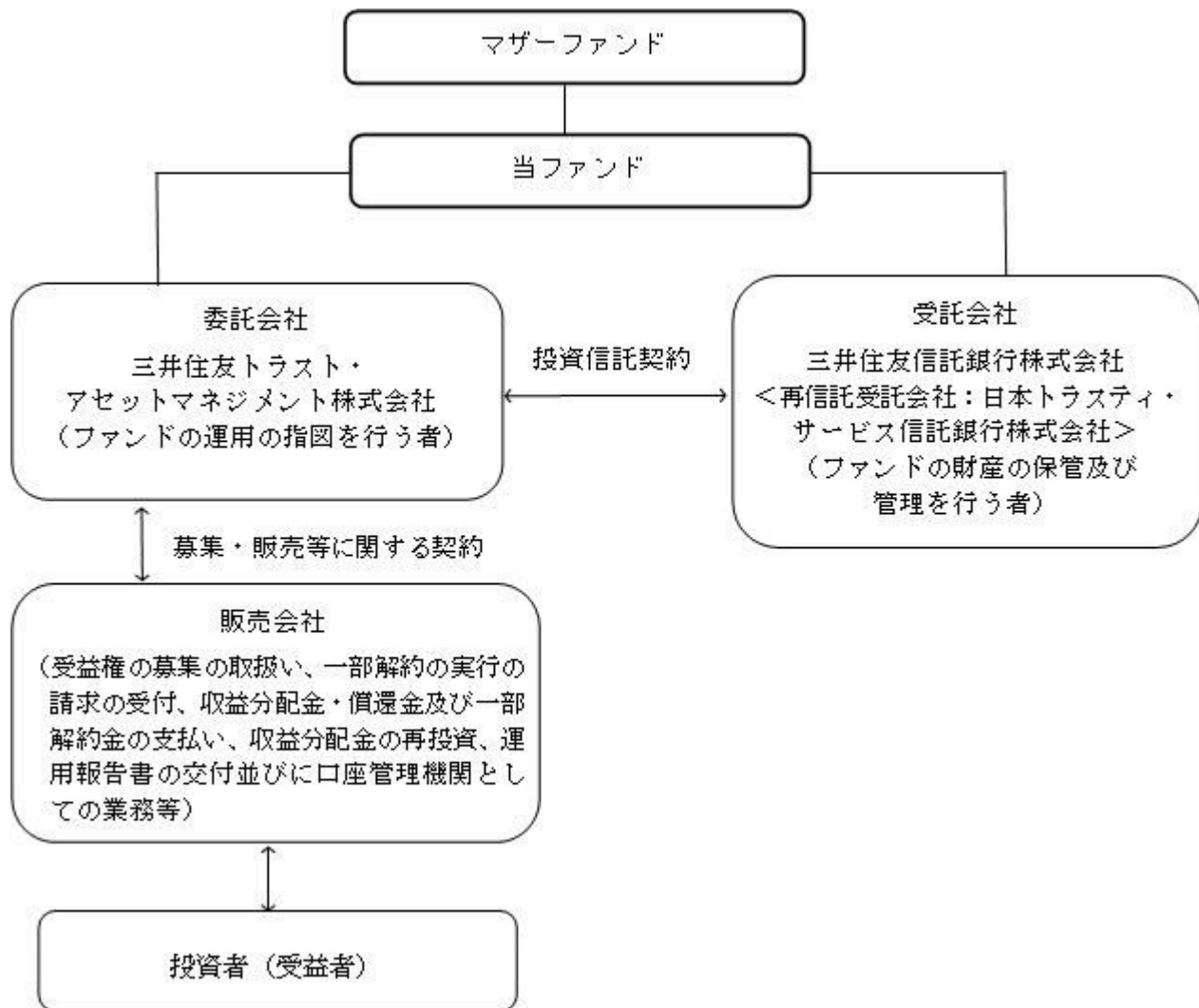
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

#### (2)【ファンドの沿革】

2001年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月 1日	本ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープン」から「DC日本株式インデックス・オープン」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

委託会社の概況（2020年 4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

## 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### (イ)基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法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投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ)運用方法

##### 投資対象

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

##### 投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)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】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (参考) マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

###### 1. 基本方針

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

###### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

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

###### (2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

###### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

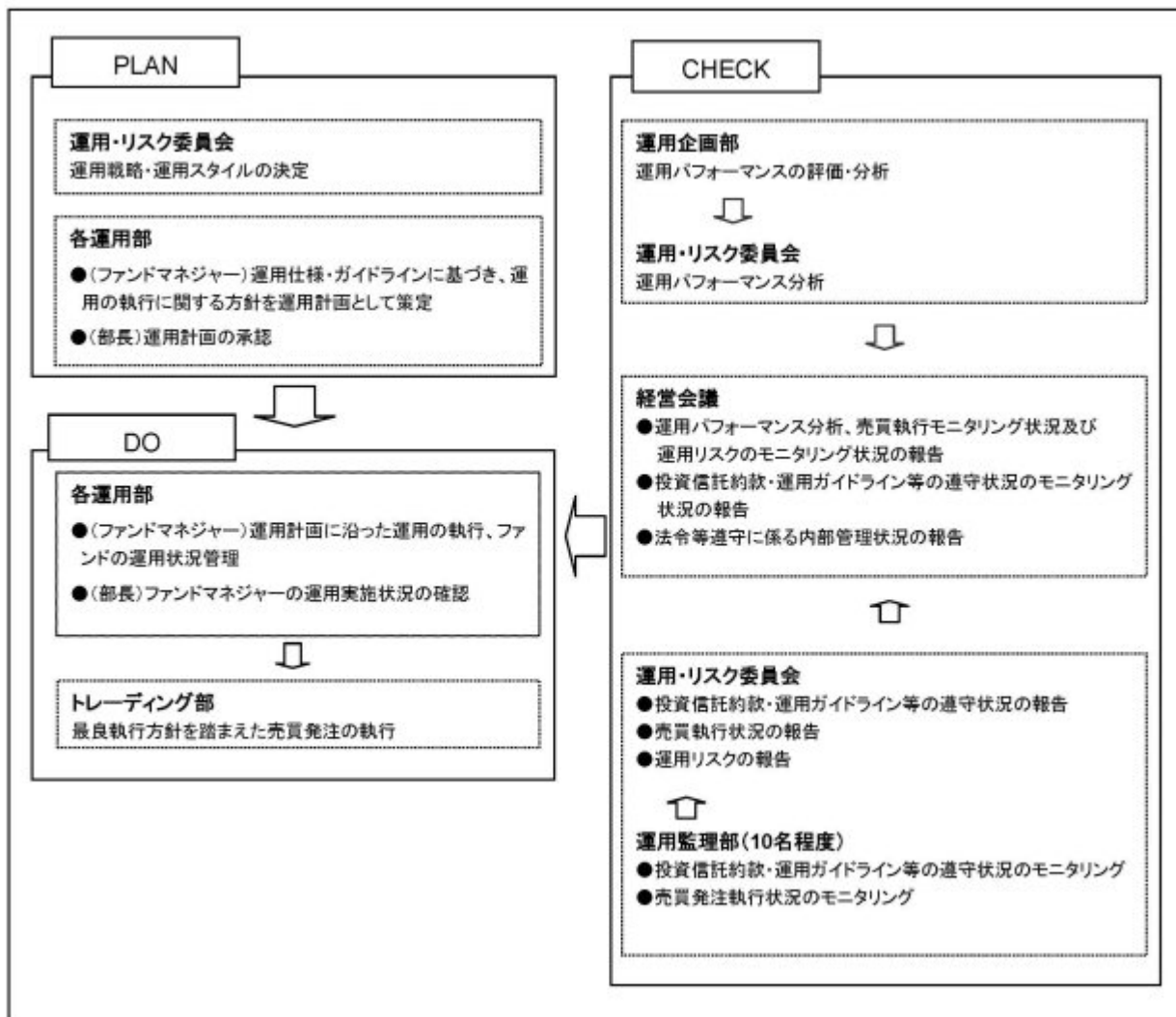
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい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および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### （3）【運用体制】

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



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

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを



行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

- ・ 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、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

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

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者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。（投資信託約款第23条）

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

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第32条）

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

### < 関連法令に基づく投資制限 >

#### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

##### （投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### < その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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

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。

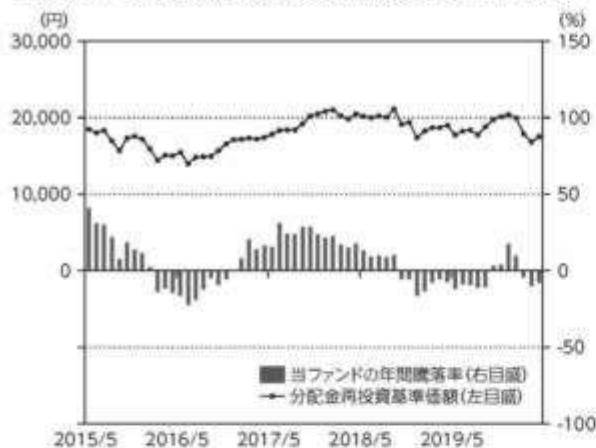
## (2) リスクの管理体制

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】

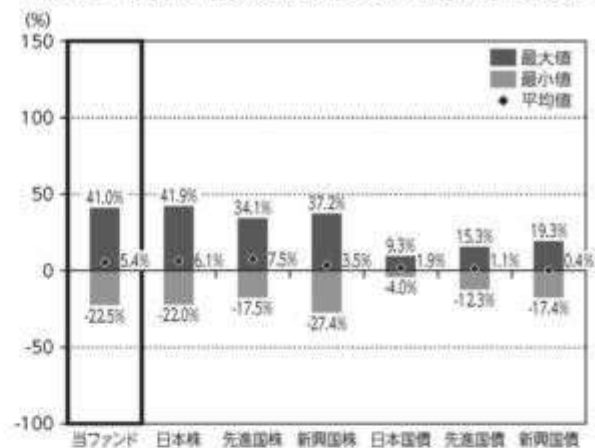
### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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5月～2020年4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

<b>日本株</b> 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国内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、公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの約定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
<b>先進国株</b> 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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> 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きを表す投資収益指数で、一定の購入価格に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関して一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、欠落または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> JPM Global Emerging Markets Index(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承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 0.66%（税抜 0.6%）（ ）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 0.231% （税抜 0.21%）	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 0.374% （税抜 0.34%）	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 0.055% （税抜 0.05%）	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、2020年4月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### 5【運用状況】

以下は、2020年4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】

##### （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	8,011,165,582	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,967,804	0.05
合計(純資産総額)		8,015,133,386	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(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	5,795,952,527	1.4728	8,536,807,896	1.3822	8,011,165,582	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第9期計算期間末 (2010年 9月30日)	1,763,856,746	1,763,856,746	8,576	8,576
第10期計算期間末 (2011年 9月30日)	1,914,318,968	1,914,318,968	8,006	8,006
第11期計算期間末 (2012年10月 1日)	2,099,913,529	2,099,913,529	7,832	7,832
第12期計算期間末 (2013年 9月30日)	3,797,442,442	3,797,442,442	12,935	12,935
第13期計算期間末 (2014年 9月30日)	4,477,408,779	4,477,408,779	14,558	14,558
第14期計算期間末 (2015年 9月30日)	5,422,952,362	5,422,952,362	15,686	15,686
第15期計算期間末 (2016年 9月30日)	5,729,227,131	5,729,227,131	14,927	14,927
第16期計算期間末 (2017年10月 2日)	7,330,898,749	7,330,898,749	19,167	19,167
第17期計算期間末 (2018年10月 1日)	8,669,330,919	8,669,330,919	21,134	21,134
第18期計算期間末 (2019年 9月30日)	8,364,659,058	8,364,659,058	18,809	18,809
2019年 4月末日	8,210,757,023		18,994	
5月末日	7,756,683,024		17,749	
6月末日	7,997,272,568		18,225	
7月末日	8,100,566,517		18,380	
8月末日	7,927,444,647		17,750	
9月末日	8,364,659,058		18,809	
10月末日	8,830,207,183		19,738	
11月末日	9,010,595,411		20,111	
12月末日	9,055,056,968		20,390	
2020年 1月末日	8,831,978,902		19,942	



2月末日	7,921,824,445		17,884
3月末日	7,593,730,441		16,810
4月末日	8,015,133,386		17,528

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	0
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	7.4
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	6.6
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	2.2
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	65.2
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	12.5
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	7.7
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	4.8
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	28.4
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	10.3
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	11.0
第19期中間計算期間	2019年10月 1日～2020年 3月31日	10.6

(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9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	548,476,476	213,143,739	2,056,687,344

第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	646,054,246	311,558,408	2,391,183,182
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	766,520,228	476,640,765	2,681,062,645
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1,221,033,540	966,324,863	2,935,771,322
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	1,073,391,560	933,574,251	3,075,588,631
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,497,444,507	1,115,886,709	3,457,146,429
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,215,333,947	834,369,525	3,838,110,851
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,128,218,267	1,141,666,812	3,824,662,306
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,122,120,183	844,769,825	4,102,012,664
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	1,105,861,467	760,666,529	4,447,207,602
第19期中間計算期間	2019年10月 1日～2020年 3月31日	693,637,685	623,428,685	4,517,416,602

(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	286,968,208,760	97.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,194,144,181	2.11
合計(純資産総額)		293,162,352,941	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	6,295,820,000	2.15

(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	1,556,700	6,649.73	10,351,639,992	6,666.00	10,376,962,200	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	874,000	5,507.82	4,813,837,720	6,932.00	6,058,568,000	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,086,300	5,087.33	5,526,375,960	4,633.00	5,032,827,900	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	126,400	31,674.04	4,003,599,340	38,770.00	4,900,528,000	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,160,800	3,802.81	4,414,312,804	3,883.00	4,507,386,400	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,830,100	2,470.18	4,520,688,415	2,443.00	4,470,934,300	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,413,000	503.64	4,740,822,212	434.30	4,088,065,900	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	85,500	38,880.57	3,324,288,806	44,650.00	3,817,575,000	1.30
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,011,400	2,629.28	2,659,258,627	3,148.00	3,183,887,200	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,020,300	2,817.32	2,874,520,668	3,109.00	3,172,112,700	1.08
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	955,000	3,565.79	3,405,330,416	3,182.00	3,038,810,000	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	399,200	5,649.20	2,255,163,640	7,382.00	2,946,894,400	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,098,500	2,731.26	3,000,296,364	2,610.50	2,867,634,250	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	234,600	9,583.26	2,248,233,622	12,015.00	2,818,719,000	0.96
日本	株式	花王	化学	334,100	8,540.19	2,853,278,390	8,316.00	2,778,375,600	0.95
日本	株式	HOYA	精密機器	278,600	8,107.92	2,258,868,908	9,866.00	2,748,667,600	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	951,700	3,729.01	3,548,900,398	2,844.00	2,706,634,800	0.92
日本	株式	ダイキン工業	機械	177,800	13,757.48	2,446,081,408	14,005.00	2,490,089,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	486,500	5,521.22	2,686,077,184	5,086.00	2,474,339,000	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	409,900	4,770.66	1,955,495,534	6,019.00	2,467,188,100	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	132,600	18,269.80	2,422,575,664	17,830.00	2,364,258,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,698,200	153.30	2,866,490,151	125.80	2,352,233,560	0.80

日本	株式	三菱商事	卸売業	964,300	2,794.86	2,695,088,933	2,300.00	2,217,890,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	670,400	3,779.08	2,533,501,880	3,241.00	2,172,766,400	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,209,700	1,549.40	1,874,316,280	1,786.50	2,161,129,050	0.74
日本	株式	S M C	機械	43,800	38,357.07	1,680,039,720	49,000.00	2,146,200,000	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	335,800	6,816.56	2,289,003,620	6,286.00	2,110,838,800	0.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	961,100	2,041.65	1,962,231,980	2,125.00	2,042,337,500	0.70
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	88,500	15,811.48	1,399,316,639	22,940.00	2,030,190,000	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	116,000	22,137.79	2,567,984,024	17,005.00	1,972,580,000	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	0.21
		建設業	2.59
		食料品	3.93
		繊維製品	0.51
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.15
		医薬品	6.50
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.53
		機械	4.95
		電気機器	14.41
		輸送用機器	7.24
		精密機器	2.53
		その他製品	2.41
電気・ガス業	1.63		
陸運業	4.21		

	海運業	0.14
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.60
	卸売業	4.57
	小売業	4.66
	銀行業	5.07
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.15
	その他金融業	1.07
	不動産業	2.12
	サービス業	5.04
	小計	97.89
合計		97.89

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの


資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	433円		6,142,333,900	6,295,820,000	2.15

(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：2001年10月1日

作成基準日：2020年4月30日

**基準価額・純資産の推移**

基準価額 17,528円

純資産総額 80.15億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年9月	0円
2016年9月	0円
2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年9月	0円

設定来  
分配金合計額 0円

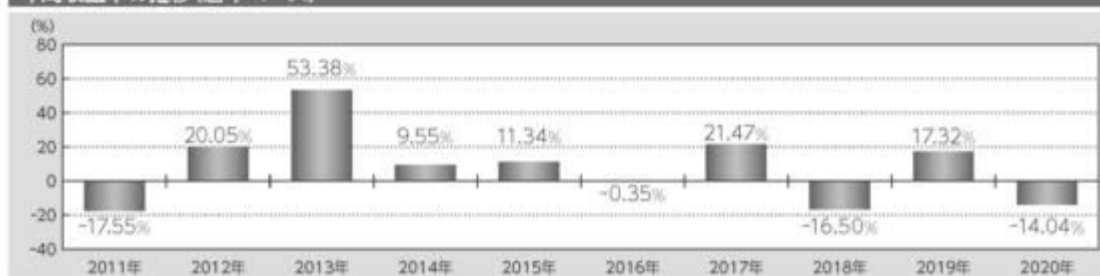
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種別	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	2.1%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.7%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.7%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.4%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	1.1%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	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)**

※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

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

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 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、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拠ることとなります。

#### < 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>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

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

### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<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。（2001年10月1日設定）

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

### （4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30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、販売会社を経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18期計算期間(2018年10月2日から2019年9月30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】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2018年10月1日現在)	第18期 (2019年9月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	44,020,818	40,952,817
親投資信託受益証券	8,664,998,233	8,360,433,831
未収入金	14,702,823	4,089,336
流動資産合計	8,723,721,874	8,405,475,984
資産合計	8,723,721,874	8,405,475,984
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	27,626,753	14,389,970
未払受託者報酬	2,194,426	2,166,360
未払委託者報酬	24,138,605	23,829,912
未払利息	110	99
その他未払費用	431,061	430,585
流動負債合計	54,390,955	40,816,926
負債合計	54,390,955	40,816,926
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,102,012,664	4,447,207,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,567,318,255	3,917,451,456
(分配準備積立金)	2,046,666,309	1,715,858,472
元本等合計	8,669,330,919	8,364,659,058
純資産合計	8,669,330,919	8,364,659,058
負債純資産合計	8,723,721,874	8,405,475,984

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2017年10月 3日	自	2018年10月 2日
	至	2018年10月 1日	至	2019年 9月30日
営業収益				
受取利息		8		8
有価証券売買等損益		830,105,415		883,239,806
営業収益合計		830,105,423		883,239,798
営業費用				
支払利息		19,162		19,084
受託者報酬		4,311,577		4,306,962
委託者報酬		47,427,218		47,376,433
その他費用		431,744		431,575
営業費用合計		52,189,701		52,134,054
営業利益又は営業損失（ ）		777,915,722		935,373,852
経常利益又は経常損失（ ）		777,915,722		935,373,852
当期純利益又は当期純損失（ ）		777,915,722		935,373,852
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（ ）		83,131,881		168,072,440
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,506,236,443		4,567,318,255
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,152,833,607		940,365,002
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,152,833,607		940,365,002
剰余金減少額又は欠損金増加額		786,535,636		822,930,389
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		786,535,636		822,930,389
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,567,318,255		3,917,451,456



## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第18期計算期間は2018年10月2日から2019年9月30日までとなっております。

( 貸借対照表に関する注記 )

	第17期 (2018年10月1日現在)	第18期 (2019年9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,102,012,664口	4,447,207,602口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1134円 (21,134円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8809円 (18,809円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第17期 自 2017年10月3日 至 2018年10月1日			第18期 自 2018年10月2日 至 2019年9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	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	694,790,644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	3,783,266,057円	収益調整金額	C	4,604,677,026円
分配準備積立金額	D	1,351,875,665円	分配準備積立金額	D	1,715,858,472円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,829,932,366円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,320,535,498円
当ファンドの期末残存口数	F	4,102,012,664口	当ファンドの期末残存口数	F	4,447,207,602口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,212円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,212円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 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18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30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18期 (2019年 9月30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17期	第18期
	自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1日	自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,824,662,306円	4,102,012,664円
期中追加設定元本額	1,122,120,183円	1,105,861,467円
期中一部解約元本額	844,769,825円	760,666,529円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	(2018年10月 1日現在)	(2019年 9月30日現在)
	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	805,269,743	802,375,309
合計	805,269,743	802,375,309

## （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	5,658,500,055	8,360,433,831	
合計		5,658,500,055	8,360,433,831	

(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 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,505,330,625
株式	301,610,113,430
派生商品評価勘定	81,247,840
未収入金	62,946,361
未収配当金	3,030,424,328
差入委託証拠金	138,291,600
流動資産合計	308,428,354,184
資産合計	308,428,354,184
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,614,940
前受金	42,643,700
未払金	35,123,420
未払解約金	1,057,439,234
未払利息	8,516
その他未払費用	1,032
流動負債合計	1,173,830,842
負債合計	1,173,830,842
純資産の部	
元本等	
元本	207,951,200,444

	2019年 9月30日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,303,322,898
元本等合計	307,254,523,342
純資産合計	307,254,523,342
負債純資産合計	308,428,354,184

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 9月30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 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	207,951,200,444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 1.4775円 (1万口当たり純資産額) (14,775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 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2019年 9月30日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年10月 2日
期首元本額	140,967,747,516円
期中追加設定元本額	85,346,035,565円
期中一部解約元本額	18,362,582,637円
期末元本額	207,951,200,444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）	587,407,842円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,050,013,032円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,191,405円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,722,338,865円
世界経済インデックスファンド	2,092,501,272円
日本株式インデックス・オープン	5,322,441,683円
D C マイセレクション 2 5	6,877,452,752円
D C マイセレクション 5 0	19,478,609,146円
D C マイセレクション 7 5	17,693,052,946円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,658,500,055円

区分	2019年 9月30日現在
DCマイセレクションS25	2,774,287,230円
DCマイセレクションS50	7,907,851,774円
DCマイセレクションS75	5,102,759,511円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,548,926,827円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	388,850,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	699,041,211円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	459,065,790円
DC世界経済インデックスファンド	1,855,684,297円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,157,492,851円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	15,912,032円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	38,352,733円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	38,766,263円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	290,125,410円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,717,839円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	80,814,436円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	333,969,311円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	65,589,781円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	494,645,634円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,795,713,875円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	734,246,719円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,243,571,741円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	678,729,136円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,442,577円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	803,985,939円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	37,531,892円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	459,891,212円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	589,379,412円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	54,933,957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）	908,039,081円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,889,234,812円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,515,055,936円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,496,119,375円
分散投資コア戦略ファンドA	5,593,816,351円
分散投資コア戦略ファンドS	11,596,231,740円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	260,123,930円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	280,936,134円
コア投資戦略ファンド（切替型）	779,159,346円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	221,196,271円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,259,567円
SMT インデックスバランス・オープン	74,944,468円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,989,522,633円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	680,819,456円



区分	2019年 9月30日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	15,430,720円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	60,732,208円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	8,859,573円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,570,672円
グローバル経済コア	315,919,546円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,081,062円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	43,611,169円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,653,698円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	196,531,526円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,326,359円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,834円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	52,993,358,774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）	617,653,901円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	3,552,530円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,775,597,978	
合計	9,775,597,978	

(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 9月30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	5,642,396,300	-	5,685,040,000	42,643,700
合計		5,642,396,300	-	5,685,040,000	42,643,700

## (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	5,900	2,778.00	16,390,200	
日本水産	180,200	611.00	110,102,200	
マルハニチロ	26,000	2,724.00	70,824,000	
カネコ種苗	5,500	1,288.00	7,084,000	
サカタのタネ	21,500	3,690.00	79,335,000	
ホクト	15,100	1,984.00	29,958,400	
ホクリヨウ	2,400	666.00	1,598,400	
住石ホールディングス	38,800	132.00	5,121,600	
日鉄鉱業	4,100	4,250.00	17,425,000	
三井松島ホールディングス	7,500	1,201.00	9,007,500	
国際石油開発帝石	723,000	991.10	716,565,300	
石油資源開発	25,900	2,739.00	70,940,100	
K&Oエナジーグループ	8,700	1,439.00	12,519,300	
ヒノキヤグループ	4,500	1,920.00	8,640,000	
ショーボンドホールディングス	25,700	3,790.00	97,403,000	
ミライト・ホールディングス	50,700	1,629.00	82,590,300	
タマホーム	8,700	1,392.00	12,110,400	
サンヨーホームズ	2,600	659.00	1,713,400	
日本アクア	7,200	616.00	4,435,200	
ファーストコーポレーション	5,500	620.00	3,410,000	
ベステラ	3,400	1,229.00	4,178,600	
T A T E R U	36,600	176.00	6,441,600	
スペースバリューホールディングス	22,000	498.00	10,956,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,500	724.00	2,534,000	
第一カッター興業	2,200	1,715.00	3,773,000	
安藤・間	115,600	804.00	92,942,400	
東急建設	52,800	826.00	43,612,800	
コムシスホールディングス	63,900	3,060.00	195,534,000	
ミサワホーム	14,200	1,105.00	15,691,000	
ピーアールホールディングス	19,600	407.00	7,977,200	
高松コンストラクショングループ	11,200	2,479.00	27,764,800	
東建コーポレーション	5,600	6,630.00	37,128,000	
ソネック	1,900	862.00	1,637,800	

ヤマウラ	7,000	869.00	6,083,000	
大成建設	148,000	4,185.00	619,380,000	
大林組	445,900	1,076.00	479,788,400	
清水建設	454,800	978.00	444,794,400	
飛鳥建設	12,700	1,159.00	14,719,300	
長谷工コーポレーション	185,900	1,258.00	233,862,200	
松井建設	16,400	724.00	11,873,600	
銭高組	1,800	4,035.00	7,263,000	
鹿島建設	348,500	1,417.00	493,824,500	
不動テトラ	10,200	1,211.00	12,352,200	
大末建設	5,200	915.00	4,758,000	
鉄建建設	9,000	2,760.00	24,840,000	
西松建設	32,100	2,010.00	64,521,000	
三井住友建設	107,200	567.00	60,782,400	
大豊建設	10,100	2,852.00	28,805,200	
前田建設工業	106,000	942.00	99,852,000	
佐田建設	9,600	418.00	4,012,800	
ナカノフドー建設	11,400	476.00	5,426,400	
奥村組	24,500	2,885.00	70,682,500	
東鉄工業	17,800	3,195.00	56,871,000	
イチケン	2,700	1,654.00	4,465,800	
富士ピー・エス	6,100	511.00	3,117,100	
浅沼組	5,000	3,840.00	19,200,000	
戸田建設	172,800	621.00	107,308,800	
熊谷組	21,200	3,075.00	65,190,000	
北野建設	3,100	2,290.00	7,099,000	
植木組	1,800	2,473.00	4,451,400	
矢作建設工業	20,200	692.00	13,978,400	
ピーエス三菱	15,700	722.00	11,335,400	
日本ハウスホールディングス	28,400	521.00	14,796,400	
大東建託	53,000	13,810.00	731,930,000	
新日本建設	17,700	755.00	13,363,500	
N I P P O	39,400	1,999.00	78,760,600	
東亜道路工業	2,800	3,420.00	9,576,000	
前田道路	44,100	2,350.00	103,635,000	
日本道路	4,000	6,520.00	26,080,000	
東亜建設工業	13,000	1,304.00	16,952,000	
日本国土開発	24,300	530.00	12,879,000	
若築建設	7,500	1,500.00	11,250,000	
東洋建設	54,400	467.00	25,404,800	
五洋建設	176,800	598.00	105,726,400	
世紀東急工業	21,600	729.00	15,746,400	

福田組	4,800	4,165.00	19,992,000	
住友林業	105,400	1,436.00	151,354,400	
日本基礎技術	15,300	324.00	4,957,200	
巴コーポレーション	18,500	400.00	7,400,000	
大和ハウス工業	411,700	3,506.00	1,443,420,200	
ライト工業	28,600	1,418.00	40,554,800	
積水ハウス	455,300	2,125.00	967,512,500	
日特建設	12,700	634.00	8,051,800	
北陸電気工事	7,200	886.00	6,379,200	
ユアテック	23,800	656.00	15,612,800	
四電工	2,300	2,830.00	6,509,000	
中電工	19,200	2,338.00	44,889,600	
関電工	67,700	966.00	65,398,200	
きんでん	98,900	1,603.00	158,536,700	
東京エネシス	15,400	879.00	13,536,600	
トーエネック	4,200	3,455.00	14,511,000	
住友電設	10,300	2,201.00	22,670,300	
日本電設工業	25,400	2,234.00	56,743,600	
協和エクシオ	58,200	2,620.00	152,484,000	
新日本空調	12,000	1,789.00	21,468,000	
九電工	29,300	3,600.00	105,480,000	
三機工業	33,600	1,280.00	43,008,000	
日揮	128,100	1,413.00	181,005,300	
中外炉工業	4,200	1,493.00	6,270,600	
ヤマト	13,300	705.00	9,376,500	
太平電業	10,100	2,386.00	24,098,600	
高砂熱学工業	36,100	1,786.00	64,474,600	
三晃金属工業	1,800	2,416.00	4,348,800	
朝日工業社	3,100	3,050.00	9,455,000	
明星工業	26,900	733.00	19,717,700	
大気社	20,200	3,255.00	65,751,000	
ダイダン	9,900	2,167.00	21,453,300	
日比谷総合設備	13,400	1,872.00	25,084,800	
東芝プラントシステム	32,200	1,802.00	58,024,400	
OSJBホールディングス	65,600	246.00	16,137,600	
東洋エンジニアリング	17,500	619.00	10,832,500	
レイズネクスト	26,700	1,102.00	29,423,400	
日本製粉	42,200	1,689.00	71,275,800	
日清製粉グループ本社	150,500	1,998.00	300,699,000	
日東富士製粉	1,000	6,730.00	6,730,000	
昭和産業	12,200	3,065.00	37,393,000	
鳥越製粉	11,800	899.00	10,608,200	

中部飼料	16,300	1,168.00	19,038,400
フィード・ワン	89,500	162.00	14,499,000
東洋精糖	2,000	1,067.00	2,134,000
日本甜菜製糖	7,600	1,882.00	14,303,200
三井製糖	10,500	2,231.00	23,425,500
塩水港精糖	14,400	206.00	2,966,400
日新製糖	6,300	1,929.00	12,152,700
森永製菓	33,500	5,250.00	175,875,000
中村屋	3,400	4,495.00	15,283,000
江崎グリコ	40,000	4,485.00	179,400,000
名糖産業	6,400	1,240.00	7,936,000
井村屋グループ	5,700	2,060.00	11,742,000
不二家	7,400	2,030.00	15,022,000
山崎製パン	99,800	1,928.00	192,414,400
第一屋製パン	2,300	961.00	2,210,300
モロゾフ	2,300	4,940.00	11,362,000
亀田製菓	8,300	4,755.00	39,466,500
寿スピリッツ	14,100	7,090.00	99,969,000
カルビー	60,700	3,360.00	203,952,000
森永乳業	26,700	4,120.00	110,004,000
六甲バター	8,800	1,722.00	15,153,600
ヤクルト本社	98,700	6,040.00	596,148,000
明治ホールディングス	94,400	7,880.00	743,872,000
雪印メグミルク	32,100	2,601.00	83,492,100
プリマハム	18,700	2,149.00	40,186,300
日本ハム	55,100	4,345.00	239,409,500
林兼産業	4,400	606.00	2,666,400
丸大食品	14,200	2,287.00	32,475,400
S Foods	12,000	2,982.00	35,784,000
伊藤ハム米久ホールディングス	85,800	678.00	58,172,400
サッポロホールディングス	45,400	2,694.00	122,307,600
アサヒグループホールディングス	278,900	5,350.00	1,492,115,000
キリンホールディングス	564,900	2,288.00	1,292,491,200
宝ホールディングス	99,700	1,069.00	106,579,300
オエノンホールディングス	35,100	387.00	13,583,700
養命酒製造	4,100	1,909.00	7,826,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	93,500	2,424.00	226,644,000
サントリー食品インターナショナル	89,100	4,620.00	411,642,000
ダイドーグループホールディングス	7,500	4,405.00	33,037,500
伊藤園	40,400	5,090.00	205,636,000
キーコーヒー	13,100	2,190.00	28,689,000
ユニカフェ	3,400	1,000.00	3,400,000

ジャパンフーズ	1,900	1,205.00	2,289,500
日清オイリオグループ	17,100	3,390.00	57,969,000
不二製油グループ本社	32,500	3,130.00	101,725,000
かどや製油	1,500	3,585.00	5,377,500
J・オイルミルズ	6,900	4,100.00	28,290,000
キッコーマン	87,900	5,160.00	453,564,000
味の素	294,100	2,040.00	599,964,000
キューピー	74,200	2,523.00	187,206,600
ハウス食品グループ本社	49,800	4,040.00	201,192,000
カゴメ	50,500	2,729.00	137,814,500
焼津水産化学工業	6,500	1,050.00	6,825,000
アリアケジャパン	12,200	8,420.00	102,724,000
ピエトロ	1,700	1,612.00	2,740,400
エバラ食品工業	3,200	2,086.00	6,675,200
やまみ	600	2,018.00	1,210,800
ニチレイ	69,200	2,464.00	170,508,800
東洋水産	68,500	4,330.00	296,605,000
イトアンド	4,600	1,691.00	7,778,600
大冷	1,500	2,000.00	3,000,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,700	920.00	3,404,000
日清食品ホールディングス	56,600	7,800.00	441,480,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,046.00	14,526,600
一正蒲鉾	5,200	1,052.00	5,470,400
フジッコ	14,400	1,949.00	28,065,600
ロック・フィールド	14,300	1,444.00	20,649,200
日本たばこ産業	769,100	2,366.00	1,819,690,600
ケンコーマヨネーズ	7,500	2,422.00	18,165,000
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,970.00	17,139,000
なとり	7,400	1,624.00	12,017,600
イフジ産業	2,300	755.00	1,736,500
ピクルスコーポレーション	3,200	2,714.00	8,684,800
北の達人コーポレーション	52,300	700.00	36,610,000
ユーグレナ	56,800	903.00	51,290,400
ミヨシ油脂	5,100	1,172.00	5,977,200
理研ビタミン	6,300	3,465.00	21,829,500
片倉工業	19,200	1,336.00	25,651,200
ゲンゼ	8,800	4,510.00	39,688,000
東洋紡	55,300	1,417.00	78,360,100
ユニチカ	39,400	318.00	12,529,200
富士紡ホールディングス	6,900	3,010.00	20,769,000
倉敷紡績	12,600	2,254.00	28,400,400
シキボウ	6,800	913.00	6,208,400

日本毛織	43,200	988.00	42,681,600
トーア紡コーポレーション	5,200	528.00	2,745,600
帝国繊維	14,800	1,796.00	26,580,800
帝人	106,200	2,076.00	220,471,200
東レ	1,008,800	802.10	809,158,480
サカイオーベックス	3,400	1,800.00	6,120,000
住江織物	3,800	3,030.00	11,514,000
日本フェルト	8,300	460.00	3,818,000
イチカワ	2,100	1,510.00	3,171,000
日東製網	1,500	1,575.00	2,362,500
アツギ	10,800	834.00	9,007,200
ダイニック	5,300	728.00	3,858,400
セーレン	32,300	1,242.00	40,116,600
ソトー	5,300	971.00	5,146,300
東海染工	1,900	1,125.00	2,137,500
小松マテーレ	21,500	779.00	16,748,500
ワコールホールディングス	36,800	2,777.00	102,193,600
ホギメディカル	16,200	3,090.00	50,058,000
レナウン	37,600	114.00	4,286,400
クラウディアホールディングス	3,400	492.00	1,672,800
T S Iホールディングス	48,100	599.00	28,811,900
マツオカコーポレーション	4,200	2,060.00	8,652,000
ワールド	17,100	2,476.00	42,339,600
三陽商会	6,800	1,453.00	9,880,400
ナイガイ	5,100	445.00	2,269,500
オンワードホールディングス	78,300	561.00	43,926,300
ルックホールディングス	4,600	1,055.00	4,853,000
ゴールドウイン	23,600	9,260.00	218,536,000
デサント	31,800	1,428.00	45,410,400
キング	7,100	599.00	4,252,900
ヤマトインターナショナル	8,200	399.00	3,271,800
特種東海製紙	8,300	3,775.00	31,332,500
王子ホールディングス	585,100	504.00	294,890,400
日本製紙	62,300	1,759.00	109,585,700
三菱製紙	21,200	483.00	10,239,600
北越コーポレーション	86,200	540.00	46,548,000
中越パルプ工業	5,500	1,494.00	8,217,000
巴川製紙所	4,300	982.00	4,222,600
大王製紙	63,300	1,372.00	86,847,600
阿波製紙	3,400	413.00	1,404,200
レンゴー	134,000	778.00	104,252,000
トモク	8,000	1,541.00	12,328,000

ザ・パックス	9,800	3,650.00	35,770,000
クラレ	204,700	1,327.00	271,636,900
旭化成	924,600	1,064.00	983,774,400
共和レザー	8,100	739.00	5,985,900
昭和電工	92,500	2,825.00	261,312,500
住友化学	1,023,100	485.00	496,203,500
住友精化	6,300	3,190.00	20,097,000
日産化学	79,300	4,495.00	356,453,500
ラサ工業	4,600	1,257.00	5,782,200
クレハ	12,000	6,430.00	77,160,000
多木化学	3,800	4,640.00	17,632,000
テイカ	10,600	1,955.00	20,723,000
石原産業	25,000	974.00	24,350,000
片倉コープアグリ	3,800	1,071.00	4,069,800
日本曹達	20,500	2,610.00	53,505,000
東ソー	200,900	1,428.00	286,885,200
トクヤマ	37,500	2,477.00	92,887,500
セントラル硝子	28,300	2,265.00	64,099,500
東亜合成	81,600	1,216.00	99,225,600
大阪ソーダ	14,300	2,769.00	39,596,700
関東電化工業	30,800	811.00	24,978,800
デンカ	51,100	2,971.00	151,818,100
信越化学工業	229,000	11,560.00	2,647,240,000
日本カーバイド工業	4,400	1,214.00	5,341,600
堺化学工業	8,600	2,523.00	21,697,800
第一稀元素化学工業	14,100	794.00	11,195,400
エア・ウォーター	106,400	1,932.00	205,564,800
大陽日酸	107,100	2,183.00	233,799,300
日本化学工業	4,400	2,342.00	10,304,800
東邦アセチレン	1,900	1,360.00	2,584,000
日本パーカラライジング	71,000	1,171.00	83,141,000
高压ガス工業	20,600	804.00	16,562,400
チタン工業	1,600	2,486.00	3,977,600
四国化成工業	21,900	1,131.00	24,768,900
戸田工業	2,800	2,214.00	6,199,200
ステラ ケミファ	7,600	2,630.00	19,988,000
保土谷化学工業	4,500	3,335.00	15,007,500
日本触媒	21,900	6,140.00	134,466,000
大日精化工業	10,700	3,170.00	33,919,000
カネカ	33,600	3,365.00	113,064,000
三菱瓦斯化学	132,100	1,442.00	190,488,200
三井化学	118,000	2,416.00	285,088,000



J S R	130,400	1,729.00	225,461,600	
東京応化工業	22,300	4,010.00	89,423,000	
大阪有機化学工業	12,000	1,071.00	12,852,000	
三菱ケミカルホールディングス	868,800	770.10	669,062,880	
K Hネオケム	22,900	2,353.00	53,883,700	
ダイセル	191,500	913.00	174,839,500	
住友ベークライト	22,500	4,220.00	94,950,000	
積水化学工業	279,500	1,673.00	467,603,500	
日本ゼオン	117,200	1,317.00	154,352,400	
アイカ工業	39,000	3,180.00	124,020,000	
宇部興産	65,600	2,179.00	142,942,400	
積水樹脂	21,400	2,125.00	45,475,000	
タキロンシーアイ	28,100	626.00	17,590,600	
旭有機材	9,000	1,293.00	11,637,000	
日立化成	60,100	3,525.00	211,852,500	
ニチバン	6,800	1,593.00	10,832,400	
リケンテクノス	35,400	457.00	16,177,800	
大倉工業	6,100	1,629.00	9,936,900	
積水化成成品工業	19,400	749.00	14,530,600	
群栄化学工業	3,300	2,400.00	7,920,000	
タイガースポリマー	6,800	599.00	4,073,200	
ミライアル	3,800	1,356.00	5,152,800	
ダイキアクシス	4,600	807.00	3,712,200	
ダイキョーニシカワ	27,400	793.00	21,728,200	
竹本容器	4,600	962.00	4,425,200	
森六ホールディングス	7,000	2,442.00	17,094,000	
日本化薬	80,400	1,290.00	103,716,000	
カーリットホールディングス	13,900	569.00	7,909,100	
日本精化	10,500	1,202.00	12,621,000	
扶桑化学工業	13,200	2,399.00	31,666,800	
トリケミカル研究所	2,900	6,630.00	19,227,000	
A D E K A	64,100	1,340.00	85,894,000	
日油	48,900	3,555.00	173,839,500	
新日本理化	23,000	192.00	4,416,000	
ハリマ化成グループ	10,700	1,217.00	13,021,900	
花王	317,700	7,984.00	2,536,516,800	
第一工業製薬	4,800	2,854.00	13,699,200	
石原ケミカル	3,300	1,651.00	5,448,300	
日華化学	4,400	834.00	3,669,600	
ニイタカ	2,000	1,584.00	3,168,000	
三洋化成工業	8,700	4,650.00	40,455,000	
有機合成薬品工業	10,000	236.00	2,360,000	

大日本塗料	14,700	1,058.00	15,552,600
日本ペイントホールディングス	107,300	5,610.00	601,953,000
関西ペイント	146,000	2,511.00	366,606,000
神東塗料	10,200	166.00	1,693,200
中国塗料	42,700	883.00	37,704,100
日本特殊塗料	9,700	1,123.00	10,893,100
藤倉化成	17,500	520.00	9,100,000
太陽ホールディングス	10,700	3,635.00	38,894,500
D I C	54,900	2,998.00	164,590,200
サカタインクス	28,400	1,119.00	31,779,600
東洋インキS Cホールディングス	27,500	2,450.00	67,375,000
T & K T O K A	10,100	932.00	9,413,200
富士フィルムホールディングス	275,600	4,740.00	1,306,344,000
資生堂	263,700	8,629.00	2,275,467,300
ライオン	172,500	2,131.00	367,597,500
高砂香料工業	9,100	2,615.00	23,796,500
マンダム	29,800	2,677.00	79,774,600
ミルボン	17,700	5,320.00	94,164,000
ファンケル	59,100	2,873.00	169,794,300
コーセー	22,500	18,250.00	410,625,000
コタ	7,000	1,256.00	8,792,000
シーボン	1,600	2,392.00	3,827,200
ポーラ・オルビスホールディングス	56,600	2,419.00	136,915,400
ノエビアホールディングス	12,700	5,640.00	71,628,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	944.00	2,832,000
エステー	9,500	1,582.00	15,029,000
アグロ カネショウ	4,100	1,580.00	6,478,000
コニシ	23,500	1,473.00	34,615,500
長谷川香料	17,600	1,995.00	35,112,000
星光P M C	7,600	782.00	5,943,200
小林製薬	37,200	8,220.00	305,784,000
荒川化学工業	11,900	1,467.00	17,457,300
メック	9,100	1,553.00	14,132,300
日本高純度化学	3,600	2,506.00	9,021,600
タカラバイオ	34,700	2,201.00	76,374,700
J C U	17,200	2,176.00	37,427,200
新田ゼラチン	8,300	667.00	5,536,100
O A T アグリオ	2,300	1,503.00	3,456,900
デクセリアルズ	34,200	800.00	27,360,000
アース製薬	10,000	5,540.00	55,400,000
北興化学工業	13,600	491.00	6,677,600
大成ラミック	4,400	2,845.00	12,518,000

クミアイ化学工業	54,900	931.00	51,111,900
日本農薬	23,600	490.00	11,564,000
アキレス	9,700	1,688.00	16,373,600
有沢製作所	20,900	1,016.00	21,234,400
日東電工	91,600	5,204.00	476,686,400
レック	14,200	978.00	13,887,600
三光合成	15,200	353.00	5,365,600
きもと	22,600	173.00	3,909,800
藤森工業	11,900	3,195.00	38,020,500
前澤化成工業	9,100	1,125.00	10,237,500
未来工業	7,100	2,002.00	14,214,200
ウェーブロックホールディングス	3,700	782.00	2,893,400
J S P	7,800	1,779.00	13,876,200
エフピコ	14,600	6,740.00	98,404,000
天馬	8,800	1,967.00	17,309,600
信越ポリマー	23,800	750.00	17,850,000
東リ	33,000	251.00	8,283,000
ニフコ	53,200	2,581.00	137,309,200
バルカー	10,800	2,173.00	23,468,400
ユニ・チャーム	255,800	3,420.00	874,836,000
ショーエイコーポレーション	1,100	738.00	811,800
協和キリン	133,500	2,098.00	280,083,000
武田薬品工業	1,158,500	3,690.00	4,274,865,000
アステラス製薬	1,167,300	1,538.50	1,795,891,050
大日本住友製薬	98,400	1,775.00	174,660,000
塩野義製薬	169,700	5,999.00	1,018,030,300
田辺三菱製薬	138,800	1,185.00	164,478,000
わかもと製薬	15,800	249.00	3,934,200
あすか製薬	16,400	1,084.00	17,777,600
日本新薬	34,700	9,090.00	315,423,000
ビオフェルミン製薬	2,300	2,172.00	4,995,600
中外製薬	138,400	8,400.00	1,162,560,000
科研製薬	22,700	5,010.00	113,727,000
エーザイ	158,800	5,491.00	871,970,800
ロート製薬	68,100	2,948.00	200,758,800
小野薬品工業	313,400	1,957.00	613,323,800
久光製薬	39,200	4,725.00	185,220,000
持田製薬	20,100	4,130.00	83,013,000
参天製薬	247,100	1,878.00	464,053,800
扶桑薬品工業	4,700	1,959.00	9,207,300
日本ケミファ	1,800	2,887.00	5,196,600
ツムラ	41,100	2,890.00	118,779,000

日医工	34,900	1,202.00	41,949,800
キッセイ薬品工業	23,500	2,601.00	61,123,500
生化学工業	25,700	1,131.00	29,066,700
栄研化学	23,300	1,633.00	38,048,900
日水製薬	5,600	1,167.00	6,535,200
鳥居薬品	8,300	2,885.00	23,945,500
JCRファーマ	9,400	8,280.00	77,832,000
東和薬品	19,100	2,504.00	47,826,400
富士製薬工業	9,000	1,317.00	11,853,000
沢井製薬	27,200	5,580.00	151,776,000
ゼリア新薬工業	26,300	1,898.00	49,917,400
第一三共	379,700	6,804.00	2,583,478,800
キョーリン製薬ホールディングス	29,300	1,789.00	52,417,700
大幸薬品	5,900	2,466.00	14,549,400
ダイト	7,700	3,020.00	23,254,000
大塚ホールディングス	252,800	4,040.00	1,021,312,000
大正製薬ホールディングス	28,100	7,850.00	220,585,000
ペプチドリーム	67,100	5,130.00	344,223,000
日本コークス工業	112,100	82.00	9,192,200
ニチレキ	17,000	1,104.00	18,768,000
ユシロ化学工業	6,900	1,337.00	9,225,300
ビーピー・カストロール	4,700	1,428.00	6,711,600
富士石油	32,200	248.00	7,985,600
MORESCO	4,800	1,330.00	6,384,000
出光興産	153,200	3,055.00	468,026,000
JXTGホールディングス	2,195,300	492.40	1,080,965,720
コスモエネルギーホールディングス	38,400	2,225.00	85,440,000
横浜ゴム	76,800	2,161.00	165,964,800
TOYO TIRE	76,200	1,366.00	104,089,200
ブリヂストン	407,900	4,184.00	1,706,653,600
住友ゴム工業	119,200	1,282.00	152,814,400
藤倉コンポジット	11,600	431.00	4,999,600
オカモト	8,900	3,970.00	35,333,000
フコク	5,800	698.00	4,048,400
ニッタ	15,000	2,877.00	43,155,000
住友理工	25,700	863.00	22,179,100
三ツ星ベルト	17,500	1,772.00	31,010,000
バンドー化学	25,300	824.00	20,847,200
日東紡績	19,800	3,325.00	65,835,000
AGC	131,200	3,350.00	439,520,000
日本板硝子	63,500	646.00	41,021,000
石塚硝子	2,200	2,010.00	4,422,000

日本山村硝子	5,500	1,269.00	6,979,500
日本電気硝子	53,300	2,404.00	128,133,200
オハラ	5,300	1,492.00	7,907,600
住友大阪セメント	26,800	4,625.00	123,950,000
太平洋セメント	83,800	2,891.00	242,265,800
日本ヒューム	13,400	769.00	10,304,600
日本コンクリート工業	28,700	268.00	7,691,600
三谷セキサン	6,200	3,245.00	20,119,000
アジアパイルホールディングス	18,900	515.00	9,733,500
東海カーボン	139,100	1,087.00	151,201,700
日本カーボン	6,800	3,815.00	25,942,000
東洋炭素	7,800	2,323.00	18,119,400
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	3,975.00	31,800,000
TOTO	102,100	4,045.00	412,994,500
日本碍子	162,000	1,539.00	249,318,000
日本特殊陶業	111,900	2,058.00	230,290,200
MARUWA	4,600	6,930.00	31,878,000
品川リフラクトリーズ	3,500	2,637.00	9,229,500
黒崎播磨	2,600	5,650.00	14,690,000
ヨータイ	11,700	580.00	6,786,000
イソライト工業	6,900	437.00	3,015,300
東京窯業	17,000	291.00	4,947,000
ニッカトー	6,100	659.00	4,019,900
フジインコーポレーテッド	11,800	2,536.00	29,924,800
クニミネ工業	6,000	938.00	5,628,000
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,026.00	2,667,600
ニチアス	36,300	1,912.00	69,405,600
ニチハ	18,500	2,950.00	54,575,000
日本製鉄	609,800	1,505.50	918,053,900
神戸製鋼所	240,300	576.00	138,412,800
中山製鋼所	18,300	438.00	8,015,400
合同製鐵	6,400	2,118.00	13,555,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	354,400	1,300.00	460,720,000
東京製鐵	70,300	828.00	58,208,400
共英製鋼	14,800	2,023.00	29,940,400
大和工業	27,900	2,680.00	74,772,000
東京鐵鋼	5,400	1,342.00	7,246,800
大阪製鐵	8,700	1,325.00	11,527,500
淀川製鋼所	17,700	2,014.00	35,647,800
丸一鋼管	46,500	2,853.00	132,664,500
モリ工業	4,000	2,012.00	8,048,000
大同特殊鋼	21,500	4,235.00	91,052,500

日本高周波鋼業	5,000	414.00	2,070,000
日本冶金工業	10,880	2,165.00	23,555,200
山陽特殊製鋼	16,600	1,439.00	23,887,400
愛知製鋼	7,400	3,070.00	22,718,000
日立金属	141,400	1,166.00	164,872,400
日本金属	3,000	810.00	2,430,000
大太平洋金属	8,900	2,241.00	19,944,900
新日本電工	84,800	167.00	14,161,600
栗本鐵工所	6,700	1,505.00	10,083,500
虹技	2,000	1,292.00	2,584,000
三菱製鋼	9,800	1,108.00	10,858,400
日亜鋼業	19,400	300.00	5,820,000
日本精線	1,900	2,392.00	4,544,800
エンビプロ・ホールディングス	5,000	670.00	3,350,000
シンニッタン	20,500	439.00	8,999,500
新家工業	3,000	1,467.00	4,401,000
大紀アルミニウム工業所	21,800	707.00	15,412,600
日本軽金属ホールディングス	358,300	194.00	69,510,200
三井金属鉱業	35,500	2,553.00	90,631,500
東邦亜鉛	7,300	1,999.00	14,592,700
三菱マテリアル	86,700	2,915.00	252,730,500
住友金属鉱山	179,800	3,347.00	601,790,600
D O W Aホールディングス	30,700	3,690.00	113,283,000
古河機械金属	21,800	1,453.00	31,675,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,200	1,759.00	26,736,800
東邦チタニウム	23,700	826.00	19,576,200
U A C J	20,000	1,814.00	36,280,000
C Kサンエツ	2,500	2,837.00	7,092,500
古河電気工業	37,900	2,599.00	98,502,100
住友電気工業	490,800	1,371.00	672,886,800
フジクラ	158,800	414.00	65,743,200
昭和電線ホールディングス	15,200	868.00	13,193,600
東京特殊電線	1,800	1,956.00	3,520,800
タツタ電線	26,300	462.00	12,150,600
カナレ電気	2,200	1,918.00	4,219,600
平河ヒューテック	5,600	1,066.00	5,969,600
リョービ	16,200	1,807.00	29,273,400
アーレスティ	16,400	555.00	9,102,000
アサヒホールディングス	24,700	2,226.00	54,982,200
稲葉製作所	7,400	1,433.00	10,604,200
宮地エンジニアリンググループ	4,000	1,624.00	6,496,000
トーカロ	33,900	894.00	30,306,600

アルファCo	4,600	1,206.00	5,547,600
SUMCO	157,100	1,450.00	227,795,000
川田テクノロジーズ	2,900	6,960.00	20,184,000
RS Technologies	3,700	3,510.00	12,987,000
信和	6,900	1,018.00	7,024,200
東洋製罐グループホールディングス	83,600	1,676.00	140,113,600
ホッカンホールディングス	6,700	1,521.00	10,190,700
コロナ	7,300	1,059.00	7,730,700
横河ブリッジホールディングス	24,400	1,621.00	39,552,400
駒井ハルテック	2,500	1,644.00	4,110,000
高田機工	1,200	2,508.00	3,009,600
三和ホールディングス	135,600	1,208.00	163,804,800
文化シャッター	38,700	924.00	35,758,800
三協立山	18,200	1,250.00	22,750,000
アルインコ	10,400	927.00	9,640,800
東洋シャッター	3,200	702.00	2,246,400
LIXILグループ	193,600	1,900.00	367,840,000
日本フィルコン	10,100	502.00	5,070,200
ノーリツ	27,200	1,253.00	34,081,600
長府製作所	13,400	2,391.00	32,039,400
リンナイ	23,400	7,260.00	169,884,000
ダイニチ工業	7,100	631.00	4,480,100
日東精工	18,200	568.00	10,337,600
三洋工業	1,800	1,853.00	3,335,400
岡部	26,600	857.00	22,796,200
ジーテクト	14,500	1,677.00	24,316,500
東プレ	24,500	1,704.00	41,748,000
高周波熱錬	25,300	849.00	21,479,700
東京製綱	8,000	1,010.00	8,080,000
サンコール	7,400	460.00	3,404,000
モリテック スチール	10,300	344.00	3,543,200
パイオラックス	21,000	1,850.00	38,850,000
エイチワン	12,900	634.00	8,178,600
日本発條	130,800	824.00	107,779,200
中央発條	1,600	2,787.00	4,459,200
アドバネクス	1,700	1,641.00	2,789,700
立川ブラインド工業	5,800	1,374.00	7,969,200
三益半導体工業	11,700	1,734.00	20,287,800
日本ドライケミカル	3,700	1,130.00	4,181,000
日本製鋼所	39,900	2,076.00	82,832,400
三浦工業	56,800	3,010.00	170,968,000
タクマ	48,000	1,225.00	58,800,000

ツガミ	29,600	915.00	27,084,000
オークマ	16,700	5,850.00	97,695,000
東芝機械	14,900	2,236.00	33,316,400
アマダホールディングス	197,300	1,164.00	229,657,200
アイダエンジニアリング	35,600	873.00	31,078,800
滝澤鉄工所	4,200	1,286.00	5,401,200
F U J I	52,500	1,605.00	84,262,500
牧野フライス製作所	15,400	4,700.00	72,380,000
オーエスジー	60,700	2,234.00	135,603,800
ダイジェット工業	1,600	1,638.00	2,620,800
旭ダイヤモンド工業	34,600	616.00	21,313,600
D M G 森精機	83,100	1,531.00	127,226,100
ソディック	31,000	772.00	23,932,000
ディスコ	17,800	20,460.00	364,188,000
日東工器	7,200	2,113.00	15,213,600
日進工具	3,900	1,950.00	7,605,000
パンチ工業	9,400	492.00	4,624,800
富士ダイス	6,000	618.00	3,708,000
豊和工業	7,400	753.00	5,572,200
O K K	5,500	711.00	3,910,500
東洋機械金属	9,600	570.00	5,472,000
津田駒工業	2,600	1,319.00	3,429,400
エンシュウ	3,500	1,092.00	3,822,000
島精機製作所	18,100	2,477.00	44,833,700
オプトラン	14,700	3,060.00	44,982,000
N C ホールディングス	4,500	479.00	2,155,500
イワキポンプ	5,700	972.00	5,540,400
フリー	10,600	919.00	9,741,400
ヤマシンフィルタ	23,000	834.00	19,182,000
日阪製作所	16,300	864.00	14,083,200
やまびこ	25,500	1,137.00	28,993,500
平田機工	6,200	7,040.00	43,648,000
ペガサスミシン製造	12,500	493.00	6,162,500
マルマエ	5,500	986.00	5,423,000
タツモ	6,200	1,087.00	6,739,400
ナプテスコ	77,400	3,345.00	258,903,000
三井海洋開発	14,000	2,629.00	36,806,000
レオン自動機	12,900	1,559.00	20,111,100
S M C	38,900	46,100.00	1,793,290,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	10,200	408.00	4,161,600
ホソカワミクロン	4,600	3,745.00	17,227,000
ユニオンツール	4,900	3,145.00	15,410,500



オイレス工業	18,400	1,574.00	28,961,600
日精エー・エス・ピー機械	4,500	3,390.00	15,255,000
サトーホールディングス	15,900	2,918.00	46,396,200
技研製作所	11,500	3,420.00	39,330,000
日本エアーテック	4,300	600.00	2,580,000
カワタ	3,700	938.00	3,470,600
日精樹脂工業	11,100	1,001.00	11,111,100
オカダアイヨン	4,600	1,201.00	5,524,600
ワイエイシイホールディングス	5,200	675.00	3,510,000
小松製作所	600,900	2,475.00	1,487,227,500
住友重機械工業	76,000	3,200.00	243,200,000
日立建機	53,200	2,605.00	138,586,000
日工	18,500	666.00	12,321,000
巴工業	5,700	2,362.00	13,463,400
井関農機	13,300	1,467.00	19,511,100
TOWA	11,500	854.00	9,821,000
丸山製作所	3,000	1,202.00	3,606,000
北川鉄工所	6,000	1,895.00	11,370,000
ローツェ	5,900	2,570.00	15,163,000
タカキタ	4,800	546.00	2,620,800
クボタ	711,000	1,634.50	1,162,129,500
荏原実業	3,400	2,000.00	6,800,000
三菱化工機	4,600	1,858.00	8,546,800
月島機械	26,400	1,386.00	36,590,400
帝国電機製作所	9,300	1,177.00	10,946,100
新東工業	31,600	971.00	30,683,600
澁谷工業	11,600	2,888.00	33,500,800
アイチ コーポレーション	23,100	690.00	15,939,000
小森コーポレーション	33,700	1,139.00	38,384,300
鶴見製作所	10,400	2,010.00	20,904,000
住友精密工業	2,200	3,075.00	6,765,000
日本ギア工業	4,200	426.00	1,789,200
酒井重工業	2,500	2,830.00	7,075,000
荏原製作所	58,900	2,877.00	169,455,300
石井鐵工所	2,100	2,217.00	4,655,700
西島製作所	13,700	976.00	13,371,200
北越工業	13,800	1,243.00	17,153,400
ダイキン工業	181,200	14,180.00	2,569,416,000
オルガノ	4,800	4,790.00	22,992,000
トーヨーカネツ	5,100	1,927.00	9,827,700
栗田工業	71,900	2,893.00	208,006,700
椿本チエイン	17,400	3,455.00	60,117,000

大同工業	6,400	801.00	5,126,400
木村化工機	11,300	379.00	4,282,700
アネスト岩田	20,800	948.00	19,718,400
ダイフク	73,100	5,570.00	407,167,000
サムコ	3,800	878.00	3,336,400
加藤製作所	6,800	1,891.00	12,858,800
油研工業	2,300	1,618.00	3,721,400
タダノ	64,100	1,029.00	65,958,900
フジテック	48,300	1,392.00	67,233,600
C K D	37,000	1,284.00	47,508,000
キトー	10,100	1,549.00	15,644,900
平和	37,100	2,225.00	82,547,500
理想科学工業	11,800	1,647.00	19,434,600
S A N K Y O	33,300	3,715.00	123,709,500
日本金銭機械	14,800	916.00	13,556,800
マースグループホールディングス	8,500	1,905.00	16,192,500
福島工業	8,200	3,135.00	25,707,000
オーイズミ	5,800	478.00	2,772,400
ダイコク電機	6,200	1,552.00	9,622,400
竹内製作所	22,300	1,677.00	37,397,100
アマノ	37,900	3,290.00	124,691,000
J U K I	18,500	903.00	16,705,500
蛇の目ミシン工業	12,400	402.00	4,984,800
マックス	20,300	1,811.00	36,763,300
グローリー	36,800	3,030.00	111,504,000
新晃工業	12,400	1,743.00	21,613,200
大和冷機工業	19,300	1,106.00	21,345,800
セガサミーホールディングス	131,700	1,512.00	199,130,400
日本ピストンリング	4,900	1,264.00	6,193,600
リケン	6,200	3,740.00	23,188,000
T P R	17,900	1,721.00	30,805,900
ツバキ・ナカシマ	27,100	1,617.00	43,820,700
ホシザキ	38,800	8,490.00	329,412,000
大豊工業	10,800	770.00	8,316,000
日本精工	272,700	910.00	248,157,000
N T N	285,600	310.00	88,536,000
ジェイテクト	127,400	1,239.00	157,848,600
不二越	12,300	4,840.00	59,532,000
日本トムソン	39,600	450.00	17,820,000
T H K	77,300	2,833.00	218,990,900
ユーシン精機	10,400	942.00	9,796,800
前澤給装工業	5,200	1,997.00	10,384,400

イーグル工業	16,500	986.00	16,269,000
前澤工業	9,200	351.00	3,229,200
日本ピラー工業	13,500	1,206.00	16,281,000
キット	53,900	719.00	38,754,100
マキタ	161,600	3,400.00	549,440,000
日立造船	105,500	351.00	37,030,500
三菱重工業	222,400	4,232.00	941,196,800
I H I	102,000	2,348.00	239,496,000
スター精密	20,800	1,531.00	31,844,800
日清紡ホールディングス	88,600	842.00	74,601,200
イビデン	81,500	2,175.00	177,262,500
コニカミノルタ	290,600	752.00	218,531,200
ブラザー工業	173,100	1,956.00	338,583,600
ミネベアミツミ	246,600	1,711.00	421,932,600
日立製作所	597,400	4,023.00	2,403,340,200
三菱電機	1,327,100	1,432.50	1,901,070,750
富士電機	86,200	3,305.00	284,891,000
東洋電機製造	5,300	1,477.00	7,828,100
安川電機	153,900	3,965.00	610,213,500
シンフォニアテクノロジー	18,500	1,197.00	22,144,500
明電舎	26,300	1,853.00	48,733,900
オリジン	3,700	1,366.00	5,054,200
山洋電気	6,500	4,720.00	30,680,000
デンヨー	12,300	1,759.00	21,635,700
東芝テック	16,700	3,190.00	53,273,000
芝浦メカトロニクス	2,500	2,881.00	7,202,500
マブチモーター	36,800	4,025.00	148,120,000
日本電産	159,700	14,520.00	2,318,844,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,900	695.00	5,490,500
トレックス・セミコンダクター	6,300	1,228.00	7,736,400
東光高岳	7,200	1,131.00	8,143,200
ダイヘン	14,600	3,265.00	47,669,000
ヤーマン	19,900	705.00	14,029,500
JVCケンウッド	103,000	319.00	32,857,000
ミマキエンジニアリング	12,900	530.00	6,837,000
第一精工	5,000	2,626.00	13,130,000
日新電機	31,200	1,311.00	40,903,200
大崎電気工業	26,600	659.00	17,529,400
オムロン	141,100	5,910.00	833,901,000
日東工業	21,300	2,046.00	43,579,800
I D E C	17,900	1,961.00	35,101,900
正興電機製作所	3,800	786.00	2,986,800

不二電機工業	1,900	1,226.00	2,329,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,000	1,867.00	89,616,000
サクサホールディングス	3,400	1,846.00	6,276,400
メルコホールディングス	5,700	2,696.00	15,367,200
テクノメディカ	3,200	2,326.00	7,443,200
日本電気	171,700	4,560.00	782,952,000
富士通	127,900	8,655.00	1,106,974,500
沖電気工業	57,600	1,471.00	84,729,600
岩崎通信機	6,200	818.00	5,071,600
電気興業	7,000	3,050.00	21,350,000
サンケン電気	15,600	2,129.00	33,212,400
ナカヨ	2,700	1,621.00	4,376,700
アイホン	7,600	1,593.00	12,106,800
ルネサスエレクトロニクス	632,200	702.00	443,804,400
セイコーエプソン	164,700	1,520.00	250,344,000
ワコム	97,500	351.00	34,222,500
アルバック	26,500	4,340.00	115,010,000
アクセル	6,400	604.00	3,865,600
E I Z O	12,200	3,770.00	45,994,000
日本信号	33,900	1,206.00	40,883,400
京三製作所	28,800	368.00	10,598,400
能美防災	17,800	2,063.00	36,721,400
ホーチキ	8,700	1,477.00	12,849,900
星和電機	8,100	514.00	4,163,400
エレコム	12,700	4,240.00	53,848,000
パナソニック	1,516,100	875.60	1,327,497,160
シャープ	131,700	1,195.00	157,381,500
アンリツ	85,500	2,119.00	181,174,500
富士通ゼネラル	40,600	1,799.00	73,039,400
ソニー	890,600	6,347.00	5,652,638,200
T D K	69,500	9,670.00	672,065,000
帝国通信工業	6,300	1,135.00	7,150,500
タムラ製作所	51,400	577.00	29,657,800
アルプスアルパイン	138,400	2,017.00	279,152,800
池上通信機	4,200	1,066.00	4,477,200
鈴木	7,900	641.00	5,063,900
日本トリム	2,600	4,590.00	11,934,000
ローランド ディー . ジー .	7,600	1,997.00	15,177,200
フォスター電機	15,100	1,830.00	27,633,000
S M K	3,800	2,689.00	10,218,200
ヨコオ	9,600	2,952.00	28,339,200
ホシデン	39,500	1,106.00	43,687,000

ヒロセ電機	19,000	13,240.00	251,560,000
日本航空電子工業	30,500	1,531.00	46,695,500
TOA	14,300	1,222.00	17,474,600
マクセルホールディングス	28,900	1,543.00	44,592,700
古野電気	17,600	941.00	16,561,600
ユニデンホールディングス	4,000	1,863.00	7,452,000
スミダコーポレーション	10,700	1,000.00	10,700,000
アイコム	7,400	2,219.00	16,420,600
リオン	6,300	2,399.00	15,113,700
本多通信工業	12,300	495.00	6,088,500
横河電機	132,900	1,977.00	262,743,300
新電元工業	4,700	3,480.00	16,356,000
アズビル	83,800	2,889.00	242,098,200
東亜ディーケーケー	7,200	825.00	5,940,000
日本光電工業	58,700	3,175.00	186,372,500
チノー	4,700	1,367.00	6,424,900
共和電業	14,200	422.00	5,992,400
日本電子材料	5,500	500.00	2,750,000
堀場製作所	26,300	6,240.00	164,112,000
アドバンテスト	90,500	4,775.00	432,137,500
小野測器	6,500	530.00	3,445,000
エスベック	12,000	1,879.00	22,548,000
キーエンス	65,100	66,900.00	4,355,190,000
日置電機	7,100	3,645.00	25,879,500
シスメックス	103,500	7,232.00	748,512,000
日本マイクロニクス	23,700	864.00	20,476,800
メガチップス	10,700	1,652.00	17,676,400
OBARA GROUP	7,000	3,650.00	25,550,000
澤藤電機	1,900	1,786.00	3,393,400
原田工業	6,000	833.00	4,998,000
コーセル	16,700	1,025.00	17,117,500
イリソ電子工業	12,300	5,180.00	63,714,000
オブテックスグループ	22,100	1,606.00	35,492,600
千代田インテグレ	6,400	2,138.00	13,683,200
アイ・オー・データ機器	5,500	877.00	4,823,500
レーザーテック	27,300	6,760.00	184,548,000
スタンレー電気	93,800	2,856.00	267,892,800
岩崎電気	5,600	1,335.00	7,476,000
ウシオ電機	77,400	1,526.00	118,112,400
岡谷電機産業	10,800	366.00	3,952,800
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	554.00	7,257,400
エノモト	4,200	1,027.00	4,313,400

日本セラミック	13,600	2,724.00	37,046,400
遠藤照明	7,500	663.00	4,972,500
古河電池	10,300	606.00	6,241,800
双信電機	7,600	432.00	3,283,200
山一電機	10,000	1,220.00	12,200,000
図研	8,900	1,860.00	16,554,000
日本電子	26,400	2,563.00	67,663,200
カシオ計算機	117,500	1,675.00	196,812,500
ファナック	126,100	20,340.00	2,564,874,000
日本シイエムケイ	34,600	577.00	19,964,200
エンプラス	6,200	3,500.00	21,700,000
大真空	5,300	1,008.00	5,342,400
ローム	63,500	8,250.00	523,875,000
浜松ホトニクス	95,300	4,010.00	382,153,000
三井ハイテック	14,900	1,695.00	25,255,500
新光電気工業	45,100	920.00	41,492,000
京セラ	202,300	6,705.00	1,356,421,500
太陽誘電	59,200	2,629.00	155,636,800
村田製作所	417,800	5,185.00	2,166,293,000
双葉電子工業	21,400	1,323.00	28,312,200
北陸電気工業	5,500	1,031.00	5,670,500
ニチコン	42,300	984.00	41,623,200
日本ケミコン	9,400	1,588.00	14,927,200
K O A	20,400	1,328.00	27,091,200
市光工業	20,500	806.00	16,523,000
小糸製作所	79,600	5,280.00	420,288,000
ミツバ	25,200	630.00	15,876,000
S C R E E Nホールディングス	23,000	6,370.00	146,510,000
キャノン電子	14,200	1,833.00	26,028,600
キャノン	714,400	2,882.50	2,059,258,000
リコー	399,100	973.00	388,324,300
象印マホービン	39,200	1,427.00	55,938,400
M U T O Hホールディングス	2,100	1,664.00	3,494,400
東京エレクトロン	88,500	20,565.00	1,820,002,500
トヨタ紡織	46,700	1,511.00	70,563,700
芦森工業	3,000	1,391.00	4,173,000
ユニプレス	26,000	1,693.00	44,018,000
豊田自動織機	107,500	6,200.00	666,500,000
モリタホールディングス	23,400	1,693.00	39,616,200
三櫻工業	17,500	613.00	10,727,500
デンソー	292,300	4,749.00	1,388,132,700
東海理化電機製作所	35,200	1,826.00	64,275,200

三井E & Sホールディングス	47,900	948.00	45,409,200
川崎重工業	103,300	2,392.00	247,093,600
名村造船所	39,900	300.00	11,970,000
日本車輛製造	4,800	2,578.00	12,374,400
三菱ロジスネクスト	21,900	1,022.00	22,381,800
近畿車輛	2,000	1,369.00	2,738,000
日産自動車	1,565,000	674.10	1,054,966,500
いすゞ自動車	419,500	1,190.50	499,414,750
トヨタ自動車	1,478,800	7,216.00	10,671,020,800
日野自動車	165,700	890.00	147,473,000
三菱自動車工業	491,200	469.00	230,372,800
エフテック	9,900	685.00	6,781,500
レシップホールディングス	4,700	787.00	3,698,900
G M B	3,100	783.00	2,427,300
ファルテック	2,900	745.00	2,160,500
武蔵精密工業	32,500	1,371.00	44,557,500
日産車体	25,900	875.00	22,662,500
新明和工業	55,600	1,262.00	70,167,200
極東開発工業	26,400	1,297.00	34,240,800
日信工業	24,500	1,513.00	37,068,500
トピー工業	11,100	1,922.00	21,334,200
ティラド	5,000	1,761.00	8,805,000
タチエス	22,100	1,308.00	28,906,800
N O K	71,600	1,602.00	114,703,200
フタバ産業	37,500	751.00	28,162,500
K Y B	13,800	3,165.00	43,677,000
大同メタル工業	22,200	638.00	14,163,600
プレス工業	66,700	450.00	30,015,000
ミクニ	18,200	317.00	5,769,400
太平洋工業	28,100	1,579.00	44,369,900
ケーヒン	30,700	1,585.00	48,659,500
河西工業	16,800	772.00	12,969,600
アイシン精機	109,400	3,395.00	371,413,000
マツダ	416,500	959.50	399,631,750
今仙電機製作所	12,800	878.00	11,238,400
本田技研工業	1,119,500	2,798.50	3,132,920,750
スズキ	242,800	4,587.00	1,113,723,600
S U B A R U	412,000	3,040.00	1,252,480,000
安永	6,700	1,283.00	8,596,100
ヤマハ発動機	173,000	1,958.00	338,734,000
ショーワ	31,600	1,557.00	49,201,200
T B K	16,800	411.00	6,904,800

エクセディ	18,200	2,109.00	38,383,800
豊田合成	43,000	2,163.00	93,009,000
愛三工業	21,300	917.00	19,532,100
盟和産業	2,400	1,103.00	2,647,200
日本プラスト	11,000	689.00	7,579,000
ヨロズ	12,700	1,301.00	16,522,700
エフ・シー・シー	24,100	2,080.00	50,128,000
シマノ	49,700	16,280.00	809,116,000
テイ・エス テック	30,900	3,280.00	101,352,000
ジャムコ	6,900	1,523.00	10,508,700
テルモ	375,500	3,480.00	1,306,740,000
クリエートメディック	4,400	972.00	4,276,800
日機装	39,800	1,152.00	45,849,600
島津製作所	170,800	2,728.00	465,942,400
JMS	12,300	646.00	7,945,800
長野計器	10,500	680.00	7,140,000
ブイ・テクノロジー	6,200	5,250.00	32,550,000
東京計器	8,500	887.00	7,539,500
愛知時計電機	1,800	4,000.00	7,200,000
インターアクション	7,100	2,050.00	14,555,000
オーバル	13,100	242.00	3,170,200
東京精密	24,000	3,175.00	76,200,000
マニー	52,900	2,841.00	150,288,900
ニコン	231,300	1,348.00	311,792,400
トプコン	71,300	1,433.00	102,172,900
オリンパス	790,800	1,456.00	1,151,404,800
理研計器	11,700	2,076.00	24,289,200
タムロン	10,700	2,318.00	24,802,600
H O Y A	267,200	8,819.00	2,356,436,800
シード	5,700	898.00	5,118,600
ノーリツ鋼機	10,500	1,698.00	17,829,000
エー・アンド・デイ	12,100	720.00	8,712,000
朝日インテック	112,600	2,837.00	319,446,200
シチズン時計	145,300	528.00	76,718,400
リズム時計工業	4,500	1,027.00	4,621,500
大研医器	10,600	514.00	5,448,400
メニコン	18,200	3,790.00	68,978,000
シンシア	1,500	624.00	936,000
松風	6,500	1,478.00	9,607,000
セイコーホールディングス	20,500	2,386.00	48,913,000
ニプロ	91,900	1,213.00	111,474,700
中本パックス	3,700	1,438.00	5,320,600



スノーピーク	6,000	1,296.00	7,776,000
パラマウントベッドホールディングス	15,300	3,925.00	60,052,500
トランザクション	8,500	1,028.00	8,738,000
S H O - B I	3,900	379.00	1,478,100
ニホンフラッシュ	5,700	2,574.00	14,671,800
前田工織	14,600	1,526.00	22,279,600
永大産業	17,300	328.00	5,674,400
アートネイチャー	14,200	689.00	9,783,800
バンダイナムコホールディングス	137,200	6,730.00	923,356,000
アイフィスジャパン	3,400	797.00	2,709,800
共立印刷	22,100	157.00	3,469,700
S H O E I	6,400	4,530.00	28,992,000
フランスベッドホールディングス	18,800	1,010.00	18,988,000
パイロットコーポレーション	23,100	4,000.00	92,400,000
萩原工業	7,400	1,467.00	10,855,800
トッパン・フォームズ	28,400	1,022.00	29,024,800
フジシールインターナショナル	29,700	2,729.00	81,051,300
タカラトミー	55,500	1,235.00	68,542,500
廣済堂	12,300	715.00	8,794,500
エステールホールディングス	3,500	638.00	2,233,000
アーク	50,600	94.00	4,756,400
タカノ	5,200	775.00	4,030,000
プロネクサス	11,400	1,112.00	12,676,800
ホクシン	8,200	167.00	1,369,400
ウッドワン	4,500	1,051.00	4,729,500
大建工業	10,000	1,875.00	18,750,000
凸版印刷	197,200	1,912.00	377,046,400
大日本印刷	187,000	2,791.00	521,917,000
共同印刷	4,100	2,706.00	11,094,600
N I S S H A	27,200	1,071.00	29,131,200
光村印刷	1,200	1,767.00	2,120,400
宝印刷	6,400	1,670.00	10,688,000
アシックス	109,500	1,845.00	202,027,500
ツツミ	4,100	2,082.00	8,536,200
小松ウオール工業	4,000	1,931.00	7,724,000
ヤマハ	78,900	4,850.00	382,665,000
河合楽器製作所	4,100	2,901.00	11,894,100
クリナップ	12,300	539.00	6,629,700
ピジョン	80,200	4,455.00	357,291,000
兼松サステック	900	1,778.00	1,600,200
キングジム	11,000	840.00	9,240,000
リンテック	31,500	2,137.00	67,315,500

イトーキ	28,200	447.00	12,605,400
任天堂	75,900	40,020.00	3,037,518,000
三菱鉛筆	21,900	1,713.00	37,514,700
タカスタンダード	27,400	1,781.00	48,799,400
コクヨ	63,700	1,508.00	96,059,600
ナカバヤシ	13,000	520.00	6,760,000
グロープライド	6,400	2,789.00	17,849,600
オカムラ	46,300	1,053.00	48,753,900
美津濃	13,100	2,800.00	36,680,000
東京電力ホールディングス	1,059,300	529.00	560,369,700
中部電力	406,000	1,565.00	635,390,000
関西電力	541,500	1,208.50	654,402,750
中国電力	183,500	1,389.00	254,881,500
北陸電力	130,000	726.00	94,380,000
東北電力	310,800	1,054.00	327,583,200
四国電力	119,500	1,019.00	121,770,500
九州電力	273,500	1,020.00	278,970,000
北海道電力	124,200	569.00	70,669,800
沖縄電力	24,600	1,700.00	41,820,000
電源開発	105,600	2,465.00	260,304,000
エフオン	6,200	706.00	4,377,200
イーレックス	23,100	1,274.00	29,429,400
レノバ	21,800	914.00	19,925,200
東京瓦斯	255,200	2,724.50	695,292,400
大阪瓦斯	257,500	2,067.00	532,252,500
東邦瓦斯	65,700	4,130.00	271,341,000
北海道瓦斯	7,100	1,508.00	10,706,800
広島ガス	27,300	337.00	9,200,100
西部瓦斯	14,900	2,370.00	35,313,000
静岡ガス	37,700	916.00	34,533,200
メタウォーター	6,400	3,675.00	23,520,000
SBSホールディングス	11,500	1,566.00	18,009,000
東武鉄道	140,000	3,500.00	490,000,000
相鉄ホールディングス	45,500	2,823.00	128,446,500
東急	360,400	2,028.00	730,891,200
京浜急行電鉄	181,800	2,095.00	380,871,000
小田急電鉄	212,500	2,588.00	549,950,000
京王電鉄	74,100	6,730.00	498,693,000
京成電鉄	99,400	4,445.00	441,833,000
富士急行	18,100	4,480.00	81,088,000
新京成電鉄	3,400	2,095.00	7,123,000
東日本旅客鉄道	233,600	10,310.00	2,408,416,000

西日本旅客鉄道	118,300	9,131.00	1,080,197,300
東海旅客鉄道	118,800	22,220.00	2,639,736,000
西武ホールディングス	164,400	1,883.00	309,565,200
鴻池運輸	21,100	1,595.00	33,654,500
西日本鉄道	36,800	2,372.00	87,289,600
ハマキョウレックス	10,200	3,470.00	35,394,000
サカイ引越センター	7,000	6,200.00	43,400,000
近鉄グループホールディングス	125,700	5,630.00	707,691,000
阪急阪神ホールディングス	167,600	4,165.00	698,054,000
南海電気鉄道	56,100	2,735.00	153,433,500
京阪ホールディングス	56,000	4,805.00	269,080,000
神戸電鉄	3,200	3,970.00	12,704,000
名古屋鉄道	103,300	3,230.00	333,659,000
山陽電気鉄道	9,700	2,199.00	21,330,300
日本通運	48,500	5,510.00	267,235,000
ヤマトホールディングス	220,300	1,626.00	358,207,800
山九	34,900	5,610.00	195,789,000
丸運	7,200	258.00	1,857,600
丸全昭和運輸	10,200	3,010.00	30,702,000
センコーグループホールディングス	69,300	841.00	58,281,300
トナミホールディングス	3,000	4,605.00	13,815,000
ニッコンホールディングス	47,800	2,460.00	117,588,000
日本石油輸送	1,500	2,842.00	4,263,000
福山通運	16,100	3,790.00	61,019,000
セイノーホールディングス	94,100	1,352.00	127,223,200
エスライン	3,800	919.00	3,492,200
神奈川中央交通	3,100	3,850.00	11,935,000
日立物流	27,600	3,160.00	87,216,000
丸和運輸機関	13,200	2,681.00	35,389,200
C & F ロジホールディングス	12,700	1,235.00	15,684,500
九州旅客鉄道	105,500	3,445.00	363,447,500
S Gホールディングス	118,700	2,645.00	313,961,500
日本郵船	105,500	1,805.00	190,427,500
商船三井	74,800	2,730.00	204,204,000
川崎汽船	38,700	1,257.00	48,645,900
N S ユナイテッド海運	7,300	2,244.00	16,381,200
飯野海運	61,900	344.00	21,293,600
共栄タンカー	1,700	1,348.00	2,291,600
乾汽船	11,300	1,199.00	13,548,700
日本航空	230,100	3,212.00	739,081,200
A N A ホールディングス	229,700	3,634.00	834,729,800
パスコ	2,400	908.00	2,179,200

トランコム	3,500	6,250.00	21,875,000
日新	10,900	1,557.00	16,971,300
三菱倉庫	43,500	2,747.00	119,494,500
三井倉庫ホールディングス	15,400	1,673.00	25,764,200
住友倉庫	46,300	1,421.00	65,792,300
澁澤倉庫	6,900	1,895.00	13,075,500
東陽倉庫	22,700	321.00	7,286,700
日本トランスシティ	27,700	472.00	13,074,400
ケイヒン	2,400	1,252.00	3,004,800
中央倉庫	7,700	1,068.00	8,223,600
川西倉庫	2,600	1,083.00	2,815,800
安田倉庫	10,300	930.00	9,579,000
ファイズ	2,200	781.00	1,718,200
東洋埠頭	3,800	1,353.00	5,141,400
宇徳	10,700	491.00	5,253,700
上組	77,500	2,448.00	189,720,000
サンリツ	3,000	645.00	1,935,000
キムラユニティー	3,400	1,049.00	3,566,600
キューソー流通システム	3,100	1,888.00	5,852,800
近鉄エクスプレス	23,700	1,518.00	35,976,600
東海運	7,100	285.00	2,023,500
エーアイティー	8,100	953.00	7,719,300
内外トランスライン	4,400	1,314.00	5,781,600
日本コンセプト	4,000	1,302.00	5,208,000
N E C ネットズエスアイ	14,400	2,931.00	42,206,400
クロスキャット	3,700	1,033.00	3,822,100
システナ	46,600	1,606.00	74,839,600
デジタルアーツ	7,000	7,140.00	49,980,000
日鉄ソリューションズ	19,600	3,525.00	69,090,000
キューブシステム	7,300	763.00	5,569,900
エイジア	2,800	1,219.00	3,413,200
コア	5,700	1,392.00	7,934,400
ソリトンシステムズ	6,000	974.00	5,844,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,800	1,622.00	9,407,600
T I S	43,400	6,230.00	270,382,000
ネオス	5,200	847.00	4,404,400
電算システム	5,100	2,886.00	14,718,600
グリー	90,400	492.00	44,476,800
コーエーテクモホールディングス	26,700	2,347.00	62,664,900
三菱総合研究所	5,700	3,585.00	20,434,500
電算	1,600	2,049.00	3,278,400
A G S	7,800	691.00	5,389,800

ファインデックス	11,300	912.00	10,305,600
ブレインパッド	2,600	6,110.00	15,886,000
K L a b	25,000	1,257.00	31,425,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,500	1,053.00	18,427,500
イーブুকイニシアティブジャパン	2,200	1,801.00	3,962,200
ネクソン	369,500	1,311.00	484,414,500
アイスタイル	33,800	746.00	25,214,800
エムアップ	4,600	2,007.00	9,232,200
エイチーム	9,200	1,126.00	10,359,200
エニグモ	9,500	972.00	9,234,000
テクノスジャパン	11,500	514.00	5,911,000
コロプラ	42,900	1,783.00	76,490,700
ブロードリーフ	65,000	582.00	37,830,000
クロス・マーケティンググループ	6,500	348.00	2,262,000
デジタルハーツホールディングス	6,200	925.00	5,735,000
システム情報	6,900	980.00	6,762,000
メディアドゥホールディングス	4,700	3,800.00	17,860,000
じげん	18,900	572.00	10,810,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,100	741.00	1,556,100
サイバーリンクス	2,200	1,136.00	2,499,200
フィックスターズ	14,000	1,439.00	20,146,000
C A R T A H O L D I N G S	6,500	1,034.00	6,721,000
オブティム	5,800	2,768.00	16,054,400
セレス	4,500	1,274.00	5,733,000
ティーガイア	9,400	2,179.00	20,482,600
セック	2,200	2,995.00	6,589,000
日本アジアグループ	13,700	330.00	4,521,000
豆蔵ホールディングス	9,000	1,721.00	15,489,000
テクマトリックス	9,300	2,325.00	21,622,500
プロシップ	4,000	1,230.00	4,920,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	31,500	2,450.00	77,175,000
G M O ペイメントゲートウェイ	21,500	7,230.00	155,445,000
ザッパラス	7,500	396.00	2,970,000
システムリサーチ	3,600	1,930.00	6,948,000
インターネットイニシアティブ	21,300	2,455.00	52,291,500
さくらインターネット	15,900	604.00	9,603,600
ヴィンクス	3,900	1,222.00	4,765,800
G M O クラウド	2,500	2,669.00	6,672,500
S R A ホールディングス	7,000	2,392.00	16,744,000
M i n o r i ソリューションズ	2,700	1,873.00	5,057,100
システムインテグレータ	4,100	652.00	2,673,200
朝日ネット	11,000	675.00	7,425,000

e B A S E	8,000	1,022.00	8,176,000
アバント	4,800	2,072.00	9,945,600
アドソル日進	4,700	2,198.00	10,330,600
フリービット	8,000	916.00	7,328,000
コムチュア	14,800	2,034.00	30,103,200
サイバーコム	2,500	1,768.00	4,420,000
アステリア	9,000	668.00	6,012,000
アイル	2,400	2,718.00	6,523,200
マークラインズ	6,700	1,806.00	12,100,200
メディカル・データ・ビジョン	10,100	1,104.00	11,150,400
ショーケース	3,400	783.00	2,662,200
モバイルファクトリー	3,100	1,665.00	5,161,500
テラスカイ	2,200	1,845.00	4,059,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,861.00	10,979,900
P C Iホールディングス	2,800	2,052.00	5,745,600
パイプドHD	2,200	1,428.00	3,141,600
アイビーシー	2,600	1,022.00	2,657,200
ネオジャパン	2,700	1,026.00	2,770,200
P R T I M E S	1,200	2,865.00	3,438,000
ランドコンピュータ	2,200	1,070.00	2,354,000
ダブルスタンダード	1,200	4,840.00	5,808,000
オープンドア	6,600	2,175.00	14,355,000
マイネット	4,700	531.00	2,495,700
アカツキ	4,600	6,680.00	30,728,000
ベネフィットジャパン	1,100	1,721.00	1,893,100
U b i c o mホールディングス	2,600	1,450.00	3,770,000
L I N E	29,800	3,865.00	115,177,000
カナミックネットワーク	8,400	571.00	4,796,400
ノムラシステムコーポレーション	3,300	534.00	1,762,200
チェンジ	2,700	1,985.00	5,359,500
シンクロ・フード	6,100	486.00	2,964,600
オークネット	8,200	1,353.00	11,094,600
セグエグループ	1,300	1,393.00	1,810,900
エイトレッド	1,500	1,580.00	2,370,000
A O I T Y O H o l d i n g s	13,600	625.00	8,500,000
マクロミル	23,400	886.00	20,732,400
ビーグリー	2,800	928.00	2,598,400
オロ	3,500	2,843.00	9,950,500
テモナ	2,100	526.00	1,104,600
ニーズウェル	1,900	704.00	1,337,600
サインポスト	2,100	2,139.00	4,491,900
ソルクシーズ	5,800	931.00	5,399,800

フェイス	5,500	778.00	4,279,000
プロトコーポレーション	11,900	1,172.00	13,946,800
ハイマックス	1,700	1,847.00	3,139,900
野村総合研究所	248,600	2,151.00	534,738,600
サイバネットシステム	9,700	670.00	6,499,000
C Eホールディングス	8,000	443.00	3,544,000
日本システム技術	2,300	1,221.00	2,808,300
インテージホールディングス	16,500	934.00	15,411,000
東邦システムサイエンス	4,100	1,004.00	4,116,400
ソースネクスト	51,100	474.00	24,221,400
インフォコム	14,300	2,522.00	36,064,600
ラクスル	7,000	3,570.00	24,990,000
F I G	15,000	309.00	4,635,000
システムサポート	1,300	1,618.00	2,103,400
アルテリア・ネットワークス	14,600	1,454.00	21,228,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,680.00	5,208,000
フォーカスシステムズ	9,100	831.00	7,562,100
クレスコ	4,000	3,430.00	13,720,000
フジ・メディア・ホールディングス	135,300	1,391.00	188,202,300
オービック	45,200	12,320.00	556,864,000
ジャストシステム	18,600	4,090.00	76,074,000
T D C ソフト	11,700	794.00	9,289,800
ヤフー	849,900	304.00	258,369,600
トレンドマイクロ	57,900	5,140.00	297,606,000
I Dホールディングス	5,200	1,240.00	6,448,000
日本オラクル	26,400	9,370.00	247,368,000
アルファシステムズ	4,200	2,714.00	11,398,800
フューチャー	15,900	1,881.00	29,907,900
C A C Holdings	8,700	1,298.00	11,292,600
ソフトバンク・テクノロジー	5,700	1,962.00	11,183,400
トーセ	3,800	861.00	3,271,800
オービックビジネスコンサルタント	13,400	4,375.00	58,625,000
伊藤忠テクノソリューションズ	59,400	2,862.00	170,002,800
アイティフォー	16,100	820.00	13,202,000
東計電算	2,000	3,190.00	6,380,000
エクスネット	2,700	935.00	2,524,500
大塚商会	70,500	4,305.00	303,502,500
サイボウズ	15,500	1,014.00	15,717,000
ソフトブレーン	8,100	651.00	5,273,100
電通国際情報サービス	8,100	3,375.00	27,337,500
デジタルガレージ	25,400	3,435.00	87,249,000
E Mシステムズ	10,700	2,028.00	21,699,600

ウェザーニューズ	4,500	3,320.00	14,940,000	
C I J	10,000	831.00	8,310,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	3,045.00	4,263,000	
日本エンタープライズ	14,700	233.00	3,425,100	
WOWOW	6,300	2,619.00	16,499,700	
スカラ	9,400	977.00	9,183,800	
インテリジェント ウェイブ	5,200	807.00	4,196,400	
I M A G I C A G R O U P	11,600	507.00	5,881,200	
ネットワンシステムズ	46,200	2,913.00	134,580,600	
システムソフト	33,300	109.00	3,629,700	
アルゴグラフィックス	11,200	2,601.00	29,131,200	
マーベラス	20,200	833.00	16,826,600	
エイベックス	22,500	1,266.00	28,485,000	
日本ユニシス	40,700	3,480.00	141,636,000	
兼松エレクトロニクス	7,200	3,080.00	22,176,000	
東京放送ホールディングス	86,500	1,748.00	151,202,000	
日本テレビホールディングス	119,800	1,384.00	165,803,200	
朝日放送グループホールディングス	13,300	709.00	9,429,700	
テレビ朝日ホールディングス	35,900	1,695.00	60,850,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	86,300	437.00	37,713,100	
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,207.00	23,835,600	
日本BS放送	4,700	1,064.00	5,000,800	
ビジョン	12,300	1,562.00	19,212,600	
スマートバリュー	4,200	742.00	3,116,400	
ワイヤレスゲート	6,500	766.00	4,979,000	
コネクシオ	9,400	1,359.00	12,774,600	
クロップス	2,800	610.00	1,708,000	
日本電信電話	890,700	5,156.00	4,592,449,200	
K D D I	1,067,600	2,825.00	3,015,970,000	
ソフトバンク	1,380,800	1,464.00	2,021,491,200	
光通信	15,400	23,380.00	360,052,000	
N T T ドコモ	824,600	2,753.00	2,270,123,800	
エムティーアイ	13,000	704.00	9,152,000	
G M O インターネット	51,500	1,856.00	95,584,000	
ファイバーゲート	2,600	1,412.00	3,671,200	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	585.00	1,930,500	
K A D O K A W A	38,200	1,511.00	57,720,200	
学研ホールディングス	4,400	5,350.00	23,540,000	
ゼンリン	26,100	1,829.00	47,736,900	
昭文社	6,700	377.00	2,525,900	
インプレスホールディングス	10,800	142.00	1,533,600	
アイネット	7,600	1,331.00	10,115,600	



松竹	8,600	14,000.00	120,400,000
東宝	85,700	4,735.00	405,789,500
東映	5,500	15,320.00	84,260,000
エヌ・ティ・ティ・データ	346,900	1,394.00	483,578,600
ピー・シー・エー	1,700	3,865.00	6,570,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,300	2,690.00	6,187,000
D T S	29,200	2,248.00	65,641,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,600	5,250.00	318,150,000
シーイーシー	14,100	2,018.00	28,453,800
カプコン	55,900	2,863.00	160,041,700
アイ・エス・ビー	2,700	1,470.00	3,969,000
ジャステック	8,500	1,096.00	9,316,000
S C S K	34,400	5,070.00	174,408,000
日本システムウエア	4,400	2,389.00	10,511,600
アイネス	16,700	1,167.00	19,488,900
T K C	11,100	4,680.00	51,948,000
富士ソフト	16,700	4,565.00	76,235,500
N S D	21,500	3,105.00	66,757,500
コナミホールディングス	53,300	5,220.00	278,226,000
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,458.00	10,815,200
J B C Cホールディングス	10,400	1,535.00	15,964,000
ミロク情報サービス	13,000	2,948.00	38,324,000
ソフトバンクグループ	1,033,300	4,240.00	4,381,192,000
ハウスイ	1,100	823.00	905,300
高千穂交易	5,100	1,113.00	5,676,300
伊藤忠食品	3,200	4,395.00	14,064,000
エレマテック	12,200	993.00	12,114,600
J A L U X	3,700	2,360.00	8,732,000
あらた	9,700	3,965.00	38,460,500
トーメンデバイス	2,000	2,361.00	4,722,000
東京エレクトロン デバイス	4,800	2,027.00	9,729,600
フィールズ	11,400	504.00	5,745,600
双日	721,900	335.00	241,836,500
アルフレッサ ホールディングス	145,300	2,413.00	350,608,900
横浜冷凍	36,700	1,035.00	37,984,500
ラサ商事	7,000	840.00	5,880,000
ラクーンホールディングス	6,300	668.00	4,208,400
アルコニックス	13,900	1,257.00	17,472,300
神戸物産	22,600	5,240.00	118,424,000
あい ホールディングス	18,700	1,845.00	34,501,500
ディーブイエックス	5,200	862.00	4,482,400
ダイワボウホールディングス	11,900	4,480.00	53,312,000

マクニカ・富士エレホールディングス	36,300	1,388.00	50,384,400
ラクト・ジャパン	4,900	3,875.00	18,987,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,600	1,047.00	25,756,200
八洲電機	10,100	864.00	8,726,400
メディアスホールディングス	7,500	715.00	5,362,500
レスターホールディングス	14,300	1,751.00	25,039,300
ジュテックホールディングス	3,000	999.00	2,997,000
大光	5,600	680.00	3,808,000
OCHIホールディングス	3,800	1,276.00	4,848,800
TOKAIホールディングス	69,100	1,011.00	69,860,100
黒谷	3,000	435.00	1,305,000
Cominix	2,300	848.00	1,950,400
三洋貿易	6,600	2,128.00	14,044,800
ビューティガレージ	2,100	1,847.00	3,878,700
ウイン・パートナーズ	8,500	1,132.00	9,622,000
ミタチ産業	4,000	699.00	2,796,000
シップヘルスケアホールディングス	27,200	4,595.00	124,984,000
明治電機工業	4,100	1,347.00	5,522,700
デリカフーズホールディングス	4,600	714.00	3,284,400
スターティアホールディングス	2,600	542.00	1,409,200
コメダホールディングス	30,400	2,013.00	61,195,200
富士興産	5,100	700.00	3,570,000
協栄産業	1,600	1,363.00	2,180,800
小野建	11,700	1,314.00	15,373,800
南陽	2,700	1,602.00	4,325,400
佐島電機	9,700	806.00	7,818,200
エコートレーディング	3,000	519.00	1,557,000
伯東	9,000	1,172.00	10,548,000
コンドーテック	10,100	917.00	9,261,700
中山福	7,600	531.00	4,035,600
ナガイレーベン	18,900	2,288.00	43,243,200
三菱食品	14,400	2,705.00	38,952,000
松田産業	9,600	1,425.00	13,680,000
第一興商	19,500	4,990.00	97,305,000
メディバルホールディングス	141,100	2,406.00	339,486,600
SPK	2,800	2,560.00	7,168,000
萩原電気ホールディングス	4,800	2,680.00	12,864,000
アズワン	9,400	8,950.00	84,130,000
スズデン	4,600	1,314.00	6,044,400
尾家産業	4,200	1,277.00	5,363,400
シモジマ	8,000	1,115.00	8,920,000
ドウシシャ	12,300	1,704.00	20,959,200

小津産業	2,900	1,835.00	5,321,500
高速	7,800	1,329.00	10,366,200
たけびし	4,600	1,337.00	6,150,200
リックス	3,000	1,519.00	4,557,000
丸文	11,600	545.00	6,322,000
ハピネット	10,900	1,267.00	13,810,300
橋本総業ホールディングス	2,700	1,631.00	4,403,700
日本ライフライン	38,700	1,732.00	67,028,400
タカショー	6,400	461.00	2,950,400
エクセル	4,900	1,218.00	5,968,200
マルカ	4,600	2,085.00	9,591,000
I D O M	44,100	475.00	20,947,500
日本エム・ディ・エム	7,700	1,690.00	13,013,000
進和	7,700	2,160.00	16,632,000
エスケイジャパン	3,200	426.00	1,363,200
ダイトロン	5,500	1,312.00	7,216,000
シークス	16,600	1,467.00	24,352,200
田中商事	4,400	637.00	2,802,800
オーハシテクニカ	7,400	1,358.00	10,049,200
白銅	4,200	1,395.00	5,859,000
伊藤忠商事	914,200	2,231.00	2,039,580,200
丸紅	1,288,900	717.70	925,043,530
高島	2,100	1,604.00	3,368,400
長瀬産業	73,500	1,506.00	110,691,000
蝶理	8,400	1,705.00	14,322,000
豊田通商	145,900	3,485.00	508,461,500
三共生興	22,300	513.00	11,439,900
兼松	52,200	1,214.00	63,370,800
ツカモトコーポレーション	2,300	1,048.00	2,410,400
三井物産	1,076,800	1,768.00	1,903,782,400
日本紙パルプ商事	7,400	3,765.00	27,861,000
日立ハイテクノロジーズ	39,700	6,240.00	247,728,000
カメイ	17,100	1,090.00	18,639,000
東都水産	1,800	2,565.00	4,617,000
O U G ホールディングス	2,100	2,752.00	5,779,200
スターゼン	4,800	4,295.00	20,616,000
山善	51,100	940.00	48,034,000
椿本興業	3,000	3,755.00	11,265,000
住友商事	773,000	1,688.00	1,304,824,000
内田洋行	5,600	3,910.00	21,896,000
三菱商事	917,200	2,651.00	2,431,497,200
第一実業	5,900	3,105.00	18,319,500

キヤノンマーケティングジャパン	37,400	2,294.00	85,795,600
西華産業	7,400	1,325.00	9,805,000
佐藤商事	11,700	820.00	9,594,000
菱洋エレクトロ	13,300	1,849.00	24,591,700
東京産業	13,100	494.00	6,471,400
ユアサ商事	13,400	3,080.00	41,272,000
神鋼商事	2,900	2,366.00	6,861,400
小林産業	7,900	283.00	2,235,700
阪和興業	22,700	2,954.00	67,055,800
正栄食品工業	8,500	3,270.00	27,795,000
カナデン	11,800	1,279.00	15,092,200
菱電商事	10,400	1,506.00	15,662,400
フルサト工業	7,200	1,440.00	10,368,000
岩谷産業	29,000	3,650.00	105,850,000
すてきナイスグループ	5,600	676.00	3,785,600
昭光通商	4,200	634.00	2,662,800
ニチモウ	2,000	1,848.00	3,696,000
極東貿易	4,000	1,740.00	6,960,000
イワキ	17,200	479.00	8,238,800
三愛石油	35,100	1,061.00	37,241,100
稲畑産業	31,400	1,328.00	41,699,200
G S I クレオス	3,500	1,057.00	3,699,500
明和産業	12,100	506.00	6,122,600
クワザワ	4,700	534.00	2,509,800
ワキタ	27,900	1,062.00	29,629,800
東邦ホールディングス	38,700	2,501.00	96,788,700
サンゲツ	38,500	2,032.00	78,232,000
ミツウロコグループホールディングス	17,400	1,049.00	18,252,600
シナネンホールディングス	5,400	1,833.00	9,898,200
伊藤忠エネクス	28,900	821.00	23,726,900
サンリオ	40,400	2,081.00	84,072,400
サンワテクノス	8,000	863.00	6,904,000
リョーサン	14,400	2,744.00	39,513,600
新光商事	24,600	929.00	22,853,400
トーホー	5,900	1,858.00	10,962,200
三信電気	9,000	1,506.00	13,554,000
東陽テクニカ	15,100	1,073.00	16,202,300
モスフードサービス	17,200	2,474.00	42,552,800
加賀電子	13,000	1,933.00	25,129,000
ソーダニッカ	13,500	544.00	7,344,000
立花エレテック	9,700	1,640.00	15,908,000
フォーバル	5,700	977.00	5,568,900

PAL TAC	23,600	5,280.00	124,608,000
三谷産業	15,400	299.00	4,604,600
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,455.00	8,292,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,319.00	1,450,900
国際紙パルプ商事	30,600	308.00	9,424,800
ヤマタネ	6,600	1,355.00	8,943,000
丸紅建材リース	1,300	1,681.00	2,185,300
日鉄物産	9,300	4,225.00	39,292,500
泉州電業	4,000	2,817.00	11,268,000
トラスコ中山	27,200	2,522.00	68,598,400
オートバックスセブン	52,000	1,768.00	91,936,000
モリト	9,600	788.00	7,564,800
加藤産業	20,400	3,350.00	68,340,000
北恵	2,500	1,034.00	2,585,000
イノテック	7,800	869.00	6,778,200
イエローハット	24,700	1,592.00	39,322,400
J Kホールディングス	11,900	490.00	5,831,000
日伝	10,900	2,017.00	21,985,300
北沢産業	9,900	262.00	2,593,800
杉本商事	7,100	1,907.00	13,539,700
因幡電機産業	18,600	4,720.00	87,792,000
東テク	4,300	2,154.00	9,262,200
ミスミグループ本社	163,700	2,543.00	416,289,100
アルテック	10,500	202.00	2,121,000
タキヒヨー	4,000	1,820.00	7,280,000
蔵王産業	2,200	1,389.00	3,055,800
スズケン	59,600	5,800.00	345,680,000
ジェコス	9,000	856.00	7,704,000
グローセル	12,100	422.00	5,106,200
ローソン	33,100	5,530.00	183,043,000
サンエー	9,900	4,765.00	47,173,500
カワチ薬品	10,200	2,084.00	21,256,800
エービーシー・マート	20,400	6,870.00	140,148,000
ハードオフコーポレーション	5,400	735.00	3,969,000
アスクル	13,700	2,919.00	39,990,300
ゲオホールディングス	20,000	1,283.00	25,660,000
アダストリア	18,200	2,429.00	44,207,800
ジーフット	8,100	617.00	4,997,700
くら寿司	6,900	4,475.00	30,877,500
キャンドウ	6,300	1,623.00	10,224,900
パルグループホールディングス	6,700	3,340.00	22,378,000
エディオン	55,500	1,043.00	57,886,500

サーラコーポレーション	26,800	602.00	16,133,600
ワッツ	6,000	617.00	3,702,000
ハローズ	5,000	2,337.00	11,685,000
フジオフードシステム	5,600	2,920.00	16,352,000
あみやき亭	2,900	3,460.00	10,034,000
ひらまつ	26,500	339.00	8,983,500
大黒天物産	3,200	3,410.00	10,912,000
ハニーズホールディングス	11,600	1,459.00	16,924,400
ファーマライズホールディングス	3,300	590.00	1,947,000
アルペン	10,100	1,702.00	17,190,200
ハブ	4,300	1,293.00	5,559,900
クオールホールディングス	19,300	1,435.00	27,695,500
ジinzホールディングス	6,900	6,410.00	44,229,000
ビックカメラ	77,600	1,137.00	88,231,200
D C Mホールディングス	70,700	1,060.00	74,942,000
ペッパーフードサービス	10,500	1,567.00	16,453,500
MonotaRO	93,000	2,826.00	262,818,000
東京一番フーズ	3,600	608.00	2,188,800
DDホールディングス	5,800	1,512.00	8,769,600
きちりホールディングス	3,700	769.00	2,845,300
アークランドサービスホールディングス	9,600	1,940.00	18,624,000
J.フロント リテイリング	167,300	1,264.00	211,467,200
ドトール・日レスホールディングス	23,000	2,142.00	49,266,000
マツモトキヨシホールディングス	54,100	3,955.00	213,965,500
ブロンコビリー	6,900	2,320.00	16,008,000
Z O Z O	141,300	2,492.00	352,119,600
トレジャー・ファクトリー	3,900	1,352.00	5,272,800
物語コーポレーション	3,200	10,080.00	32,256,000
ココカラファイン	14,700	5,820.00	85,554,000
三越伊勢丹ホールディングス	244,800	862.00	211,017,600
H a m e e	4,100	1,090.00	4,469,000
ウエルシアホールディングス	34,600	5,440.00	188,224,000
クリエイトSDホールディングス	19,300	2,520.00	48,636,000
丸善C H Iホールディングス	15,300	373.00	5,706,900
ティーライフ	1,900	835.00	1,586,500
エー・ピーカンパニー	2,700	549.00	1,482,300
チムニー	4,000	2,388.00	9,552,000
シュッピン	9,000	1,073.00	9,657,000
ネクステージ	18,700	1,156.00	21,617,200
ジョイフル本田	38,400	1,387.00	53,260,800
鳥貴族	4,400	2,425.00	10,670,000
キリン堂ホールディングス	5,200	2,109.00	10,966,800

ホットランド	7,900	1,147.00	9,061,300
すかいらーくホールディングス	146,500	1,966.00	288,019,000
SFPホールディングス	5,600	2,160.00	12,096,000
綿半ホールディングス	4,900	1,975.00	9,677,500
ヨシックス	2,200	3,160.00	6,952,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,100	962.00	36,652,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	686.00	4,253,200
B E E N O S	4,700	1,247.00	5,860,900
あさひ	10,900	1,189.00	12,960,100
日本調剤	4,700	3,715.00	17,460,500
コスモス薬品	5,800	21,150.00	122,670,000
トーエル	6,500	743.00	4,829,500
オンリー	2,400	817.00	1,960,800
セブン&アイ・ホールディングス	547,900	4,132.00	2,263,922,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	35,200	1,760.00	61,952,000
ツルハホールディングス	28,400	11,770.00	334,268,000
サンマルクホールディングス	10,400	2,379.00	24,741,600
フェリシモ	3,000	991.00	2,973,000
トリドールホールディングス	16,200	2,432.00	39,398,400
T O K Y O B A S E	12,000	787.00	9,444,000
ウイルプラスホールディングス	2,200	748.00	1,645,600
ジャパンミート	6,700	2,252.00	15,088,400
サツドラホールディングス	2,000	1,762.00	3,524,000
デファクトスタンダード	1,600	333.00	532,800
アレンザホールディングス	7,200	762.00	5,486,400
串カツ田中ホールディングス	2,100	2,252.00	4,729,200
パロックジャパンリミテッド	10,700	1,018.00	10,892,600
クスリのアオキホールディングス	13,000	7,360.00	95,680,000
力の源ホールディングス	5,100	798.00	4,069,800
スシローグローバルホールディングス	14,400	7,270.00	104,688,000
L I X I L ビバ	11,100	1,624.00	18,026,400
メディカルシステムネットワーク	14,200	512.00	7,270,400
はるやまホールディングス	6,300	817.00	5,147,100
ノジマ	23,300	1,812.00	42,219,600
カップ・クリエイト	18,300	1,416.00	25,912,800
ライトオン	9,800	650.00	6,370,000
良品計画	185,200	2,018.00	373,733,600
三城ホールディングス	16,700	292.00	4,876,400
アドヴァン	20,100	1,151.00	23,135,100
アルビス	5,000	2,339.00	11,695,000
コナカ	15,700	414.00	6,499,800

ハウス オブ ローゼ	1,700	1,630.00	2,771,000
G - 7ホールディングス	3,900	3,045.00	11,875,500
イオン北海道	13,400	751.00	10,063,400
コジマ	22,800	488.00	11,126,400
ヒマラヤ	4,800	824.00	3,955,200
コーナン商事	17,200	2,386.00	41,039,200
エコス	4,900	1,684.00	8,251,600
ワタミ	17,300	1,355.00	23,441,500
マルシェ	3,600	772.00	2,779,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	313,200	1,805.00	565,326,000
西松屋チェーン	28,800	920.00	26,496,000
ゼンショーホールディングス	63,600	2,330.00	148,188,000
幸楽苑ホールディングス	8,400	2,344.00	19,689,600
ハークスレイ	2,900	1,064.00	3,085,600
サイゼリヤ	21,600	2,777.00	59,983,200
V Tホールディングス	59,400	444.00	26,373,600
魚力	3,700	1,516.00	5,609,200
フジ・コーポレーション	3,500	2,167.00	7,584,500
ユナイテッドアローズ	15,000	3,160.00	47,400,000
ハイデイ日高	18,900	2,087.00	39,444,300
京都きもの友禅	8,700	351.00	3,053,700
コロワイド	43,500	1,997.00	86,869,500
ピーシーデポコーポレーション	17,600	491.00	8,641,600
壱番屋	9,200	5,080.00	46,736,000
P L A N T	3,500	715.00	2,502,500
スギホールディングス	28,700	5,850.00	167,895,000
薬王堂ホールディングス	5,700	2,706.00	15,424,200
スクロール	20,500	322.00	6,601,000
ヨンドシーホールディングス	14,600	2,626.00	38,339,600
ファミリーマート	146,200	2,633.00	384,944,600
木曽路	16,100	2,722.00	43,824,200
S R Sホールディングス	15,500	1,020.00	15,810,000
タカキュー	11,000	176.00	1,936,000
ケーヨー	24,500	492.00	12,054,000
上新電機	15,500	2,139.00	33,154,500
日本瓦斯	20,700	3,045.00	63,031,500
ロイヤルホールディングス	22,900	2,731.00	62,539,900
いなげや	14,700	1,568.00	23,049,600
島忠	27,700	2,639.00	73,100,300
チヨダ	13,800	1,691.00	23,335,800
ライフコーポレーション	10,000	2,154.00	21,540,000
リンガーハット	16,200	2,578.00	41,763,600



MrMaxHD	18,300	455.00	8,326,500
テンアライド	12,000	432.00	5,184,000
AOKIホールディングス	26,300	1,039.00	27,325,700
オークワ	18,800	1,213.00	22,804,400
コメリ	20,200	2,182.00	44,076,400
青山商事	22,900	1,882.00	43,097,800
しまむら	15,200	8,560.00	130,112,000
はせがわ	7,300	400.00	2,920,000
高島屋	102,700	1,259.00	129,299,300
松屋	26,500	833.00	22,074,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,200	1,181.00	79,363,200
近鉄百貨店	5,000	3,140.00	15,700,000
パルコ	12,700	1,271.00	16,141,700
丸井グループ	110,600	2,282.00	252,389,200
アクシアル リテイリング	10,900	3,930.00	42,837,000
イオン	503,000	1,980.50	996,191,500
イズミ	26,600	4,230.00	112,518,000
平和堂	26,600	2,028.00	53,944,800
フジ	15,900	1,876.00	29,828,400
ヤオコー	14,900	4,830.00	71,967,000
ゼビオホールディングス	15,900	1,177.00	18,714,300
ケーズホールディングス	135,900	1,176.00	159,818,400
Olympicグループ	7,900	619.00	4,890,100
日産東京販売ホールディングス	19,700	282.00	5,555,400
Genky DrugStores	6,400	2,202.00	14,092,800
総合メディカルホールディングス	11,500	1,770.00	20,355,000
ブックオフグループホールディングス	6,800	1,173.00	7,976,400
アインホールディングス	17,500	6,290.00	110,075,000
元気寿司	3,700	2,711.00	10,030,700
ヤマダ電機	398,500	523.00	208,415,500
アークランドサカモト	22,300	1,253.00	27,941,900
ニトリホールディングス	56,600	15,810.00	894,846,000
グルメ杵屋	9,400	1,156.00	10,866,400
愛眼	10,400	243.00	2,527,200
ケーユーホールディングス	7,000	849.00	5,943,000
吉野家ホールディングス	45,700	2,445.00	111,736,500
松屋フーズホールディングス	6,300	3,890.00	24,507,000
サガミホールディングス	17,600	1,337.00	23,531,200
関西スーパーマーケット	10,000	1,073.00	10,730,000
王将フードサービス	9,600	6,990.00	67,104,000
プレナス	14,700	1,810.00	26,607,000
ミニストップ	9,800	1,391.00	13,631,800

アークス	24,600	2,259.00	55,571,400
パローホールディングス	28,300	1,820.00	51,506,000
ベルク	6,500	5,280.00	34,320,000
大庄	7,100	1,570.00	11,147,000
ファーストリテイリング	17,500	64,210.00	1,123,675,000
サンドラッグ	49,200	3,400.00	167,280,000
サクスパー ホールディングス	11,200	890.00	9,968,000
ヤマザワ	2,800	1,670.00	4,676,000
やまや	2,300	2,191.00	5,039,300
ペルーナ	32,300	686.00	22,157,800
島根銀行	4,100	680.00	2,788,000
じもとホールディングス	88,400	99.00	8,751,600
めぶきフィナンシャルグループ	683,500	266.00	181,811,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,300	1,400.00	25,620,000
九州フィナンシャルグループ	216,900	440.00	95,436,000
ゆうちょ銀行	371,700	1,047.00	389,169,900
富山第一銀行	34,100	307.00	10,468,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	823,300	414.00	340,846,200
西日本フィナンシャルホールディングス	83,600	757.00	63,285,200
関西みらいフィナンシャルグループ	62,800	679.00	42,641,200
三十三フィナンシャルグループ	11,900	1,605.00	19,099,500
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	2,718.00	62,785,800
新生銀行	96,100	1,574.00	151,261,400
あおぞら銀行	73,100	2,702.00	197,516,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,009,800	548.40	4,940,974,320
りそなホールディングス	1,436,300	463.00	665,006,900
三井住友トラスト・ホールディングス	257,300	3,896.00	1,002,440,800
三井住友フィナンシャルグループ	922,400	3,695.00	3,408,268,000
千葉銀行	451,800	556.00	251,200,800
群馬銀行	264,400	350.00	92,540,000
武蔵野銀行	20,000	1,875.00	37,500,000
千葉興業銀行	39,000	289.00	11,271,000
筑波銀行	54,400	183.00	9,955,200
七十七銀行	41,600	1,603.00	66,684,800
青森銀行	10,500	2,630.00	27,615,000
秋田銀行	8,800	2,047.00	18,013,600
山形銀行	15,300	1,459.00	22,322,700
岩手銀行	9,500	2,602.00	24,719,000
東邦銀行	117,000	254.00	29,718,000
東北銀行	6,700	1,056.00	7,075,200
みちのく銀行	8,400	1,559.00	13,095,600
ふくおかフィナンシャルグループ	115,700	2,041.00	236,143,700

静岡銀行	325,200	805.00	261,786,000
十六銀行	18,000	2,367.00	42,606,000
八十二銀行	317,900	440.00	139,876,000
山梨中央銀行	16,600	1,028.00	17,064,800
大垣共立銀行	28,000	2,391.00	66,948,000
福井銀行	11,800	1,425.00	16,815,000
北國銀行	13,900	2,801.00	38,933,900
清水銀行	5,900	1,842.00	10,867,800
富山銀行	2,900	2,592.00	7,516,800
滋賀銀行	26,600	2,455.00	65,303,000
南都銀行	20,800	2,526.00	52,540,800
百五銀行	120,400	345.00	41,538,000
京都銀行	47,100	4,225.00	198,997,500
紀陽銀行	46,900	1,679.00	78,745,100
ほくほくフィナンシャルグループ	88,000	1,045.00	91,960,000
広島銀行	194,900	534.00	104,076,600
山陰合同銀行	79,000	656.00	51,824,000
中国銀行	113,600	1,015.00	115,304,000
鳥取銀行	5,100	1,438.00	7,333,800
伊予銀行	175,000	565.00	98,875,000
百十四銀行	14,300	2,220.00	31,746,000
四国銀行	19,500	980.00	19,110,000
阿波銀行	20,400	2,437.00	49,714,800
大分銀行	8,300	2,898.00	24,053,400
宮崎銀行	9,100	2,422.00	22,040,200
佐賀銀行	8,500	1,471.00	12,503,500
沖縄銀行	12,300	3,385.00	41,635,500
琉球銀行	31,000	1,112.00	34,472,000
セブン銀行	445,300	296.00	131,808,800
みずほフィナンシャルグループ	17,784,900	165.60	2,945,179,440
高知銀行	4,700	790.00	3,713,000
山口フィナンシャルグループ	164,600	742.00	122,133,200
長野銀行	4,800	1,622.00	7,785,600
名古屋銀行	10,900	3,175.00	34,607,500
北洋銀行	201,200	229.00	46,074,800
愛知銀行	5,000	3,390.00	16,950,000
中京銀行	5,800	2,105.00	12,209,000
大光銀行	5,000	1,581.00	7,905,000
愛媛銀行	19,100	1,087.00	20,761,700
トマト銀行	5,900	1,066.00	6,289,400
京葉銀行	57,200	639.00	36,550,800
栃木銀行	72,400	195.00	14,118,000

北日本銀行	4,600	1,790.00	8,234,000
東和銀行	23,000	791.00	18,193,000
福島銀行	11,400	213.00	2,428,200
大東銀行	6,300	584.00	3,679,200
トモニホールディングス	103,800	350.00	36,330,000
フィデアホールディングス	127,100	116.00	14,743,600
池田泉州ホールディングス	143,600	187.00	26,853,200
F P G	41,300	1,080.00	44,604,000
マーキュリアインベストメント	6,000	718.00	4,308,000
S B Iホールディングス	156,000	2,311.00	360,516,000
ジャフコ	21,500	4,080.00	87,720,000
大和証券グループ本社	1,050,600	481.40	505,758,840
野村ホールディングス	2,303,400	457.90	1,054,726,860
岡三証券グループ	112,000	383.00	42,896,000
丸三証券	39,200	498.00	19,521,600
東洋証券	47,800	184.00	8,795,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,600	298.00	46,666,800
光世証券	3,400	591.00	2,009,400
水戸証券	38,700	238.00	9,210,600
いちよし証券	26,500	679.00	17,993,500
松井証券	64,300	908.00	58,384,400
だいこう証券ビジネス	5,600	552.00	3,091,200
マネックスグループ	121,200	311.00	37,693,200
極東証券	17,800	861.00	15,325,800
岩井コスモホールディングス	13,600	1,115.00	15,164,000
藍澤證券	23,800	674.00	16,041,200
マネーパートナーズグループ	16,000	259.00	4,144,000
スパークス・グループ	52,500	249.00	13,072,500
かんぽ生命保険	46,400	1,630.00	75,632,000
S O M P Oホールディングス	230,700	4,517.00	1,042,071,900
アニコム ホールディングス	10,800	4,095.00	44,226,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	342,200	3,500.00	1,197,700,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	107,600	2,342.00	251,999,200
第一生命ホールディングス	740,500	1,629.00	1,206,274,500
東京海上ホールディングス	468,000	5,779.00	2,704,572,000
T & Dホールディングス	404,800	1,145.00	463,496,000
アドバンスクリエイト	3,100	1,813.00	5,620,300
全国保証	36,900	4,205.00	155,164,500
ジェイリース	3,600	317.00	1,141,200
イントラスト	3,700	657.00	2,430,900
日本モーゲージサービス	2,400	1,208.00	2,899,200
C a s a	5,900	1,241.00	7,321,900

アルヒ	11,900	2,407.00	28,643,300
プレミアグループ	7,500	1,919.00	14,392,500
クレディセゾン	91,700	1,449.00	132,873,300
芙蓉総合リース	15,000	6,480.00	97,200,000
興銀リース	24,600	2,922.00	71,881,200
東京センチュリー	26,400	4,995.00	131,868,000
日本証券金融	57,700	503.00	29,023,100
アイフル	199,700	252.00	50,324,400
リコーリース	10,300	3,490.00	35,947,000
イオンフィナンシャルサービス	83,600	1,626.00	135,933,600
アコム	263,100	424.00	111,554,400
ジャックス	14,500	2,280.00	33,060,000
オリエントコーポレーション	354,000	145.00	51,330,000
日立キャピタル	30,900	2,195.00	67,825,500
アプラスフィナンシャル	62,800	73.00	4,584,400
オリックス	873,200	1,611.00	1,406,725,200
三菱UFJリース	295,300	624.00	184,267,200
九州リースサービス	6,400	596.00	3,814,400
日本取引所グループ	353,600	1,699.00	600,766,400
イー・ギャランティ	12,300	1,489.00	18,314,700
アサックス	5,400	618.00	3,337,200
NECキャピタルソリューション	5,300	2,171.00	11,506,300
いちご	168,900	435.00	73,471,500
日本駐車場開発	149,500	170.00	25,415,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,875.00	13,687,500
ヒューリック	280,400	1,105.00	309,842,000
三栄建築設計	6,000	1,479.00	8,874,000
野村不動産ホールディングス	87,700	2,334.00	204,691,800
三重交通グループホールディングス	28,400	549.00	15,591,600
サムティ	19,100	1,884.00	35,984,400
ディア・ライフ	18,800	488.00	9,174,400
コーセーアールイー	5,400	718.00	3,877,200
エー・ディー・ワークス	403,100	31.00	12,496,100
日本商業開発	8,900	1,458.00	12,976,200
プレサンスコーポレーション	21,400	1,742.00	37,278,800
ユニゾホールディングス	18,800	4,815.00	90,522,000
ハウスコム	2,100	1,546.00	3,246,600
日本管理センター	9,400	1,478.00	13,893,200
サンセイランディック	5,100	819.00	4,176,900
エストラスト	1,800	823.00	1,481,400
フージャースホールディングス	28,500	636.00	18,126,000
オープンハウス	38,400	2,574.00	98,841,600

東急不動産ホールディングス	353,600	689.00	243,630,400
飯田グループホールディングス	109,800	1,758.00	193,028,400
イーランド	3,300	698.00	2,303,400
ムゲンエステート	10,800	642.00	6,933,600
ハウストゥ	7,200	1,752.00	12,614,400
シーアールイー	4,200	1,008.00	4,233,600
ケイアイスター不動産	4,000	1,918.00	7,672,000
グッドコムアセット	3,600	1,877.00	6,757,200
ジェイ・エス・ビー	1,600	4,690.00	7,504,000
テンポイノベーション	2,100	1,660.00	3,486,000
パーク24	70,700	2,508.00	177,315,600
パラカ	3,800	2,058.00	7,820,400
三井不動産	694,800	2,679.00	1,861,369,200
三菱地所	917,400	2,084.00	1,911,861,600
平和不動産	24,500	2,420.00	59,290,000
東京建物	143,700	1,518.00	218,136,600
ダイビル	39,500	1,106.00	43,687,000
京阪神ビルディング	23,700	1,312.00	31,094,400
住友不動産	294,500	4,113.00	1,211,278,500
テーオーシー	31,200	825.00	25,740,000
東京楽天地	2,100	5,700.00	11,970,000
スターツコーポレーション	18,200	2,638.00	48,011,600
フジ住宅	18,200	692.00	12,594,400
空港施設	17,200	530.00	9,116,000
明和地所	9,100	538.00	4,895,800
ゴールドクレスト	10,800	2,120.00	22,896,000
日本エスリード	5,700	1,610.00	9,177,000
日神不動産	21,700	460.00	9,982,000
日本エスコン	25,000	823.00	20,575,000
タカラレーベン	62,300	418.00	26,041,400
サンヨーハウジング名古屋	8,600	869.00	7,473,400
イオンモール	66,200	1,705.00	112,871,000
毎日コムネット	4,100	771.00	3,161,100
ファースト住建	6,400	1,345.00	8,608,000
カチタス	14,800	4,440.00	65,712,000
トーセイ	18,800	1,276.00	23,988,800
穴吹興産	1,800	2,805.00	5,049,000
サンフロンティア不動産	18,900	1,289.00	24,362,100
エフ・ジェー・ネクスト	12,400	1,041.00	12,908,400
インテリックス	5,200	706.00	3,671,200
ランドビジネス	5,500	756.00	4,158,000
日本社宅サービス	4,300	1,049.00	4,510,700

グランディハウス	13,800	449.00	6,196,200
日本空港ビルディング	42,000	4,680.00	196,560,000
日本工営	8,600	3,150.00	27,090,000
L I F U L L	44,500	703.00	31,283,500
ジェイエイシーリクルートメント	8,600	2,068.00	17,784,800
日本M&Aセンター	95,800	3,040.00	291,232,000
メンバーズ	4,400	1,817.00	7,994,800
中広	1,600	564.00	902,400
アイティメディア	2,800	680.00	1,904,000
タケエイ	13,300	1,061.00	14,111,300
E・Jホールディングス	1,700	1,325.00	2,252,500
トラスト・テック	14,100	1,294.00	18,245,400
コシダカホールディングス	30,600	1,716.00	52,509,600
アルトナー	3,300	736.00	2,428,800
パソナグループ	15,600	1,553.00	24,226,800
C D S	3,300	1,331.00	4,392,300
リンクアンドモチベーション	28,200	552.00	15,566,400
G C A	15,200	775.00	11,780,000
エス・エム・エス	46,700	2,628.00	122,727,600
サニーサイドアップ	3,000	906.00	2,718,000
パーソルホールディングス	126,900	2,042.00	259,129,800
リニカル	7,300	989.00	7,219,700
クックパッド	44,800	302.00	13,529,600
エスクリ	3,700	830.00	3,071,000
アイ・ケイ・ケイ	6,400	702.00	4,492,800
学情	4,600	1,430.00	6,578,000
スタジオアリス	6,500	2,006.00	13,039,000
シミックホールディングス	7,100	1,716.00	12,183,600
エプコ	2,100	1,361.00	2,858,100
N J S	2,900	1,710.00	4,959,000
総合警備保障	50,500	5,660.00	285,830,000
カカクコム	95,000	2,658.00	252,510,000
アイロムグループ	4,800	1,622.00	7,785,600
セントケア・ホールディング	9,500	504.00	4,788,000
サイネックス	2,400	635.00	1,524,000
ルネサンス	7,100	1,603.00	11,381,300
ディップ	20,500	2,624.00	53,792,000
オプトホールディング	7,000	1,640.00	11,480,000
ツクイ	30,200	427.00	12,895,400
キャリアデザインセンター	3,300	1,421.00	4,689,300
ベネフィット・ワン	35,200	2,042.00	71,878,400
エムスリー	267,000	2,602.00	694,734,000

ツカダ・グローバルホールディング	8,400	597.00	5,014,800
プラス	1,700	658.00	1,118,600
アウトソーシング	72,700	1,028.00	74,735,600
ウェルネット	12,200	711.00	8,674,200
ワールドホールディングス	4,300	1,568.00	6,742,400
ディー・エヌ・エー	68,400	1,907.00	130,438,800
博報堂D Yホールディングス	176,400	1,561.00	275,360,400
ぐるなび	18,300	736.00	13,468,800
タカミヤ	13,700	643.00	8,809,100
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,052.00	9,047,200
ファンコミュニケーションズ	35,200	538.00	18,937,600
ライク	5,100	1,599.00	8,154,900
ビジネス・ブレークスルー	5,800	361.00	2,093,800
エスプール	24,500	669.00	16,390,500
WDBホールディングス	5,800	2,889.00	16,756,200
ティア	7,700	614.00	4,727,800
C D G	1,300	1,372.00	1,783,600
バリューコマース	7,200	1,707.00	12,290,400
インフォマート	69,600	1,684.00	117,206,400
J Pホールディングス	36,800	265.00	9,752,000
エコナックホールディングス	24,300	125.00	3,037,500
E P Sホールディングス	19,200	1,281.00	24,595,200
レグス	3,200	1,547.00	4,950,400
プレステージ・インターナショナル	47,600	858.00	40,840,800
アミューズ	7,700	2,707.00	20,843,900
ドリームインキュベータ	4,000	1,477.00	5,908,000
クイック	8,000	1,355.00	10,840,000
T A C	7,700	198.00	1,524,600
ケネディクス	121,000	545.00	65,945,000
電通	130,800	3,805.00	497,694,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	1,173.00	5,865,000
ぴあ	3,700	4,675.00	17,297,500
イオンファンタジー	4,100	2,964.00	12,152,400
シーティーエス	14,500	715.00	10,367,500
ネクシィーズグループ	4,500	1,913.00	8,608,500
みらかホールディングス	35,500	2,462.00	87,401,000
アルプス技研	11,300	1,534.00	17,334,200
ダイオーズ	3,000	1,475.00	4,425,000
日本空調サービス	14,600	688.00	10,044,800
オリエンタルランド	149,900	16,440.00	2,464,356,000
ダスキン	32,600	2,784.00	90,758,400
明光ネットワークジャパン	15,100	879.00	13,272,900



ファルコホールディングス	7,100	1,631.00	11,580,100
ラウンドワン	39,400	1,615.00	63,631,000
リゾートトラスト	53,800	1,748.00	94,042,400
ビー・エム・エル	16,400	2,906.00	47,658,400
ワタベウェディング	2,300	577.00	1,327,100
りらいあコミュニケーションズ	23,000	1,346.00	30,958,000
リソー教育	64,700	439.00	28,403,300
早稲田アカデミー	3,800	808.00	3,070,400
ユー・エス・エス	155,000	2,097.00	325,035,000
東京個別指導学院	4,700	930.00	4,371,000
サイバーエージェント	73,000	4,150.00	302,950,000
楽天	591,200	1,065.00	629,628,000
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,197.00	9,097,200
テー・オー・ダブリュー	11,300	737.00	8,328,100
山田コンサルティンググループ	6,200	1,688.00	10,465,600
セントラルスポーツ	4,800	3,155.00	15,144,000
フルキャストホールディングス	12,800	2,189.00	28,019,200
エン・ジャパン	18,500	4,135.00	76,497,500
リソルホールディングス	1,400	4,000.00	5,600,000
テクノプロ・ホールディングス	25,500	6,400.00	163,200,000
アトラ	3,300	352.00	1,161,600
インターワークス	2,700	512.00	1,382,400
アイ・アールジャパンホールディングス	5,200	3,840.00	19,968,000
K e e P e r 技研	4,800	1,574.00	7,555,200
ファーストロジック	3,200	606.00	1,939,200
三機サービス	2,800	949.00	2,657,200
G u n o s y	8,900	1,397.00	12,433,300
デザインワン・ジャパン	3,000	308.00	924,000
イー・ガーディアン	6,500	1,645.00	10,692,500
リブセンス	8,800	259.00	2,279,200
ジャパンマテリアル	34,800	1,330.00	46,284,000
ベクトル	16,000	900.00	14,400,000
ウチヤマホールディングス	6,600	484.00	3,194,400
チャーム・ケア・コーポレーション	4,100	2,151.00	8,819,100
ライクキッズネクスト	3,200	899.00	2,876,800
キャリアリンク	4,900	606.00	2,969,400
I B J	8,700	1,151.00	10,013,700
アサンテ	5,200	1,971.00	10,249,200
N・フィールド	9,000	621.00	5,589,000
バリューHR	2,500	3,185.00	7,962,500
M&Aキャピタルパートナーズ	4,500	6,480.00	29,160,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	1,482.00	8,002,800

ERIホールディングス	3,800	807.00	3,066,600	
アシスト	2,000	2,623.00	5,246,000	
シグマクシス	6,200	1,452.00	9,002,400	
ウィルグループ	8,400	939.00	7,887,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,200	232.00	4,222,400	
リクルートホールディングス	908,400	3,286.00	2,985,002,400	
エラン	7,600	1,767.00	13,429,200	
土木管理総合試験所	5,900	433.00	2,554,700	
ネットマーケティング	4,800	853.00	4,094,400	
日本郵政	1,039,500	995.00	1,034,302,500	
ベルシステム24ホールディングス	21,300	1,651.00	35,166,300	
鎌倉新書	9,500	1,480.00	14,060,000	
ソネット・メディア・ネットワークス	1,800	692.00	1,245,600	
一蔵	1,600	610.00	976,000	
LITALICO	3,000	2,040.00	6,120,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,100	837.00	1,757,700	
エボラブルアジア	5,700	1,925.00	10,972,500	
アトラエ	3,300	3,200.00	10,560,000	
ストライク	4,800	2,909.00	13,963,200	
ソラスト	31,200	1,215.00	37,908,000	
セラク	4,200	706.00	2,965,200	
インソース	6,200	2,711.00	16,808,200	
ベikalレント・コンサルティング	9,000	4,755.00	42,795,000	
Orchestra Holdings	2,700	1,163.00	3,140,100	
アイモバイル	4,300	550.00	2,365,000	
キャリアインデックス	4,700	423.00	1,988,100	
MS - Japan	5,300	1,314.00	6,964,200	
船場	2,200	955.00	2,101,000	
グレイステクノロジー	4,600	2,943.00	13,537,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,000	2,806.00	28,060,000	
フルテック	1,900	1,260.00	2,394,000	
グリーンズ	4,900	1,342.00	6,575,800	
ツナググループ・ホールディングス	1,800	571.00	1,027,800	
GameWith	3,000	927.00	2,781,000	
ソウルドアウト	2,100	1,311.00	2,753,100	
MS&Consulting	2,000	977.00	1,954,000	
日総工産	8,600	1,110.00	9,546,000	
キュービーネットホールディングス	7,800	2,250.00	17,550,000	
RPAホールディングス	5,500	1,697.00	9,333,500	
スプリックス	4,400	1,412.00	6,212,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	793.00	4,123,600	
リログループ	69,400	2,648.00	183,771,200	

東祥	8,000	2,380.00	19,040,000	
エイチ・アイ・エス	19,800	2,683.00	53,123,400	
ラックランド	2,600	2,340.00	6,084,000	
共立メンテナンス	19,400	4,625.00	89,725,000	
イチネンホールディングス	13,300	1,088.00	14,470,400	
建設技術研究所	8,900	1,639.00	14,587,100	
スペース	8,400	1,260.00	10,584,000	
長大	4,800	940.00	4,512,000	
燦ホールディングス	5,600	1,088.00	6,092,800	
スバル興業	900	6,890.00	6,201,000	
東京テアトル	5,100	1,366.00	6,966,600	
タナベ経営	2,600	1,269.00	3,299,400	
ナガワ	3,600	6,010.00	21,636,000	
よみうりランド	2,800	4,470.00	12,516,000	
東京都競馬	8,300	3,290.00	27,307,000	
カナモト	20,800	2,683.00	55,806,400	
東京ドーム	47,600	1,040.00	49,504,000	
西尾レントオール	12,900	2,774.00	35,784,600	
トランス・コスモス	14,100	2,605.00	36,730,500	
乃村工藝社	59,400	1,360.00	80,784,000	
藤田観光	5,600	2,799.00	15,674,400	
KNT-CTホールディングス	6,800	1,582.00	10,757,600	
日本管財	13,700	1,867.00	25,577,900	
トーカイ	12,300	2,359.00	29,015,700	
白洋舎	1,500	2,880.00	4,320,000	
セコム	134,600	9,858.00	1,326,886,800	
セントラル警備保障	6,100	5,500.00	33,550,000	
丹青社	24,100	1,209.00	29,136,900	
メイテック	15,700	5,290.00	83,053,000	
応用地質	13,800	1,072.00	14,793,600	
船井総研ホールディングス	26,300	2,458.00	64,645,400	
進学会ホールディングス	6,100	523.00	3,190,300	
オオバ	10,200	633.00	6,456,600	
いであ	2,500	1,220.00	3,050,000	
学究社	4,300	1,230.00	5,289,000	
ベネッセホールディングス	46,500	2,806.00	130,479,000	
イオンディライト	15,700	3,390.00	53,223,000	
ナック	8,200	965.00	7,913,000	
ニチイ学館	18,100	1,770.00	32,037,000	
ダイセキ	21,300	2,759.00	58,766,700	
ステップ	4,800	1,418.00	6,806,400	
合計	155,575,280		301,610,113,430	

## (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19期中間計算期間(2019年10月1日から2020年3月31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】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2019年 9月30日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	40,952,817	49,637,013
親投資信託受益証券	8,360,433,831	7,589,847,200
未収入金	4,089,336	1,153,457
流動資産合計	8,405,475,984	7,640,637,670
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,389,970	18,228,609
未払受託者報酬	2,166,360	2,370,134
未払委託者報酬	23,829,912	26,071,395
未払利息	99	133
その他未払費用	430,585	236,958
流動負債合計	40,816,926	46,907,229
負債合計	40,816,926	46,907,229
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,447,207,602	4,517,416,602
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,917,451,456	3,076,313,839
(分配準備積立金)	1,715,858,472	1,491,537,385
元本等合計	8,364,659,058	7,593,730,441
純資産合計	8,364,659,058	7,593,730,441
負債純資産合計	8,405,475,984	7,640,637,670

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2018年10月 2日 至 2019年 4月 1日	第19期中間計算期間 自 2019年10月 1日 至 2020年 3月31日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	28
有価証券売買等損益	850,319,884	847,683,838
営業収益合計	850,319,882	847,683,810
<b>営業費用</b>		
支払利息	10,149	7,748
受託者報酬	2,140,602	2,370,134
委託者報酬	23,546,521	26,071,395
その他費用	214,954	236,959
営業費用合計	25,912,226	28,686,236
営業利益又は営業損失（ ）	876,232,108	876,370,046
経常利益又は経常損失（ ）	876,232,108	876,370,046
中間純利益又は中間純損失（ ）	876,232,108	876,370,046
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（ ）	88,150,721	6,088,963
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,567,318,255	3,917,451,456
剰余金増加額又は欠損金減少額	546,919,069	593,157,722
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	546,919,069	593,157,722
剰余金減少額又は欠損金増加額	437,788,389	551,836,330
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	437,788,389	551,836,330
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,888,367,548	3,076,313,839

## ( 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18期 (2019年 9月30日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,447,207,602口	4,517,416,602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) 1.8809円 (18,809円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6810円 (16,810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19期中間計算期間 (2020年 3月31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19期中間計算期間 (2020年 3月31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18期 自 2018年10月 2日 至 2019年 9月30日	第19期中間計算期間 自 2019年10月 1日 至 2020年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,102,012,664円	4,447,207,602円
期中追加設定元本額	1,105,861,467円	693,637,685円
期中一部解約元本額	760,666,529円	623,428,685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

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,462,344,079
株式	278,084,056,570

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	108,254,800
未収入金	150,440,000
未収配当金	3,689,823,329
前払金	83,941,550
差入委託証拠金	534,031,200
流動資産合計	286,112,891,528
資産合計	286,112,891,528
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	192,224,950
未払金	20,305,500
未払解約金	168,059,990
未払利息	9,306
流動負債合計	380,599,746
負債合計	380,599,746
純資産の部	
元本等	
元本	215,676,267,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,056,024,391
元本等合計	285,732,291,782
純資産合計	285,732,291,782
負債純資産合計	286,112,891,528

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

2020年 3月31日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	215,676,267,391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 1.3248円 (1万口当たり純資産額) (13,248円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月31日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2020年 3月31日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月 1日
期首元本額	207,951,200,444円
期中追加設定元本額	29,969,761,206円
期中一部解約元本額	22,244,694,259円
期末元本額	215,676,267,391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）	592,989,209円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,001,383,233円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,199,044円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,630,403,729円
世界経済インデックスファンド	2,141,900,972円
日本株式インデックス・オープン	4,349,908,700円
D C マイセレクション 2 5	7,605,626,222円
D C マイセレクション 5 0	19,995,149,703円
D C マイセレクション 7 5	17,577,886,062円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,729,051,329円
D C マイセレクション S 2 5	3,167,360,279円
D C マイセレクション S 5 0	8,343,357,281円
D C マイセレクション S 7 5	5,163,813,669円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,890,642,445円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	337,999,390円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	766,926,022円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	505,185,827円
D C 世界経済インデックスファンド	2,839,578,144円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,063,201,671円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,001,542円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	36,537,652円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	40,287,416円

区分	2020年 3月31日現在
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	273,964,505円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,765,336円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	77,183,583円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	259,870,679円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	56,816,289円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	336,075,521円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,855,889,689円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	721,807,410円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,355,715,905円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	638,155,991円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	43,282,825円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	804,623,687円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	36,995,498円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	471,980,935円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	597,040,485円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	57,354,066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)	845,167,258円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,925,074,305円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,084,122,027円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	6,481,723,918円
分散投資コア戦略ファンドS	18,222,622,901円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	308,231,695円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	340,153,862円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,307,790円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,590,544円
SMT インデックスバランス・オープン	68,176,877円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,122,045,633円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
SMT 世界経済インデックス・オープン	19,934,839円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	69,814,452円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	12,327,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,335,519円
グローバル経済コア	268,425,313円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,369,643円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	45,194,253円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,796,332円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,642,992円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	82,015円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	115,808円

区分	2020年 3月31日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	53,399円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	26,167円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	52,226,477,229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)	589,532,116円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	24,694,481円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	17,796,798円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2020年 3月31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	7,561,931,550	-	7,477,990,000	83,941,550
	合計	7,561,931,550	-	7,477,990,000	83,941,550

#### (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】

## 【純資産額計算書】

(2020年 4月30日現在)

資産総額	8,032,496,266円
負債総額	17,362,880円
純資産総額( - )	8,015,133,386円
発行済口数	4,572,676,741口
1口当たり純資産額( / )	1.7528円
(1万口当たり純資産額)	(17,528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

(2020年 4月30日現在)

資産総額	294,798,535,703円
負債総額	1,636,182,762円
純資産総額( - )	293,162,352,941円
発行済口数	212,102,266,945口
1口当たり純資産額( / )	1.3822円
(1万口当たり純資産額)	(13,822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（2020年 4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 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年4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	542	12,099,508
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	289,453
単位型公社債投資信託	26	199,687
合計	647	12,588,648

## 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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本				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	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"



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

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

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

### (企業結合等関係)

#### 共通支配下の取引等

##### (1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

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

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(当社)

その他取引の概要に関する事項

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

##### (2)実施した会計処理の概要

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

### (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

### (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

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

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

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

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

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

中間純利益

4,895

## 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

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

## 重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日）

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

### 有価証券

#### 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

## 4. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 6. 引当金の計上基準

### (1) 貸倒引当金

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

### (2) 賞与引当金

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

### (3) 退職給付引当金

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

## 7. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

#### 8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

##### (2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

#### 注記事項

##### (中間貸借対照表関係)

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

##### (中間損益計算書関係)

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

##### (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

##### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2. 配当に関する事項

##### 配当金支払額

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



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

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

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

(単位:百万円)

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

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

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

## 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

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

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

## 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

## (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

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

## 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  
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11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

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2018年10月2日から2019年9月30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9月30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. X B R L 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5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

松崎雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2019年10月1日から2020年3月31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2020年3月31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10月1日から2020年3月31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。