

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年7月2日提出
【計算期間】	第1期(自 2019年12月13日至 2020年4月8日)
【ファンド名】	SMDAM トピックス上場投信
【発行者名】	三井住友D S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 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数（東証株価指数（TOPIX））の変動率に一致させることを目的として運用を行います。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5兆円に相当する株式および金銭を限度として追加信託することができます。この限度は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	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います。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 （収益の源泉）	株式	目論見書または信託約款において、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います。
独立区分	E T F	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号および第2号に規定する証券投資信託なら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います。
補足分類	インデックス型	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またはそれに準じる記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	株式 一般	目論見書または信託約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものであって、大型株属性、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいいます。
決算頻度	年2回	目論見書または信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、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います。
対象インデックス	T O P I X	目論見書または信託約款において、東証株価指数（TOPIX）に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

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
	海外	債券	MRF	
追加型	内外	不動産投信		特殊型
		その他資産 ()	ETF	
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル	
一般	年2回	日本	日経225
大型株			
中小型株	年4回	北米	
債券	年6回(隔月)	欧州	
一般	年12回(毎月)	アジア	
公債	日々	オセアニア	TOPIX
社債	その他	中南米	
その他債券	()	アフリカ	
クレジット属性		中近東(中東)	その他
()		エマージング	()
不動産投信			
その他資産			
()			
資産複合			
()			
資産配分固定型			
資産配分変更型			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。
商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ
(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2019年12月13日 信託契約締結、設定、運用開始。
2019年12月16日 受益権を東京証券取引所に上場。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）作成等を行います。

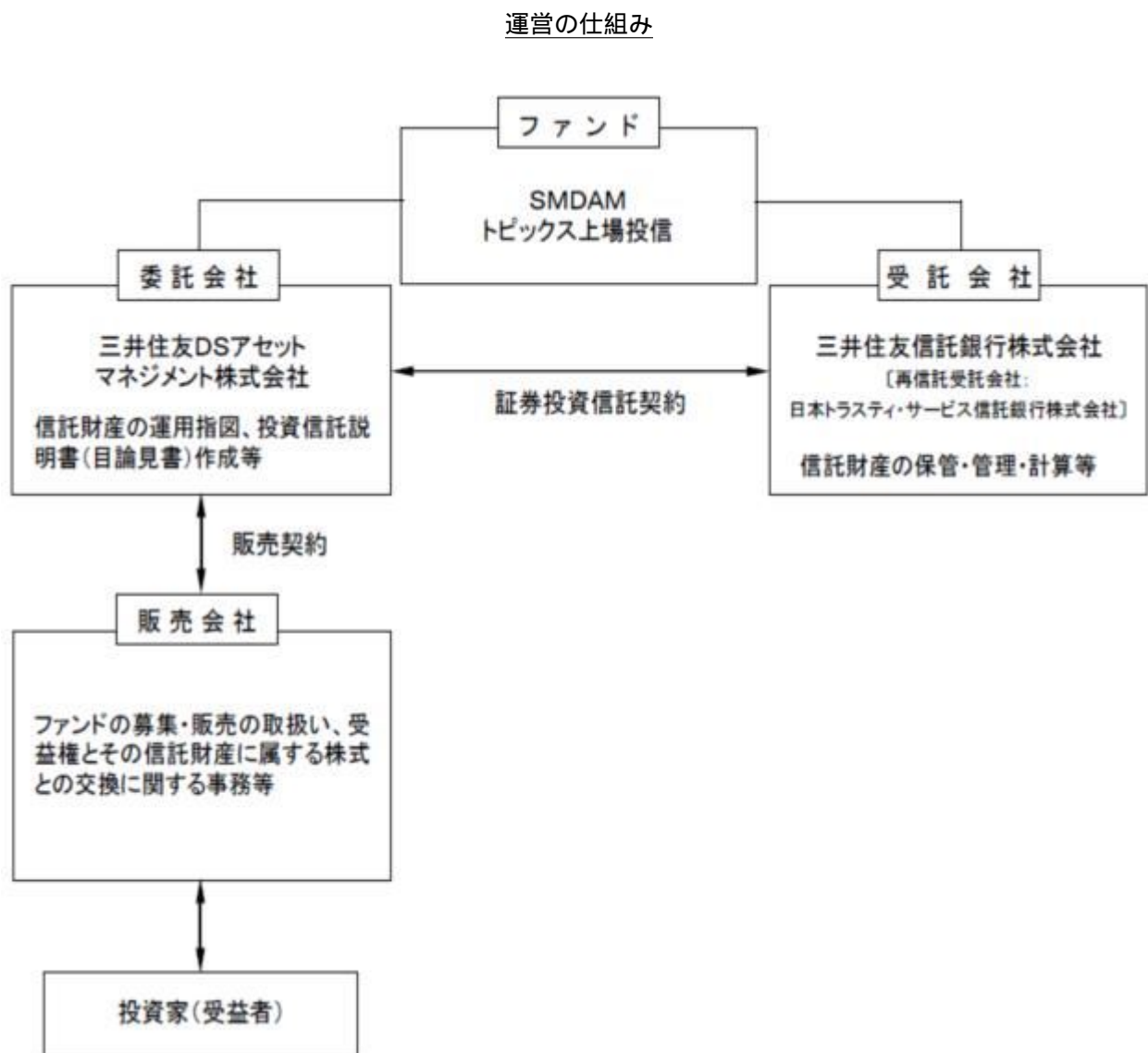
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社^{*}に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

^{*}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日に資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社と合併し、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。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を行います。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020年4月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

- 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
 1987年2月20日 証券投資顧問業の登録
 1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
 1999年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

(ハ) 大株主の状況

(2020年4月30日現在)

名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- イ 当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
- ロ 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- ハ 上記イの基本方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。
- ニ 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ホ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含みます。)の株式に投資します。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

2

上場投資信託(ETF)であり、通常の投資信託とは仕組みが異なります。

- 受益権は、東京証券取引所に上場しており、株式と同様に売買可能です。
 - 売買単位は、10口単位です。
 - 取引方法は、原則として株式と同様です。
- 追加設定は、株式により行います。
 - 追加設定にかかる受益権の取得申込者は、ユニット(対象指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ)単位で、株式による取得申込みを行うことができます。
 - 委託会社は、取得申込受付日に適用されるユニットの銘柄および株数を決定し、販売会社に提示します。
 - 原則として、金銭による取得申込みはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
 - 一定口数以上の受益権を保有する受益者は、当該受益権を当該受益権に相当する信託財産に属する株式と交換することができます。
 - 解約申込みにより、受益権を換金することはできません。

3

年2回(4月および10月の8日)決算を行い、分配方針に基づき分配を行います。

- 経費等控除後の配当等収益の全額を分配することを原則とします。
- 売買益(評価損益を含みます。)からの分配は行いません。
- 分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

運用プロセス



※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。



完全法とは

指数を構成するすべての銘柄について、その時価構成比率に合わせて保有し、ポートフォリオを構築する方法です。すべての銘柄へ投資する必要があるため、信用不安が懸念される銘柄も原則として組み入れる点にも留意する必要があります。

東証株価指数(TOPIX)について

● 指数の概要

TOPIXとは東京証券取引所第一部に上場している全銘柄を算出対象とした時価総額を指数化したものであり、1968年1月4日(基準時)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。また、この指数は、日本経済の動向を示す代表的な経済指標として用いられるほか、ETFなどの金融商品のベンチマークとして利用されています。

● 指数の著作権など

- TOPIXの指数値およびTOPIXの高標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの高標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。
- 東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- 東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの高標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をしません。
- 東京証券取引所は、TOPIXの指数値およ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、東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- 東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、東京証券取引所は当ファンドの発行また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。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類(本邦通貨表示のものに限ります。)は、次に掲げるものとします。

(イ)次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限ります。)
3. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
4. 金銭債権

(ロ)特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託財産を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株式
2. 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。)

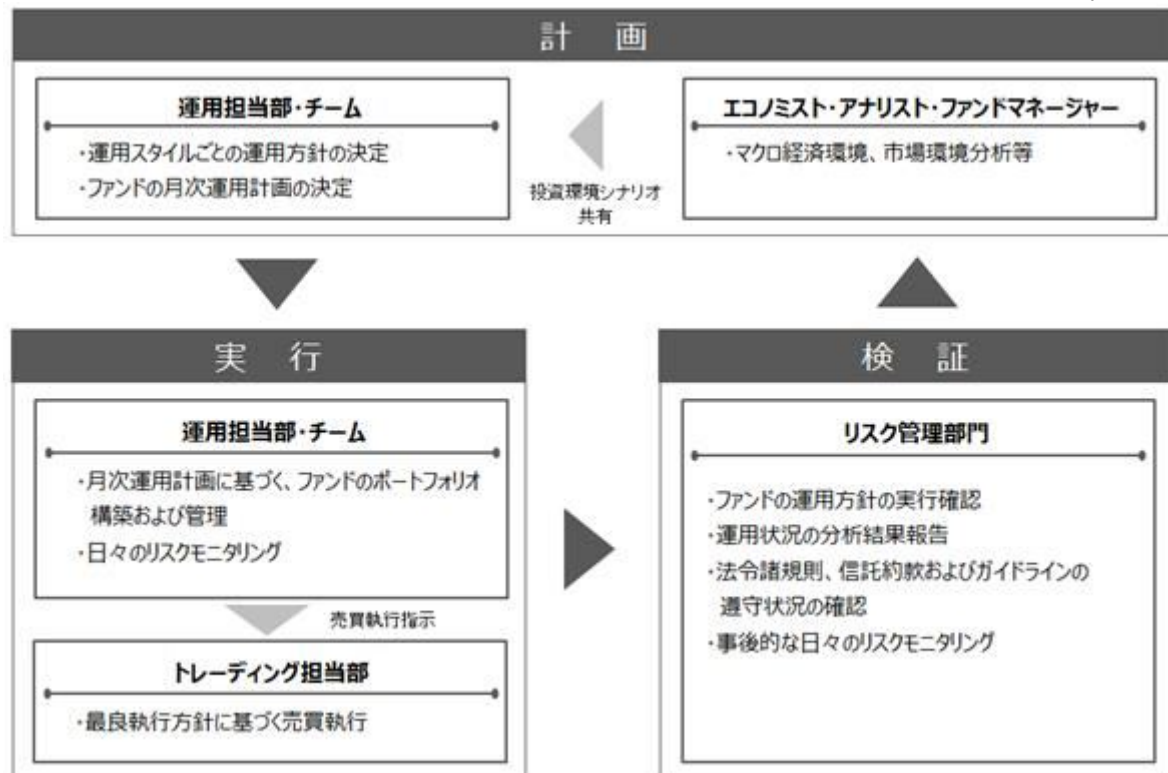
ハ 投資対象とする金融商品

上記ロの規定にかかわらず、この信託の設定、交換、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託財産を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号で定め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

(3)【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

- イ 毎計算期末（年２回。４月、１０月の各８日。）に、経費等控除後の配当等収益（配当金、貸付株式にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ロ 売買益（評価損益を含みます。）からの分配は行いません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ニ 投資する株式の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場している株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場することが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ 先物取引等の運用指図

委託会社は、日本の金融商品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。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ヘ 株式の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、株式の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

法令に基づく投資制限

イ 同一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第9条)

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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行う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】

イ ファンドのもつリスクの特性

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。したがって、投資者の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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ハ) 市場流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 指数の動きと連動しない要因

ファンドは、東証株価指数（TOPIX）の変動率に一致させることを目的として運用を行います。

ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、指数構成銘柄と組入有価証券との誤差（各銘柄の構成比率と当ファンドにおける各銘柄の組入比率が完全に一致しないこと、当該指数を構成する銘柄が変更になること）、ならびに取得申込みの一部が金銭にて行われた場合および組入銘柄の配当金や権利処理等によってファンド内に現金が発生すること等の影響から、上記指数の動きに一致しないことがあります。

(ホ) 基準価額と取引価格の乖離にかかる留意点

ファンドは、東京証券取引所に上場し、当該取引所で取引されますが、その取引価格は、当該取引所における需給関係等を反映して決まります。したがって、ファンドの基準価額と取引価格は一致しないことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



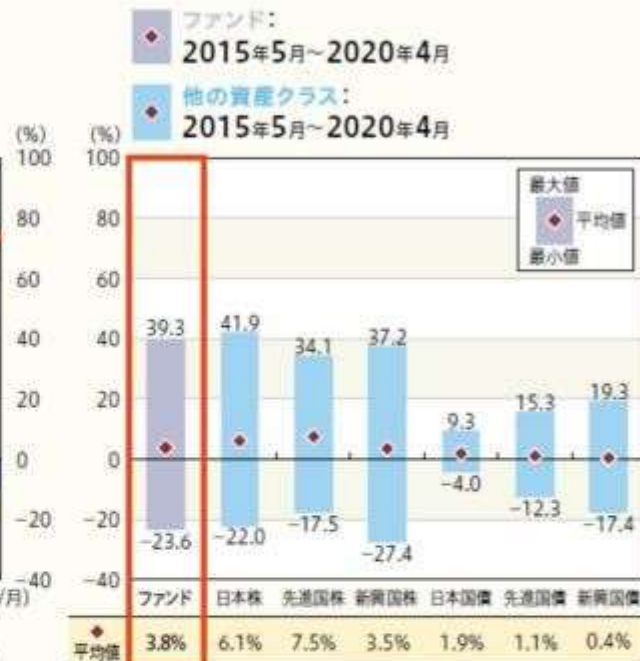
※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金(解約)手数料】

イ 換金手数料

販売会社は、受益権の交換または買取りに際して、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を受益者から徴収することができるものとします。

換金手数料は販売会社によるファンドの受益権の交換または買取りの取扱い事務等の対価です。

詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ロ 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算されるイとロの合計額とし、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

イ 計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0814% (税抜き0.074%) 以内の率を乗じて得た額

ロ ファンドの信託約款に規定する株式の貸付けの指図を行った場合は、その品貸料に0.55 (税抜き0.5) 以内を乗じて得た額

なお、2020年7月2日現在における上記イおよびロに規定する率、委託会社と受託会社の配分(税抜き)は以下の通りです。(今後、変更される場合があります。)

イの率および委託会社と受託会社の配分

合計	委託会社	受託会社
年0.0814% (税抜き0.074%)	年0.046%	年0.028%

ロの率および委託会社と受託会社の配分

合計	委託会社	受託会社
0.55 (税抜き0.5)	0.25	0.25

上記の配分(税抜き)には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行、名義登録・分配金支払事務等の対価

(4) 【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上し、信託財産中から支弁するものとします。

ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

- ニ 受益権の上場にかかる費用および消費税等に相当する金額は、信託財産中から支弁することができます。

2020年7月2日現在、追加上場料は追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に0.00825%(税抜き0.0075%)の率を乗じた額、年間上場料は毎年末のファンドの純資産総額に最大0.00825%(税抜き0.0075%)の率を乗じた額です。

- ホ 対象指数の商標(これに類する商標を含みます。)の使用料および消費税等に相当する金額は、信託財産中から支弁することができます。

2020年7月2日現在、商標使用料はファンドの純資産総額に最大年0.033%(税抜き0.03%)の率を乗じた額です。ただし、165万円(税抜き150万円)を下回る場合は、165万円(税抜き150万円)となります。

- ヘ 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.15%)を徴することができるものとします。

- ト 取得申込者がユニットに含まれる株式の発行会社等である場合には、原則として当該株式の時価総額に相当する金額および当該株式を取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.15%)を金銭にて支払うものとします。

上記口、八にかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)~(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

イ 個人受益者の場合

(イ) 受益権の売却時の課税

売却時の差益(譲渡益)については譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、確定申告は不要です。

売却時の損失(譲渡損)については、確定申告により、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。)、特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。)の譲渡益および利子等との損益通算が可能です。

(ロ) 収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行われます。なお、確定申告を行い、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります。)のいずれかを選択することもできます。

(ハ) 受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記(イ)の受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

(二) 償還時

償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

□ 法人受益者の場合

（イ）受益権の売却時の課税

受益権の売却価額と取得価額との差額について、他の法人所得と合算して課税されます。

（ロ）収益分配金の受取り時の課税

収益分配金は配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収され、他の法人所得と合算して課税されます。

収益分配金は益金不算入の対象となり、その限度は株式の配当金と同様の取扱いとなります。

（ハ）受益権と現物株式との交換

受益権と現物株式との交換についても受益権の譲渡として、上記（イ）の受益権の売却時と同様の取扱いとなります。

（ニ）償還時

償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

特定株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用が可能です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。

また、特定株式投資信託の分配金の受取方法については、販売会社の口座で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2020年4月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	28,713,779,390	98.15

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		541,908,831	1.85
合計(純資産総額)		29,255,688,221	100.00

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

その他以下の取引を行っております。

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	537,980,000	1.83
合計	買建		537,980,000	1.83

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 4月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	155,700	6,753.00	1,051,442,100	6,666.00	1,037,896,200	3.55
日本	株式	ソニー	電気機器	87,400	6,702.00	585,754,800	6,932.00	605,856,800	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	108,700	4,139.00	449,909,300	4,633.00	503,607,100	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	12,600	37,000.00	466,200,000	38,770.00	488,502,000	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	116,100	3,487.00	404,840,700	3,883.00	450,816,300	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	183,100	2,657.00	486,496,700	2,443.00	447,313,300	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	939,800	407.00	382,498,600	434.30	408,155,140	1.40
日本	株式	任天堂	その他製品	8,600	43,590.00	374,874,000	44,650.00	383,990,000	1.31
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	101,200	3,444.00	348,532,800	3,148.00	318,577,600	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	102,100	3,144.00	321,002,400	3,109.00	317,428,900	1.09
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	95,400	2,730.00	260,442,000	3,182.00	303,562,800	1.04

日本	株式	第一三共	医薬品	40,000	7,530.00	301,200,000	7,382.00	295,280,000	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	109,800	2,424.50	266,210,100	2,610.50	286,632,900	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	23,500	11,375.00	267,312,500	12,015.00	282,352,500	0.97
日本	株式	花王	化学	33,400	9,083.00	303,372,200	8,316.00	277,754,400	0.95
日本	株式	H O Y A	精密機器	27,800	9,964.00	276,999,200	9,866.00	274,274,800	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	95,000	2,696.00	256,120,000	2,844.00	270,180,000	0.92
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,800	13,995.00	249,111,000	14,005.00	249,289,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,600	5,098.00	247,762,800	5,086.00	247,179,600	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	41,000	5,726.00	234,766,000	6,019.00	246,779,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	13,300	14,580.00	193,914,000	17,830.00	237,139,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,866,300	123.30	230,114,790	125.80	234,780,540	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	96,400	2,231.50	215,116,600	2,300.00	221,720,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	67,000	3,150.00	211,050,000	3,241.00	217,147,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	120,900	1,699.50	205,469,550	1,786.50	215,987,850	0.74
日本	株式	S M C	機械	4,400	47,880.00	210,672,000	49,000.00	215,600,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	33,500	5,569.00	186,561,500	6,286.00	210,581,000	0.72
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,900	22,620.00	201,318,000	22,940.00	204,166,000	0.70
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	96,000	2,155.50	206,928,000	2,125.00	204,000,000	0.70
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	11,600	18,350.00	212,860,000	17,005.00	197,258,000	0.67

□ 種別・業種別の投資比率

2020年 4月30日現在

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	2.60
		食料品	3.94
		繊維製品	0.51
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.26
		医薬品	6.51

石油・石炭製品	0.45
ゴム製品	0.63
ガラス・土石製品	0.75
鉄鋼	0.55
非鉄金属	0.65
金属製品	0.53
機械	4.96
電気機器	14.44
輸送用機器	7.26
精密機器	2.54
その他製品	2.42
電気・ガス業	1.63
陸運業	4.22
海運業	0.14
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.61
卸売業	4.58
小売業	4.67
銀行業	5.08
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	2.13
サービス業	5.04
合計	98.15

【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】

2020年 4月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
----	------	----	-----------	----	----	-----------	-----------	-----------------

株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	37日本円	517,348,300	537,980,000	1.83
----------	-------	----------	----	-------	-------------	-------------	------

(注) 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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

年月日	純資産総額 (円)		100口当たりの 純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格(円)
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第1期 (2020年 4月 8日)	28,476,872,305	28,845,250,742	142,625	144,470	1,403
2019年12月末日	10,328,155,378		172,360		1,726
2020年 1月末日	10,106,562,558		168,662		1,697
2月末日	15,142,673,738		151,334		1,505
3月末日	28,412,090,836		142,300		1,411
4月末日	29,255,688,221		146,525		1,450

(注) 各月末日における東京証券取引所取引価格は、原則として、該当月の最終営業日における終値を表示しておりますが、終値がない場合には、その直近値を表示しております。

【分配の推移】

	計算期間	100口当たり分配金(円)
第1期	2019年12月13日～2020年 4月 8日	1,845

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	15.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。ただし、第1期については、第1期計算期間末の分配基準価額から当初元本(1口当たり1,713円)を控除した額を当初元本(1口当たり1,713円)で除した値としております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	21,939,400	1,973,089

(注1) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(注2) 解約口数は、交換口数を表示しております。

参考情報

基準日: 2020年4月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※分配金再投資基準価額、基準価額は、100口当たり、信託報酬控除後です。
※分配金再投資基準価額は、上記期間における分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

分配の推移

決算期	分配金
2020年4月	1,845円
設定来累計	1,845円

※分配金は100口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.85
合計(純資産総額)		100.00

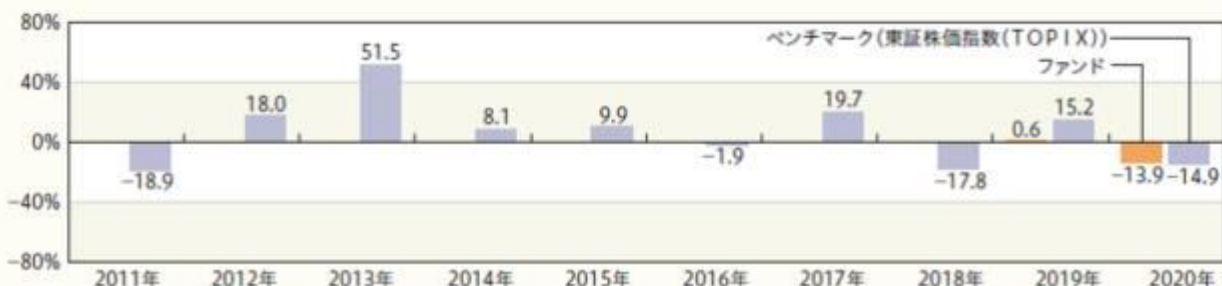
※株価指数先物取引の買建て 1.83%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.55
日本	株式	ソニー	電気機器	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.53
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.40
日本	株式	任天堂	その他製品	1.31
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.09

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。
※2019年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2019年12月13日)から年末までの騰落率を表示しています。
※2020年の収益率は、年初から2020年4月30日までの騰落率を表示しています。
※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) 当ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドの取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する株式をもって取得の申込みを行うものとします。当該株式は、対象指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ(ユニット)とします。

なお、当該ユニットの評価額が、取得する受益権口数の評価額(取得申込受益権口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額)に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭をもって支払うものとします。

(ロ) 当ファンドの取得申込者が、委託会社が別に定める時限(営業日の午後3時)までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その申込みの翌営業日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受け付けます。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる株式および金銭の受渡または支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 当ファンドの取得申込者が対象指数の構成銘柄である株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みにかかるユニットのうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値(終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。)に取得申込みにかかるユニットに含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該株式の個別銘柄時価総額に0.15%の率を乗じて得た額)を徴収します。

(ホ) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込受付日が以下に定める日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません。

1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間
2. 対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間
3. 計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間(ただし、計算期間終了日が休日(営業日でない日をいいます。)の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内)
4. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
5. 上記1.~4.のほか、委託会社が運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

ただし、委託会社は、上記に定める日における受益権の取得申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における受益権の取得申込みについては、当該取得申込みの受け付けを行うことができます。

(ヘ) 上記(ホ)1.に該当する日(対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々の前営業日を除きます。)において、当ファンドの取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかるユニットのうち、配当落または権利落対象銘柄(以下「対象銘柄」といいます。)の

個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付ける場合があります。この場合において、委託会社は、当該対象銘柄を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該株式の個別銘柄時価総額に0.15%の率を乗じて得た額)を徴収します。

- (ト) 金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、投資方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると認めるとき、またはその他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

□ 申込価額

当初申込期間：1口当たり1,713円です。

継続申込期間：取得申込受付日の基準価額となります。

八 申込手数料

販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額を取得申込者から徴収することができるものとします。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

二 申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

取得申込みにかかる口数は、委託会社が定めるものとし、100口の整数倍とします。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は販売会社の指定する日までに、原則としてその保有する株式等を販売会社に引き渡すものとします。

振替受益権にかかる各取得申込受付日の発行価額の総額に相当する株式等は、販売会社によって、追加信託が行われる日(当初申込期間にかかる発行価額の総額に相当する株式等については設定日)に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。株式等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行われる日(当初申込期間にかかる金銭については設定日)に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金(解約)手続等】

イ 信託契約の一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権につき、信託期間中において、解約請求(一部解約の実行請求)をすることはできません。

ロ 交換請求

- (イ) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に、当該受益権と信託財産に属する株式との交換(以下「交換」といいます。)を請求することができます。

委託会社は、委託会社が別に定める時限(営業日の午後3時)までに交換請求が行われ、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その請求の翌営業日を交換請求受付日として、当該交換請求を受け付けます。受益者は、交換請求にかかる一定口数(当該口数に交換請求受付日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求受付日において委託会社が対象指数の動きに連動す

ると想定する、対象指数における各構成銘柄の評価額の合計に相当するものとして、委託会社が定める口数をいい、以下「交換請求口数」といいます。)の整数倍の受益権をもって交換請求を行うことができます。

受益者が交換請求を行うときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

(ロ) 販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとします。当該抹消にかかる手続きおよび交換株式にかかる振替の請求が行われた後に、振替機関は、当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定に従い振替機関等の口座に交換請求を行った受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行われます。

(ハ) 委託会社は、受益者から提示された口数の振替受益権から受益者が取得できる個別銘柄の株式の株数と、交換に要する受益権の口数(1口未満の端数があるときは、1口に切り上げます。)を計算します。

交換にかかる受益権の価額は交換請求受付日の基準価額とします。この場合において、受益者が交換によって取得する個別銘柄の株式の株数は、交換請求受付日における当該株式の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位(金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。以下同じ。)の整数倍とします。

販売会社は、交換時において、当該手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を当該交換請求を行った受益者から徴収することができるものとします。

(ニ) 委託会社は、受託会社に対し、上記(ハ)により計算された口数の受益権と信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。ただし、交換の請求を行った受益者が、対象指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、上記(ハ)の交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、上記(ハ)の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値(終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。)に上記(ハ)に基づき計算された数を乗じて得た金額とします。

(ホ) 受託会社は、交換のための振替受益権の抹消にかかる手続きが行われたことを確認した場合に、委託会社の指図に従い、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換株式にかかる振替の請求を行うものとします。受益者への交換株式の交付に際しては、原則として交換請求の受付日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に交換の請求を行った受益者にかかる株式の増加の記載または記録が行われます。

(ヘ) 委託会社は、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取り扱うこととし、受託会社は、当該受益権にかかる振替受益権が交換株式の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

(ト) 受託会社は、委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび上記(ヘ)の抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したものとして取り扱います。

(チ) 申込不可日

上記にかかわらず、交換請求受付日が以下に定める日に当たる場合には、交換請求の受付は行いません。

1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間
2. 対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間
3. 計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間(ただし、計算期間終了日が休日(営業日でない日をいいます。)の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内)
4. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間

5. 上記1.～4.のほか、委託会社が運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき

なお委託会社は、上記に定める日における交換請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における交換請求については、当該交換請求の受け付けを行うことができます。

- (リ) 上記にかかわらず、委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、決済機能の停止、投資方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると認めるとき、またはその他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた交換請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できません。受益者がその交換請求を撤回しない場合には、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交換請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

八 受益権の買取請求

販売会社は、以下(イ)、(ロ)に該当する場合で受益者の請求があるときは、その翌営業日を買取請求受付日としてその受益権を買い取ります。ただし、(ロ)の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

(イ) 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

(ロ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取請求受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取り時において、当該手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を当該買取請求を行った受益者から徴収することができるものとします。

販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

この場合、受益者は当該受付停止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受付停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、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。）を法令およ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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。なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせください。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2019年12月13日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年4月9日から10月8日まで、および10月9日から翌年4月8日までとします。なお、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】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、信託財産の一部を受益権と交換することにより受益権の口数が200万口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中において次の1.～3.に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
 2. 対象指数が廃止された場合
 3. 対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めたこの信託約款の変更が書面決議により否決された場合なお、上記1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。
- c. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- d. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、委託会社が上記aの規定に基づいて信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、上記bの規定に基づいて信託契約を解約する場合、および信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c～eまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従

い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(八) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 信託約款の変更等

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。

(ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

八 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更等が行われる場合において、書面決議において当該議案に反対した受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

二 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益権とその信託財産に属する株式との交換に関する事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ホ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

へ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

ト 運用にかかる報告書の開示方法

投資信託及び投資法人に関する法律の規定により、運用報告書の作成、交付は行いません。

チ 金融商品取引所への上場

委託会社および受託会社は、当ファンドの受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとします。

委託会社および受託会社は、当ファンドの受益権が上場された場合には、当該金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとします。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権および名義登録

受益者（計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

受託会社は、ファンドにかかる受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。以下同じ。）または法人番号（同条に規定する法人番号をいいます。以下同じ。）（個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所とします。以下同じ。）その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権にかかる受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号または法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払いの取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。）その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式により行うものとします。

なお、受益者はファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限り、）を経由して受益者名簿に名義を登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴収することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社（受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。

受託会社は、支払開始日から5年経過した後、収益分配金について未払残高があるときは、当

該金額を委託会社に交付するものとします。

受益者が、支払開始日から5年間、収益分配金の支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

償還は、信託終了日現在において受益者名簿に名義登録されている者を信託終了日現在における受益者（以下「信託終了時受益者」といいます。）として、当該信託終了時受益者に、信託終了時の信託財産の純資産総額に相当する金銭を支払うことにより行います。なお、当該信託終了時受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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または記録が行われます。

信託終了時受益者に交付する金銭の額は、信託終了時の基準価額（信託終了時の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。）に、当該信託終了時受益者に属する受益権の口数を乗じた額とします。なお、この場合における税法上の受益権1口あたり元本の額は、信託終了時において信託されている金額を受益権総口数で除した金額とします。

償還金の支払いは、原則として受託会社が、信託終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日から行うものとし、信託終了時受益者は、受託会社から送付される領収書をゆうちょ銀行に持ち込む方式や受託会社から振り込まれる預金口座等をあらかじめ指定する方式などにより償還金を受領できます。

受益者が、信託終了による償還金について、支払開始日から10年経過した後に未払残高があるときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 交換請求権および買取請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、交換または買取りを請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

書面決議の結果、当ファンドの解約または重大な信託約款の変更が行われる場合は、書面決議において当該議案に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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)ならびに同規則第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1期(2019年12月13日から2020年4月8日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

		第1期 (2020年 4月 8日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		467,982,916
株式		27,986,972,900
派生商品評価勘定		13,124,500
未収配当金		359,512,179
差入委託証拠金		37,465,000
流動資産合計		28,865,057,495
資産合計		28,865,057,495
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		4,602,500
前受金		8,555,000
未払収益分配金		368,378,437
未払受託者報酬		1,426,559
未払委託者報酬		2,343,595
その他未払費用		2,879,099
流動負債合計		388,185,190
負債合計		388,185,190
純資産の部		
元本等		
元本		34,202,290,743
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()		5,725,418,438
元本等合計		28,476,872,305
純資産合計		28,476,872,305
負債純資産合計		28,865,057,495

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日
営業収益	
受取配当金	375,042,535
有価証券売買等損益	1,972,328,506
派生商品取引等損益	3,754,000
営業収益合計	1,601,039,971
営業費用	
支払利息	5,672
受託者報酬	1,426,559
委託者報酬	2,343,595
その他費用	2,880,279
営業費用合計	6,656,105
営業利益又は営業損失()	1,607,696,076
経常利益又は経常損失()	1,607,696,076
当期純利益又は当期純損失()	1,607,696,076
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()	-
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,051,477
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,051,477
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,826,395,402
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,826,395,402
分配金	368,378,437
期末剰余金又は期末欠損金()	5,725,418,438

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	
	(2020年 4月 8日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		19,966,311口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	5,725,418,438円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,426.25円
	(100口当たりの純資産額)	142,625円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(368,386,430円)および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は368,386,430円(100口当たり1,845.04円)であり、うち368,378,437円(100口当たり1,845円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2020年 4月 8日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式、新株予約権証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期（自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,821,131,560円
合計	1,821,131,560円

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（2020年 4月 8日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	814,233,000	-	822,755,000	8,522,000
	東証株価指数先物	814,233,000	-	822,755,000	8,522,000
	合計	814,233,000	-	822,755,000	8,522,000

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に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います。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います。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項目	第1期 (2020年 4月 8日現在)
期首元本額	10,264,638,600円
期中追加設定元本額	27,317,553,600円
期中一部交換元本額	3,379,901,457円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	700	2,597.00	1,817,900	
日本水産	19,000	470.00	8,930,000	
マルハニチロ	2,700	2,287.00	6,174,900	
カネコ種苗	600	1,450.00	870,000	
サカタのタネ	2,300	3,210.00	7,383,000	
ホクト	1,400	1,879.00	2,630,600	
ホクリヨウ	200	583.00	116,600	
住石ホールディングス	5,300	117.00	620,100	
日鉄鉱業	400	4,320.00	1,728,000	
三井松島ホールディングス	700	869.00	608,300	
国際石油開発帝石	76,000	662.20	50,327,200	
石油資源開発	2,500	1,910.00	4,775,000	
K & O エナジーグループ	900	1,635.00	1,471,500	
ヒノキヤグループ	400	1,342.00	536,800	
ショーボンドホールディングス	3,000	4,200.00	12,600,000	
ミライト・ホールディングス	5,800	1,299.00	7,534,200	
タマホーム	1,100	1,115.00	1,226,500	
日本アクア	900	637.00	573,300	
ファーストコーポレーション	1,100	432.00	475,200	
ベステラ	300	947.00	284,100	
T A T E R U	3,900	113.00	440,700	
スペースバリューホールディングス	2,500	323.00	807,500	
ダイセキ環境ソリューション	200	868.00	173,600	
第一カッター興業	200	1,583.00	316,600	
明豊ファシリティワークス	300	474.00	142,200	
安藤・間	11,400	679.00	7,740,600	
東急建設	5,700	552.00	3,146,400	
コムシスホールディングス	6,700	2,673.00	17,909,100	

ビーアールホールディングス	2,200	493.00	1,084,600	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,369.00	2,605,900	
東建コーポレーション	600	7,470.00	4,482,000	
ヤマウラ	1,100	746.00	820,600	
大成建設	14,600	3,350.00	48,910,000	
大林組	43,600	979.00	42,684,400	
清水建設	44,300	846.00	37,477,800	
飛島建設	1,300	993.00	1,290,900	
長谷工コーポレーション	16,900	1,132.00	19,130,800	
松井建設	2,100	619.00	1,299,900	
銭高組	200	3,510.00	702,000	
鹿島建設	34,300	1,090.00	37,387,000	
不動テトラ	1,200	1,266.00	1,519,200	
大末建設	300	741.00	222,300	
鉄建建設	900	2,274.00	2,046,600	
西松建設	3,400	2,052.00	6,976,800	
三井住友建設	10,700	438.00	4,686,600	
大豊建設	1,100	2,195.00	2,414,500	
前田建設工業	11,100	844.00	9,368,400	
佐田建設	600	345.00	207,000	
ナカノフドー建設	600	341.00	204,600	
奥村組	2,300	2,336.00	5,372,800	
東鉄工業	1,900	2,773.00	5,268,700	
イチケン	200	1,142.00	228,400	
富士ピー・エス	900	506.00	455,400	
浅沼組	500	3,345.00	1,672,500	
戸田建設	18,100	630.00	11,403,000	
熊谷組	2,000	2,409.00	4,818,000	
北野建設	200	2,370.00	474,000	
植木組	100	2,446.00	244,600	
矢作建設工業	2,300	751.00	1,727,300	
ピーエス三菱	1,500	528.00	792,000	
日本ハウスホールディングス	3,700	278.00	1,028,600	
大東建託	5,200	10,255.00	53,326,000	
新日本建設	2,000	781.00	1,562,000	
N I P P O	3,600	2,335.00	8,406,000	
東亜道路工業	200	2,985.00	597,000	
前田道路	3,900	1,997.00	7,788,300	
日本道路	400	6,370.00	2,548,000	
東亜建設工業	1,300	1,354.00	1,760,200	
日本国土開発	3,100	559.00	1,732,900	
若築建設	700	1,166.00	816,200	

東洋建設	4,700	445.00	2,091,500
五洋建設	17,400	549.00	9,552,600
世紀東急工業	2,400	798.00	1,915,200
福田組	500	4,295.00	2,147,500
住友林業	11,100	1,339.00	14,862,900
日本基礎技術	1,200	385.00	462,000
巴コーポレーション	2,200	337.00	741,400
大和ハウス工業	43,200	2,734.00	118,108,800
ライト工業	2,600	1,262.00	3,281,200
積水ハウス	47,800	1,839.50	87,928,100
日特建設	1,400	725.00	1,015,000
北陸電気工事	700	910.00	637,000
ユアテック	2,900	613.00	1,777,700
四電工	200	2,375.00	475,000
中電工	1,800	2,198.00	3,956,400
関電工	6,100	848.00	5,172,800
きんでん	10,400	1,688.00	17,555,200
東京エネシス	1,500	809.00	1,213,500
トーエネック	400	3,170.00	1,268,000
住友電設	1,200	2,108.00	2,529,600
日本電設工業	2,300	2,173.00	4,997,900
協和エクシオ	6,600	2,373.00	15,661,800
新日本空調	1,200	2,099.00	2,518,800
九電工	3,100	2,809.00	8,707,900
三機工業	3,200	1,187.00	3,798,400
日揮ホールディングス	13,400	989.00	13,252,600
中外炉工業	400	1,485.00	594,000
ヤマト	1,500	650.00	975,000
太平電業	1,100	2,203.00	2,423,300
高砂熱学工業	3,800	1,687.00	6,410,600
三晃金属工業	100	2,072.00	207,200
朝日工業社	300	3,035.00	910,500
明星工業	3,000	725.00	2,175,000
大気社	2,100	3,120.00	6,552,000
ダイダン	1,100	2,789.00	3,067,900
日比谷総合設備	1,400	1,880.00	2,632,000
フィル・カンパニー	200	2,423.00	484,600
OSJBホールディングス	7,300	232.00	1,693,600
東洋エンジニアリング	2,400	335.00	804,000
レイズネクスト	2,300	1,226.00	2,819,800
日本製粉	4,000	1,680.00	6,720,000
日清製粉グループ本社	15,800	1,693.00	26,749,400

日東富士製粉	100	5,950.00	595,000
昭和産業	1,300	3,230.00	4,199,000
鳥越製粉	1,400	857.00	1,199,800
中部飼料	1,700	1,579.00	2,684,300
フィード・ワン	10,000	160.00	1,600,000
東洋精糖	100	1,198.00	119,800
日本甜菜製糖	700	1,693.00	1,185,100
三井製糖	1,300	2,126.00	2,763,800
塩水港精糖	1,300	197.00	256,100
日新製糖	700	1,956.00	1,369,200
森永製菓	3,300	4,360.00	14,388,000
中村屋	300	3,930.00	1,179,000
江崎グリコ	4,200	4,730.00	19,866,000
名糖産業	700	1,332.00	932,400
井村屋グループ	700	1,923.00	1,346,100
不二家	700	2,051.00	1,435,700
山崎製パン	10,500	2,298.00	24,129,000
第一屋製パン	200	909.00	181,800
モロゾフ	200	5,280.00	1,056,000
亀田製菓	700	4,940.00	3,458,000
寿スピリッツ	1,400	4,820.00	6,748,000
カルビー	6,400	3,080.00	19,712,000
森永乳業	2,600	4,140.00	10,764,000
六甲バター	900	1,428.00	1,285,200
ヤクルト本社	9,600	6,530.00	62,688,000
明治ホールディングス	9,300	7,700.00	71,610,000
雪印メグミルク	3,400	2,410.00	8,194,000
プリマハム	2,100	2,384.00	5,006,400
日本ハム	5,300	3,570.00	18,921,000
林兼産業	200	535.00	107,000
丸大食品	1,600	1,892.00	3,027,200
S Foods	1,200	2,238.00	2,685,600
柿安本店	500	2,160.00	1,080,000
伊藤ハム米久ホールディングス	9,300	626.00	5,821,800
サッポロホールディングス	4,800	1,993.00	9,566,400
アサヒグループホールディングス	29,300	3,612.00	105,831,600
キリンホールディングス	59,300	2,245.00	133,128,500
宝ホールディングス	10,400	743.00	7,727,200
オエノンホールディングス	4,000	390.00	1,560,000
養命酒製造	400	1,928.00	771,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,800	2,056.00	20,148,800
サントリー食品インターナショナル	9,400	4,265.00	40,091,000

ダイドーグループホールディングス	700	4,000.00	2,800,000
伊藤園	4,300	5,990.00	25,757,000
キーコーヒー	1,300	2,288.00	2,974,400
ユニカフェ	200	828.00	165,600
ジャパンフーズ	200	1,122.00	224,400
日清オイリオグループ	1,800	3,345.00	6,021,000
不二製油グループ本社	3,400	2,618.00	8,901,200
かどや製油	100	3,500.00	350,000
J・オイルミルズ	800	4,315.00	3,452,000
キッコーマン	10,100	4,860.00	49,086,000
味の素	30,900	1,908.50	58,972,650
キューピー	7,800	2,109.00	16,450,200
ハウス食品グループ本社	5,300	3,240.00	17,172,000
カゴメ	5,300	2,825.00	14,972,500
焼津水産化学工業	700	913.00	639,100
アリアケジャパン	1,300	6,450.00	8,385,000
ピエトロ	200	1,591.00	318,200
エバラ食品工業	300	2,192.00	657,600
やまみ	100	1,850.00	185,000
ニチレイ	6,700	2,892.00	19,376,400
東洋水産	7,200	5,350.00	38,520,000
イートアンド	400	1,725.00	690,000
大冷	100	1,779.00	177,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	862.00	603,400
日清食品ホールディングス	5,900	8,940.00	52,746,000
永谷園ホールディングス	700	2,203.00	1,542,100
一正蒲鉾	700	950.00	665,000
フジッコ	1,600	1,979.00	3,166,400
ロック・フィールド	1,600	1,418.00	2,268,800
日本たばこ産業	80,700	1,996.50	161,117,550
ケンコーマヨネーズ	800	2,034.00	1,627,200
わらべや日洋ホールディングス	900	1,756.00	1,580,400
なとり	800	1,725.00	1,380,000
イフジ産業	200	749.00	149,800
ピクルスコーポレーション	300	2,322.00	696,600
北の達人コーポレーション	4,700	537.00	2,523,900
ユーグレナ	6,000	688.00	4,128,000
ミヨシ油脂	600	1,051.00	630,600
理研ビタミン	1,400	2,081.00	2,913,400
片倉工業	2,000	1,007.00	2,014,000
ゲンゼ	900	3,615.00	3,253,500
東洋紡	5,600	1,120.00	6,272,000

ユニチカ	4,400	282.00	1,240,800
富士紡ホールディングス	700	2,587.00	1,810,900
倉敷紡績	1,300	2,442.00	3,174,600
シキボウ	700	959.00	671,300
日本毛織	4,600	908.00	4,176,800
ダイトウボウ	2,200	150.00	330,000
トーア紡コーポレーション	1,300	449.00	583,700
ダイドーリミテッド	2,600	190.00	494,000
帝国繊維	1,600	2,163.00	3,460,800
帝人	11,100	1,747.00	19,391,700
東レ	98,800	460.00	45,448,000
サカイオーベックス	300	1,918.00	575,400
住江織物	200	1,742.00	348,400
日本フェルト	300	424.00	127,200
イチカワ	100	1,332.00	133,200
日東製網	100	1,533.00	153,300
アツギ	1,400	617.00	863,800
ダイニック	400	684.00	273,600
セーレン	3,300	1,299.00	4,286,700
ソトー	700	939.00	657,300
小松マテーレ	2,500	751.00	1,877,500
ワコールホールディングス	3,600	2,200.00	7,920,000
ホギメディカル	1,600	3,415.00	5,464,000
レナウン	2,100	73.00	153,300
T S Iホールディングス	4,700	381.00	1,790,700
マツオカコーポレーション	400	1,679.00	671,600
ワールド	2,000	1,334.00	2,668,000
三陽商会	700	917.00	641,900
ナイガイ	400	439.00	175,600
オンワードホールディングス	8,100	421.00	3,410,100
ルックホールディングス	200	754.00	150,800
キムラタン	7,400	24.00	177,600
ゴールドウイン	2,500	5,600.00	14,000,000
デサント	2,700	1,257.00	3,393,900
キング	1,000	496.00	496,000
ヤマトインターナショナル	300	325.00	97,500
特種東海製紙	800	4,105.00	3,284,000
王子ホールディングス	56,900	580.00	33,002,000
日本製紙	6,000	1,554.00	9,324,000
三菱製紙	2,100	355.00	745,500
北越コーポレーション	9,300	401.00	3,729,300
中越パルプ工業	700	1,387.00	970,900

巴川製紙所	300	791.00	237,300
大王製紙	6,000	1,460.00	8,760,000
阿波製紙	300	460.00	138,000
レンゴー	13,100	837.00	10,964,700
トーモク	800	1,523.00	1,218,400
ザ・パック	1,000	3,565.00	3,565,000
クラレ	21,500	1,075.00	23,112,500
旭化成	90,400	733.50	66,308,400
共和レザー	600	682.00	409,200
昭和電工	9,700	2,283.00	22,145,100
住友化学	99,800	306.00	30,538,800
住友精化	600	2,631.00	1,578,600
日産化学	7,600	3,850.00	29,260,000
ラサ工業	400	1,340.00	536,000
クレハ	1,200	4,445.00	5,334,000
多木化学	400	4,185.00	1,674,000
テイカ	1,100	1,499.00	1,648,900
石原産業	2,500	568.00	1,420,000
片倉コープアグリ	300	1,155.00	346,500
日本曹達	2,000	2,799.00	5,598,000
東ソー	21,100	1,272.00	26,839,200
トクヤマ	3,900	2,153.00	8,396,700
セントラル硝子	2,800	1,843.00	5,160,400
東亜合成	8,700	940.00	8,178,000
大阪ソーダ	1,300	2,524.00	3,281,200
関東電化工業	3,300	777.00	2,564,100
デンカ	5,000	2,728.00	13,640,000
信越化学工業	23,500	11,375.00	267,312,500
日本カーバイド工業	400	967.00	386,800
堺化学工業	800	1,747.00	1,397,600
第一稀元素化学工業	1,500	754.00	1,131,000
エア・ウォーター	12,700	1,401.00	17,792,700
大陽日酸	13,200	1,545.00	20,394,000
日本化学工業	400	2,167.00	866,800
東邦アセチレン	200	1,197.00	239,400
日本パーカラライジング	6,900	1,108.00	7,645,200
高压ガス工業	2,500	666.00	1,665,000
チタン工業	100	1,701.00	170,100
四国化成工業	2,000	999.00	1,998,000
戸田工業	200	1,299.00	259,800
ステラ ケミファ	700	2,386.00	1,670,200
保土谷化学工業	500	3,055.00	1,527,500

日本触媒	2,100	5,070.00	10,647,000
大日精化工業	1,200	2,188.00	2,625,600
カネカ	3,500	2,591.00	9,068,500
三菱瓦斯化学	12,700	1,285.00	16,319,500
三井化学	12,400	1,957.00	24,266,800
J S R	12,700	1,941.00	24,650,700
東京応化工業	2,300	3,930.00	9,039,000
大阪有機化学工業	1,300	1,584.00	2,059,200
三菱ケミカルホールディングス	91,100	632.50	57,620,750
K Hネオケム	2,400	1,569.00	3,765,600
ダイセル	18,700	797.00	14,903,900
住友ベークライト	2,100	2,491.00	5,231,100
積水化学工業	29,300	1,441.00	42,221,300
日本ゼオン	12,500	838.00	10,475,000
アイカ工業	4,100	3,060.00	12,546,000
宇部興産	6,900	1,638.00	11,302,200
積水樹脂	2,500	2,028.00	5,070,000
タキロンシーアイ	3,100	573.00	1,776,300
旭有機材	700	1,335.00	934,500
日立化成	6,300	4,615.00	29,074,500
ニチバン	700	1,509.00	1,056,300
リケンテクノス	3,700	390.00	1,443,000
大倉工業	700	1,603.00	1,122,100
積水化成品工業	2,000	556.00	1,112,000
群栄化学工業	300	2,463.00	738,900
タイガースポリマー	1,300	447.00	581,100
ミライアル	400	985.00	394,000
ダイキアクシス	300	728.00	218,400
ダイキョーニシカワ	3,000	446.00	1,338,000
竹本容器	300	618.00	185,400
森六ホールディングス	700	1,448.00	1,013,600
日本化薬	8,600	976.00	8,393,600
カーリットホールディングス	1,600	456.00	729,600
日本精化	1,200	1,481.00	1,777,200
扶桑化学工業	1,400	2,978.00	4,169,200
トリケミカル研究所	300	8,010.00	2,403,000
A D E K A	6,200	1,320.00	8,184,000
日油	5,200	3,570.00	18,564,000
新日本理化	1,300	158.00	205,400
ハリマ化成グループ	1,100	1,045.00	1,149,500
花王	33,400	9,083.00	303,372,200
第一工業製薬	500	3,955.00	1,977,500

石原ケミカル	300	1,894.00	568,200
日華化学	300	849.00	254,700
ニイタカ	200	2,804.00	560,800
三洋化成工業	800	4,030.00	3,224,000
有機合成薬品工業	1,000	252.00	252,000
大日本塗料	1,700	888.00	1,509,600
日本ペイントホールディングス	11,300	5,800.00	65,540,000
関西ペイント	15,400	2,073.00	31,924,200
神東塗料	500	147.00	73,500
中国塗料	4,000	813.00	3,252,000
日本特殊塗料	1,200	765.00	918,000
藤倉化成	2,000	490.00	980,000
太陽ホールディングス	1,000	4,140.00	4,140,000
D I C	5,800	2,367.00	13,728,600
サカタインクス	3,100	881.00	2,731,100
東洋インキS Cホールディングス	2,800	2,028.00	5,678,400
T & K T O K A	1,400	712.00	996,800
富士フィルムホールディングス	26,800	5,732.00	153,617,600
資生堂	27,700	6,530.00	180,881,000
ライオン	18,100	2,325.00	42,082,500
高砂香料工業	800	2,002.00	1,601,600
マンダム	3,200	2,104.00	6,732,800
ミルボン	1,900	5,120.00	9,728,000
ファンケル	5,700	2,464.00	14,044,800
コーセー	2,600	13,620.00	35,412,000
コタ	770	1,204.00	927,080
シーボン	200	2,111.00	422,200
ポーラ・オルビスホールディングス	6,000	2,082.00	12,492,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,400.00	7,020,000
アジュバンコスメジャパン	200	909.00	181,800
エステー	800	1,524.00	1,219,200
アグロ カネショウ	400	1,664.00	665,600
コニシ	2,200	1,358.00	2,987,600
長谷川香料	1,900	2,016.00	3,830,400
星光P M C	1,100	646.00	710,600
小林製薬	3,900	10,840.00	42,276,000
荒川化学工業	1,300	1,167.00	1,517,100
メック	900	1,536.00	1,382,400
日本高純度化学	400	2,426.00	970,400
タカラバイオ	3,700	2,140.00	7,918,000
J C U	1,700	2,262.00	3,845,400
新田ゼラチン	500	609.00	304,500

O A Tアグリオ	100	892.00	89,200
デクセリアルズ	3,800	716.00	2,720,800
アース製薬	1,100	5,670.00	6,237,000
北興化学工業	1,700	641.00	1,089,700
大成ラミック	400	2,459.00	983,600
クミアイ化学工業	6,000	831.00	4,986,000
日本農薬	3,100	432.00	1,339,200
アキレス	900	1,678.00	1,510,200
有沢製作所	2,300	817.00	1,879,100
日東電工	9,600	4,995.00	47,952,000
レック	1,600	1,003.00	1,604,800
三光合成	1,900	239.00	454,100
きもと	1,300	129.00	167,700
藤森工業	1,200	3,040.00	3,648,000
前澤化成工業	700	969.00	678,300
未来工業	700	2,006.00	1,404,200
ウェーブロックホールディングス	300	516.00	154,800
J S P	800	1,296.00	1,036,800
エフピコ	1,600	7,880.00	12,608,000
天馬	800	1,636.00	1,308,800
信越ポリマー	2,700	840.00	2,268,000
東リ	4,300	255.00	1,096,500
ニフコ	5,100	1,887.00	9,623,700
バルカー	1,100	1,752.00	1,927,200
ユニ・チャーム	26,900	4,189.00	112,684,100
協和キリン	14,000	2,403.00	33,642,000
武田薬品工業	116,100	3,487.00	404,840,700
アステラス製薬	120,900	1,699.50	205,469,550
大日本住友製薬	10,200	1,389.00	14,167,800
塩野義製薬	17,900	5,527.00	98,933,300
わかもと製薬	2,500	223.00	557,500
あすか製薬	1,800	1,136.00	2,044,800
日本新薬	3,700	7,780.00	28,786,000
バイオフェルミン製薬	200	2,350.00	470,000
中外製薬	14,500	13,660.00	198,070,000
科研製薬	2,400	5,570.00	13,368,000
エーザイ	16,700	7,678.00	128,222,600
ロート製薬	7,100	3,175.00	22,542,500
小野薬品工業	32,000	2,554.50	81,744,000
久光製薬	3,700	5,010.00	18,537,000
持田製薬	2,000	4,230.00	8,460,000
参天製薬	25,900	1,904.00	49,313,600

扶桑薬品工業	500	2,123.00	1,061,500
日本ケミファ	200	2,330.00	466,000
ツムラ	4,300	2,841.00	12,216,300
日医工	4,000	1,382.00	5,528,000
キッセイ薬品工業	2,400	2,600.00	6,240,000
生化学工業	2,700	1,108.00	2,991,600
栄研化学	2,200	2,065.00	4,543,000
日水製薬	600	1,177.00	706,200
鳥居薬品	800	2,544.00	2,035,200
JCRファーマ	1,000	10,070.00	10,070,000
東和薬品	1,700	2,253.00	3,830,100
富士製薬工業	800	1,131.00	904,800
沢井製薬	2,900	6,120.00	17,748,000
ゼリア新薬工業	2,500	2,003.00	5,007,500
第一三共	40,000	7,530.00	301,200,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	2,186.00	6,558,000
大幸薬品	1,600	1,716.00	2,745,600
ダイト	800	2,882.00	2,305,600
大塚ホールディングス	26,600	4,291.00	114,140,600
大正製薬ホールディングス	3,000	6,570.00	19,710,000
ペプチドリーム	7,100	3,395.00	24,104,500
日本コークス工業	10,600	59.00	625,400
ニチレキ	1,800	1,351.00	2,431,800
ユシロ化学工業	700	1,136.00	795,200
ビーピー・カストロール	600	1,117.00	670,200
富士石油	3,400	187.00	635,800
MORESCO	600	902.00	541,200
出光興産	15,700	2,540.00	39,878,000
JXTGホールディングス	209,300	386.50	80,894,450
コスモエネルギーホールディングス	4,000	1,648.00	6,592,000
横浜ゴム	8,100	1,308.00	10,594,800
TOYO TIRE	8,000	1,162.00	9,296,000
ブリヂストン	40,100	3,358.00	134,655,800
住友ゴム工業	12,500	998.00	12,475,000
藤倉コンポジット	700	339.00	237,300
オカモト	900	3,935.00	3,541,500
フコク	400	561.00	224,400
ニッタ	1,600	1,895.00	3,032,000
住友理工	3,000	537.00	1,611,000
三ツ星ベルト	1,900	1,301.00	2,471,900
バンドー化学	2,500	573.00	1,432,500
日東紡績	2,000	4,665.00	9,330,000

A G C	13,800	2,442.00	33,699,600
日本板硝子	6,700	300.00	2,010,000
石塚硝子	200	2,021.00	404,200
日本山村硝子	600	855.00	513,000
日本電気硝子	5,600	1,427.00	7,991,200
オハラ	700	923.00	646,100
住友大阪セメント	2,700	3,345.00	9,031,500
太平洋セメント	8,800	2,036.00	17,916,800
日本ヒューム	1,500	591.00	886,500
日本コンクリート工業	3,400	246.00	836,400
三谷セキサン	700	4,320.00	3,024,000
アジアパイルホールディングス	2,200	417.00	917,400
東海カーボン	14,700	909.00	13,362,300
日本カーボン	700	3,320.00	2,324,000
東洋炭素	800	1,458.00	1,166,400
ノリタケカンパニーリミテド	800	3,480.00	2,784,000
T O T O	9,900	3,625.00	35,887,500
日本碍子	17,000	1,336.00	22,712,000
日本特殊陶業	10,800	1,496.00	16,156,800
M A R U W A	500	6,510.00	3,255,000
品川リフラクトリーズ	300	2,135.00	640,500
黒崎播磨	300	3,770.00	1,131,000
ヨータイ	1,000	657.00	657,000
イソライト工業	900	426.00	383,400
東京窯業	2,600	292.00	759,200
ニッカトー	800	550.00	440,000
フジインコーポレーテッド	1,200	2,635.00	3,162,000
クニミネ工業	800	980.00	784,000
エーアンドエーマテリアル	100	1,116.00	111,600
ニチアス	3,800	2,054.00	7,805,200
ニチハ	2,000	1,962.00	3,924,000
日本製鉄	61,500	871.20	53,578,800
神戸製鋼所	25,200	333.00	8,391,600
中山製鋼所	2,200	388.00	853,600
合同製鐵	800	1,886.00	1,508,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	37,000	672.00	24,864,000
東京製鐵	6,700	667.00	4,468,900
共英製鋼	1,700	1,301.00	2,211,700
大和工業	2,900	1,954.00	5,666,600
東京鐵鋼	700	1,127.00	788,900
大阪製鐵	700	1,227.00	858,900
淀川製鋼所	1,900	1,696.00	3,222,400

丸一鋼管	4,500	2,462.00	11,079,000
モリ工業	400	2,264.00	905,600
大同特殊鋼	2,200	3,445.00	7,579,000
日本冶金工業	1,200	1,604.00	1,924,800
山陽特殊製鋼	1,200	883.00	1,059,600
愛知製鋼	800	3,015.00	2,412,000
日立金属	14,900	1,090.00	16,241,000
大太平洋金属	900	1,655.00	1,489,500
新日本電工	10,300	151.00	1,555,300
栗本鐵工所	700	1,878.00	1,314,600
虹技	100	1,025.00	102,500
日本鑄鉄管	100	1,343.00	134,300
三菱製鋼	1,100	793.00	872,300
日亜鋼業	2,600	246.00	639,600
日本精線	200	2,866.00	573,200
エンビプロ・ホールディングス	300	555.00	166,500
シンニッタン	2,200	249.00	547,800
新家工業	200	1,020.00	204,000
大紀アルミニウム工業所	2,500	570.00	1,425,000
日本軽金属ホールディングス	35,400	161.00	5,699,400
三井金属鉱業	3,700	1,835.00	6,789,500
東邦亜鉛	700	1,220.00	854,000
三菱マテリアル	9,100	2,128.00	19,364,800
住友金属鉱山	17,600	2,386.00	41,993,600
D O W A ホールディングス	3,500	2,849.00	9,971,500
古河機械金属	2,200	1,028.00	2,261,600
エス・サイエンス	2,500	35.00	87,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,400	857.00	1,199,800
東邦チタニウム	2,600	598.00	1,554,800
U A C J	2,000	1,553.00	3,106,000
C K サンエツ	300	2,867.00	860,100
古河電気工業	4,200	1,878.00	7,887,600
住友電気工業	51,400	1,070.00	54,998,000
フジクラ	16,700	289.00	4,826,300
昭和電線ホールディングス	1,800	1,029.00	1,852,200
東京特殊電線	200	2,343.00	468,600
タツタ電線	3,000	486.00	1,458,000
カナレ電気	200	1,615.00	323,000
平河ヒューテック	600	913.00	547,800
リョービ	1,800	1,209.00	2,176,200
アーレスティ	2,400	339.00	813,600
アサヒホールディングス	2,400	2,220.00	5,328,000

稲葉製作所	700	1,286.00	900,200
宮地エンジニアリンググループ	300	1,552.00	465,600
トーカロ	4,000	935.00	3,740,000
アルファC o	400	932.00	372,800
SUMCO	16,500	1,454.00	23,991,000
川田テクノロジーズ	300	5,490.00	1,647,000
RS Technologies	400	2,474.00	989,600
信和	600	686.00	411,600
東洋製罐グループホールディングス	8,800	1,157.00	10,181,600
ホッカンホールディングス	700	1,514.00	1,059,800
コロナ	700	928.00	649,600
横河ブリッジホールディングス	2,600	1,947.00	5,062,200
駒井ハルテック	200	1,495.00	299,000
高田機工	100	2,263.00	226,300
三和ホールディングス	13,100	817.00	10,702,700
文化シャッター	4,000	770.00	3,080,000
三協立山	1,900	946.00	1,797,400
アルインコ	1,100	929.00	1,021,900
東洋シャッター	200	677.00	135,400
LIXILグループ	20,300	1,274.00	25,862,200
日本フィルコン	1,500	458.00	687,000
ノーリツ	2,700	1,174.00	3,169,800
長府製作所	1,300	2,198.00	2,857,400
リンナイ	2,700	7,890.00	21,303,000
ダイニチ工業	1,300	638.00	829,400
日東精工	2,100	483.00	1,014,300
三洋工業	100	1,657.00	165,700
岡部	2,800	718.00	2,010,400
ジーテクト	1,800	1,095.00	1,971,000
東プレ	2,700	1,100.00	2,970,000
高周波熱錬	2,700	624.00	1,684,800
東京製綱	1,100	569.00	625,900
サンコール	500	422.00	211,000
モリテック スチール	900	264.00	237,600
パイオラックス	2,000	1,526.00	3,052,000
エイチワン	1,400	471.00	659,400
日本発條	14,800	679.00	10,049,200
中央発條	100	2,568.00	256,800
アドバネクス	200	1,207.00	241,400
立川ブラインド工業	700	1,127.00	788,900
三益半導体工業	1,100	1,919.00	2,110,900
日本ドライケミカル	300	1,374.00	412,200

日本製鋼所	4,200	1,241.00	5,212,200
三浦工業	5,900	4,105.00	24,219,500
タクマ	4,700	1,238.00	5,818,600
ツガミ	3,000	794.00	2,382,000
オークマ	1,600	3,300.00	5,280,000
芝浦機械	1,600	2,059.00	3,294,400
アマダ	17,500	869.00	15,207,500
アイダエンジニアリング	3,800	672.00	2,553,600
滝澤鉄工所	200	1,040.00	208,000
F U J I	5,900	1,659.00	9,788,100
牧野フライス製作所	1,600	2,762.00	4,419,200
オーエスジー	6,300	1,333.00	8,397,900
ダイジェット工業	200	1,046.00	209,200
旭ダイヤモンド工業	3,900	466.00	1,817,400
D M G 森精機	8,800	888.00	7,814,400
ソディック	3,300	655.00	2,161,500
ディスコ	1,900	23,130.00	43,947,000
日東工器	800	1,688.00	1,350,400
日進工具	400	2,720.00	1,088,000
パンチ工業	1,400	316.00	442,400
富士ダイス	600	585.00	351,000
豊和工業	700	621.00	434,700
O K K	700	453.00	317,100
石川製作所	300	1,248.00	374,400
東洋機械金属	1,500	415.00	622,500
津田駒工業	100	812.00	81,200
エンシュウ	300	968.00	290,400
島精機製作所	2,100	1,447.00	3,038,700
オプトラン	1,500	2,677.00	4,015,500
N C ホールディングス	200	581.00	116,200
イワキポンプ	700	908.00	635,600
フリー	1,300	826.00	1,073,800
ヤマシンフィルタ	3,100	800.00	2,480,000
日阪製作所	2,000	754.00	1,508,000
やまびこ	2,700	784.00	2,116,800
平田機工	600	4,860.00	2,916,000
ペガサスミシン製造	2,100	356.00	747,600
マルマエ	500	738.00	369,000
タツモ	700	1,106.00	774,200
ナプテスコ	8,100	2,661.00	21,554,100
三井海洋開発	1,400	1,392.00	1,948,800
レオン自動機	1,300	1,197.00	1,556,100

S M C	4,400	47,880.00	210,672,000
ヤマハモーターロボティクスホールディング	1,200	748.00	897,600
ホソカワミクロン	500	4,590.00	2,295,000
ユニオンツール	600	2,725.00	1,635,000
オイレス工業	1,600	1,375.00	2,200,000
日精エー・エス・ビー機械	400	2,949.00	1,179,600
サトーホールディングス	2,000	2,019.00	4,038,000
技研製作所	1,200	3,700.00	4,440,000
日本エアータック	400	1,147.00	458,800
カワタ	300	624.00	187,200
日精樹脂工業	1,100	975.00	1,072,500
オカダアイヨン	200	856.00	171,200
ワイエイシイホールディングス	200	388.00	77,600
小松製作所	63,000	1,812.00	114,156,000
住友重機械工業	8,000	2,062.00	16,496,000
日立建機	5,600	2,357.00	13,199,200
日工	2,300	599.00	1,377,700
巴工業	700	2,001.00	1,400,700
井関農機	1,400	1,115.00	1,561,000
T O W A	1,400	803.00	1,124,200
丸山製作所	300	1,073.00	321,900
北川鉄工所	700	1,551.00	1,085,700
ローツェ	600	3,240.00	1,944,000
タカキタ	200	547.00	109,400
クボタ	73,900	1,294.50	95,663,550
荏原実業	300	2,074.00	622,200
三菱化工機	400	1,592.00	636,800
月島機械	2,600	1,259.00	3,273,400
帝国電機製作所	1,300	1,310.00	1,703,000
新東工業	3,300	758.00	2,501,400
澁谷工業	1,200	2,589.00	3,106,800
アイチ コーポレーション	2,500	648.00	1,620,000
小森コーポレーション	3,600	773.00	2,782,800
鶴見製作所	1,100	2,029.00	2,231,900
住友精密工業	200	2,224.00	444,800
酒井重工業	200	2,291.00	458,200
荏原製作所	5,800	2,122.00	12,307,600
石井鐵工所	100	2,233.00	223,300
西島製作所	1,500	761.00	1,141,500
北越工業	1,400	1,049.00	1,468,600
ダイキン工業	17,800	13,995.00	249,111,000
オルガノ	500	5,360.00	2,680,000

トーヨーカネツ	700	1,938.00	1,356,600
栗田工業	7,500	2,703.00	20,272,500
椿本チエイン	2,000	2,361.00	4,722,000
大同工業	1,100	709.00	779,900
木村化工機	1,300	428.00	556,400
アネスト岩田	2,100	821.00	1,724,100
ダイフク	7,100	6,950.00	49,345,000
サムコ	400	1,587.00	634,800
加藤製作所	900	1,200.00	1,080,000
油研工業	200	1,407.00	281,400
タダノ	6,700	739.00	4,951,300
フジテック	5,100	1,460.00	7,446,000
C K D	3,900	1,571.00	6,126,900
キトー	1,200	992.00	1,190,400
平和	3,600	1,852.00	6,667,200
理想科学工業	1,300	1,585.00	2,060,500
S A N K Y O	3,100	3,055.00	9,470,500
日本金銭機械	1,500	540.00	810,000
マースグループホールディングス	800	1,694.00	1,355,200
フクシマガリレイ	800	3,365.00	2,692,000
オーイズミ	1,300	358.00	465,400
ダイコク電機	700	1,150.00	805,000
竹内製作所	2,300	1,332.00	3,063,600
アマノ	3,500	2,315.00	8,102,500
J U K I	2,100	538.00	1,129,800
サンデンホールディングス	2,300	322.00	740,600
蛇の目ミシン工業	700	316.00	221,200
マックス	2,000	1,586.00	3,172,000
グローリー	3,600	2,436.00	8,769,600
新晃工業	1,300	1,401.00	1,821,300
大和冷機工業	2,000	990.00	1,980,000
セガサミーホールディングス	13,900	1,276.00	17,736,400
日本ピストンリング	600	1,131.00	678,600
リケン	700	2,739.00	1,917,300
T P R	1,900	1,122.00	2,131,800
ツバキ・ナカシマ	2,700	593.00	1,601,100
ホシザキ	4,000	7,830.00	31,320,000
大豊工業	1,400	544.00	761,600
日本精工	26,100	650.00	16,965,000
N T N	32,700	181.00	5,918,700
ジェイテクト	13,300	714.00	9,496,200
不二越	1,300	2,725.00	3,542,500

日本トムソン	4,300	350.00	1,505,000
THK	8,100	2,197.00	17,795,700
ユーシン精機	1,400	656.00	918,400
前澤給装工業	600	1,959.00	1,175,400
イーグル工業	1,900	672.00	1,276,800
前澤工業	700	311.00	217,700
日本ピラー工業	1,400	1,223.00	1,712,200
キット	5,400	630.00	3,402,000
マキタ	18,200	3,400.00	61,880,000
日立造船	11,300	341.00	3,853,300
三菱重工業	23,300	2,603.50	60,661,550
IHI	10,100	1,196.00	12,079,600
スター精密	2,000	1,015.00	2,030,000
日清紡ホールディングス	9,400	674.00	6,335,600
イビデン	8,500	2,210.00	18,785,000
コニカミノルタ	30,900	393.00	12,143,700
ブラザー工業	17,000	1,758.00	29,886,000
ミネベアミツミ	25,800	1,620.00	41,796,000
日立製作所	67,000	3,150.00	211,050,000
三菱電機	139,200	1,330.00	185,136,000
富士電機	8,400	2,518.00	21,151,200
東洋電機製造	600	1,151.00	690,600
安川電機	15,000	2,915.00	43,725,000
シンフォニアテクノロジー	1,900	927.00	1,761,300
明電舎	2,600	1,544.00	4,014,400
オリジン	300	1,481.00	444,300
山洋電気	700	4,305.00	3,013,500
デンヨー	1,200	1,853.00	2,223,600
東芝テック	1,800	3,325.00	5,985,000
芝浦メカトロニクス	200	2,383.00	476,600
マブチモーター	3,900	3,255.00	12,694,500
日本電産	33,500	5,569.00	186,561,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	229.00	229,000
トレックス・セミコンダクター	800	1,012.00	809,600
東光高岳	700	915.00	640,500
ダブル・スコープ	2,400	325.00	780,000
宮越ホールディングス	300	547.00	164,100
ダイヘン	1,500	2,833.00	4,249,500
ヤーマン	2,200	682.00	1,500,400
JVCケンウッド	11,900	175.00	2,082,500
ミマキエンジニアリング	1,700	405.00	688,500
第一精工	600	2,051.00	1,230,600

日新電機	3,300	921.00	3,039,300
大崎電気工業	3,100	512.00	1,587,200
オムロン	12,500	5,840.00	73,000,000
日東工業	2,000	1,742.00	3,484,000
I D E C	2,000	1,328.00	2,656,000
正興電機製作所	200	938.00	187,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,700	1,433.00	6,735,100
サクサホールディングス	300	1,538.00	461,400
メルコホールディングス	400	2,736.00	1,094,400
テクノメディカ	300	1,810.00	543,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	200	476.00	95,200
日本電気	16,900	3,975.00	67,177,500
富士通	13,400	10,150.00	136,010,000
沖電気工業	5,800	966.00	5,602,800
岩崎通信機	600	818.00	490,800
電気興業	700	2,494.00	1,745,800
サンケン電気	1,600	2,042.00	3,267,200
ナカヨ	300	1,380.00	414,000
アイホン	800	1,501.00	1,200,800
ルネサスエレクトロニクス	66,700	430.00	28,681,000
セイコーエプソン	17,300	1,073.00	18,562,900
ワコム	9,600	328.00	3,148,800
アルバック	2,600	2,749.00	7,147,400
アクセル	500	704.00	352,000
E I Z O	1,100	3,185.00	3,503,500
ジャパンディスプレイ	40,700	47.00	1,912,900
日本信号	3,200	1,004.00	3,212,800
京三製作所	3,300	458.00	1,511,400
能美防災	1,900	1,951.00	3,706,900
ホーチキ	1,100	1,288.00	1,416,800
星和電機	900	527.00	474,300
エレコム	1,500	4,230.00	6,345,000
パナソニック	159,200	839.10	133,584,720
シャープ	16,200	1,145.00	18,549,000
アンリツ	9,000	2,053.00	18,477,000
富士通ゼネラル	3,800	1,910.00	7,258,000
ソニー	88,200	6,702.00	591,116,400
T D K	6,700	8,270.00	55,409,000
帝国通信工業	700	1,166.00	816,200
タムラ製作所	4,700	382.00	1,795,400
アルプスアルパイン	12,400	1,016.00	12,598,400
池上通信機	400	824.00	329,600

日本電波工業	1,800	372.00	669,600
鈴木	600	706.00	423,600
日本トリム	200	2,828.00	565,600
ローランド ディー・ジー・	700	1,134.00	793,800
フォスター電機	1,400	1,091.00	1,527,400
S M K	300	2,420.00	726,000
ヨコオ	900	2,216.00	1,994,400
ティアック	600	156.00	93,600
ホシデン	3,900	779.00	3,038,100
ヒロセ電機	2,200	11,450.00	25,190,000
日本航空電子工業	3,200	1,289.00	4,124,800
T O A	1,700	718.00	1,220,600
マクセルホールディングス	3,200	1,009.00	3,228,800
古野電気	1,900	857.00	1,628,300
ユニデンホールディングス	300	1,858.00	557,400
スミダコーポレーション	1,100	597.00	656,700
アイコム	800	2,582.00	2,065,600
リオン	600	2,326.00	1,395,600
本多通信工業	1,500	379.00	568,500
船井電機	1,500	454.00	681,000
横河電機	12,800	1,364.00	17,459,200
新電元工業	500	2,351.00	1,175,500
アズビル	8,800	2,788.00	24,534,400
東亜ディーケーケー	700	903.00	632,100
日本光電工業	5,800	3,600.00	20,880,000
チノー	400	1,251.00	500,400
共和電業	1,300	386.00	501,800
日本電子材料	700	853.00	597,100
堀場製作所	2,800	5,510.00	15,428,000
アドバンテスト	10,400	4,650.00	48,360,000
小野測器	900	492.00	442,800
エスベック	1,200	1,594.00	1,912,800
キーエンス	12,600	37,000.00	466,200,000
日置電機	600	3,105.00	1,863,000
シスメックス	10,000	7,935.00	79,350,000
日本マイクロニクス	2,400	779.00	1,869,600
メガチップス	1,300	1,561.00	2,029,300
O B A R A G R O U P	700	2,449.00	1,714,300
澤藤電機	200	1,489.00	297,800
原田工業	700	797.00	557,900
コーセル	1,900	944.00	1,793,600
イリソ電子工業	1,200	3,010.00	3,612,000

オブテックスグループ	2,200	1,052.00	2,314,400
千代田インテグレ	700	1,700.00	1,190,000
アイ・オー・データ機器	600	920.00	552,000
レーザーテック	6,100	5,490.00	33,489,000
スタンレー電気	9,800	2,258.00	22,128,400
岩崎電気	600	1,285.00	771,000
ウシオ電機	7,800	1,027.00	8,010,600
岡谷電機産業	700	323.00	226,100
ハリオス テクノ ホールディング	1,100	344.00	378,400
エノモト	400	871.00	348,400
日本セラミック	1,400	1,872.00	2,620,800
遠藤照明	400	580.00	232,000
古河電池	600	527.00	316,200
双信電機	800	339.00	271,200
山一電機	1,100	1,319.00	1,450,900
図研	900	2,215.00	1,993,500
日本電子	2,800	2,696.00	7,548,800
カシオ計算機	12,300	1,655.00	20,356,500
ファナック	13,300	14,580.00	193,914,000
日本シイエムケイ	3,300	431.00	1,422,300
エンプラス	800	2,266.00	1,812,800
大真空	600	1,772.00	1,063,200
ローム	6,200	6,390.00	39,618,000
浜松ホトニクス	10,000	4,480.00	44,800,000
三井ハイテック	1,600	1,111.00	1,777,600
新光電気工業	4,700	1,052.00	4,944,400
京セラ	19,600	6,222.00	121,951,200
太陽誘電	6,200	2,832.00	17,558,400
村田製作所	41,000	5,726.00	234,766,000
双葉電子工業	2,200	992.00	2,182,400
北陸電気工業	600	872.00	523,200
ニチコン	4,700	655.00	3,078,500
日本ケミコン	1,200	1,077.00	1,292,400
K O A	2,000	888.00	1,776,000
市光工業	2,400	445.00	1,068,000
小糸製作所	8,300	3,760.00	31,208,000
ミツバ	2,800	439.00	1,229,200
S C R E E Nホールディングス	2,400	3,990.00	9,576,000
キャノン電子	1,400	1,562.00	2,186,800
キャノン	75,000	2,312.50	173,437,500
リコー	35,500	693.00	24,601,500
象印マホービン	4,100	1,513.00	6,203,300

MUTOHホールディングス	200	1,440.00	288,000
東京エレクトロン	8,900	22,620.00	201,318,000
トヨタ紡織	4,000	1,248.00	4,992,000
芦森工業	100	796.00	79,600
ユニプレス	2,700	892.00	2,408,400
豊田自動織機	11,300	5,180.00	58,534,000
モリタホールディングス	2,200	1,634.00	3,594,800
三櫻工業	1,800	684.00	1,231,200
デンソー	30,700	3,702.00	113,651,400
東海理化電機製作所	3,700	1,318.00	4,876,600
三井E & Sホールディングス	5,100	538.00	2,743,800
川崎重工業	10,800	1,450.00	15,660,000
名村造船所	5,300	193.00	1,022,900
サノヤスホールディングス	800	142.00	113,600
日本車輛製造	600	2,669.00	1,601,400
三菱ロジスネクスト	1,900	857.00	1,628,300
近畿車輛	100	1,048.00	104,800
日産自動車	164,100	358.40	58,813,440
いすゞ自動車	40,400	713.40	28,821,360
トヨタ自動車	155,700	6,753.00	1,051,442,100
日野自動車	17,500	578.00	10,115,000
三菱自動車工業	51,500	308.00	15,862,000
エフテック	500	414.00	207,000
レシップホールディングス	1,300	411.00	534,300
G M B	200	542.00	108,400
ファルテック	300	612.00	183,600
武蔵精密工業	3,100	774.00	2,399,400
日産車体	2,700	862.00	2,327,400
新明和工業	3,900	1,086.00	4,235,400
極東開発工業	2,700	1,244.00	3,358,800
日信工業	2,800	2,216.00	6,204,800
トピー工業	1,200	1,242.00	1,490,400
ティラド	600	1,259.00	755,400
曙ブレーキ工業	7,700	156.00	1,201,200
タチエス	2,200	933.00	2,052,600
N O K	7,500	1,121.00	8,407,500
フタバ産業	4,000	451.00	1,804,000
K Y B	1,600	2,064.00	3,302,400
大同メタル工業	3,200	528.00	1,689,600
プレス工業	7,300	228.00	1,664,400
ミクニ	2,500	227.00	567,500
太平洋工業	2,800	790.00	2,212,000

ケーヒン	3,200	2,527.00	8,086,400
河西工業	2,100	490.00	1,029,000
アイシン精機	11,500	2,651.00	30,486,500
マツダ	40,900	574.00	23,476,600
今仙電機製作所	1,400	696.00	974,400
本田技研工業	109,800	2,424.50	266,210,100
スズキ	27,600	2,808.50	77,514,600
S U B A R U	43,300	1,915.00	82,919,500
安永	700	1,022.00	715,400
ヤマハ発動機	18,200	1,294.00	23,550,800
ショーワ	3,300	2,235.00	7,375,500
T B K	1,900	483.00	917,700
エクセディ	1,900	1,486.00	2,823,400
豊田合成	4,500	1,804.00	8,118,000
愛三工業	2,500	506.00	1,265,000
盟和産業	100	907.00	90,700
日本プラスト	600	432.00	259,200
ヨロズ	1,300	1,045.00	1,358,500
エフ・シー・シー	2,200	1,522.00	3,348,400
シマノ	5,200	15,520.00	80,704,000
テイ・エス テック	3,200	2,643.00	8,457,600
ジャムコ	700	694.00	485,800
テルモ	39,500	3,737.00	147,611,500
クリエートメディック	400	1,060.00	424,000
日機装	4,200	785.00	3,297,000
日本エム・ディ・エム	800	1,561.00	1,248,800
島津製作所	16,600	2,908.00	48,272,800
J M S	1,400	811.00	1,135,400
長野計器	1,200	800.00	960,000
ブイ・テクノロジー	700	3,220.00	2,254,000
東京計器	800	712.00	569,600
愛知時計電機	200	4,440.00	888,000
インターアクション	800	2,143.00	1,714,400
オーバル	500	218.00	109,000
東京精密	2,500	3,135.00	7,837,500
マニー	5,600	2,512.00	14,067,200
ニコン	22,500	977.00	21,982,500
トプコン	7,100	801.00	5,687,100
オリンパス	77,100	1,646.50	126,945,150
理研計器	1,200	2,123.00	2,547,600
タムロン	1,200	1,729.00	2,074,800
H O Y A	27,800	9,964.00	276,999,200

シード	700	835.00	584,500
ノーリツ銅機	900	981.00	882,900
エー・アンド・デイ	1,400	628.00	879,200
朝日インテック	11,800	2,790.00	32,922,000
シチズン時計	16,600	370.00	6,142,000
リズム時計工業	200	608.00	121,600
大研医器	1,300	637.00	828,100
メニコン	2,000	4,900.00	9,800,000
松風	700	1,592.00	1,114,400
セイコーホールディングス	2,000	1,664.00	3,328,000
ニプロ	9,700	1,179.00	11,436,300
中本パックス	300	1,302.00	390,600
スノーピーク	600	696.00	417,600
パラマウントベッドホールディングス	1,400	4,325.00	6,055,000
トランザクション	900	862.00	775,800
ニホンフラッシュ	1,400	1,002.00	1,402,800
前田工織	1,400	2,031.00	2,843,400
永大産業	2,600	265.00	689,000
アートネイチャー	1,500	675.00	1,012,500
バンダイナムコホールディングス	14,400	5,405.00	77,832,000
アイフィスジャパン	200	667.00	133,400
共立印刷	1,500	148.00	222,000
S H O E I	1,200	2,109.00	2,530,800
フランスベッドホールディングス	2,300	872.00	2,005,600
パイロットコーポレーション	2,300	3,395.00	7,808,500
萩原工業	800	1,344.00	1,075,200
トッパン・フォームズ	2,800	913.00	2,556,400
フジシールインターナショナル	3,000	1,883.00	5,649,000
タカラトミー	6,200	815.00	5,053,000
廣濟堂	1,100	773.00	850,300
アーク	2,800	79.00	221,200
タカノ	900	667.00	600,300
プロネクサス	1,300	1,019.00	1,324,700
ウッドワン	400	1,016.00	406,400
大建工業	900	1,700.00	1,530,000
凸版印刷	19,600	1,574.00	30,850,400
大日本印刷	18,100	2,317.00	41,937,700
共同印刷	400	2,776.00	1,110,400
N I S S H A	2,900	707.00	2,050,300
T A K A R A & C O M P A N Y	700	1,756.00	1,229,200
アシックス	11,600	910.00	10,556,000
ツツミ	400	1,588.00	635,200

小松ウオール工業	400	1,847.00	738,800
ヤマハ	8,300	4,440.00	36,852,000
河合楽器製作所	400	2,480.00	992,000
クリナップ	1,400	537.00	751,800
ピジョン	8,400	4,155.00	34,902,000
オリバー	300	2,911.00	873,300
キングジム	1,400	818.00	1,145,200
リンテック	3,300	2,265.00	7,474,500
イトーキ	3,600	309.00	1,112,400
任天堂	8,600	43,590.00	374,874,000
三菱鉛筆	2,200	1,364.00	3,000,800
タカラスタANDARD	2,900	1,595.00	4,625,500
コクヨ	6,700	1,437.00	9,627,900
ナカバヤシ	2,000	541.00	1,082,000
グローブライド	700	1,795.00	1,256,500
オカムラ	4,900	771.00	3,777,900
美津濃	1,100	1,760.00	1,936,000
東京電力ホールディングス	111,100	367.00	40,773,700
中部電力	42,600	1,468.50	62,558,100
関西電力	52,800	1,130.00	59,664,000
中国電力	20,200	1,483.00	29,956,600
北陸電力	12,700	746.00	9,474,200
東北電力	34,800	1,004.00	34,939,200
四国電力	12,700	816.00	10,363,200
九州電力	28,700	876.00	25,141,200
北海道電力	13,300	433.00	5,758,900
沖縄電力	2,700	1,839.00	4,965,300
電源開発	11,100	2,117.00	23,498,700
エフオン	700	478.00	334,600
イーレックス	2,000	1,236.00	2,472,000
レノバ	2,200	954.00	2,098,800
東京瓦斯	26,800	2,595.50	69,559,400
大阪瓦斯	27,000	2,041.00	55,107,000
東邦瓦斯	6,900	5,130.00	35,397,000
北海道瓦斯	700	1,517.00	1,061,900
広島ガス	2,600	354.00	920,400
西部瓦斯	1,600	2,647.00	4,235,200
静岡ガス	4,000	971.00	3,884,000
メタウォーター	700	3,960.00	2,772,000
SBSホールディングス	1,300	1,866.00	2,425,800
東武鉄道	14,700	3,725.00	54,757,500
相鉄ホールディングス	4,500	2,813.00	12,658,500

東急	35,100	1,768.00	62,056,800
京浜急行電鉄	17,900	1,860.00	33,294,000
小田急電鉄	20,700	2,450.00	50,715,000
京王電鉄	7,200	6,470.00	46,584,000
京成電鉄	9,700	3,135.00	30,409,500
富士急行	1,900	2,747.00	5,219,300
新京成電鉄	300	2,040.00	612,000
東日本旅客鉄道	24,600	8,500.00	209,100,000
西日本旅客鉄道	12,400	7,616.00	94,438,400
東海旅客鉄道	11,600	18,350.00	212,860,000
西武ホールディングス	18,800	1,287.00	24,195,600
鴻池運輸	2,100	1,218.00	2,557,800
西日本鉄道	3,900	2,686.00	10,475,400
ハマキョウレックス	1,100	2,680.00	2,948,000
サカイ引越センター	800	5,810.00	4,648,000
近鉄グループホールディングス	13,200	5,330.00	70,356,000
阪急阪神ホールディングス	17,600	3,765.00	66,264,000
南海電気鉄道	6,200	2,468.00	15,301,600
京阪ホールディングス	5,900	4,880.00	28,792,000
神戸電鉄	300	3,795.00	1,138,500
名古屋鉄道	10,900	3,170.00	34,553,000
山陽電気鉄道	800	2,037.00	1,629,600
日本通運	4,700	5,160.00	24,252,000
ヤマトホールディングス	23,200	1,864.00	43,244,800
山九	3,700	4,260.00	15,762,000
丸運	900	228.00	205,200
丸全昭和運輸	1,200	2,298.00	2,757,600
センコーグループホールディングス	7,300	840.00	6,132,000
トナミホールディングス	300	4,850.00	1,455,000
ニッコンホールディングス	4,700	2,070.00	9,729,000
日本石油輸送	100	2,730.00	273,000
福山通運	1,700	3,765.00	6,400,500
セイノーホールディングス	9,900	1,248.00	12,355,200
エスライン	400	885.00	354,000
神奈川中央交通	300	4,040.00	1,212,000
日立物流	2,400	2,407.00	5,776,800
丸和運輸機関	1,300	2,656.00	3,452,800
C & F ロジホールディングス	1,300	1,318.00	1,713,400
九州旅客鉄道	11,600	3,095.00	35,902,000
S Gホールディングス	13,900	2,677.00	37,210,300
日本郵船	11,000	1,364.00	15,004,000
商船三井	8,400	1,786.00	15,002,400

川崎汽船	4,000	915.00	3,660,000
N S ユナイテッド海運	800	1,441.00	1,152,800
明治海運	900	340.00	306,000
飯野海運	6,100	310.00	1,891,000
共栄タンカー	200	795.00	159,000
乾汽船	900	1,227.00	1,104,300
日本航空	23,800	2,018.00	48,028,400
A N A ホールディングス	24,200	2,537.00	61,395,400
パスコ	200	1,658.00	331,600
ランコム	400	7,070.00	2,828,000
日新	1,200	1,640.00	1,968,000
三菱倉庫	4,200	2,216.00	9,307,200
三井倉庫ホールディングス	1,600	1,457.00	2,331,200
住友倉庫	4,800	1,201.00	5,764,800
澁澤倉庫	700	2,054.00	1,437,800
東陽倉庫	2,700	345.00	931,500
日本トランスシティ	3,500	470.00	1,645,000
ケイヒン	100	1,089.00	108,900
中央倉庫	700	1,093.00	765,100
川西倉庫	100	883.00	88,300
安田倉庫	1,200	852.00	1,022,400
ファイズホールディングス	300	883.00	264,900
東洋埠頭	300	1,298.00	389,400
宇徳	1,600	498.00	796,800
上組	7,400	1,860.00	13,764,000
サンリツ	200	553.00	110,600
キムラユニティー	100	926.00	92,600
キューソー流通システム	200	1,539.00	307,800
近鉄エクスプレス	2,800	1,591.00	4,454,800
東海運	700	248.00	173,600
エーアイティー	900	741.00	666,900
内外トランスライン	400	1,169.00	467,600
日本コンセプト	400	1,406.00	562,400
N E C ネットエスアイ	1,300	4,185.00	5,440,500
クロスキャット	300	767.00	230,100
システナ	4,900	1,410.00	6,909,000
デジタルアーツ	700	5,220.00	3,654,000
日鉄ソリューションズ	2,000	2,600.00	5,200,000
キューブシステム	1,100	616.00	677,600
エイジア	100	1,232.00	123,200
コア	700	1,197.00	837,900
ラクーンホールディングス	600	512.00	307,200

ソリトンシステムズ	700	1,276.00	893,200
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,683.00	1,178,100
T I S	13,700	1,888.00	25,865,600
ネオス	800	545.00	436,000
電算システム	600	2,230.00	1,338,000
グリー	8,000	410.00	3,280,000
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,591.00	7,254,800
三菱総合研究所	600	3,270.00	1,962,000
ボルテージ	600	335.00	201,000
電算	100	1,989.00	198,900
A G S	700	768.00	537,600
ファインデックス	1,100	731.00	804,100
ブレインパッド	300	4,570.00	1,371,000
K L a b	2,700	672.00	1,814,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	785.00	1,413,000
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,385.00	138,500
ネクソン	38,200	1,773.00	67,728,600
アイスタイル	4,200	233.00	978,600
エムアップホールディングス	400	2,267.00	906,800
エイチーム	1,100	654.00	719,400
エニグモ	1,100	810.00	891,000
テクノスジャパン	1,800	327.00	588,600
e n i s h	800	388.00	310,400
コロプラ	4,600	839.00	3,859,400
オルトプラス	1,200	426.00	511,200
ブロードリーフ	6,700	477.00	3,195,900
クロス・マーケティンググループ	300	261.00	78,300
デジタルハーツホールディングス	700	750.00	525,000
システム情報	600	724.00	434,400
メディアドゥホールディングス	400	3,270.00	1,308,000
じげん	3,700	277.00	1,024,900
ブイキューブ	700	1,080.00	756,000
エンカレッジ・テクノロジー	200	637.00	127,400
サイバーリンクス	100	1,018.00	101,800
フィックスターズ	1,400	1,072.00	1,500,800
C A R T A H O L D I N G S	700	858.00	600,600
オブティム	400	2,090.00	836,000
セレス	400	722.00	288,800
S H I F T	300	7,110.00	2,133,000
ティーガイア	1,200	2,080.00	2,496,000
セック	200	2,787.00	557,400
日本アジアグループ	800	248.00	198,400

テクマトリックス	900	2,170.00	1,953,000
プロシップ	400	1,179.00	471,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,300	1,533.00	5,058,900
GMOペイメントゲートウェイ	2,300	8,300.00	19,090,000
ザッパラス	300	301.00	90,300
システムリサーチ	300	1,435.00	430,500
インターネットイニシアティブ	2,000	3,825.00	7,650,000
さくらインターネット	1,800	475.00	855,000
ヴィンクス	300	719.00	215,700
GMOクラウド	200	1,922.00	384,400
SRAホールディングス	700	2,176.00	1,523,200
システムインテグレータ	300	666.00	199,800
朝日ネット	1,000	821.00	821,000
eBASE	1,600	795.00	1,272,000
アバント	900	838.00	754,200
アドソル日進	500	2,169.00	1,084,500
フリービット	900	688.00	619,200
コムチュア	1,600	2,038.00	3,260,800
サイバーコム	200	1,622.00	324,400
アステリア	1,300	346.00	449,800
アイル	500	1,351.00	675,500
マークラインズ	700	1,512.00	1,058,400
メディカル・データ・ビジョン	1,200	681.00	817,200
gumi	1,800	591.00	1,063,800
ショーケース	200	440.00	88,000
モバイルファクトリー	300	1,066.00	319,800
テラスカイ	500	2,927.00	1,463,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,179.00	825,300
PCIホールディングス	400	792.00	316,800
パイブドHD	100	1,243.00	124,300
アイビーシー	200	804.00	160,800
ネオジャパン	100	1,039.00	103,900
PR TIMES	100	1,741.00	174,100
ランドコンピュータ	100	971.00	97,100
ダブルスタンダード	200	3,745.00	749,000
オープンドア	700	869.00	608,300
マイネット	400	609.00	243,600
アカツキ	500	3,570.00	1,785,000
ベネフィットジャパン	100	1,409.00	140,900
Ubicomホールディングス	300	1,236.00	370,800
LINE	3,100	5,270.00	16,337,000
カナミックネットワーク	800	548.00	438,400

チェンジ	300	2,870.00	861,000
シンクロ・フード	500	216.00	108,000
オークネット	700	1,171.00	819,700
セグエグループ	200	879.00	175,800
エイトレッド	200	1,243.00	248,600
AOI TYO Holdings	1,800	443.00	797,400
マクロミル	2,900	590.00	1,711,000
ビーグリー	100	1,318.00	131,800
オロ	400	2,897.00	1,158,800
ユーザーローカル	100	2,410.00	241,000
サインポスト	200	1,263.00	252,600
ソルクシーズ	300	554.00	166,200
フェイス	300	608.00	182,400
プロトコーポレーション	1,300	842.00	1,094,600
ハイマックス	100	1,905.00	190,500
野村総合研究所	19,400	2,472.00	47,956,800
サイバネットシステム	1,100	547.00	601,700
CEホールディングス	500	453.00	226,500
日本システム技術	100	1,278.00	127,800
インテージホールディングス	2,000	766.00	1,532,000
東邦システムサイエンス	200	828.00	165,600
ソースネクスト	6,600	290.00	1,914,000
インフォコム	1,400	2,622.00	3,670,800
HEROZ	100	3,060.00	306,000
ラクスル	800	2,153.00	1,722,400
FIG	2,500	235.00	587,500
システムサポート	100	2,443.00	244,300
イーソル	500	989.00	494,500
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,992.00	3,187,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	200	890.00	178,000
フォーカスシステムズ	1,100	675.00	742,500
クレスコ	800	1,377.00	1,101,600
フジ・メディア・ホールディングス	13,300	1,082.00	14,390,600
オービック	4,700	14,900.00	70,030,000
ジャストシステム	2,200	5,570.00	12,254,000
TDCソフト	1,400	751.00	1,051,400
Zホールディングス	188,000	364.00	68,432,000
トレンドマイクロ	6,100	4,800.00	29,280,000
IDホールディングス	600	1,382.00	829,200
日本オラクル	2,800	9,510.00	26,628,000
アルファシステムズ	400	2,760.00	1,104,000
フューチャー	1,800	1,393.00	2,507,400

C A C Holdings	800	980.00	784,000
S Bテクノロジー	500	2,333.00	1,166,500
トーセ	300	740.00	222,000
オービックビジネスコンサルタント	1,400	4,490.00	6,286,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,300	3,135.00	19,750,500
アイティフォー	1,600	575.00	920,000
東計電算	200	4,145.00	829,000
エクスネット	200	925.00	185,000
大塚商会	7,400	4,795.00	35,483,000
サイボウズ	1,700	1,751.00	2,976,700
ソフトブレーン	1,300	359.00	466,700
電通国際情報サービス	900	3,810.00	3,429,000
A C C E S S	1,300	854.00	1,110,200
デジタルガレージ	2,500	3,510.00	8,775,000
E Mシステムズ	1,900	880.00	1,672,000
ウェザーニューズ	400	3,315.00	1,326,000
C I J	1,200	757.00	908,400
ビジネスエンジニアリング	200	2,272.00	454,400
日本エンタープライズ	1,300	208.00	270,400
WOWOW	700	2,425.00	1,697,500
スカラ	900	451.00	405,900
インテリジェント ウェイブ	300	487.00	146,100
I M A G I C A GROUP	1,400	347.00	485,800
ネットワンシステムズ	5,200	2,427.00	12,620,400
システムソフト	3,000	68.00	204,000
アルゴグラフィックス	1,200	3,270.00	3,924,000
マーベラス	2,400	520.00	1,248,000
エイベックス	2,200	848.00	1,865,600
日本ユニシス	4,300	2,904.00	12,487,200
兼松エレクトロニクス	700	3,315.00	2,320,500
東京放送ホールディングス	8,300	1,604.00	13,313,200
日本テレビホールディングス	11,300	1,232.00	13,921,600
朝日放送グループホールディングス	1,400	686.00	960,400
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,599.00	6,236,100
スカパー J S A Tホールディングス	9,300	396.00	3,682,800
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,301.00	2,761,200
日本BS放送	200	1,029.00	205,800
ビジョン	1,300	720.00	936,000
スマートバリュー	300	860.00	258,000
U S E N - N E X T HOLDINGS	600	1,360.00	816,000
ワイヤレスゲート	900	512.00	460,800
コネクシオ	800	1,327.00	1,061,600

日本通信	10,700	165.00	1,765,500
クロップス	200	465.00	93,000
日本電信電話	183,100	2,657.00	486,496,700
K D D I	102,100	3,144.00	321,002,400
ソフトバンク	124,500	1,388.00	172,806,000
光通信	1,400	19,740.00	27,636,000
N T T ドコモ	101,200	3,444.00	348,532,800
エムティーアイ	1,700	580.00	986,000
G M O インターネット	5,400	2,053.00	11,086,200
ファイバーゲート	300	1,127.00	338,100
アйдママーケティングコミュニケーション	200	363.00	72,600
K A D O K A W A	3,800	1,545.00	5,871,000
学研ホールディングス	1,800	1,706.00	3,070,800
ゼンリン	2,700	1,062.00	2,867,400
昭文社ホールディングス	300	386.00	115,800
アイネット	700	1,395.00	976,500
松竹	900	11,930.00	10,737,000
東宝	8,100	3,345.00	27,094,500
東映	500	13,760.00	6,880,000
エヌ・ティ・ティ・データ	36,400	1,038.00	37,783,200
ピー・シー・エー	200	3,055.00	611,000
ビジネスブレイン太田昭和	200	2,715.00	543,000
D T S	3,100	1,936.00	6,001,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,800	4,945.00	28,681,000
シーイーシー	1,400	1,402.00	1,962,800
カブコン	6,400	3,390.00	21,696,000
アイ・エス・ビー	200	1,463.00	292,600
ジャステック	700	1,000.00	700,000
S C S K	3,200	4,960.00	15,872,000
日本システムウエア	400	1,758.00	703,200
アイネス	1,300	1,260.00	1,638,000
T K C	1,200	4,755.00	5,706,000
富士ソフト	1,800	3,540.00	6,372,000
N S D	4,400	1,368.00	6,019,200
コナミホールディングス	4,900	3,245.00	15,900,500
福井コンピュータホールディングス	600	2,288.00	1,372,800
J B C C ホールディングス	900	1,712.00	1,540,800
ミロク情報サービス	1,200	2,421.00	2,905,200
ソフトバンクグループ	108,700	4,139.00	449,909,300
高千穂交易	600	934.00	560,400
伊藤忠食品	300	4,445.00	1,333,500
エレマテック	1,300	824.00	1,071,200

J A L U X	300	1,548.00	464,400
あらた	1,100	4,320.00	4,752,000
トーメンデバイス	200	3,260.00	652,000
東京エレクトロン デバイス	600	2,284.00	1,370,400
フィールズ	1,400	301.00	421,400
双日	75,900	246.00	18,671,400
アルフレッサ ホールディングス	15,300	2,212.00	33,843,600
横浜冷凍	4,000	899.00	3,596,000
ラサ商事	600	848.00	508,800
アルコニクス	1,400	1,058.00	1,481,200
神戸物産	4,700	4,815.00	22,630,500
あい ホールディングス	2,000	1,340.00	2,680,000
ディーブイエックス	300	882.00	264,600
ダイワボウホールディングス	1,200	5,740.00	6,888,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,300	1,421.00	4,689,300
ラクト・ジャパン	500	2,849.00	1,424,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	1,102.00	2,975,400
八洲電機	1,400	781.00	1,093,400
メディアスホールディングス	900	848.00	763,200
レスターホールディングス	1,400	1,624.00	2,273,600
ジューテックホールディングス	300	935.00	280,500
大光	900	630.00	567,000
O C H Iホールディングス	300	1,308.00	392,400
T O K A Iホールディングス	7,300	899.00	6,562,700
C o m i n i x	200	714.00	142,800
三洋貿易	1,700	823.00	1,399,100
ビューティガレージ	200	1,374.00	274,800
ウイン・パートナーズ	1,200	936.00	1,123,200
ミタチ産業	200	563.00	112,600
シップヘルスケアホールディングス	2,200	4,505.00	9,911,000
明治電機工業	300	1,239.00	371,700
デリカフーズホールディングス	500	643.00	321,500
スターティアホールディングス	200	460.00	92,000
コメダホールディングス	2,800	1,571.00	4,398,800
アセンテック	100	2,687.00	268,700
富士興産	200	409.00	81,800
小野建	1,300	1,155.00	1,501,500
南陽	300	1,223.00	366,900
佐島電機	1,200	890.00	1,068,000
伯東	700	972.00	680,400
コンドーテック	1,100	910.00	1,001,000
中山福	1,300	429.00	557,700

ナガイレーベン	2,000	2,488.00	4,976,000
三菱食品	1,500	2,624.00	3,936,000
松田産業	1,200	1,278.00	1,533,600
第一興商	2,000	2,823.00	5,646,000
メディカルホールディングス	14,800	2,140.00	31,672,000
S P K	400	1,242.00	496,800
萩原電気ホールディングス	600	2,121.00	1,272,600
アズワン	900	9,460.00	8,514,000
スズデン	400	1,098.00	439,200
尾家産業	300	1,379.00	413,700
シモジマ	700	1,242.00	869,400
ドウシシャ	1,300	1,260.00	1,638,000
小津産業	200	1,775.00	355,000
高速	700	1,199.00	839,300
たけびし	400	1,252.00	500,800
リックス	300	1,450.00	435,000
丸文	1,700	495.00	841,500
ハピネット	1,300	1,098.00	1,427,400
橋本総業ホールディングス	200	1,760.00	352,000
日本ライフライン	4,100	1,284.00	5,264,400
タカショー	1,500	441.00	661,500
マルカ	400	1,714.00	685,600
I D O M	3,900	373.00	1,454,700
進和	800	1,741.00	1,392,800
ダイトロン	700	1,434.00	1,003,800
シークス	1,800	834.00	1,501,200
田中商事	200	640.00	128,000
オーハシテクニカ	700	1,324.00	926,800
白銅	600	1,261.00	756,600
伊藤忠商事	96,000	2,155.50	206,928,000
丸紅	143,100	516.00	73,839,600
高島	200	1,498.00	299,600
長瀬産業	7,900	1,311.00	10,356,900
蝶理	800	1,419.00	1,135,200
豊田通商	15,300	2,344.00	35,863,200
三共生興	2,200	468.00	1,029,600
兼松	5,200	1,061.00	5,517,200
ツカモトコーポレーション	100	1,091.00	109,100
三井物産	120,700	1,518.00	183,222,600
日本紙パルプ商事	800	3,520.00	2,816,000
日立ハイテク	4,700	7,990.00	37,553,000
カメイ	1,900	1,064.00	2,021,600

東都水産	100	2,700.00	270,000
OUGホールディングス	200	2,489.00	497,800
スターゼン	500	4,230.00	2,115,000
山善	5,400	911.00	4,919,400
椿本興業	200	3,275.00	655,000
住友商事	86,600	1,203.50	104,223,100
内田洋行	600	4,245.00	2,547,000
三菱商事	96,400	2,231.50	215,116,600
第一実業	700	3,560.00	2,492,000
キャノンマーケティングジャパン	4,000	2,198.00	8,792,000
西華産業	700	1,103.00	772,100
佐藤商事	1,400	788.00	1,103,200
菱洋エレクトロ	1,400	2,199.00	3,078,600
東京産業	1,700	486.00	826,200
ユアサ商事	1,300	2,899.00	3,768,700
神鋼商事	300	1,671.00	501,300
トルク	700	254.00	177,800
阪和興業	2,600	1,583.00	4,115,800
正栄食品工業	900	3,875.00	3,487,500
カナデン	1,100	1,159.00	1,274,900
菱電商事	1,200	1,300.00	1,560,000
フルサト工業	700	1,367.00	956,900
岩谷産業	3,100	3,660.00	11,346,000
ナイス	600	952.00	571,200
昭光通商	200	599.00	119,800
ニチモウ	200	1,655.00	331,000
極東貿易	300	1,335.00	400,500
イワキ	1,600	520.00	832,000
三愛石油	3,400	1,138.00	3,869,200
稲畑産業	3,200	1,143.00	3,657,600
G S Iクレオス	200	942.00	188,400
明和産業	1,500	476.00	714,000
クワザワ	200	469.00	93,800
ワキタ	2,700	1,009.00	2,724,300
東邦ホールディングス	4,400	2,287.00	10,062,800
サンゲツ	3,600	1,570.00	5,652,000
ミツウロコグループホールディングス	2,000	1,097.00	2,194,000
シナネンホールディングス	600	2,623.00	1,573,800
伊藤忠エネクス	3,100	829.00	2,569,900
サンリオ	3,900	1,485.00	5,791,500
サンワテクノス	800	830.00	664,000
リョーサン	1,600	2,355.00	3,768,000

新光商事	2,400	849.00	2,037,600	
トーヨー	700	1,673.00	1,171,100	
三信電気	700	1,432.00	1,002,400	
東陽テクニカ	1,800	966.00	1,738,800	
モスフードサービス	1,900	2,613.00	4,964,700	
加賀電子	1,300	1,773.00	2,304,900	
ソーダニッカ	1,700	588.00	999,600	
立花エレテック	1,100	1,453.00	1,598,300	
フォーバル	700	1,137.00	795,900	
PALTA C	2,200	5,490.00	12,078,000	
三谷産業	2,600	309.00	803,400	
太平洋興発	1,100	600.00	660,000	
西本Wismettacホールディングス	200	1,850.00	370,000	
国際紙パルプ商事	4,000	279.00	1,116,000	
ヤマタネ	700	1,142.00	799,400	
日鉄物産	1,000	3,435.00	3,435,000	
泉州電業	400	2,325.00	930,000	
トラスコ中山	2,800	2,294.00	6,423,200	
オートボックスセブン	5,200	1,241.00	6,453,200	
モリト	900	686.00	617,400	
加藤産業	2,100	3,445.00	7,234,500	
北恵	200	807.00	161,400	
イノテック	700	909.00	636,300	
イエローハット	2,700	1,464.00	3,952,800	
J Kホールディングス	1,400	713.00	998,200	
日伝	1,300	2,029.00	2,637,700	
北沢産業	900	280.00	252,000	
杉本商事	700	1,723.00	1,206,100	
因幡電機産業	4,000	2,234.00	8,936,000	
東テク	400	1,714.00	685,600	
ミスミグループ本社	17,200	2,280.00	39,216,000	
アルテック	1,200	183.00	219,600	
タキヒヨー	300	1,567.00	470,100	
蔵王産業	200	1,420.00	284,000	
スズケン	5,800	4,130.00	23,954,000	
ジェコス	700	779.00	545,300	
グローセル	1,800	386.00	694,800	
ローソン	3,500	5,780.00	20,230,000	
サンエー	1,200	4,655.00	5,586,000	
カワチ薬品	1,100	2,317.00	2,548,700	
エービーシー・マート	2,100	5,210.00	10,941,000	
ハードオフコーポレーション	300	664.00	199,200	

アスクル	1,400	3,155.00	4,417,000
ゲオホールディングス	2,500	1,315.00	3,287,500
アダストリア	2,000	1,355.00	2,710,000
ジーフット	1,300	446.00	579,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	418.00	83,600
くら寿司	700	3,960.00	2,772,000
キャンドウ	700	1,717.00	1,201,900
パルグループホールディングス	1,300	1,294.00	1,682,200
エディオン	6,200	920.00	5,704,000
サーラコーポレーション	3,000	558.00	1,674,000
ワッツ	600	609.00	365,400
ハローズ	600	2,721.00	1,632,600
フジオフードシステム	1,200	1,320.00	1,584,000
あみやき亭	200	2,863.00	572,600
ひらまつ	2,600	160.00	416,000
大黒天物産	300	3,190.00	957,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,107.00	1,439,100
アルペン	1,200	1,577.00	1,892,400
ハブ	200	585.00	117,000
クオールホールディングス	2,000	1,217.00	2,434,000
ジinzホールディングス	700	5,530.00	3,871,000
ビックカメラ	8,100	904.00	7,322,400
D C Mホールディングス	7,900	1,000.00	7,900,000
ペッパーフードサービス	1,200	428.00	513,600
MonotaRO	9,800	2,935.00	28,763,000
東京一番フーズ	200	423.00	84,600
DDホールディングス	700	717.00	501,900
きちりホールディングス	200	521.00	104,200
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,524.00	1,828,800
J . フロント リテイリング	16,400	804.00	13,185,600
ドトール・日レスホールディングス	2,200	1,688.00	3,713,600
マツモトキヨシホールディングス	5,700	3,830.00	21,831,000
ブロンコビリー	700	2,160.00	1,512,000
Z O Z O	9,500	1,584.00	15,048,000
トレジャー・ファクトリー	300	626.00	187,800
物語コーポレーション	300	5,790.00	1,737,000
ココカラファイン	1,400	5,320.00	7,448,000
三越伊勢丹ホールディングス	24,100	585.00	14,098,500
H a m e e	500	1,154.00	577,000
ウエルシアホールディングス	4,100	7,290.00	29,889,000
クリエイトSDホールディングス	2,200	2,791.00	6,140,200
丸善C H Iホールディングス	900	364.00	327,600

ミサワ	200	419.00	83,800
ティーライフ	200	902.00	180,400
チムニー	200	1,547.00	309,400
シュッピン	900	636.00	572,400
ネクステージ	2,000	583.00	1,166,000
ジョイフル本田	4,000	1,254.00	5,016,000
鳥貴族	400	1,441.00	576,400
麒麟堂ホールディングス	600	1,763.00	1,057,800
ホットランド	800	1,006.00	804,800
すかいらーくホールディングス	15,400	1,599.00	24,624,600
SFPホールディングス	700	1,379.00	965,300
綿半ホールディングス	600	1,612.00	967,200
ヨシックス	200	1,801.00	360,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,000	985.00	3,940,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	485.00	485,000
B E E N O S	600	855.00	513,000
あさひ	1,100	1,284.00	1,412,400
日本調剤	400	1,645.00	658,000
コスモス薬品	600	25,300.00	15,180,000
トーエル	400	778.00	311,200
セブン&アイ・ホールディングス	53,800	3,544.00	190,667,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,600	640.00	4,864,000
ツルハホールディングス	3,000	13,960.00	41,880,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,723.00	2,067,600
フェリシモ	100	1,005.00	100,500
トリドールホールディングス	3,600	1,142.00	4,111,200
T O K Y O B A S E	1,100	258.00	283,800
ウイルプラスホールディングス	200	502.00	100,400
J Mホールディングス	700	2,215.00	1,550,500
サツドラホールディングス	200	1,921.00	384,200
アレンザホールディングス	700	736.00	515,200
串カツ田中ホールディングス	200	1,213.00	242,600
パロックジャパンリミテッド	900	582.00	523,800
クスリのアオキホールディングス	1,200	8,350.00	10,020,000
力の源ホールディングス	600	598.00	358,800
スシローグローバルホールディングス	6,000	1,650.00	9,900,000
L I X I L ビバ	1,300	1,875.00	2,437,500
メディカルシステムネットワーク	1,600	437.00	699,200
はるやまホールディングス	1,100	734.00	807,400
ノジマ	2,200	1,796.00	3,951,200
カップ・クリエイト	2,000	1,329.00	2,658,000

ライトオン	1,300	509.00	661,700
良品計画	18,300	1,097.00	20,075,100
三城ホールディングス	900	265.00	238,500
アドヴァン	2,000	1,053.00	2,106,000
アルビス	600	2,084.00	1,250,400
コナカ	1,900	295.00	560,500
G - 7ホールディングス	800	2,244.00	1,795,200
イオン北海道	1,700	741.00	1,259,700
コジマ	2,500	357.00	892,500
ヒマラヤ	200	724.00	144,800
コーナン商事	2,000	2,183.00	4,366,000
エコス	600	1,676.00	1,005,600
ワタミ	1,800	917.00	1,650,600
パン・パシフィック・インターナショナルホ	30,200	1,989.00	60,067,800
西松屋チェーン	3,100	792.00	2,455,200
ゼンショーホールディングス	6,700	2,083.00	13,956,100
幸楽苑ホールディングス	800	1,386.00	1,108,800
ハークスレイ	200	991.00	198,200
サイゼリヤ	2,200	1,979.00	4,353,800
V Tホールディングス	5,900	274.00	1,616,600
魚力	300	1,473.00	441,900
フジ・コーポレーション	300	1,749.00	524,700
ユナイテッドアローズ	1,400	1,580.00	2,212,000
ハイデイ日高	2,000	1,591.00	3,182,000
京都きもの友禅	400	255.00	102,000
コロワイド	4,600	1,555.00	7,153,000
ピーシーデポコーポレーション	1,600	428.00	684,800
壱番屋	1,000	4,355.00	4,355,000
P L A N T	200	440.00	88,000
スギホールディングス	2,800	5,710.00	15,988,000
薬王堂ホールディングス	600	2,188.00	1,312,800
ヴィア・ホールディングス	2,300	443.00	1,018,900
スクロール	2,600	290.00	754,000
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,828.00	2,559,200
ファミリーマート	11,000	1,959.00	21,549,000
木曽路	1,700	2,426.00	4,124,200
S R Sホールディングス	1,900	845.00	1,605,500
千趣会	2,700	351.00	947,700
ケーヨー	2,900	511.00	1,481,900
上新電機	1,700	1,927.00	3,275,900
日本瓦斯	2,100	3,220.00	6,762,000
ロイヤルホールディングス	2,200	1,697.00	3,733,400

いなげや	1,800	1,578.00	2,840,400
鳥忠	2,600	2,754.00	7,160,400
チヨダ	1,400	1,087.00	1,521,800
ライフコーポレーション	1,100	2,954.00	3,249,400
リンガーハット	1,800	2,113.00	3,803,400
MrMaxHD	2,000	388.00	776,000
テンアライド	1,000	360.00	360,000
AOKIホールディングス	2,700	652.00	1,760,400
オークワ	2,000	1,647.00	3,294,000
コメリ	2,100	1,931.00	4,055,100
青山商事	2,800	813.00	2,276,400
しまむら	1,600	6,420.00	10,272,000
高島屋	10,000	940.00	9,400,000
松屋	3,000	624.00	1,872,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,500	798.00	5,187,000
近鉄百貨店	600	2,411.00	1,446,600
丸井グループ	12,600	1,710.00	21,546,000
アクシアル リテイリング	1,200	3,970.00	4,764,000
イオン	52,800	2,204.50	116,397,600
イズミ	2,800	2,969.00	8,313,200
平和堂	2,800	1,799.00	5,037,200
フジ	1,800	1,835.00	3,303,000
ヤオコー	1,600	6,390.00	10,224,000
ゼビオホールディングス	1,900	866.00	1,645,400
ケーズホールディングス	13,300	1,107.00	14,723,100
Olympicグループ	900	630.00	567,000
日産東京販売ホールディングス	2,600	204.00	530,400
シルバーライフ	100	1,885.00	188,500
Genky DrugStores	700	2,035.00	1,424,500
ナルミヤ・インターナショナル	100	533.00	53,300
ブックオフグループホールディングス	1,100	822.00	904,200
アインホールディングス	1,700	6,020.00	10,234,000
元気寿司	300	2,234.00	670,200
ヤマダ電機	41,900	515.00	21,578,500
アークランドサカモト	2,000	975.00	1,950,000
ニトリホールディングス	6,000	15,995.00	95,970,000
グルメ杵屋	900	895.00	805,500
愛眼	500	207.00	103,500
ケーユーホールディングス	900	864.00	777,600
吉野家ホールディングス	4,600	2,198.00	10,110,800
松屋フーズホールディングス	700	3,780.00	2,646,000
サガミホールディングス	2,000	1,234.00	2,468,000

関西スーパーマーケット	1,300	1,023.00	1,329,900
王将フードサービス	1,000	5,810.00	5,810,000
プレナス	1,700	1,783.00	3,031,100
ミニストップ	1,100	1,426.00	1,568,600
アークス	2,800	1,903.00	5,328,400
パローホールディングス	3,100	1,884.00	5,840,400
ベルク	700	5,430.00	3,801,000
大庄	700	1,125.00	787,500
ファーストリテイリング	1,800	46,420.00	83,556,000
サンドラッグ	5,200	3,450.00	17,940,000
サックスパー ホールディングス	1,400	568.00	795,200
ヤマザワ	300	1,582.00	474,600
やまや	200	2,029.00	405,800
ベルーナ	3,200	470.00	1,504,000
島根銀行	200	428.00	85,600
じもとホールディングス	10,700	93.00	995,100
めぶきフィナンシャルグループ	71,300	215.00	15,329,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	1,196.00	2,392,000
九州フィナンシャルグループ	22,900	439.00	10,053,100
ゆうちょ銀行	38,900	979.00	38,083,100
富山第一銀行	3,900	293.00	1,142,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,000	317.00	25,677,000
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	586.00	5,684,200
関西みらいフィナンシャルグループ	8,100	359.00	2,907,900
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,420.00	1,846,000
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	2,329.00	5,356,700
新生銀行	10,100	1,524.00	15,392,400
あおぞら銀行	8,200	1,936.00	15,875,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	939,800	407.00	382,498,600
りそなホールディングス	150,800	337.00	50,819,600
三井住友トラスト・ホールディングス	26,000	3,098.00	80,548,000
三井住友フィナンシャルグループ	95,000	2,696.00	256,120,000
千葉銀行	45,800	484.00	22,167,200
群馬銀行	27,400	323.00	8,850,200
武蔵野銀行	2,000	1,347.00	2,694,000
千葉興業銀行	4,900	244.00	1,195,600
筑波銀行	6,300	162.00	1,020,600
七十七銀行	4,700	1,319.00	6,199,300
青森銀行	1,100	2,369.00	2,605,900
秋田銀行	800	1,509.00	1,207,200
山形銀行	1,600	1,347.00	2,155,200
岩手銀行	800	2,538.00	2,030,400

東邦銀行	12,100	249.00	3,012,900
東北銀行	700	875.00	612,500
みちのく銀行	800	1,109.00	887,200
ふくおかフィナンシャルグループ	11,600	1,422.00	16,495,200
静岡銀行	33,800	644.00	21,767,200
十六銀行	1,700	1,853.00	3,150,100
スルガ銀行	14,100	353.00	4,977,300
八十二銀行	33,100	376.00	12,445,600
山梨中央銀行	1,700	723.00	1,229,100
大垣共立銀行	2,700	2,099.00	5,667,300
福井銀行	1,200	1,485.00	1,782,000
北國銀行	1,400	3,235.00	4,529,000
清水銀行	600	1,837.00	1,102,200
富山銀行	200	1,849.00	369,800
滋賀銀行	2,800	2,643.00	7,400,400
南都銀行	2,200	2,138.00	4,703,600
百五銀行	12,600	297.00	3,742,200
京都銀行	4,900	3,495.00	17,125,500
紀陽銀行	4,800	1,534.00	7,363,200
ほくほくフィナンシャルグループ	9,300	872.00	8,109,600
広島銀行	20,300	447.00	9,074,100
山陰合同銀行	8,100	553.00	4,479,300
中国銀行	11,800	988.00	11,658,400
鳥取銀行	400	1,178.00	471,200
伊予銀行	19,600	541.00	10,603,600
百十四銀行	1,400	1,946.00	2,724,400
四国銀行	2,300	814.00	1,872,200
阿波銀行	2,200	2,372.00	5,218,400
大分銀行	800	2,015.00	1,612,000
宮崎銀行	900	2,343.00	2,108,700
佐賀銀行	800	1,106.00	884,800
沖縄銀行	1,300	3,135.00	4,075,500
琉球銀行	3,300	1,008.00	3,326,400
セブン銀行	46,100	284.00	13,092,400
みずほフィナンシャルグループ	1,866,300	123.30	230,114,790
高知銀行	300	635.00	190,500
山口フィナンシャルグループ	17,400	583.00	10,144,200
長野銀行	400	1,135.00	454,000
名古屋銀行	1,200	2,315.00	2,778,000
北洋銀行	21,300	192.00	4,089,600
愛知銀行	500	3,100.00	1,550,000
中京銀行	700	2,007.00	1,404,900

大光銀行	400	1,436.00	574,400
愛媛銀行	2,000	1,129.00	2,258,000
トマト銀行	600	1,010.00	606,000
京葉銀行	6,000	521.00	3,126,000
栃木銀行	6,900	151.00	1,041,900
北日本銀行	400	1,870.00	748,000
東和銀行	2,500	603.00	1,507,500
福島銀行	500	154.00	77,000
大東銀行	1,300	560.00	728,000
トモニホールディングス	10,700	361.00	3,862,700
フィデアホールディングス	14,900	99.00	1,475,100
池田泉州ホールディングス	16,000	153.00	2,448,000
F P G	4,100	519.00	2,127,900
マーキュリアインベストメント	600	559.00	335,400
S B Iホールディングス	15,300	1,680.00	25,704,000
日本アジア投資	1,200	184.00	220,800
ジャフコ	2,100	3,105.00	6,520,500
大和証券グループ本社	109,700	454.40	49,847,680
野村ホールディングス	241,400	458.20	110,609,480
岡三証券グループ	12,000	357.00	4,284,000
丸三証券	4,000	444.00	1,776,000
東洋証券	5,900	134.00	790,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,000	253.00	4,048,000
光世証券	200	575.00	115,000
水戸証券	4,400	189.00	831,600
いちよし証券	2,900	454.00	1,316,600
松井証券	8,000	800.00	6,400,000
だいこう証券ビジネス	900	473.00	425,700
マネックスグループ	10,600	195.00	2,067,000
極東証券	2,200	541.00	1,190,200
岩井コスモホールディングス	1,300	933.00	1,212,900
藍澤證券	2,700	758.00	2,046,600
マネーパートナーズグループ	500	190.00	95,000
スパークス・グループ	5,800	176.00	1,020,800
かんぽ生命保険	4,800	1,319.00	6,331,200
S O M P Oホールディングス	25,900	3,570.00	92,463,000
アニコム ホールディングス	1,200	3,420.00	4,104,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	36,000	3,093.00	111,348,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	11,200	1,802.00	20,182,400
第一生命ホールディングス	77,900	1,368.00	106,567,200
東京海上ホールディングス	49,200	5,098.00	250,821,600
T & Dホールディングス	41,000	910.00	37,310,000

アドバンスクリエイト	300	1,730.00	519,000
全国保証	3,900	2,956.00	11,528,400
イントラスト	200	533.00	106,600
日本モーゲージサービス	300	1,565.00	469,500
C a s a	400	995.00	398,000
アルヒ	2,100	1,191.00	2,501,100
プレミアグループ	800	1,453.00	1,162,400
クレディセゾン	9,600	1,083.00	10,396,800
芙蓉総合リース	1,400	5,420.00	7,588,000
みずほリース	2,000	2,010.00	4,020,000
東京センチュリー	2,800	3,535.00	9,898,000
日本証券金融	6,000	482.00	2,892,000
アイフル	21,300	231.00	4,920,300
リコーリース	1,100	2,768.00	3,044,800
イオンフィナンシャルサービス	8,400	1,044.00	8,769,600
アコム	28,000	443.00	12,404,000
ジャックス	1,600	1,674.00	2,678,400
オリエントコーポレーション	37,900	120.00	4,548,000
日立キャピタル	3,200	1,903.00	6,089,600
アプラスフィナンシャル	9,200	62.00	570,400
オリックス	85,900	1,239.50	106,473,050
三菱UFJリース	34,800	491.00	17,086,800
九州リースサービス	900	427.00	384,300
日本取引所グループ	39,500	2,160.00	85,320,000
イー・ギャランティ	1,500	1,751.00	2,626,500
アサックス	1,100	602.00	662,200
NECキャピタルソリューション	600	1,765.00	1,059,000
いちご	17,900	259.00	4,636,100
日本駐車場開発	15,300	130.00	1,989,000
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,464.00	1,024,800
ADワークスグループ	2,600	154.00	400,400
ヒューリック	29,400	982.00	28,870,800
三栄建築設計	600	1,144.00	686,400
野村不動産ホールディングス	8,400	1,728.00	14,515,200
三重交通グループホールディングス	3,000	500.00	1,500,000
サムティ	2,000	1,164.00	2,328,000
ディア・ライフ	2,300	365.00	839,500
コーセーアールイー	200	455.00	91,000
日本商業開発	800	1,263.00	1,010,400
プレサンスコーポレーション	2,200	1,090.00	2,398,000
ユニゾホールディングス	2,100	5,970.00	12,537,000
THEグローバル社	1,200	307.00	368,400

ハウスコム	100	1,258.00	125,800
日本管理センター	800	1,052.00	841,600
フージャースホールディングス	3,100	589.00	1,825,900
オープンハウス	4,000	2,279.00	9,116,000
東急不動産ホールディングス	37,400	484.00	18,101,600
飯田グループホールディングス	11,500	1,423.00	16,364,500
ムゲンエステート	1,100	431.00	474,100
ビーロッド	400	574.00	229,600
ファーストブラザーズ	100	643.00	64,300
ハウズドゥ	700	721.00	504,700
シーアールイー	200	1,075.00	215,000
プロパティエージェント	100	851.00	85,100
ケイアイスター不動産	300	1,072.00	321,600
グッドコムアセット	200	1,397.00	279,400
ジェイ・エス・ビー	100	4,195.00	419,500
テンポイノベーション	300	567.00	170,100
グローバル・リンク・マネジメント	200	554.00	110,800
パーク24	7,400	1,497.00	11,077,800
パラカ	300	1,560.00	468,000
三井不動産	67,800	1,952.00	132,345,600
三菱地所	96,300	1,724.00	166,021,200
平和不動産	2,600	2,699.00	7,017,400
東京建物	14,500	1,121.00	16,254,500
ダイビル	3,800	874.00	3,321,200
京阪神ビルディング	2,200	1,316.00	2,895,200
住友不動産	30,900	2,588.50	79,984,650
テーオーシー	3,200	606.00	1,939,200
東京楽天地	200	4,175.00	835,000
レオパレス21	18,100	261.00	4,724,100
スターツコーポレーション	1,900	1,953.00	3,710,700
フジ住宅	1,500	495.00	742,500
空港施設	2,200	418.00	919,600
明和地所	1,300	431.00	560,300
ゴールドクレスト	1,200	1,664.00	1,996,800
エスリード	600	1,271.00	762,600
日神グループホールディングス	2,200	357.00	785,400
日本エスコン	2,900	592.00	1,716,800
タカラレーベン	6,100	342.00	2,086,200
A V A N T I A	700	558.00	390,600
イオンモール	6,900	1,260.00	8,694,000
毎日コムネット	200	778.00	155,600
ファースト住建	600	981.00	588,600

ランド	69,100	8.00	552,800
カチタス	3,400	1,804.00	6,133,600
トーセイ	2,000	1,031.00	2,062,000
穴吹興産	200	1,383.00	276,600
サンフロンティア不動産	2,000	815.00	1,630,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	780.00	1,014,000
インテリックス	200	531.00	106,200
ランドビジネス	400	282.00	112,800
日本社宅サービス	100	936.00	93,600
グランディハウス	600	320.00	192,000
日本空港ビルデング	4,400	4,260.00	18,744,000
日本工営	900	3,010.00	2,709,000
L I F U L L	4,700	318.00	1,494,600
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,007.00	805,600
日本M & Aセンター	10,100	2,947.00	29,764,700
メンバーズ	400	1,304.00	521,600
UTグループ	1,600	1,111.00	1,777,600
アイティメディア	300	834.00	250,200
タケエイ	1,300	733.00	952,900
E・Jホールディングス	200	1,300.00	260,000
ビーネックスグループ	1,900	492.00	934,800
コシダカホールディングス	3,300	352.00	1,161,600
アルトナー	200	601.00	120,200
パソナグループ	1,600	920.00	1,472,000
C D S	200	1,210.00	242,000
リンクアンドモチベーション	2,900	281.00	814,900
G C A	1,500	581.00	871,500
エス・エム・エス	4,200	1,999.00	8,395,800
サニーサイドアップグループ	300	544.00	163,200
パーソルホールディングス	13,300	1,050.00	13,965,000
リニカル	700	899.00	629,300
クックパッド	5,100	305.00	1,555,500
エスクリ	200	321.00	64,200
アイ・ケイ・ケイ	400	608.00	243,200
学情	500	1,125.00	562,500
スタジオアリス	700	1,513.00	1,059,100
シミックホールディングス	800	1,393.00	1,114,400
エプコ	100	870.00	87,000
N J S	300	1,621.00	486,300
総合警備保障	5,300	5,290.00	28,037,000
カカクコム	9,900	2,125.00	21,037,500
アイロムグループ	500	1,239.00	619,500

セントケア・ホールディング	1,400	391.00	547,400
ルネサンス	700	943.00	660,100
ディップ	1,900	1,843.00	3,501,700
オプトホールディング	800	1,503.00	1,202,400
新日本科学	1,500	547.00	820,500
ツクイ	3,300	397.00	1,310,100
キャリアデザインセンター	300	751.00	225,300
ベネフィット・ワン	3,700	1,636.00	6,053,200
エムスリー	29,400	3,780.00	111,132,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	340.00	442,000
アウトソーシング	7,800	420.00	3,276,000
ウェルネット	1,400	447.00	625,800
ワールドホールディングス	400	1,216.00	486,400
ディー・エヌ・エー	6,400	1,146.00	7,334,400
博報堂D Yホールディングス	18,500	1,104.00	20,424,000
ぐるなび	2,400	540.00	1,296,000
タカミヤ	1,500	408.00	612,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	630.00	693,000
ファンコミュニケーションズ	4,000	450.00	1,800,000
ライク	400	1,290.00	516,000
ビジネス・ブレークスルー	300	369.00	110,700
エスプール	2,700	646.00	1,744,200
WDBホールディングス	700	2,197.00	1,537,900
ティア	1,300	509.00	661,700
バリューコマース	800	1,753.00	1,402,400
インフォマート	14,700	659.00	9,687,300
J Pホールディングス	4,600	263.00	1,209,800
エコナックホールディングス	1,600	87.00	139,200
E P Sホールディングス	2,000	1,120.00	2,240,000
レッグス	200	771.00	154,200
プレステージ・インターナショナル	5,100	812.00	4,141,200
アミューズ	800	2,227.00	1,781,600
ドリームインキュベータ	400	1,100.00	440,000
クイック	800	952.00	761,600
ケネディクス	12,700	422.00	5,359,400
電通グループ	13,700	2,011.00	27,550,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	490.00	294,000
ぴあ	400	2,280.00	912,000
イオンファンタジー	600	1,439.00	863,400
シーティーエス	1,500	540.00	810,000
ネクシィーズグループ	400	918.00	367,200
みらかホールディングス	3,800	2,254.00	8,565,200

アルプス技研	1,200	1,427.00	1,712,400
サニックス	2,700	274.00	739,800
ダイオーズ	100	983.00	98,300
日本空調サービス	1,500	660.00	990,000
オリエンタルランド	14,200	14,450.00	205,190,000
ダスキン	3,400	2,861.00	9,727,400
明光ネットワークジャパン	1,500	746.00	1,119,000
ファルコホールディングス	800	1,770.00	1,416,000
田谷	200	541.00	108,200
ラウンドワン	3,800	652.00	2,477,600
リゾートトラスト	6,200	1,088.00	6,745,600
ビー・エム・エル	1,600	2,747.00	4,395,200
りらいあコミュニケーションズ	2,400	1,055.00	2,532,000
リソー教育	6,000	258.00	1,548,000
早稲田アカデミー	400	933.00	373,200
ユー・エス・エス	14,900	1,665.00	24,808,500
東京個別指導学院	200	442.00	88,400
サイバーエージェント	7,700	4,005.00	30,838,500
楽天	62,100	865.00	53,716,500
クリーク・アンド・リバー社	700	764.00	534,800
テー・オー・ダブリュー	2,800	258.00	722,400
山田コンサルティンググループ	700	969.00	678,300
セントラルスポーツ	600	2,144.00	1,286,400
フルキャストホールディングス	1,300	1,154.00	1,500,200
エン・ジャパン	2,400	2,076.00	4,982,400
リソルホールディングス	100	3,275.00	327,500
テクノプロ・ホールディングス	2,600	4,720.00	12,272,000
アイ・アールジャパンホールディングス	500	5,770.00	2,885,000
K e e P e r 技研	500	1,362.00	681,000
ファーストロジック	200	569.00	113,800
三機サービス	100	1,016.00	101,600
G u n o s y	700	935.00	654,500
イー・ガーディアン	700	1,598.00	1,118,600
リブセンス	900	250.00	225,000
ジャパンマテリアル	4,100	1,447.00	5,932,700
ベクトル	1,700	673.00	1,144,100
ウチヤマホールディングス	500	321.00	160,500
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	749.00	973,700
ライクキッズ	200	515.00	103,000
キャリアリンク	400	381.00	152,400
I B J	800	571.00	456,800
アサンテ	600	1,451.00	870,600

N・フィールド	500	393.00	196,500
バリューHR	400	1,372.00	548,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,000	2,584.00	2,584,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,432.00	859,200
E R Iホールディングス	200	608.00	121,600
アシスト	200	1,755.00	351,000
シグマクシス	900	1,359.00	1,223,100
ウィルグループ	700	539.00	377,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,000	153.00	153,000
リクルートホールディングス	95,400	2,730.00	260,442,000
エラン	800	1,487.00	1,189,600
土木管理総合試験所	400	324.00	129,600
ネットマーケティング	300	605.00	181,500
日本郵政	109,100	834.50	91,043,950
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,148.00	2,525,600
鎌倉新書	1,200	1,036.00	1,243,200
S MN	200	609.00	121,800
L I T A L I C O	500	2,169.00	1,084,500
グローバルキッズCOMPANY	200	523.00	104,600
エアトリ	700	840.00	588,000
アトラエ	400	2,435.00	974,000
ストライク	500	3,895.00	1,947,500
ソラスト	3,800	960.00	3,648,000
セラク	400	712.00	284,800
インソース	700	2,005.00	1,403,500
ベйкаレント・コンサルティング	800	4,835.00	3,868,000
Orchestra Holdings	300	764.00	229,200
アイモバイル	200	582.00	116,400
キャリアインデックス	500	246.00	123,000
MS - Japan	400	675.00	270,000
船場	100	867.00	86,700
グレイステクノロジー	600	2,550.00	1,530,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,575.00	3,605,000
フルテック	200	1,185.00	237,000
GameWith	200	515.00	103,000
ソウルドアウト	200	1,970.00	394,000
ミダック	100	1,037.00	103,700
日総工産	1,100	394.00	433,400
キュービーネットホールディングス	600	1,690.00	1,014,000
R P Aホールディングス	700	628.00	439,600
スプリックス	400	639.00	255,600
マネジメントソリューションズ	300	966.00	289,800

カーブスホールディングス	3,300	475.00	1,567,500
アドバンテッジリスクマネジメント	800	625.00	500,000
リログループ	7,300	2,288.00	16,702,400
東祥	800	919.00	735,200
エイチ・アイ・エス	2,000	1,291.00	2,582,000
ラックランド	300	1,589.00	476,700
共立メンテナンス	2,200	2,329.00	5,123,800
イチネンホールディングス	1,600	1,114.00	1,782,400
建設技術研究所	900	1,648.00	1,483,200
スペース	900	1,026.00	923,400
長大	400	849.00	339,600
燦ホールディングス	700	1,248.00	873,600
スバル興業	100	7,830.00	783,000
東京テアトル	600	1,171.00	702,600
タナベ経営	300	1,199.00	359,700
ナガワ	400	7,170.00	2,868,000
よみうりランド	200	3,250.00	650,000
東京都競馬	900	2,863.00	2,576,700
常盤興産	600	1,306.00	783,600
カナモト	2,200	2,089.00	4,595,800
東京ドーム	5,400	700.00	3,780,000
西尾レントオール	1,300	2,158.00	2,805,400
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	4,000	21.00	84,000
トランス・コスモス	1,300	1,872.00	2,433,600
乃村工藝社	5,900	827.00	4,879,300
藤田観光	700	1,720.00	1,204,000
KNT-CTホールディングス	700	834.00	583,800
日本管財	1,400	1,752.00	2,452,800
トーカイ	1,300	2,875.00	3,737,500
白洋舎	200	2,685.00	537,000
セコム	14,100	9,027.00	127,280,700
セントラル警備保障	600	3,655.00	2,193,000
丹青社	2,600	686.00	1,783,600
メイテック	1,600	4,190.00	6,704,000
応用地質	1,400	1,274.00	1,783,600
船井総研ホールディングス	2,800	1,952.00	5,465,600
進学会ホールディングス	1,300	503.00	653,900
オオバ	1,200	513.00	615,600
いであ	200	1,495.00	299,000
学究社	200	1,102.00	220,400
ベネッセホールディングス	4,500	2,739.00	12,325,500
イオンディライト	1,600	3,175.00	5,080,000

ナック	700	811.00	567,700	
ニチイ学館	2,000	1,048.00	2,096,000	
ダイセキ	2,200	2,059.00	4,529,800	
ステップ	500	1,367.00	683,500	
合 計	16,526,470		27,986,972,900	

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	株式会社千葉興業銀行(ワラント)	4,900		
合 計		4,900		

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)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年 4月30日現在

資産総額	29,313,028,417円
負債総額	57,340,196円
純資産総額（ - ）	29,255,688,221円
発行済口数	19,966,311口
1口当たり純資産額（ / ）	1,465.25円
（100口当たり純資産額）	（146,525円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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また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は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者に対する特典

ありません。

ハ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 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または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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また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。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ニ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところに従い、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。

ホ 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払

い、交換請求の受付け、交換株式の交付等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2020年4月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

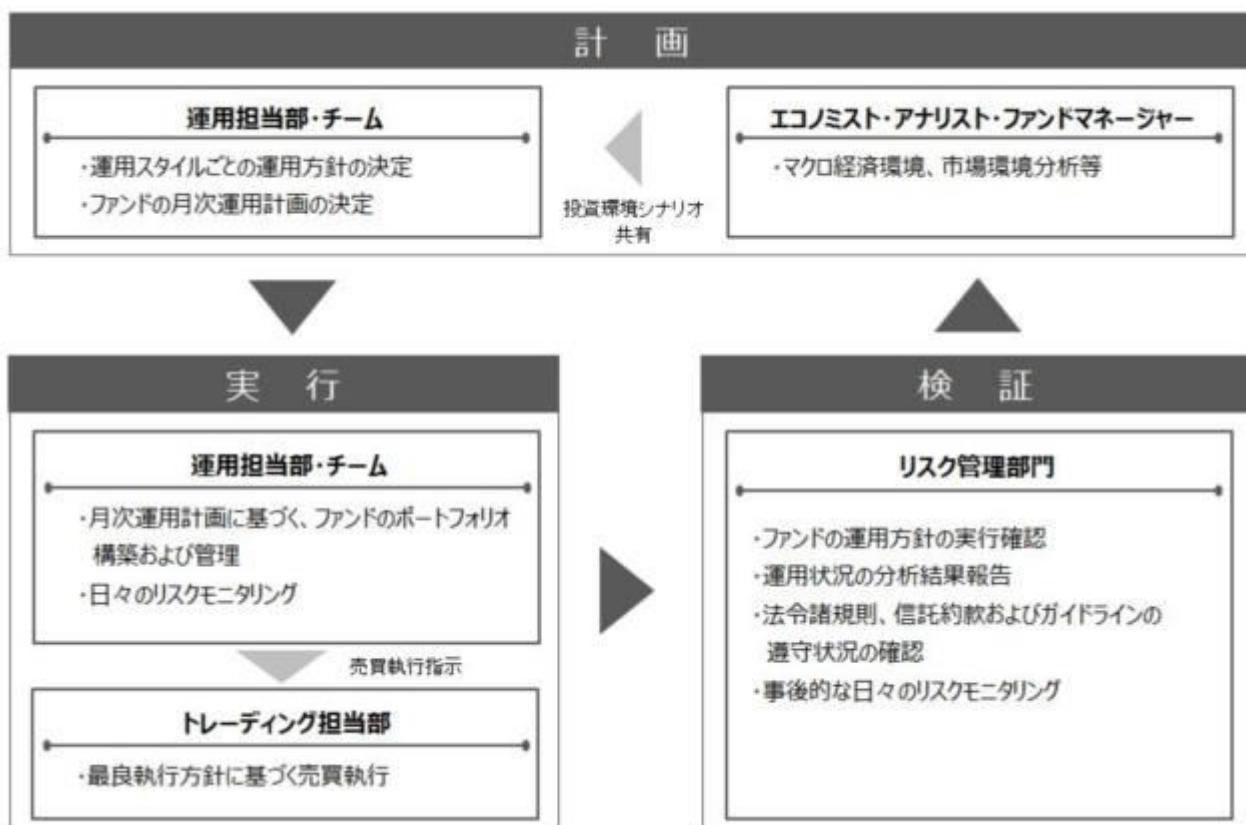
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2020年4月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	749	7,160,364
単体型株式投資信託	123	569,027
追加型公社債投資信託	1	28,432
単体型公社債投資信託	183	455,190
合計	1,056	8,213,015

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785
未収投資助言報酬	285,668	299,826
未収収益	44,150	37,702
その他の流動資産	31,771	40,119
流動資産合計	22,771,504	45,664,712
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	173,517	101,609
器具備品	751,471	783,224

土地	-	710
リース資産	-	968
建設仮勘定	-	66,498
有形固定資産合計	924,988	953,010
無形固定資産		
ソフトウェア	479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定	183,528	508,733
のれん	-	34,397,824
顧客関連資産	-	17,785,166
電話加入権	44	12,739
商標権	60	54
無形固定資産合計	663,501	53,613,651
投資その他の資産		
投資有価証券	10,829,628	19,436,480
関係会社株式	10,252,067	11,246,398
長期差入保証金	2,004,451	2,523,637
長期前払費用	97,107	113,852
会員権	7,819	90,479
繰延税金資産	1,426,381	-
貸倒引当金	-	20,750
投資その他の資産合計	24,617,457	33,390,098
固定資産合計	26,205,946	87,956,760
資産合計	48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		

資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2018年4月1日	(自	2019年4月1日
	至	2019年3月31日)	至	2020年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		39,156,499		54,615,133
運用受託報酬		6,277,217		9,389,058
投資助言報酬		1,332,888		1,303,595
その他営業収益				
サービス支援手数料		182,502		181,061
その他		49,507		32,421
営業収益計		46,998,614		65,521,269
営業費用				
支払手数料		18,499,433		24,888,040
広告宣伝費		361,696		447,024
公告費		125		-
調査費				
調査費		1,752,905		3,214,679
委託調査費		6,050,441		7,702,309
営業雑経費				
通信費		46,551		70,007
印刷費		338,465		612,249
協会費		24,700		45,117
諸会費		23,756		32,199
情報機器関連費		2,872,416		4,349,174
販売促進費		49,118		68,688
その他		148,307		154,201
営業費用合計		30,167,918		41,583,691
一般管理費				
給料				
役員報酬		190,951		264,325
給料・手当		6,308,066		9,789,691
賞与		514,259		914,702
賞与引当金繰入額		1,235,936		1,726,013
交際費		27,802		30,898
寄付金		82		2,022

事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	-	778,113
受取利息	623	947
時効成立分配金・償還金	72	1,041
原稿・講演料	1,951	2,061
投資有価証券償還益	289,451	6,398
投資有価証券売却益	7,247	24,206
雑収入	36,408	53,484
営業外収益合計	335,754	866,254
営業外費用		
為替差損	15,760	72,457
投資有価証券償還損	13,668	129,006
投資有価証券売却損	14,605	12,906
雑損失	7,027	8,334
営業外費用合計	51,061	222,704
経常利益	6,292,738	2,166,469
特別利益		
過去勤務費用償却益	79,850	-
特別利益合計	79,850	
特別損失		
固定資産除却損	1 1,462	110,668
関係会社株式評価損	160,455	-
合併関連費用	2 187,140	42,800
本社移転費用	3 -	133,168
減損損失	4 -	46,417
特別損失合計	349,058	333,054
税引前当期純利益	6,023,530	1,833,414
法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等	
	利益剰余金			

	利益剰余金 合計	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

[注記事項]

(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

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（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）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の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

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 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

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「営業外費用」として、表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当事業年度から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別利益」の「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」に表示していた7,247千円及び289,451千円は「営業外収益」として、「特別損失」の「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」に表示していた14,605千円及び13,668千円は「営業外費用」として組み替えております。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	350,176千円	466,875千円
器具備品	922,553千円	1,225,261千円
リース資産	-千円	1,452千円

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	174,854千円	132,559千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	当事業年度 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	-千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	-千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	102,695千円

2 合併関連費用

前事業年度の合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用であります。

当事業年度の合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

3 本社移転費用

本社移転費用は、本社事務所移転に伴い解約日までに賃貸期間の残存分(2020年7月13日から2020年9月30日まで)の賃料及び共益費相当額として133,168千円支払うものであります。

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

上記事業用資産については、霞ヶ関オフィスの移転に係る意思決定をしたことに伴い将来の使用が見込めなくなった資産につき、回収可能額を零と見積もり、当該減少額を減損損失に計上しております。その内訳は、建物に計上した資産除去債務に対応する原状回復費用相当額であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	17,622,360株	-	17,640,000株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

当社は2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019年 3月22日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

2019年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

2020年6月29日開催の第35回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

(4) 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、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。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、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（2019年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	33,264,545	33,264,545	-
(2)顧客分別金信託	300,021	300,021	-
(3)未収委託者報酬	8,404,880	8,404,880	-
(4)未収運用受託報酬	2,199,785	2,199,785	-
(5)未収投資助言報酬	299,826	299,826	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	19,391,111	19,391,111	-
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	-
資産計	66,383,807	66,383,807	-
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	-
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	-
負債計	3,791,158	3,791,158	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

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います。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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います。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、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、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

区分	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	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

区分	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	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2019年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(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
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 298千円)については、市場価格がなく、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、記載しておりません。

当事業年度(2020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
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がなく、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、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 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

728,127	7,247	14,605
---------	-------	--------

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,578,762	289,451	13,668

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
3,631,425	6,398	129,006

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について160,455千円(関係会社株式160,455千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,319,830	3,418,601
勤務費用	267,362	523,396
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	3,658	195
退職給付の支払額	85,082	349,050
過去勤務費用の発生額	79,850	-
合併による発生額	-	1,707,062
退職給付債務の期末残高	3,418,601	5,299,814

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842

確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158
-----------------	---------	---------

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.000%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,046,775	1,622,803
賞与引当金	400,242	530,059
調査費	80,983	178,573
未払金	57,192	162,557
未払事業税	54,797	46,423
ソフトウェア償却	17,501	91,937
子会社株式評価損	50,580	114,876
その他有価証券評価差額金	-	150,771
その他	32,218	88,250
繰延税金資産小計	1,740,292	2,986,254
評価性引当額(注)	51,729	193,485
繰延税金資産合計	1,688,563	2,792,768
繰延税金負債		
無形固定資産	-	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産(負債)の純額	1,426,381	2,963,538

(注) 評価性引当額が141,756千円増加しております。この増加の内容は、主として大和住銀投信投資顧問株式会社との合併によるものであります。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1

その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.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。

4.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。

5.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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09円

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
 2. 当社は、2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。
 1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。
 3. 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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社
 事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2) 企業結合を行った主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

(3) 企業結合日

2019年4月1日

(4) 企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5) 結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 2019年1月16日)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」(企業会計基準適用指針第10号 2019年1月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	企業結合日に交付した当社の普通株式の時価	81,927,000千円
取得原価		81,927,000千円

4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1) 合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はE Y トランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はP w C アドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

(3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1)発生したのれん

37,043,811千円

(2)発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3)償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	24,546,329千円
固定資産	34,001,531千円
資産合計	58,547,860千円
流動負債	5,406,939千円
固定負債	8,257,731千円
負債合計	13,664,671千円

(参考)大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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。

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	第46期 （平成30年3月31日）	第47期 （平成31年3月31日）
資産の部		

流動資産			
現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 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	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531

株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605
当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650

注記事項

(重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28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す。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 2～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、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。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の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。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

4. 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。

(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、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ました。

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」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

(追加情報)

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

(貸借対照表関係)

第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
1.有形固定資産の減価償却累計額	1.有形固定資産の減価償却累計額
建物 465,964千円	建物 556,889千円
器具備品 266,621千円	器具備品 297,262千円
リース資産 8,719千円	リース資産 12,584千円

(損益計算書関係)

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

(2) 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)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日
----------------------	----------	-----------	-----------	-----	------------	------------

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(2) 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)	配当の 原資	1株当た り配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

(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、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

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、次表に含めておりません（(注2)を参照ください）。

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用（*）	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4) 未収入金	4,542	4,542	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2) 未払費用（*）	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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。

- (5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

- (6) 長期差入保証金

敷金の性質及び貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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。

(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	第46期（平成30年3月31日）	第47期（平成31年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、市場価格がなく、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時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30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・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31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・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

2. その他有価証券

第46期（平成30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 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、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。

第47期（平成31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 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 45,071千円）については、市場価格がなく、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. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期（自平成30年4月1日 至平成31年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

（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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965

繰延税金負債		
建物	-	54,715
その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

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

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」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46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の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90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3.主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の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90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3.主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 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)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 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)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

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

1株当たりの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。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 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。)または子法人等(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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】**イ 定款の変更、その他の重要事項****(イ) 定款の変更**

2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

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】****イ 受託会社**

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2020年3月末現在)
- (ハ) 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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社*
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2020年3月末現在)
- ・ 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。

*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日に資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社と合併し、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。

□ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
B N Pパリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱U F Jモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	

資本金の額は、2020年3月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、交換の請求の受付け、収益分配金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当ありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年12月13日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

2020年6月15日

三井住友DS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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印**監査意見**

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DS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35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。

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DSアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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 . X B R 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

2020年5月12日

三井住友DS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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 菅野 雅子 印
業務執行社員

監査意見

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SMDAM トピックス上場投信の2019年12月13日から2020年4月8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。

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、SMDAM トピックス上場投信の2020年4月8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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに

対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

三井住友DS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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。