

## 【表紙】

|                                          |                                                            |
|------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書                                                  |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                                                    |
| 【提出日】                                    | 2020年8月7日提出                                                |
| 【発行者名】                                   | 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社                                              |
| 【代表者の役職氏名】                               | 取締役社長 松田 通                                                 |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号                                         |
| 【事務連絡者氏名】                                | 伊藤 晃                                                       |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740                                               |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | MAXISカーボン・エフィシエント日本株上場投信                                   |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | (1)当初設定額<br>22億3,160万円を上限とします。<br>(2)継続申込額<br>10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】                               | 株式会社東京証券取引所<br>(東京都中央区日本橋兜町２番１号)                           |

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年1月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

## 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

## １【ファンドの性格】

## （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;更新後&gt;

当ファンドは、Ｓ＆Ｐ／ＪＰＸ カーボン・エフィシエント指数（以下「対象指数」といいます。）に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式のみに投資を行い、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た運用を行います。

追加信託の限度額は、１兆円相当額です。

\* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

## 商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>（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             | ETF  | 特殊型<br>（ ） |
|         |        | その他資産<br>（ ）      |      |            |
|         |        | 資産複合              |      |            |

## 属性区分表

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態                 | 為替<br>ヘッジ | 対象<br>インデックス                               | 特殊型                           |
|--------|------|--------|----------------------|-----------|--------------------------------------------|-------------------------------|
| 株式     | 年１回  | グローバル  | ファミリー<br>ファンド        | あり<br>（ ） | 日経２２５                                      | ブル・ベア型                        |
| 一般     | 年２回  | 日本     |                      |           | TOPIX                                      | 条件付運用型                        |
| 大型株    | 年４回  | 北米     | ファンド・<br>オブ・<br>ファンズ | なし        | その他<br>（Ｓ＆Ｐ／ＪＰ<br>Ｘカーボン・<br>エフィシエント<br>指数） | ロング・<br>ショート型／<br>絶対収益<br>追求型 |
| 中小型株   | 年６回  | 欧州     |                      |           |                                            |                               |
| 債券     | （隔月） | アジア    |                      |           |                                            |                               |
| 一般     | 年１２回 | オセアニア  |                      |           |                                            |                               |
| 公債     | （毎月） | 中南米    |                      |           |                                            |                               |
| 社債     | 日々   | アフリカ   |                      |           |                                            |                               |
| その他債券  | その他  | 中近東    |                      |           |                                            |                               |
| クレジット  | （ ）  | （中東）   |                      |           |                                            |                               |
| 属性     |      | エマージング |                      |           |                                            |                               |
| （ ）    |      |        |                      |           |                                            | その他<br>（ ）                    |
| 不動産投信  |      |        |                      |           |                                            |                               |
| その他資産  |      |        |                      |           |                                            |                               |
| （ ）    |      |        |                      |           |                                            |                               |
| 資産複合   |      |        |                      |           |                                            |                               |
| （ ）    |      |        |                      |           |                                            |                               |

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容に

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

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

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

#### 商品分類の定義

|         |                       |                                                                                                            |
|---------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 単位型・追加型 | 単位型                   | 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。                                                        |
|         | 追加型                   | 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                    | 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。                                                     |
|         | 海外                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                     |
|         | 内外                    | 信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                        |
| 投資対象資産  | 株式                    | 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。                                                        |
|         | 債券                    | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                        |
|         | 不動産投信（リート）            | 信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                               |
|         | その他資産                 | 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、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                        |
|         | 資産複合                  | 信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                       |
| 独立区分    | MMF（マネー・マネージメント・ファンド） | 一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。                                                              |
|         | MRF（マネー・リザーブ・ファンド）    | 一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。                                                              |
|         | ETF                   | 投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第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。                                                          |
|         | 特殊型                   | 信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。                                         |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

#### 属性区分の定義

|        |    |      |                                       |
|--------|----|------|---------------------------------------|
| 投資対象資産 | 株式 | 一般   | 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。       |
|        |    | 大型株  | 信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。  |
|        |    | 中小型株 | 信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。 |
|        | 債券 | 一般   | 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。    |

|        |           |                                                                                                                                               |
|--------|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 公債        | 信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。                                                         |
|        | 社債        | 信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                   |
|        | その他債券     | 信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                 |
|        | クレジット属性   | 目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。 |
|        | 不動産投信     | 信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                        |
|        | その他資産     | 信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。                                                                                              |
|        | 資産複合      | 信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                                          |
| 決算頻度   | 年１回       | 信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                               |
|        | 年２回       | 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。                                                                                                               |
|        | 年４回       | 信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                               |
|        | 年６回（隔月）   | 信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                               |
|        | 年12回（毎月）  | 信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                          |
|        | 日々        | 信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。                                                                                                                |
|        | その他       | 上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。                                                                                                                       |
| 投資対象地域 | グローバル     | 信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                               |
|        | 日本        | 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。                                                                                               |
|        | 北米        | 信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                             |
|        | 欧州        | 信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                             |
|        | アジア       | 信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                       |
|        | オセアニア     | 信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                          |
|        | 中南米       | 信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                            |
|        | アフリカ      | 信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                           |
|        | 中近東（中東）   | 信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                                                            |
|        | エマージング    | 信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                                                          |
| 投資形態   | ファミリーファンド | 信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。                                                                              |

|          |                   |                                                                                                                          |
|----------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | ファンド・オブ・ファンズ      | 一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。                                                               |
| 為替ヘッジ    | あり                | 信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。                                                                       |
|          | なし                | 信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。                                                                 |
| 対象インデックス | 日経２２５             | 信託約款において、日経２２５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。                                                                       |
|          | ＴＯＰＩＸ             | 信託約款において、ＴＯＰＩＸ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。                                                                       |
|          | その他               | 信託約款において、上記以外の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。                                                                     |
| 特殊型      | ブル・ベア型            | 信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。                        |
|          | 条件付運用型            | 信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。 |
|          | ロング・ショート型／絶対収益追求型 | 信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。                                                |
|          | その他               | 信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。                                                              |

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

#### 〔ファンドの目的・特色〕

## ファンドの目的

対象指数(S&P／JPX カーボン・エフィシエント指数)に連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

### 投資方針

S&P／JPX カーボン・エフィシエント指数に連動する成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率をS&P／JPX カーボン・エフィシエント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。)の株式のみに投資を行います。
- 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。
- 対象指数との連動を維持するため、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことがあります。

### <S&P／JPX カーボン・エフィシエント指数について>

S&P／JPX カーボン・エフィシエント指数とは、東証株価指数(TOPIX)に組み入れられている銘柄をユニバースとして、炭素効率性の高い(炭素排出量の少ない)企業のウェイトを高め、炭素効率性の低い(炭素排出量の多い)企業のウェイトを下げることで、指数全体の炭素排出量の削減を目指す指数です。東証株価指数(TOPIX)と同程度の産業グループ構成比率を維持することにより、東証株価指数(TOPIX)との乖離を抑制します。

S&P／JPX カーボン・エフィシエント指数は、2009年3月20日の時価総額を100ポイントとして、S&P ダウ・ジョーンズ・インデックスおよび株式会社日本取引所グループが算出・公表しております。<sup>(注1)</sup>

算出対象銘柄数の増減や増資など市況変動によらない時価総額の増減が発生する場合は、その連続性を維持するため、基準時の時価総額(基準時価総額)を修正します。<sup>(注2)</sup>

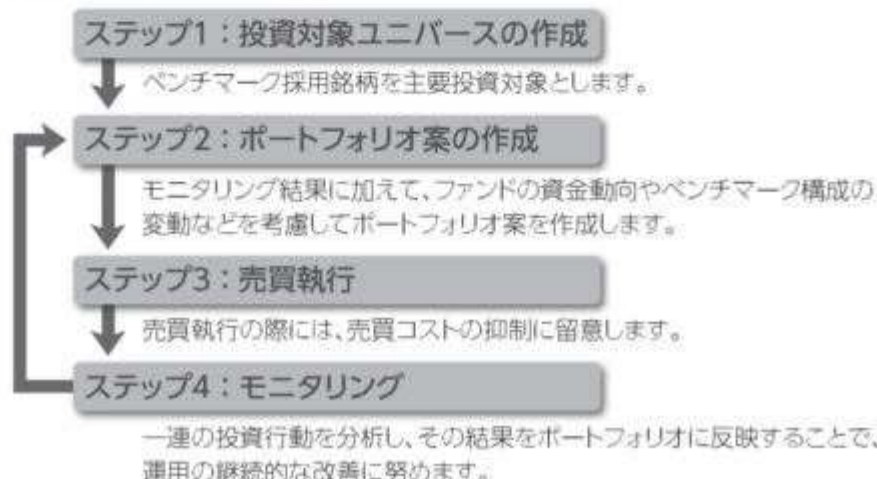
(注1)算出方法: 指数値=当日の時価総額÷基準時価総額×100

(注2)基準時価総額の修正方法:

新・基準時価総額

=旧・基準時価総額×(修正日前営業日の時価総額±修正額)÷修正日前営業日の時価総額

### <運用プロセスのイメージ>



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境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。

📄 委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

## ■上場投信の仕組み

ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律により定められる投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品性を持っています。

### 受益権が上場されます。

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は1口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

＜金融商品取引所＞

・東京証券取引所（2020年2月6日に新規上場）

### 取得申込みは株式によって行われます。

金融商品取引所における買付けのほか、株式による取得申込み（追加設定）を行うことができます。

委託会社は、あらかじめ取得申込みに必要な株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。

取得申込者はこれらの株式を提供することで、引換えに受益権を取得することができます。

なお、所定の条件に該当する場合を除き、金銭による取得申込みを行うことはできません。

### 受益権と引換えに株式を交付（交換）します。

一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する信託財産中の株式と交換することができます。

委託会社は、あらかじめ交換できる株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。

なお、通常の投資信託における換金手続きの「解約請求」は、ファンドでは行うことができません。

換金は、原則として金融商品取引所を通じての売却となります。

## ■主な投資制限

・株式への投資割合に制限を設けません。

・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

・有価証券先物取引等を行うことができます。

### 分配方針

年2回の決算時に分配を行います。

- 年2回の決算時(5・11月の各10日)に分配を行います。
- 分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、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。

## ●「MAXIS(マクシス)」の由来

「MAXIS(マクシス)」は三菱UFJ国際投信が運用するETF(上場投資信託)シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高(MAX)の品質」と「お客さまの投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJ国際投信の思いが込められています。

### 「S&P/JPX カーボン・エフィシエント指数」の著作権等について

「S&P/JPX カーボン・エフィシエント指数」(「当指数」)は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)および株式会社日本取引所グループの商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社に付与されています。Standard & Poor's s&pおよびS&Pは、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jonesは、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。また、JPXは株式会社日本取引所グループ、TOPIXは東京証券取引所の商標です。これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJ国際投信株式会社にそれぞれ付与されています。指数に直接投資することはできません。ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)、または株式会社日本取引所グループによってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesまたは株式会社日本取引所グループのいずれも、ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的にファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡する当指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。当指数に関して、S&P Dow Jones Indicesおよび株式会社日本取引所グループと三菱UFJ国際投信株式会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび株式会社日本取引所グループの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。当指数は三菱UFJ国際投信株式会社またはファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesまたは株式会社日本取引所グループによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesおよび株式会社日本取引所グループは、当指数の決定、構成または計算において三菱UFJ国際投信株式会社またはファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesおよび株式会社日本取引所グループのいずれも、ファンドの価格および数量、またはファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によってはファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesおよび株式会社日本取引所グループは、ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。当指数に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P DOW JONES INDICESまたは株式会社日本取引所グループは、当指数またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESおよび株式会社日本取引所グループは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESおよび株式会社日本取引所グループは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくは当指数を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、三菱UFJ国際投信株式会社、ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESまたは株式会社日本取引所グループは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと三菱UFJ国際投信株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

### < 訂正前 >

|           |                         |
|-----------|-------------------------|
| 2020年2月5日 | 設定日、信託契約締結、運用開始         |
| 2020年2月6日 | ファンドの受益権を東京証券取引所に上場(予定) |

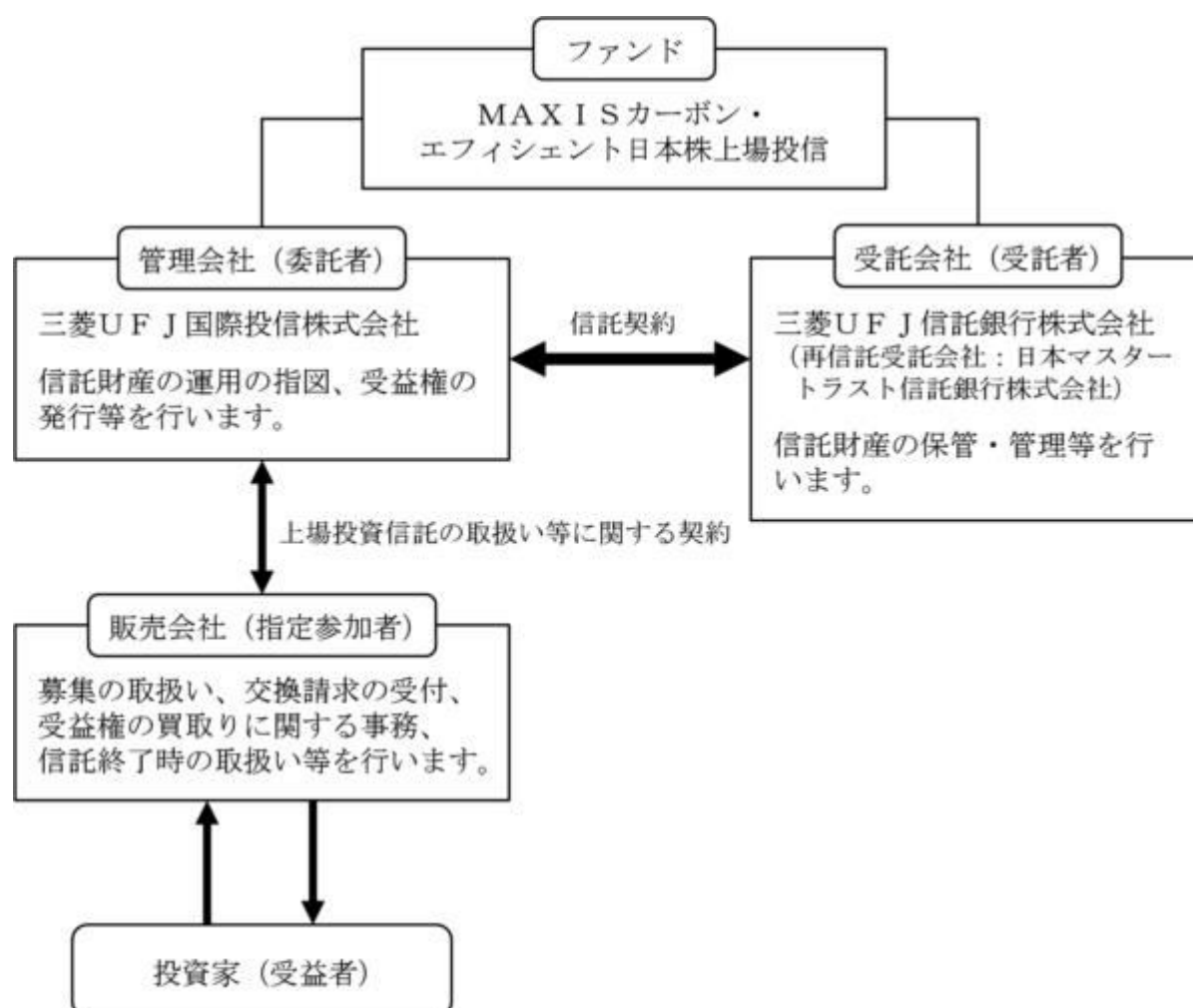
### < 訂正後 >

|           |                     |
|-----------|---------------------|
| 2020年2月5日 | 設定日、信託契約締結、運用開始     |
| 2020年2月6日 | ファンドの受益権を東京証券取引所に上場 |

## (3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

## 委託会社およびファンドの関係法人の役割



## 委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要                                                                                                                      |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「上場投資信託の取扱い等に関する契約」 | 募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いに係る事務の内容等が定められています。                                                               |

## 委託会社の概況（2019年10月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月

東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始

2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更

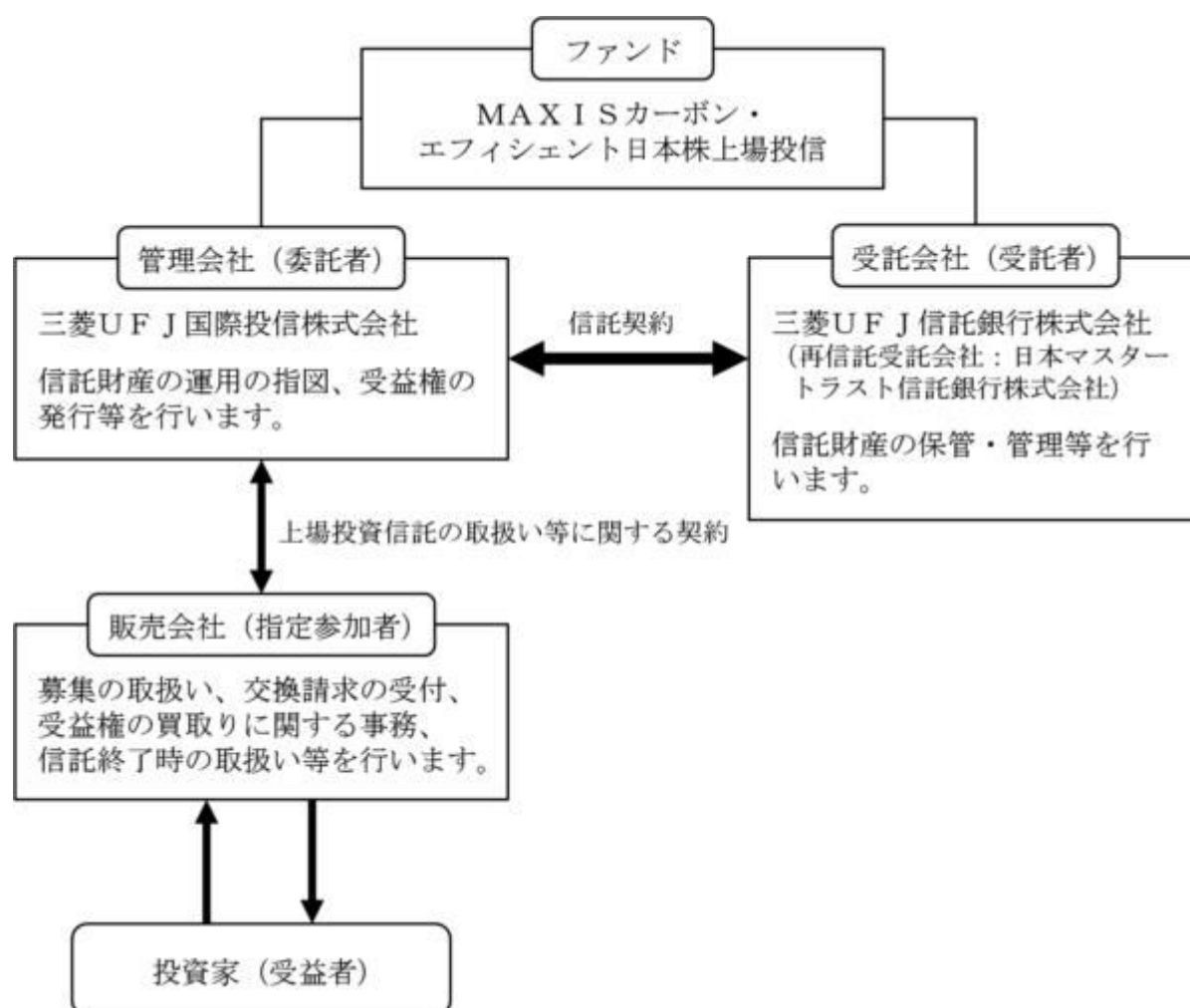
2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

| 株 主 名         | 住 所               | 所有株式数    | 所有比率   |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目４番５号 | 211,581株 | 100.0% |

< 訂正後 >

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

|                                      | 概要                                                                                                                      |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「信託契約」              | 運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。<br>なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「上場投資信託の取扱い等に関する契約」 | 募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いに係る事務の内容等が定められています。                                                               |

## 委託会社の概況（2020年5月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革
  - 1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
  - 2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
  - 2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
  - 2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況

| 株 主 名         | 住 所               | 所有株式数    | 所有比率   |
|---------------|-------------------|----------|--------|
| 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 | 東京都千代田区丸の内一丁目４番５号 | 211,581株 | 100.0% |

## 3【投資リスク】

&lt; 更新後 &gt;

## ( 1 ) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が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。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

**価格変動  
リスク**

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

**信用リスク**

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

**流動性  
リスク**

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

## 留意事項

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

- ・ファンドは、交換時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・ファンドは、Ｓ＆Ｐ／ＪＰＸ カーボン・エフィシエント指数の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数における各銘柄の構成比率と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、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要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

### トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

## <流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

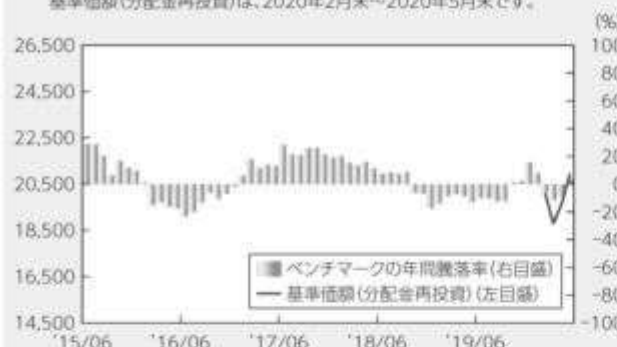
\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

### ● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率はありません。  
ベンチマークの年間騰落率は、2015年6月～2020年5月です。  
基準価額(分配金再投資)は、2020年2月末～2020年5月末です。



### ● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年6月末～2020年5月末)

ファンドの年間騰落率にはベンチマークを用いています。



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

| 資産クラス | 指数名                           | 注記等                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本株   | 東証株価指数(TOPIX)<br>(配当込み)       | 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。                                                                                                                           |
| 先進国株  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(配当込み)     | MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                               |
| 新興国株  | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み) | MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。                                                                                                                                                                                                    |
| 日本国債  | NOMURA-BPI(国債)                | NOMURA-BPI(国債)とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。                                                                                                                          |
| 先進国債  | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本)      | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債  | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド   | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。                                                                                                                                       |

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (4)【その他の手数料等】

## &lt;訂正前&gt;

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- ・受益権の上場に係る費用（新規上場料（新規上場時の純資産総額に対して0.00825%（税抜0.0075%））、追加上場料（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）に対して0.00825%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜0.0075%））、その他新規上場に係る費用（55万円（税抜50万円）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.015%（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

## &lt;訂正後&gt;

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- ・受益権の上場に係る費用（追加上場料（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）に対して0.00825%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.015%（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

## &lt; 訂正前 &gt;

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

## 個人の受益者に対する課税

## １．受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

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%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

## ２．収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）・申告分離課税を選択することもできます。

## ３．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記１．と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む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。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

特定株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

## １．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

## ２．収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

## ３．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記１．と同様の取扱いとなります。

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

上記は2019年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## &lt; 訂正後 &gt;

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

## 個人の受益者に対する課税

## １．受益権の売却時

売却価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得として課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

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%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

## 2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）・申告分離課税を選択することもできます。

## 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む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。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

特定株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する（ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

### 1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

### 2. 収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

### 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

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

上記は2020年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### 【MAXISカーボン・エフィシエント日本株上場投信】

#### （1）【投資状況】

令和 2年 5月29日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国／地域 | 時価合計        | 投資比率（％） |
|--------------------------|------|-------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 717,671,290 | 97.85   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） | —    | 15,774,285  | 2.15    |

|       |             |        |
|-------|-------------|--------|
| 純資産総額 | 733,445,575 | 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の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

令和 2年 5月29日現在

（単位：円）

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計       | 投資比率（％） |
|----------|----|------|------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 15,590,000 | 2.13    |

（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の比率をいいます。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 5月29日現在

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|--------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 5,000  | 6,492.00        | 32,460,000      | 6,755.00        | 33,775,000      | 4.60            |
| 日本   | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 3,000  | 6,948.00        | 20,844,000      | 6,874.00        | 20,622,000      | 2.81            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 3,000  | 4,668.00        | 14,004,000      | 4,832.00        | 14,496,000      | 1.98            |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 3,200  | 3,736.00        | 11,955,200      | 4,191.00        | 13,411,200      | 1.83            |
| 日本   | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 300    | 39,490.00       | 11,847,000      | 44,350.00       | 13,305,000      | 1.81            |
| 日本   | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 3,300  | 3,149.00        | 10,391,700      | 3,710.00        | 12,243,000      | 1.67            |
| 日本   | 株式 | K D D I           | 情報・通信業 | 3,500  | 3,175.00        | 11,112,500      | 3,136.00        | 10,976,000      | 1.50            |
| 日本   | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 24,100 | 419.20          | 10,102,720      | 444.20          | 10,705,220      | 1.46            |
| 日本   | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 900    | 7,750.00        | 6,975,000       | 10,085.00       | 9,076,500       | 1.24            |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 3,200  | 2,538.00        | 8,121,600       | 2,784.00        | 8,908,800       | 1.21            |
| 日本   | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 200    | 44,300.00       | 8,860,000       | 43,540.00       | 8,708,000       | 1.19            |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 3,500  | 2,447.50        | 8,566,250       | 2,444.00        | 8,554,000       | 1.17            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 2,600  | 2,763.50        | 7,185,100       | 3,119.00        | 8,109,400       | 1.11            |
| 日本   | 株式 | オリエンタルランド         | サービス業  | 500    | 13,730.00       | 6,865,000       | 15,615.00       | 7,807,500       | 1.06            |
| 日本   | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 400    | 17,910.00       | 7,164,000       | 19,215.00       | 7,686,000       | 1.05            |
| 日本   | 株式 | N T T ドコモ         | 情報・通信業 | 2,500  | 3,135.00        | 7,837,500       | 2,951.50        | 7,378,750       | 1.01            |
| 日本   | 株式 | アステラス製薬           | 医薬品    | 3,700  | 1,835.00        | 6,789,500       | 1,914.50        | 7,083,650       | 0.97            |
| 日本   | 株式 | 日本たばこ産業           | 食料品    | 3,100  | 1,970.50        | 6,108,550       | 2,137.50        | 6,626,250       | 0.90            |
| 日本   | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 300    | 22,490.00       | 6,747,000       | 21,500.00       | 6,450,000       | 0.88            |
| 日本   | 株式 | 中外製薬              | 医薬品    | 400    | 13,090.00       | 5,236,000       | 15,890.00       | 6,356,000       | 0.87            |

|    |    |             |      |       |           |           |           |           |      |
|----|----|-------------|------|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|
| 日本 | 株式 | ダイキン工業      | 機械   | 400   | 14,090.00 | 5,636,000 | 15,850.00 | 6,340,000 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業      | 化学   | 500   | 12,045.00 | 6,022,500 | 12,620.00 | 6,310,000 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所       | 電気機器 | 1,800 | 3,205.00  | 5,769,000 | 3,455.00  | 6,219,000 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | ＨＯＹＡ        | 精密機器 | 600   | 9,872.00  | 5,923,200 | 10,110.00 | 6,066,000 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 花王          | 化学   | 700   | 8,510.00  | 5,957,000 | 8,647.00  | 6,052,900 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道      | 陸運業  | 300   | 17,105.00 | 5,131,500 | 18,435.00 | 5,530,500 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | キリンホールディングス | 食料品  | 2,500 | 2,070.00  | 5,175,000 | 2,207.50  | 5,518,750 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | ＳＭＣ         | 機械   | 100   | 50,560.00 | 5,056,000 | 54,370.00 | 5,437,000 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機        | 電気機器 | 3,800 | 1,335.00  | 5,073,000 | 1,418.50  | 5,390,300 | 0.73 |
| 日本 | 株式 | 日本電産        | 電気機器 | 800   | 6,169.00  | 4,935,200 | 6,622.00  | 5,297,600 | 0.72 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

令和 2年 5月29日現在

| 種類 | 業種       | 投資比率（％） |
|----|----------|---------|
| 株式 | 水産・農林業   | 0.05    |
|    | 鉱業       | 0.24    |
|    | 建設業      | 3.16    |
|    | 食料品      | 3.72    |
|    | 繊維製品     | 0.40    |
|    | パルプ・紙    | 0.21    |
|    | 化学       | 7.03    |
|    | 医薬品      | 6.99    |
|    | 石油・石炭製品  | 0.45    |
|    | ゴム製品     | 0.07    |
|    | ガラス・土石製品 | 0.51    |
|    | 鉄鋼       | 0.40    |
|    | 非鉄金属     | 0.72    |
|    | 金属製品     | 0.30    |
|    | 機械       | 5.04    |
|    | 電気機器     | 15.22   |
|    | 輸送用機器    | 8.35    |
|    | 精密機器     | 2.44    |
|    | その他製品    | 1.96    |
|    | 電気・ガス業   | 1.63    |
|    | 陸運業      | 4.28    |
|    | 海運業      | 0.09    |
|    | 空運業      | 0.39    |
|    | 倉庫・運輸関連業 | 0.17    |
|    | 情報・通信業   | 9.50    |
|    | 卸売業      | 3.85    |
|    | 小売業      | 3.92    |
|    | 銀行業      | 5.10    |

|            |       |
|------------|-------|
| 証券、商品先物取引業 | 0.79  |
| 保険業        | 2.13  |
| その他金融業     | 1.11  |
| 不動産業       | 2.03  |
| サービス業      | 5.61  |
| 小計         | 97.85 |
| 合計         | 97.85 |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

令和 2年 5月29日現在

| 資産の種類    | 取引所名  | 資産の名称         | 建別 | 数量 | 通貨 | 簿価金額（円）    | 評価金額（円）    | 投資比率（％） |
|----------|-------|---------------|----|----|----|------------|------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX 20年06月限 | 買建 | 1  | 円  | 14,555,000 | 15,590,000 | 2.13    |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

#### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年5月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

|                       | 純資産総額       |             | 基準価額<br>（１口当たりの純資産価額） |        | 東京証券取引所<br>取引価格 |
|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------|-----------------|
|                       | （分配落）       | （分配付）       | （分配落）                 | （分配付）  |                 |
| 第1計算期間末日（令和 2年 5月10日） | 685,273,771 | 693,294,963 | 19,308                | 19,534 | 19,230          |
| 令和 2年 2月末日            | 712,780,596 | —           | 20,083                | —      | 19,990          |
| 3月末日                  | 667,395,262 | —           | 18,804                | —      | 18,880          |
| 4月末日                  | 696,670,937 | —           | 19,629                | —      | 19,230          |
| 5月末日                  | 733,445,575 | —           | 20,665                | —      | 20,630          |

#### 【分配の推移】

|        | 1口当たりの分配金 |
|--------|-----------|
| 第1計算期間 | 226円00銭   |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率（％） |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 12.46  |

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

## （４）【設定及び解約の実績】

|        | 設定口数   | 解約口数 | 発行済口数  |
|--------|--------|------|--------|
| 第1計算期間 | 35,492 | —    | 35,492 |

（注）解約口数は、交換口数を表示しております。

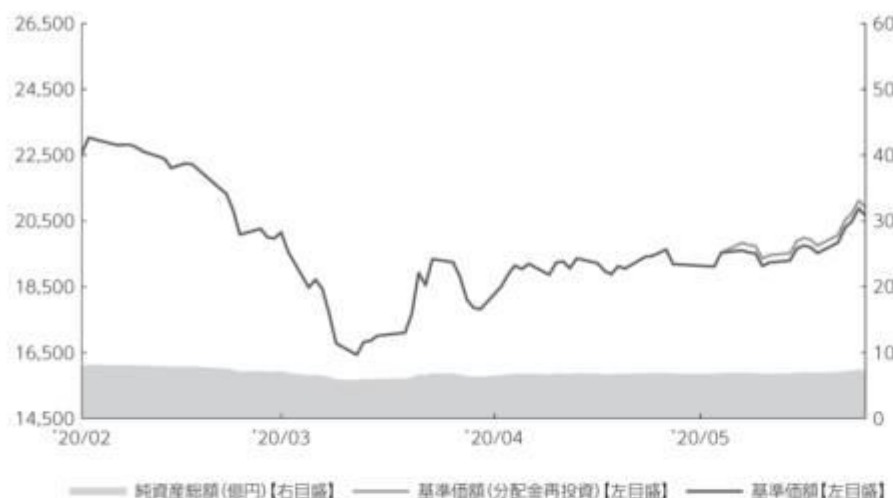
## 参考情報



# 運用実績

2020年5月29日現在

## ■基準価額・純資産の推移 2020年2月5日(設定日)～2020年5月29日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は22,316(当初元本1口当たり)を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

## ■基準価額・純資産

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 20,665円 |
| 純資産総額 | 7.3億円   |

## ■分配の推移

|         |      |
|---------|------|
| 2020年5月 | 226円 |
| 設定来累計   | 226円 |

・分配金は1口当たり、税引前

## ■主要な資産の状況

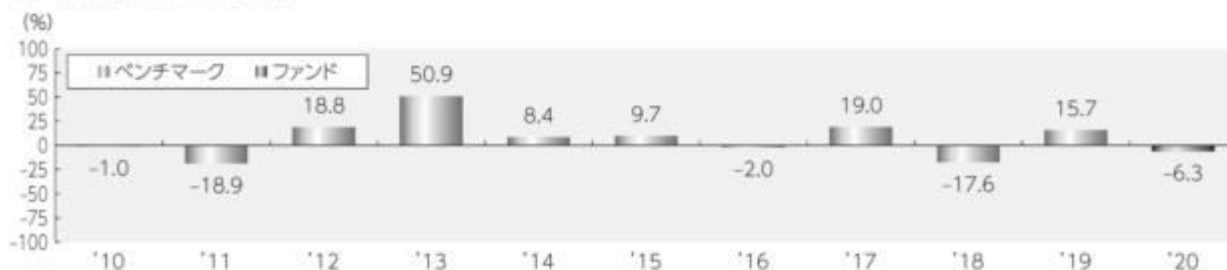
| 組入上位業種   | 比率    |
|----------|-------|
| 1 電気機器   | 15.2% |
| 2 情報・通信業 | 9.5%  |
| 3 輸送用機器  | 8.4%  |
| 4 化学     | 7.0%  |
| 5 医薬品    | 7.0%  |
| 6 サービス業  | 5.6%  |
| 7 銀行業    | 5.1%  |
| 8 機械     | 5.0%  |
| 9 陸運業    | 4.3%  |
| 10 小売業   | 3.9%  |

| 組入上位銘柄              | 業種     | 比率   |
|---------------------|--------|------|
| 1 トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 4.6% |
| 2 ソニー               | 電気機器   | 2.8% |
| 3 ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 2.0% |
| 4 武田薬品工業            | 医薬品    | 1.8% |
| 5 キーエンス             | 電気機器   | 1.8% |
| 6 リクルートホールディングス     | サービス業  | 1.7% |
| 7 KDDI              | 情報・通信業 | 1.5% |
| 8 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 1.5% |
| 9 第一三共              | 医薬品    | 1.2% |
| 10 本田技研工業           | 輸送用機器  | 1.2% |

| その他資産の状況     | 比率   |
|--------------|------|
| 株価指数先物取引(買建) | 2.1% |

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの

## ■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2020年は設定日から5月29日までの収益率を表示
- ・2019年以前は対象指数(ベンチマーク)の年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。  
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

## 2【換金（解約）手続等】

### <訂正前>

#### 解約の受付

解約の請求はできません。（受託会社が書面決議において重大な約款の変更等に反対した受益者からの請求により買い取った受益権を除きます。）

#### 交換の受付

2020年4月1日以降において、受益者は自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換（「交換」といいます。）を請求できます。原則、交換請求受付日の正午までに受け付けた交換請求（当該交換請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該交換請求受付日の請求とします。正午過ぎに受け付けた交換請求は翌営業日を交換請求受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に交換請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には交換請求ができません。

- 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前営業日
- 2．対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内
- 3．対象指数の構成銘柄の株式移転および合併等による当該銘柄の上場廃止日から、当該移転および当該合併等に伴う新規銘柄の対象指数への採用日および存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日までの間
- 4．計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、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）
- 5．ファンド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
- 6．1．から5．のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、1．から6．に定める日の交換請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、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、交換請求の受け付けを行うことができます。

受益者の交換請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### 交換の方法

受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、販売会社所定の方法で行うものとします。

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、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。

委託会社は、受託会社に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位（金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。）の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。

交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の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、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有価証券（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。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社はその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。

委託会社は、発行会社等による大口の交換請求に対し、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合には、制限を設けることがあります。

受益者が取得できる個別銘柄の有価証券に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは

当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行われることとなる有価証券（「配当落ち銘柄等」といいます。）が含まれる場合は、委託会社は、交換に係る有価証券のうち当該配当落ち銘柄等の株式に相当する部分について、当該株式の個別銘柄時価総額に相当する金銭の交付をもって交換するよう指図することができます。

#### 交換単位等

委託会社が定める一定口数（「交換請求口数」といいます。）

交換に係る受益権の評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有価証券の数は、交換請求受付日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位の整数倍とします。

#### 交換手数料

販売会社が定める額

交換手数料は販売会社にご確認ください。

#### 交付有価証券

原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から、受益者への交換有価証券の交付に際しては振替機関等の口座に交換請求を行った受益者に係る有価証券の増加の記載または記録が行われ、金銭の交付については販売会社の営業所等において行われます。

#### 交換請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合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すでに受け付けた交換請求の受け付けを取り消すことができます。その場合には、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す。ただし、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ます。

#### 買取り

販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、正午までに受け付けた請求については当日を受付日としてその受益権を買取ります。正午過ぎに受け付けた場合は翌営業日を受付日とします。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

2. 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、買取請求の受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴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、外国為替取引の停止、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。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

詳しくは販売会社にご確認ください。

#### < 訂正後 >

##### 解約の受付

解約の請求はできません。（受託会社が書面決議において重大な約款の変更等に反対した受益者からの請求により買い取った受益権を除きます。）

##### 交換の受付

受益者は自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換（「交換」といいます。）

す。)を請求できます。原則、交換請求受付日の正午までに受け付けた交換請求(当該交換請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を当該交換請求受付日の請求とします。正午過ぎに受け付けた交換請求は翌営業日を交換請求受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に交換請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には交換請求ができません。

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前営業日
2. 対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内
3. 対象指数の構成銘柄の株式移転および合併等による当該銘柄の上場廃止日から、当該移転および当該合併等に伴う新規銘柄の対象指数への採用日および存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日までの間
4. 計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、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)
5. ファンド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
6. 1. から5. のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、1. から6. に定める日の交換請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、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、交換請求の受け付けを行うことができます。

受益者の交換請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### 交換の方法

受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、販売会社所定の方法で行うものとします。

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、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。

委託会社は、受益者に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位(金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。)の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。

交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の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、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有価証券(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。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社はその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

委託会社は、発行会社等による大口の交換請求に対し、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合には、制限を設けることがあります。

受益者が取得できる個別銘柄の有価証券に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行われることとなる有価証券(「配当落ち銘柄等」といいます。)が含まれる場合は、委託会社は、交換に係る有価証券のうち当該配当落ち銘柄等の株式に相当する部分について、当該株式の個別銘柄時価総額に相当する金銭の交付をもって交換するよう指図することができます。

#### 交換単位等

委託会社が定める一定口数(「交換請求口数」といいます。)

交換に係る受益権の評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有価証券の数は、交換請求受付日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位の整数倍とします。

#### 交換手数料

## 販売会社が定める額

交換手数料は販売会社にご確認ください。

## 交付有価証券

原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から、受益者への交換有価証券の交付に際しては振替機関等の口座に交換請求を行った受益者に係る有価証券の増加の記載または記録が行われ、金銭の交付については販売会社の営業所等において行われます。

## 交換請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合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すでに受け付けた交換請求の受け付けを取り消すことができます。その場合には、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す。ただし、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ます。

## 買取り

販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、正午までに受け付けた請求については当日を受付日としてその受益権を買取ります。正午過ぎに受け付けた場合は翌営業日を受付日とします。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

2. 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、買取請求の受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴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、外国為替取引の停止、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。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

詳しくは販売会社にご確認ください。

## 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 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和2年2月5日から令和2年5月10日までとしております。

- 3 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、当期（令和2年2月5日から令和2年5月10日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【MAXISカーボン・エフィシエント日本株上場投信】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

| 第1期<br>[ 令和2年5月10日現在 ] |             |
|------------------------|-------------|
| 資産の部                   |             |
| 流動資産                   |             |
| コール・ローン                | 8,598,992   |
| 株式                     | 670,339,660 |
| 派生商品評価勘定               | 559,450     |
| 未収入金                   | 5,382,600   |
| 未収配当金                  | 8,565,159   |
| 差入委託証拠金                | 735,000     |
| 流動資産合計                 | 694,180,861 |
| 資産合計                   | 694,180,861 |
| 負債の部                   |             |
| 流動負債                   |             |
| 前受金                    | 280,000     |
| 未払収益分配金                | 8,021,192   |
| 未払受託者報酬                | 56,399      |
| 未払委託者報酬                | 195,352     |
| 未払利息                   | 22          |
| その他未払費用                | 354,125     |
| 流動負債合計                 | 8,907,090   |
| 負債合計                   | 8,907,090   |
| 純資産の部                  |             |
| 元本等                    |             |
| 元本                     | 792,039,472 |
| 剰余金                    |             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）        | 106,765,701 |
| （分配準備積立金）              | 3,861       |
| 元本等合計                  | 685,273,771 |
| 純資産合計                  | 685,273,771 |
| 負債純資産合計                | 694,180,861 |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第1期<br>自 令和 2年 2月 5日<br>至 令和 2年 5月10日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |
| 受取配当金                                     | 8,631,209                             |
| 受取利息                                      | 12                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 107,329,012                           |
| 派生商品取引等損益                                 | 559,450                               |
| 営業収益合計                                    | 98,138,341                            |
| 営業費用                                      |                                       |
| 支払利息                                      | 292                                   |
| 受託者報酬                                     | 56,399                                |
| 委託者報酬                                     | 195,352                               |
| その他費用                                     | 354,125                               |
| 営業費用合計                                    | 606,168                               |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 98,744,509                            |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 98,744,509                            |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 98,744,509                            |
| 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（ ）                           | -                                     |
| 分配金                                       | 8,021,192                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 106,765,701                           |

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                         |
|-----------------------|---------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。                         |

（貸借対照表に関する注記）

|                             | 第1期<br>[令和 2年 5月10日現在] |
|-----------------------------|------------------------|
| 1. 期首元本額                    | —円                     |
| 期中追加設定元本額                   | 792,039,472円           |
| 期中一部交換元本額                   | —円                     |
| 2. 元本の欠損                    |                        |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 106,765,701円           |
| 3. 受益権の総数                   | 35,492口                |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

## 第1期

自 令和 2年 2月 5日

至 令和 2年 5月10日

## 1. その他費用

上場費用および商標使用料等を含んでおります。

## 2. 分配金の計算過程

| 項目             |       |            |
|----------------|-------|------------|
| 当期配当等収益額       | A     | 8,630,929円 |
| 分配準備積立金額       | B     | —円         |
| 配当等収益合計額       | C=A+B | 8,630,929円 |
| 経費             | D     | 605,876円   |
| 当ファンドの分配対象収益額  | E=C-D | 8,025,053円 |
| 収益分配金金額        | F     | 8,021,192円 |
| 次期繰越金(分配準備積立金) | G=E-F | 3,861円     |
| 当ファンドの期末残存口数   | H     | 35,492口    |
| 1口当たり分配金額      | I=F/H | 226円       |

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

| 区分                       | 第1期<br>自 令和 2年 2月 5日<br>至 令和 2年 5月10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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格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に晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制        | <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>                                                                               |

## 2 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 第1期<br>[ 令和 2年 5月10日現在 ]                                                                                                                                                                                                                 |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                           |                                                                                                                                                                                                                                          |
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているためその差額はありません。                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.時価の算定方法                 | <p>( 1 ) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>( 2 ) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（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 ) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。                                                                                                                    |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種類 | 第1期<br>[ 令和 2年 5月10日現在 ] |
|----|--------------------------|
|    | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）     |
| 株式 | 104,926,605              |
| 合計 | 104,926,605              |

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

第1期 [ 令和 2年 5月10日現在 ]

| 区分   | 種類             | 契約額等（円）    |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|------|----------------|------------|-------|------------|---------|
|      |                |            | うち1年超 |            |         |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 13,995,000 | —     | 14,555,000 | 560,000 |
| 合計   |                | 13,995,000 | —     | 14,555,000 | 560,000 |

## （注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
  - 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
  - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （１口当たり情報）

|           | 第1期<br>[ 令和 2年 5月10日現在 ] |
|-----------|--------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 19,308円                  |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

（単位：円）

|      | 銘 柄            | 株式数   | 評価額      |           | 備考 |
|------|----------------|-------|----------|-----------|----|
|      |                |       | 単価       | 金額        |    |
| 1332 | 日本水産           | 800   | 472.00   | 377,600   |    |
| 1514 | 住石ホールディングス     | 100   | 113.00   | 11,300    |    |
| 1605 | 国際石油開発帝石       | 2,300 | 692.20   | 1,592,060 |    |
| 1414 | ショーボンドホールディングス | 100   | 4,395.00 | 439,500   |    |
| 1417 | ミライト・ホールディングス  | 100   | 1,433.00 | 143,300   |    |
| 1435 | T A T E R U    | 100   | 115.00   | 11,500    |    |
| 1719 | 安藤・間           | 400   | 702.00   | 280,800   |    |
| 1720 | 東急建設           | 200   | 571.00   | 114,200   |    |
| 1721 | コムシスホールディングス   | 100   | 3,080.00 | 308,000   |    |
| 1801 | 大成建設           | 500   | 3,495.00 | 1,747,500 |    |
| 1802 | 大林組            | 1,400 | 961.00   | 1,345,400 |    |
| 1803 | 清水建設           | 1,400 | 874.00   | 1,223,600 |    |
| 1808 | 長谷工コーポレーション    | 400   | 1,179.00 | 471,600   |    |
| 1812 | 鹿島建設           | 1,100 | 1,151.00 | 1,266,100 |    |
| 1820 | 西松建設           | 100   | 2,087.00 | 208,700   |    |
| 1821 | 三井住友建設         | 300   | 445.00   | 133,500   |    |
| 1824 | 前田建設工業         | 300   | 871.00   | 261,300   |    |
| 1833 | 奥村組            | 100   | 2,399.00 | 239,900   |    |
| 1835 | 東鉄工業           | 100   | 2,727.00 | 272,700   |    |
| 1860 | 戸田建設           | 400   | 638.00   | 255,200   |    |
| 1861 | 熊谷組            | 100   | 2,479.00 | 247,900   |    |
| 1870 | 矢作建設工業         | 100   | 793.00   | 79,300    |    |

|      |                          |       |           |           |  |
|------|--------------------------|-------|-----------|-----------|--|
| 1873 | 日本ハウスホールディングス            | 100   | 277.00    | 27,700    |  |
| 1878 | 大東建託                     | 200   | 10,570.00 | 2,114,000 |  |
| 1881 | ＮＩＰＰＯ                    | 100   | 2,507.00  | 250,700   |  |
| 1883 | 前田道路                     | 100   | 2,025.00  | 202,500   |  |
| 1890 | 東洋建設                     | 100   | 434.00    | 43,400    |  |
| 1893 | 五洋建設                     | 400   | 556.00    | 222,400   |  |
| 1911 | 住友林業                     | 300   | 1,286.00  | 385,800   |  |
| 1925 | 大和ハウス工業                  | 1,200 | 2,723.50  | 3,268,200 |  |
| 1926 | ライト工業                    | 100   | 1,393.00  | 139,300   |  |
| 1928 | 積水ハウス                    | 1,700 | 1,860.00  | 3,162,000 |  |
| 1934 | ユアテック                    | 100   | 622.00    | 62,200    |  |
| 1941 | 中電工                      | 100   | 2,185.00  | 218,500   |  |
| 1942 | 関電工                      | 200   | 901.00    | 180,200   |  |
| 1944 | きんでん                     | 300   | 1,779.00  | 533,700   |  |
| 1950 | 日本電設工業                   | 100   | 2,088.00  | 208,800   |  |
| 1951 | 協和エクシオ                   | 200   | 2,687.00  | 537,400   |  |
| 1959 | 九電工                      | 100   | 2,972.00  | 297,200   |  |
| 1961 | 三機工業                     | 100   | 1,258.00  | 125,800   |  |
| 1963 | 日揮ホールディングス               | 300   | 1,032.00  | 309,600   |  |
| 1969 | 高砂熱学工業                   | 100   | 1,701.00  | 170,100   |  |
| 1976 | 明星工業                     | 100   | 814.00    | 81,400    |  |
| 1979 | 大気社                      | 100   | 3,185.00  | 318,500   |  |
| 5912 | ＯＳＪＢホールディングス             | 200   | 245.00    | 49,000    |  |
| 6379 | レイズネクスト                  | 100   | 1,191.00  | 119,100   |  |
| 2002 | 日清製粉グループ本社               | 100   | 1,679.00  | 167,900   |  |
| 2201 | 森永製菓                     | 100   | 4,415.00  | 441,500   |  |
| 2212 | 山崎製パン                    | 400   | 1,897.00  | 758,800   |  |
| 2501 | サッポロホールディングス             | 200   | 2,015.00  | 403,000   |  |
| 2502 | アサヒグループホールディングス          | 1,100 | 3,700.00  | 4,070,000 |  |
| 2503 | 麒麟ホールディングス               | 2,500 | 2,070.00  | 5,175,000 |  |
| 2531 | 宝ホールディングス                | 200   | 820.00    | 164,000   |  |
| 2579 | コカ・コーラ ボトラーズジャパン<br>ホールデ | 500   | 1,964.00  | 982,000   |  |
| 2587 | サントリー食品インターナショナル         | 500   | 3,980.00  | 1,990,000 |  |
| 2801 | キッコーマン                   | 400   | 4,760.00  | 1,904,000 |  |
| 2802 | 味の素                      | 100   | 1,921.50  | 192,150   |  |
| 2875 | 東洋水産                     | 200   | 5,250.00  | 1,050,000 |  |
| 2897 | 日清食品ホールディングス             | 200   | 9,020.00  | 1,804,000 |  |
| 2914 | 日本たばこ産業                  | 3,100 | 1,970.50  | 6,108,550 |  |
| 2930 | 北の達人コーポレーション             | 100   | 525.00    | 52,500    |  |
| 2931 | ユーグレナ                    | 100   | 666.00    | 66,600    |  |
| 3101 | 東洋紡                      | 100   | 1,264.00  | 126,400   |  |
| 3202 | ダイトウボウ                   | 100   | 123.00    | 12,300    |  |
| 3401 | 帝人                       | 400   | 1,681.00  | 672,400   |  |

|      |                |       |           |           |  |
|------|----------------|-------|-----------|-----------|--|
| 3402 | 東レ             | 2,900 | 479.50    | 1,390,550 |  |
| 3591 | ワコールホールディングス   | 100   | 2,142.00  | 214,200   |  |
| 3606 | レナウン           | 100   | 75.00     | 7,500     |  |
| 3608 | T S I ホールディングス | 100   | 420.00    | 42,000    |  |
| 8016 | オンワードホールディングス  | 200   | 331.00    | 66,200    |  |
| 8107 | キムラタン          | 200   | 25.00     | 5,000     |  |
| 8114 | デサント           | 100   | 1,360.00  | 136,000   |  |
| 3861 | 王子ホールディングス     | 1,400 | 572.00    | 800,800   |  |
| 3863 | 日本製紙           | 100   | 1,532.00  | 153,200   |  |
| 3865 | 北越コーポレーション     | 300   | 416.00    | 124,800   |  |
| 3880 | 大王製紙           | 100   | 1,469.00  | 146,900   |  |
| 3941 | レンゴー           | 400   | 840.00    | 336,000   |  |
| 3405 | クラレ            | 500   | 1,082.00  | 541,000   |  |
| 3407 | 旭化成            | 2,600 | 741.30    | 1,927,380 |  |
| 4004 | 昭和電工           | 200   | 2,272.00  | 454,400   |  |
| 4005 | 住友化学           | 3,000 | 329.00    | 987,000   |  |
| 4021 | 日産化学           | 300   | 4,080.00  | 1,224,000 |  |
| 4028 | 石原産業           | 100   | 652.00    | 65,200    |  |
| 4041 | 日本曹達           | 100   | 2,811.00  | 281,100   |  |
| 4042 | 東ソー            | 300   | 1,317.00  | 395,100   |  |
| 4043 | トクヤマ           | 100   | 2,283.00  | 228,300   |  |
| 4044 | セントラル硝子        | 100   | 1,864.00  | 186,400   |  |
| 4045 | 東亜合成           | 100   | 993.00    | 99,300    |  |
| 4047 | 関東電化工業         | 100   | 848.00    | 84,800    |  |
| 4061 | デンカ            | 100   | 2,636.00  | 263,600   |  |
| 4063 | 信越化学工業         | 500   | 12,045.00 | 6,022,500 |  |
| 4088 | エア・ウォーター       | 300   | 1,522.00  | 456,600   |  |
| 4091 | 大陽日酸           | 200   | 1,666.00  | 333,200   |  |
| 4095 | 日本パーカライジング     | 200   | 1,109.00  | 221,800   |  |
| 4114 | 日本触媒           | 100   | 5,210.00  | 521,000   |  |
| 4118 | カネカ            | 100   | 2,750.00  | 275,000   |  |
| 4182 | 三菱瓦斯化学         | 200   | 1,329.00  | 265,800   |  |
| 4183 | 三井化学           | 300   | 2,032.00  | 609,600   |  |
| 4185 | J S R          | 300   | 1,946.00  | 583,800   |  |
| 4186 | 東京応化工業         | 100   | 4,520.00  | 452,000   |  |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 2,100 | 605.80    | 1,272,180 |  |
| 4202 | ダイセル           | 400   | 865.00    | 346,000   |  |
| 4203 | 住友ベークライト       | 100   | 2,789.00  | 278,900   |  |
| 4204 | 積水化学工業         | 200   | 1,359.00  | 271,800   |  |
| 4205 | 日本ゼオン          | 300   | 953.00    | 285,900   |  |
| 4206 | アイカ工業          | 100   | 3,030.00  | 303,000   |  |
| 4208 | 宇部興産           | 100   | 1,780.00  | 178,000   |  |
| 4212 | 積水樹脂           | 100   | 2,320.00  | 232,000   |  |

|      |                  |       |           |            |  |
|------|------------------|-------|-----------|------------|--|
| 4215 | タキロンシーアイ         | 100   | 618.00    | 61,800     |  |
| 4220 | リケンテクノス          | 100   | 418.00    | 41,800     |  |
| 4228 | 積水化成品工業          | 100   | 615.00    | 61,500     |  |
| 4246 | ダイキョーニシカワ        | 100   | 548.00    | 54,800     |  |
| 4272 | 日本化薬             | 300   | 1,024.00  | 307,200    |  |
| 4401 | A D E K A        | 200   | 1,397.00  | 279,400    |  |
| 4403 | 日油               | 100   | 3,535.00  | 353,500    |  |
| 4452 | 花王               | 700   | 8,510.00  | 5,957,000  |  |
| 4611 | 大日本塗料            | 100   | 945.00    | 94,500     |  |
| 4612 | 日本ペイントホールディングス   | 400   | 6,390.00  | 2,556,000  |  |
| 4613 | 関西ペイント           | 500   | 2,047.00  | 1,023,500  |  |
| 4617 | 中国塗料             | 100   | 819.00    | 81,900     |  |
| 4620 | 藤倉化成             | 100   | 515.00    | 51,500     |  |
| 4631 | D I C            | 200   | 2,501.00  | 500,200    |  |
| 4633 | サカタインクス          | 100   | 978.00    | 97,800     |  |
| 4634 | 東洋インキＳＣホールディングス  | 100   | 2,003.00  | 200,300    |  |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス   | 600   | 5,287.00  | 3,172,200  |  |
| 4911 | 資生堂              | 700   | 6,390.00  | 4,473,000  |  |
| 4912 | ライオン             | 500   | 2,300.00  | 1,150,000  |  |
| 4917 | マンダム             | 100   | 2,025.00  | 202,500    |  |
| 4921 | ファンケル            | 200   | 2,900.00  | 580,000    |  |
| 4922 | コーセー             | 100   | 13,100.00 | 1,310,000  |  |
| 4927 | ポーラ・オルビスホールディングス | 200   | 1,919.00  | 383,800    |  |
| 4956 | コニシ              | 100   | 1,425.00  | 142,500    |  |
| 4958 | 長谷川香料            | 100   | 2,178.00  | 217,800    |  |
| 4967 | 小林製薬             | 100   | 9,980.00  | 998,000    |  |
| 4975 | J C U            | 100   | 2,752.00  | 275,200    |  |
| 4980 | デクセリアルズ          | 100   | 716.00    | 71,600     |  |
| 4996 | クミアイ化学工業         | 200   | 872.00    | 174,400    |  |
| 4997 | 日本農薬             | 100   | 436.00    | 43,600     |  |
| 6988 | 日東電工             | 400   | 5,410.00  | 2,164,000  |  |
| 7908 | きもと              | 100   | 140.00    | 14,000     |  |
| 7970 | 信越ポリマー           | 100   | 850.00    | 85,000     |  |
| 8113 | ユニ・チャーム          | 500   | 4,011.00  | 2,005,500  |  |
| 4151 | 協和キリン            | 100   | 2,614.00  | 261,400    |  |
| 4502 | 武田薬品工業           | 3,200 | 3,736.00  | 11,955,200 |  |
| 4503 | アステラス製薬          | 3,700 | 1,835.00  | 6,789,500  |  |
| 4506 | 大日本住友製薬          | 300   | 1,500.00  | 450,000    |  |
| 4507 | 塩野義製薬            | 500   | 5,960.00  | 2,980,000  |  |
| 4519 | 中外製薬             | 400   | 13,090.00 | 5,236,000  |  |
| 4521 | 科研製薬             | 100   | 5,740.00  | 574,000    |  |
| 4523 | エーザイ             | 400   | 7,544.00  | 3,017,600  |  |
| 4527 | ロート製薬            | 100   | 3,090.00  | 309,000    |  |

|      |                    |       |          |           |  |
|------|--------------------|-------|----------|-----------|--|
| 4528 | 小野薬品工業             | 900   | 2,619.00 | 2,357,100 |  |
| 4530 | 久光製薬               | 100   | 5,080.00 | 508,000   |  |
| 4536 | 参天製薬               | 600   | 1,881.00 | 1,128,600 |  |
| 4541 | 日医工                | 100   | 1,424.00 | 142,400   |  |
| 4547 | キッセイ薬品工業           | 100   | 2,640.00 | 264,000   |  |
| 4548 | 生化学工業              | 100   | 1,084.00 | 108,400   |  |
| 4568 | 第一三共               | 900   | 7,750.00 | 6,975,000 |  |
| 4569 | キョーリン製薬ホールディングス    | 100   | 2,225.00 | 222,500   |  |
| 4574 | 大幸薬品               | 100   | 1,728.00 | 172,800   |  |
| 4578 | 大塚ホールディングス         | 200   | 4,241.00 | 848,200   |  |
| 4581 | 大正製薬ホールディングス       | 100   | 6,720.00 | 672,000   |  |
| 3315 | 日本コークス工業           | 200   | 58.00    | 11,600    |  |
| 5017 | 富士石油               | 100   | 180.00   | 18,000    |  |
| 5019 | 出光興産               | 300   | 2,443.00 | 732,900   |  |
| 5020 | J X T Gホールディングス    | 5,800 | 380.10   | 2,204,580 |  |
| 5021 | コスモエネルギーホールディングス   | 100   | 1,578.00 | 157,800   |  |
| 5108 | ブリヂストン             | 100   | 3,303.00 | 330,300   |  |
| 5191 | 住友理工               | 100   | 556.00   | 55,600    |  |
| 5195 | バンドー化学             | 100   | 630.00   | 63,000    |  |
| 5201 | A G C              | 300   | 2,667.00 | 800,100   |  |
| 5202 | 日本板硝子              | 100   | 345.00   | 34,500    |  |
| 5214 | 日本電気硝子             | 100   | 1,583.00 | 158,300   |  |
| 5233 | 太平洋セメント            | 100   | 2,184.00 | 218,400   |  |
| 5301 | 東海カーボン             | 400   | 831.00   | 332,400   |  |
| 5332 | T O T O            | 300   | 3,965.00 | 1,189,500 |  |
| 5333 | 日本碍子               | 300   | 1,374.00 | 412,200   |  |
| 5393 | ニチアス               | 100   | 2,141.00 | 214,100   |  |
| 5401 | 日本製鉄               | 1,100 | 896.60   | 986,260   |  |
| 5406 | 神戸製鋼所              | 400   | 351.00   | 140,400   |  |
| 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 600   | 707.00   | 424,200   |  |
| 5423 | 東京製鐵               | 200   | 764.00   | 152,800   |  |
| 5463 | 丸一鋼管               | 100   | 2,445.00 | 244,500   |  |
| 5471 | 大同特殊鋼              | 100   | 3,545.00 | 354,500   |  |
| 5486 | 日立金属               | 300   | 1,035.00 | 310,500   |  |
| 5563 | 新日本電工              | 100   | 151.00   | 15,100    |  |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス      | 1,100 | 169.00   | 185,900   |  |
| 5706 | 三井金属鉱業             | 100   | 2,071.00 | 207,100   |  |
| 5711 | 三菱マテリアル            | 200   | 2,210.00 | 442,000   |  |
| 5713 | 住友金属鉱山             | 400   | 2,715.00 | 1,086,000 |  |
| 5714 | D O W Aホールディングス    | 100   | 3,020.00 | 302,000   |  |
| 5721 | エス・サイエンス           | 200   | 38.00    | 7,600     |  |
| 5727 | 東邦チタニウム            | 100   | 616.00   | 61,600    |  |
| 5741 | U A C J            | 100   | 1,726.00 | 172,600   |  |

|      |                  |       |           |           |  |
|------|------------------|-------|-----------|-----------|--|
| 5801 | 古河電気工業           | 100   | 1,998.00  | 199,800   |  |
| 5802 | 住友電気工業           | 1,400 | 1,085.00  | 1,519,000 |  |
| 5803 | フジクラ             | 500   | 306.00    | 153,000   |  |
| 5809 | タツタ電線            | 100   | 536.00    | 53,600    |  |
| 5857 | アサヒホールディングス      | 100   | 2,575.00  | 257,500   |  |
| 3433 | トーカロ             | 100   | 1,048.00  | 104,800   |  |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 200   | 1,065.00  | 213,000   |  |
| 5911 | 横河ブリッジホールディングス   | 100   | 1,879.00  | 187,900   |  |
| 5929 | 三和ホールディングス       | 300   | 834.00    | 250,200   |  |
| 5930 | 文化シヤッター          | 100   | 791.00    | 79,100    |  |
| 5938 | ＬＩＸＩＬグループ        | 600   | 1,382.00  | 829,200   |  |
| 5943 | ノーリツ             | 100   | 1,262.00  | 126,200   |  |
| 5959 | 岡部               | 100   | 775.00    | 77,500    |  |
| 5975 | 東プレ              | 100   | 1,268.00  | 126,800   |  |
| 5976 | 高周波熱錬            | 100   | 586.00    | 58,600    |  |
| 5631 | 日本製鋼所            | 100   | 1,340.00  | 134,000   |  |
| 6005 | 三浦工業             | 100   | 4,520.00  | 452,000   |  |
| 6013 | タクマ              | 100   | 1,227.00  | 122,700   |  |
| 6101 | ツガミ              | 100   | 995.00    | 99,500    |  |
| 6113 | アマダ              | 500   | 974.00    | 487,000   |  |
| 6118 | アイダエンジニアリング      | 100   | 732.00    | 73,200    |  |
| 6134 | ＦＵＪＩ             | 100   | 1,777.00  | 177,700   |  |
| 6136 | オーエスジー           | 100   | 1,415.00  | 141,500   |  |
| 6140 | 旭ダイヤモンド工業        | 100   | 489.00    | 48,900    |  |
| 6141 | ＤＭＧ森精機           | 200   | 1,130.00  | 226,000   |  |
| 6143 | ソディック            | 100   | 780.00    | 78,000    |  |
| 6146 | ディスコ             | 100   | 24,910.00 | 2,491,000 |  |
| 6250 | やまびこ             | 100   | 833.00    | 83,300    |  |
| 6268 | ナブテスコ            | 200   | 3,280.00  | 656,000   |  |
| 6273 | ＳＭＣ              | 100   | 50,560.00 | 5,056,000 |  |
| 6301 | 小松製作所            | 1,800 | 2,034.50  | 3,662,100 |  |
| 6302 | 住友重機械工業          | 200   | 2,244.00  | 448,800   |  |
| 6305 | 日立建機             | 200   | 2,538.00  | 507,600   |  |
| 6326 | クボタ              | 1,800 | 1,336.00  | 2,404,800 |  |
| 6332 | 月島機械             | 100   | 1,238.00  | 123,800   |  |
| 6339 | 新東工業             | 100   | 755.00    | 75,500    |  |
| 6345 | アイチ コーポレーション     | 100   | 689.00    | 68,900    |  |
| 6349 | 小森コーポレーション       | 100   | 757.00    | 75,700    |  |
| 6361 | 荏原製作所            | 200   | 2,420.00  | 484,000   |  |
| 6367 | ダイキン工業           | 400   | 14,090.00 | 5,636,000 |  |
| 6370 | 栗田工業             | 200   | 2,995.00  | 599,000   |  |
| 6381 | アネスト岩田           | 100   | 848.00    | 84,800    |  |
| 6383 | ダイフク             | 200   | 7,470.00  | 1,494,000 |  |

|      |                   |       |          |           |  |
|------|-------------------|-------|----------|-----------|--|
| 6395 | タダノ               | 100   | 801.00   | 80,100    |  |
| 6406 | フジテック             | 100   | 1,543.00 | 154,300   |  |
| 6407 | C K D             | 100   | 1,811.00 | 181,100   |  |
| 6412 | 平和                | 100   | 1,868.00 | 186,800   |  |
| 6417 | S A N K Y O       | 100   | 2,909.00 | 290,900   |  |
| 6432 | 竹内製作所             | 100   | 1,634.00 | 163,400   |  |
| 6436 | アマノ               | 100   | 2,212.00 | 221,200   |  |
| 6440 | J U K I           | 100   | 615.00   | 61,500    |  |
| 6457 | グローリー             | 100   | 2,448.00 | 244,800   |  |
| 6459 | 大和冷機工業            | 100   | 940.00   | 94,000    |  |
| 6460 | セガサミーホールディングス     | 400   | 1,322.00 | 528,800   |  |
| 6465 | ホシザキ              | 100   | 8,250.00 | 825,000   |  |
| 6471 | 日本精工              | 600   | 764.00   | 458,400   |  |
| 6472 | N T N             | 700   | 205.00   | 143,500   |  |
| 6473 | ジェイテクト            | 400   | 759.00   | 303,600   |  |
| 6480 | 日本トムソン            | 100   | 380.00   | 38,000    |  |
| 6481 | T H K             | 200   | 2,604.00 | 520,800   |  |
| 6498 | キッツ               | 100   | 685.00   | 68,500    |  |
| 6586 | マキタ               | 500   | 3,385.00 | 1,692,500 |  |
| 7004 | 日立造船              | 300   | 359.00   | 107,700   |  |
| 7011 | 三菱重工業             | 600   | 2,686.00 | 1,611,600 |  |
| 7013 | I H I             | 300   | 1,302.00 | 390,600   |  |
| 7718 | スター精密             | 100   | 1,187.00 | 118,700   |  |
| 3105 | 日清紡ホールディングス       | 200   | 760.00   | 152,000   |  |
| 4062 | イビデン              | 100   | 2,911.00 | 291,100   |  |
| 4902 | コニカミノルタ           | 900   | 389.00   | 350,100   |  |
| 6448 | ブラザー工業            | 500   | 1,809.00 | 904,500   |  |
| 6479 | ミネベアミツミ           | 500   | 1,768.00 | 884,000   |  |
| 6501 | 日立製作所             | 1,800 | 3,205.00 | 5,769,000 |  |
| 6503 | 三菱電機              | 3,800 | 1,335.00 | 5,073,000 |  |
| 6504 | 富士電機              | 200   | 2,672.00 | 534,400   |  |
| 6506 | 安川電機              | 400   | 3,500.00 | 1,400,000 |  |
| 6508 | 明電舎               | 100   | 1,694.00 | 169,400   |  |
| 6588 | 東芝テック             | 100   | 3,520.00 | 352,000   |  |
| 6592 | マブチモーター           | 100   | 3,280.00 | 328,000   |  |
| 6594 | 日本電産              | 800   | 6,169.00 | 4,935,200 |  |
| 6619 | ダブル・スコープ          | 100   | 371.00   | 37,100    |  |
| 6632 | J V C ケンウッド       | 300   | 167.00   | 50,100    |  |
| 6641 | 日新電機              | 100   | 1,083.00 | 108,300   |  |
| 6644 | 大崎電気工業            | 100   | 518.00   | 51,800    |  |
| 6645 | オムロン              | 400   | 6,700.00 | 2,680,000 |  |
| 6651 | 日東工業              | 100   | 1,807.00 | 180,700   |  |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 100   | 1,530.00 | 153,000   |  |

|      |              |       |           |            |  |
|------|--------------|-------|-----------|------------|--|
| 6701 | 日本電気         | 600   | 4,100.00  | 2,460,000  |  |
| 6702 | 富士通          | 300   | 10,545.00 | 3,163,500  |  |
| 6703 | 沖電気工業        | 200   | 1,049.00  | 209,800    |  |
| 6724 | セイコーエプソン     | 600   | 1,206.00  | 723,600    |  |
| 6727 | ワコム          | 300   | 377.00    | 113,100    |  |
| 6728 | アルバック        | 100   | 2,927.00  | 292,700    |  |
| 6740 | ジャパンディスプレイ   | 600   | 43.00     | 25,800     |  |
| 6741 | 日本信号         | 100   | 1,047.00  | 104,700    |  |
| 6742 | 京三製作所        | 100   | 513.00    | 51,300     |  |
| 6752 | パナソニック       | 1,500 | 799.60    | 1,199,400  |  |
| 6753 | シャープ         | 300   | 1,181.00  | 354,300    |  |
| 6754 | アンリツ         | 300   | 2,208.00  | 662,400    |  |
| 6758 | ソニー          | 3,000 | 6,948.00  | 20,844,000 |  |
| 6762 | T D K        | 100   | 9,370.00  | 937,000    |  |
| 6768 | タムラ製作所       | 100   | 439.00    | 43,900     |  |
| 6770 | アルプスアルパイン    | 400   | 1,122.00  | 448,800    |  |
| 6804 | ホシデン         | 100   | 912.00    | 91,200     |  |
| 6806 | ヒロセ電機        | 100   | 12,030.00 | 1,203,000  |  |
| 6807 | 日本航空電子工業     | 100   | 1,428.00  | 142,800    |  |
| 6810 | マクセルホールディングス | 100   | 984.00    | 98,400     |  |
| 6841 | 横河電機         | 400   | 1,497.00  | 598,800    |  |
| 6845 | アズビル         | 200   | 2,848.00  | 569,600    |  |
| 6849 | 日本光電工業       | 200   | 3,975.00  | 795,000    |  |
| 6856 | 堀場製作所        | 100   | 5,790.00  | 579,000    |  |
| 6857 | アドバンテスト      | 200   | 5,370.00  | 1,074,000  |  |
| 6861 | キーエンス        | 300   | 39,490.00 | 11,847,000 |  |
| 6869 | シスメックス       | 300   | 7,461.00  | 2,238,300  |  |
| 6871 | 日本マイクロニクス    | 100   | 890.00    | 89,000     |  |
| 6914 | オプテックスグループ   | 100   | 1,252.00  | 125,200    |  |
| 6920 | レーザーテック      | 100   | 7,670.00  | 767,000    |  |
| 6925 | ウシオ電機        | 200   | 1,134.00  | 226,800    |  |
| 6951 | 日本電子         | 100   | 3,355.00  | 335,500    |  |
| 6952 | カシオ計算機       | 300   | 1,678.00  | 503,400    |  |
| 6954 | ファナック        | 400   | 17,910.00 | 7,164,000  |  |
| 6965 | 浜松ホトニクス      | 200   | 4,665.00  | 933,000    |  |
| 6967 | 新光電気工業       | 100   | 1,364.00  | 136,400    |  |
| 6971 | 京セラ          | 400   | 5,803.00  | 2,321,200  |  |
| 6976 | 太陽誘電         | 100   | 3,050.00  | 305,000    |  |
| 6981 | 村田製作所        | 800   | 6,054.00  | 4,843,200  |  |
| 6986 | 双葉電子工業       | 100   | 1,056.00  | 105,600    |  |
| 6996 | ニチコン         | 100   | 685.00    | 68,500     |  |
| 7276 | 小糸製作所        | 200   | 4,005.00  | 801,000    |  |
| 7280 | ミツバ          | 100   | 453.00    | 45,300     |  |

|      |                |       |           |            |  |
|------|----------------|-------|-----------|------------|--|
| 7735 | ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 100   | 5,180.00  | 518,000    |  |
| 7751 | キヤノン           | 2,000 | 2,184.50  | 4,369,000  |  |
| 7752 | リコー            | 1,100 | 763.00    | 839,300    |  |
| 8035 | 東京エレクトロン       | 300   | 22,490.00 | 6,747,000  |  |
| 3116 | トヨタ紡織          | 100   | 1,320.00  | 132,000    |  |
| 5949 | ユニプレス          | 100   | 938.00    | 93,800     |  |
| 6455 | モリタホールディングス    | 100   | 1,627.00  | 162,700    |  |
| 6902 | デンソー           | 800   | 3,682.00  | 2,945,600  |  |
| 6995 | 東海理化電機製作所      | 100   | 1,380.00  | 138,000    |  |
| 7003 | 三井Ｅ＆Ｓホールディングス  | 100   | 613.00    | 61,300     |  |
| 7012 | 川崎重工業          | 300   | 1,599.00  | 479,700    |  |
| 7014 | 名村造船所          | 100   | 177.00    | 17,700     |  |
| 7201 | 日産自動車          | 4,400 | 347.60    | 1,529,440  |  |
| 7202 | いすゞ自動車         | 1,400 | 813.30    | 1,138,620  |  |
| 7203 | トヨタ自動車         | 5,000 | 6,492.00  | 32,460,000 |  |
| 7205 | 日野自動車          | 600   | 652.00    | 391,200    |  |
| 7211 | 三菱自動車工業        | 1,700 | 289.00    | 491,300    |  |
| 7220 | 武蔵精密工業         | 100   | 851.00    | 85,100     |  |
| 7222 | 日産車体           | 200   | 889.00    | 177,800    |  |
| 7224 | 新明和工業          | 200   | 1,081.00  | 216,200    |  |
| 7226 | 極東開発工業         | 100   | 1,224.00  | 122,400    |  |
| 7230 | 日信工業           | 100   | 2,210.00  | 221,000    |  |
| 7238 | 曙ブレーキ工業        | 200   | 192.00    | 38,400     |  |
| 7239 | タチエス           | 100   | 929.00    | 92,900     |  |
| 7240 | ＮＯＫ            | 200   | 1,206.00  | 241,200    |  |
| 7241 | フタバ産業          | 100   | 483.00    | 48,300     |  |
| 7246 | プレス工業          | 200   | 251.00    | 50,200     |  |
| 7250 | 太平洋工業          | 100   | 940.00    | 94,000     |  |
| 7251 | ケーヒン           | 100   | 2,545.00  | 254,500    |  |
| 7261 | マツダ            | 1,400 | 585.00    | 819,000    |  |
| 7267 | 本田技研工業         | 3,200 | 2,538.00  | 8,121,600  |  |
| 7269 | スズキ            | 700   | 3,345.00  | 2,341,500  |  |
| 7270 | ＳＵＢＡＲＵ         | 1,300 | 2,115.00  | 2,749,500  |  |
| 7272 | ヤマハ発動機         | 500   | 1,365.00  | 682,500    |  |
| 7274 | ショーワ           | 100   | 2,256.00  | 225,600    |  |
| 7283 | 愛三工業           | 100   | 551.00    | 55,100     |  |
| 7296 | エフ・シー・シー       | 100   | 1,539.00  | 153,900    |  |
| 7313 | テイ・エス テック      | 100   | 2,869.00  | 286,900    |  |
| 4543 | テルモ            | 1,000 | 3,563.00  | 3,563,000  |  |
| 6376 | 日機装            | 100   | 847.00    | 84,700     |  |
| 7701 | 島津製作所          | 400   | 2,635.00  | 1,054,000  |  |
| 7729 | 東京精密           | 100   | 3,415.00  | 341,500    |  |
| 7730 | マニー            | 100   | 2,433.00  | 243,300    |  |

|      |                 |       |           |           |  |
|------|-----------------|-------|-----------|-----------|--|
| 7731 | ニコン             | 700   | 984.00    | 688,800   |  |
| 7732 | トプコン            | 200   | 842.00    | 168,400   |  |
| 7733 | オリンパス           | 2,000 | 1,681.50  | 3,363,000 |  |
| 7741 | ＨＯＹＡ            | 600   | 9,872.00  | 5,923,200 |  |
| 7747 | 朝日インテック         | 200   | 2,778.00  | 555,600   |  |
| 7762 | シチズン時計          | 400   | 371.00    | 148,400   |  |
| 8086 | ニプロ             | 200   | 1,198.00  | 239,600   |  |
| 7832 | バンダイナムコホールディングス | 400   | 5,479.00  | 2,191,600 |  |
| 7864 | フジシールインターナショナル  | 100   | 1,854.00  | 185,400   |  |
| 7867 | タカラトミー          | 100   | 876.00    | 87,600    |  |
| 7915 | ＮＩＳＳＨＡ          | 100   | 797.00    | 79,700    |  |
| 7936 | アシックス           | 500   | 1,005.00  | 502,500   |  |
| 7951 | ヤマハ             | 200   | 4,385.00  | 877,000   |  |
| 7956 | ビジョン            | 200   | 4,040.00  | 808,000   |  |
| 7966 | リンテック           | 100   | 2,380.00  | 238,000   |  |
| 7974 | 任天堂             | 200   | 44,300.00 | 8,860,000 |  |
| 7981 | タカラスタANDARD     | 100   | 1,588.00  | 158,800   |  |
| 9501 | 東京電力ホールディングス    | 1,800 | 359.00    | 646,200   |  |
| 9502 | 中部電力            | 700   | 1,454.00  | 1,017,800 |  |
| 9503 | 関西電力            | 1,700 | 1,053.50  | 1,790,950 |  |
| 9504 | 中国電力            | 300   | 1,456.00  | 436,800   |  |
| 9505 | 北陸電力            | 200   | 710.00    | 142,000   |  |
| 9506 | 東北電力            | 600   | 1,024.00  | 614,400   |  |
| 9507 | 四国電力            | 200   | 799.00    | 159,800   |  |
| 9508 | 九州電力            | 500   | 868.00    | 434,000   |  |
| 9509 | 北海道電力           | 300   | 413.00    | 123,900   |  |
| 9513 | 電源開発            | 100   | 1,977.00  | 197,700   |  |
| 9531 | 東京瓦斯            | 1,100 | 2,491.50  | 2,740,650 |  |
| 9532 | 大阪瓦斯            | 800   | 2,061.00  | 1,648,800 |  |
| 9533 | 東邦瓦斯            | 300   | 5,670.00  | 1,701,000 |  |
| 9543 | 静岡ガス            | 100   | 957.00    | 95,700    |  |
| 2384 | ＳＢＳホールディングス     | 100   | 1,842.00  | 184,200   |  |
| 9001 | 東武鉄道            | 300   | 3,570.00  | 1,071,000 |  |
| 9003 | 相鉄ホールディングス      | 100   | 2,759.00  | 275,900   |  |
| 9005 | 東急              | 900   | 1,600.00  | 1,440,000 |  |
| 9006 | 京浜急行電鉄          | 400   | 1,735.00  | 694,000   |  |
| 9007 | 小田急電鉄           | 400   | 2,331.00  | 932,400   |  |
| 9008 | 京王電鉄            | 100   | 5,610.00  | 561,000   |  |
| 9009 | 京成電鉄            | 200   | 2,993.00  | 598,600   |  |
| 9020 | 東日本旅客鉄道         | 600   | 7,811.00  | 4,686,600 |  |
| 9021 | 西日本旅客鉄道         | 300   | 6,274.00  | 1,882,200 |  |
| 9022 | 東海旅客鉄道          | 300   | 17,105.00 | 5,131,500 |  |
| 9024 | 西武ホールディングス      | 300   | 1,261.00  | 378,300   |  |

|      |                      |       |          |           |  |
|------|----------------------|-------|----------|-----------|--|
| 9025 | 鴻池運輸                 | 100   | 1,146.00 | 114,600   |  |
| 9031 | 西日本鉄道                | 100   | 2,590.00 | 259,000   |  |
| 9041 | 近鉄グループホールディングス       | 500   | 5,130.00 | 2,565,000 |  |
| 9042 | 阪急阪神ホールディングス         | 400   | 3,755.00 | 1,502,000 |  |
| 9044 | 南海電気鉄道               | 200   | 2,404.00 | 480,800   |  |
| 9045 | 京阪ホールディングス           | 100   | 4,780.00 | 478,000   |  |
| 9048 | 名古屋鉄道                | 200   | 3,080.00 | 616,000   |  |
| 9062 | 日本通運                 | 200   | 5,090.00 | 1,018,000 |  |
| 9064 | ヤマトホールディングス          | 700   | 1,912.00 | 1,338,400 |  |
| 9065 | 山九                   | 100   | 4,025.00 | 402,500   |  |
| 9069 | センコーグループホールディングス     | 300   | 870.00   | 261,000   |  |
| 9072 | ニッコンホールディングス         | 100   | 2,049.00 | 204,900   |  |
| 9076 | セイノーホールディングス         | 200   | 1,286.00 | 257,200   |  |
| 9086 | 日立物流                 | 100   | 2,599.00 | 259,900   |  |
| 9142 | 九州旅客鉄道               | 200   | 2,873.00 | 574,600   |  |
| 9143 | S Gホールディングス          | 200   | 3,030.00 | 606,000   |  |
| 9101 | 日本郵船                 | 200   | 1,370.00 | 274,000   |  |
| 9104 | 商船三井                 | 100   | 1,795.00 | 179,500   |  |
| 9107 | 川崎汽船                 | 100   | 1,023.00 | 102,300   |  |
| 9119 | 飯野海運                 | 100   | 317.00   | 31,700    |  |
| 9201 | 日本航空                 | 600   | 1,792.00 | 1,075,200 |  |
| 9202 | A N Aホールディングス        | 600   | 2,186.00 | 1,311,600 |  |
| 9301 | 三菱倉庫                 | 200   | 2,380.00 | 476,000   |  |
| 9303 | 住友倉庫                 | 100   | 1,241.00 | 124,100   |  |
| 9364 | 上組                   | 200   | 1,916.00 | 383,200   |  |
| 9375 | 近鉄エクスプレス             | 100   | 1,525.00 | 152,500   |  |
| 2317 | システナ                 | 100   | 1,552.00 | 155,200   |  |
| 2327 | 日鉄ソリューションズ           | 100   | 2,738.00 | 273,800   |  |
| 3626 | T I S                | 300   | 2,082.00 | 624,600   |  |
| 3632 | グリー                  | 200   | 431.00   | 86,200    |  |
| 3635 | コーエーテクモホールディングス      | 100   | 2,988.00 | 298,800   |  |
| 3656 | K L a b              | 100   | 727.00   | 72,700    |  |
| 3659 | ネクソン                 | 1,200 | 1,792.00 | 2,150,400 |  |
| 3660 | アイスタイル               | 100   | 295.00   | 29,500    |  |
| 3668 | コロブラ                 | 200   | 910.00   | 182,000   |  |
| 3673 | ブロードリーフ              | 200   | 518.00   | 103,600   |  |
| 3765 | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 100   | 1,706.00 | 170,600   |  |
| 3769 | G M Oペイメントゲートウェイ     | 100   | 9,800.00 | 980,000   |  |
| 3774 | インターネットイニシアティブ       | 100   | 3,840.00 | 384,000   |  |
| 3903 | g u m i              | 100   | 740.00   | 74,000    |  |
| 3938 | L I N E              | 100   | 5,300.00 | 530,000   |  |
| 4307 | 野村総合研究所              | 600   | 2,630.00 | 1,578,000 |  |
| 4344 | ソースネクスト              | 100   | 321.00   | 32,100    |  |

|      |                      |       |           |            |  |
|------|----------------------|-------|-----------|------------|--|
| 4676 | フジ・メディア・ホールディングス     | 600   | 1,083.00  | 649,800    |  |
| 4684 | オービック                | 100   | 17,110.00 | 1,711,000  |  |
| 4689 | Zホールディングス            | 2,300 | 435.00    | 1,000,500  |  |
| 4704 | トレンドマイクロ             | 200   | 5,420.00  | 1,084,000  |  |
| 4716 | 日本オラクル               | 100   | 11,870.00 | 1,187,000  |  |
| 4739 | 伊藤忠テクノソリューションズ       | 200   | 3,470.00  | 694,000    |  |
| 4768 | 大塚商会                 | 200   | 4,975.00  | 995,000    |  |
| 4819 | デジタルガレージ             | 100   | 3,940.00  | 394,000    |  |
| 4820 | E Mシステムズ             | 100   | 815.00    | 81,500     |  |
| 7518 | ネットワンシステムズ           | 100   | 3,255.00  | 325,500    |  |
| 7527 | システムソフト              | 100   | 74.00     | 7,400      |  |
| 7844 | マーベラス                | 100   | 557.00    | 55,700     |  |
| 7860 | エイベックス               | 100   | 817.00    | 81,700     |  |
| 8056 | 日本ユニシス               | 100   | 3,125.00  | 312,500    |  |
| 9401 | 東京放送ホールディングス         | 200   | 1,664.00  | 332,800    |  |
| 9404 | 日本テレビホールディングス        | 300   | 1,188.00  | 356,400    |  |
| 9409 | テレビ朝日ホールディングス        | 100   | 1,610.00  | 161,000    |  |
| 9412 | スカパーＪＳＡＴホールディングス     | 300   | 410.00    | 123,000    |  |
| 9424 | 日本通信                 | 300   | 156.00    | 46,800     |  |
| 9432 | 日本電信電話               | 3,500 | 2,447.50  | 8,566,250  |  |
| 9433 | K D D I              | 3,500 | 3,175.00  | 11,112,500 |  |
| 9434 | ソフトバンク               | 2,600 | 1,455.50  | 3,784,300  |  |
| 9437 | N T T ドコモ            | 2,500 | 3,135.00  | 7,837,500  |  |
| 9449 | G M O インターネット        | 100   | 2,363.00  | 236,300    |  |
| 9468 | K A D O K A W A      | 100   | 1,649.00  | 164,900    |  |
| 9474 | ゼンリン                 | 100   | 1,245.00  | 124,500    |  |
| 9602 | 東宝                   | 200   | 3,565.00  | 713,000    |  |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ         | 1,000 | 1,131.00  | 1,131,000  |  |
| 9682 | D T S                | 100   | 2,153.00  | 215,300    |  |
| 9684 | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 200   | 4,545.00  | 909,000    |  |
| 9697 | カプコン                 | 100   | 3,385.00  | 338,500    |  |
| 9719 | S C S K              | 100   | 4,930.00  | 493,000    |  |
| 9749 | 富士ソフト                | 100   | 3,900.00  | 390,000    |  |
| 9759 | N S D                | 100   | 1,593.00  | 159,300    |  |
| 9766 | コナミホールディングス          | 100   | 3,435.00  | 343,500    |  |
| 9984 | ソフトバンクグループ           | 3,000 | 4,668.00  | 14,004,000 |  |
| 2768 | 双日                   | 2,300 | 245.00    | 563,500    |  |
| 2784 | アルフレッサ ホールディングス      | 400   | 2,097.00  | 838,800    |  |
| 2874 | 横浜冷凍                 | 100   | 887.00    | 88,700     |  |
| 3038 | 神戸物産                 | 100   | 5,250.00  | 525,000    |  |
| 3076 | あい ホールディングス          | 100   | 1,373.00  | 137,300    |  |
| 3132 | マクニカ・富士エレホールディングス    | 100   | 1,503.00  | 150,300    |  |

|      |                     |       |          |           |  |
|------|---------------------|-------|----------|-----------|--|
| 3151 | バイタルケーエスケー・ホールディングス | 100   | 1,082.00 | 108,200   |  |
| 3167 | ＴＯＫＡＩホールディングス       | 200   | 989.00   | 197,800   |  |
| 3360 | シップヘルスケアホールディングス    | 100   | 4,810.00 | 481,000   |  |
| 7459 | メディパルホールディングス       | 300   | 2,077.00 | 623,100   |  |
| 7575 | 日本ライフライン            | 100   | 1,282.00 | 128,200   |  |
| 7599 | ＩＤＯＭ                | 100   | 447.00   | 44,700    |  |
| 8001 | 伊藤忠商事               | 1,800 | 2,159.50 | 3,887,100 |  |
| 8002 | 丸紅                  | 2,400 | 471.40   | 1,131,360 |  |
| 8012 | 長瀬産業                | 200   | 1,259.00 | 251,800   |  |
| 8015 | 豊田通商                | 400   | 2,532.00 | 1,012,800 |  |
| 8020 | 兼松                  | 200   | 1,142.00 | 228,400   |  |
| 8031 | 三井物産                | 1,900 | 1,590.50 | 3,021,950 |  |
| 8037 | カメイ                 | 100   | 1,050.00 | 105,000   |  |
| 8051 | 山善                  | 200   | 917.00   | 183,400   |  |
| 8053 | 住友商事                | 3,000 | 1,292.00 | 3,876,000 |  |
| 8058 | 三菱商事                | 2,100 | 2,341.50 | 4,917,150 |  |
| 8060 | キヤノンマーケティングジャパン     | 100   | 2,136.00 | 213,600   |  |
| 8078 | 阪和興業                | 100   | 1,733.00 | 173,300   |  |
| 8088 | 岩谷産業                | 100   | 3,730.00 | 373,000   |  |
| 8097 | 三愛石油                | 100   | 1,139.00 | 113,900   |  |
| 8098 | 稲畑産業                | 100   | 1,187.00 | 118,700   |  |
| 8125 | ワキタ                 | 100   | 1,008.00 | 100,800   |  |
| 8129 | 東邦ホールディングス          | 100   | 2,216.00 | 221,600   |  |
| 8130 | サンゲツ                | 100   | 1,580.00 | 158,000   |  |
| 8133 | 伊藤忠エネクス             | 100   | 802.00   | 80,200    |  |
| 8136 | サンリオ                | 100   | 1,636.00 | 163,600   |  |
| 8141 | 新光商事                | 100   | 869.00   | 86,900    |  |
| 9830 | トラスコ中山              | 100   | 2,365.00 | 236,500   |  |
| 9832 | オートバックスセブン          | 100   | 1,303.00 | 130,300   |  |
| 9869 | 加藤産業                | 100   | 3,645.00 | 364,500   |  |
| 9882 | イエローハット             | 100   | 1,491.00 | 149,100   |  |
| 9934 | 因幡電機産業              | 100   | 2,284.00 | 228,400   |  |
| 9962 | ミスミグループ本社           | 400   | 2,630.00 | 1,052,000 |  |
| 9987 | スズケン                | 100   | 4,095.00 | 409,500   |  |
| 2651 | ローソン                | 100   | 5,550.00 | 555,000   |  |
| 2670 | エービーシー・マート          | 100   | 5,730.00 | 573,000   |  |
| 2681 | ゲオホールディングス          | 100   | 1,330.00 | 133,000   |  |
| 2730 | エディオン               | 100   | 946.00   | 94,600    |  |
| 2734 | サーラコーポレーション         | 100   | 570.00   | 57,000    |  |
| 3048 | ビックカメラ              | 200   | 1,021.00 | 204,200   |  |
| 3050 | ＤＣＭホールディングス         | 200   | 1,077.00 | 215,400   |  |
| 3064 | ＭｏｎｏｔａＲＯ            | 200   | 3,765.00 | 753,000   |  |
| 3086 | Ｊ．フロント リテイリング       | 400   | 871.00   | 348,400   |  |

|      |                      |       |           |           |  |
|------|----------------------|-------|-----------|-----------|--|
| 3087 | ドトール・日レスホールディングス     | 100   | 1,693.00  | 169,300   |  |
| 3088 | マツモトキヨシホールディングス      | 100   | 3,605.00  | 360,500   |  |
| 3092 | Z O Z O              | 200   | 1,919.00  | 383,800   |  |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス        | 600   | 635.00    | 381,000   |  |
| 3141 | ウエルシアホールディングス        | 100   | 7,900.00  | 790,000   |  |
| 3191 | ジョイフル本田              | 100   | 1,272.00  | 127,200   |  |
| 3197 | すかいらーくホールディングス       | 300   | 1,700.00  | 510,000   |  |
| 3222 | ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 100   | 1,032.00  | 103,200   |  |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス      | 1,400 | 3,454.00  | 4,835,600 |  |
| 3387 | クリエイト・レストランツ・ホールディング | 100   | 655.00    | 65,500    |  |
| 3391 | ツルハホールディングス          | 100   | 14,320.00 | 1,432,000 |  |
| 3563 | スシローグローバルホールディングス    | 100   | 1,977.00  | 197,700   |  |
| 7419 | ノジマ                  | 100   | 1,874.00  | 187,400   |  |
| 7453 | 良品計画                 | 500   | 1,366.00  | 683,000   |  |
| 7532 | バン・パシフィック・インターナショナルホ | 900   | 2,100.00  | 1,890,000 |  |
| 7545 | 西松屋チェーン              | 100   | 843.00    | 84,300    |  |
| 7550 | ゼンショーホールディングス        | 200   | 2,187.00  | 437,400   |  |
| 7593 | V Tホールディングス          | 100   | 291.00    | 29,100    |  |
| 7616 | コロワイド                | 100   | 1,499.00  | 149,900   |  |
| 7618 | ピーシーデボコーポレーション       | 100   | 574.00    | 57,400    |  |
| 7649 | スギホールディングス           | 100   | 6,370.00  | 637,000   |  |
| 8005 | スクロール                | 100   | 332.00    | 33,200    |  |
| 8028 | ファミリーマート             | 400   | 1,826.00  | 730,400   |  |
| 8165 | 千趣会                  | 100   | 331.00    | 33,100    |  |
| 8168 | ケーヨー                 | 100   | 590.00    | 59,000    |  |
| 8174 | 日本瓦斯                 | 100   | 3,900.00  | 390,000   |  |
| 8184 | 島忠                   | 100   | 2,769.00  | 276,900   |  |
| 8214 | A O K Iホールディングス      | 100   | 638.00    | 63,800    |  |
| 8218 | コメリ                  | 100   | 2,326.00  | 232,600   |  |
| 8219 | 青山商事                 | 100   | 882.00    | 88,200    |  |
| 8233 | 高島屋                  | 300   | 953.00    | 285,900   |  |
| 8237 | 松屋                   | 100   | 606.00    | 60,600    |  |
| 8242 | エイチ・ツー・オー リテイリング     | 200   | 798.00    | 159,600   |  |
| 8252 | 丸井グループ               | 300   | 1,727.00  | 518,100   |  |
| 8267 | イオン                  | 1,300 | 2,175.00  | 2,827,500 |  |
| 8273 | イズミ                  | 100   | 3,195.00  | 319,500   |  |
| 8276 | 平和堂                  | 100   | 1,814.00  | 181,400   |  |
| 8282 | ケーズホールディングス          | 300   | 1,191.00  | 357,300   |  |
| 9831 | ヤマダ電機                | 1,100 | 520.00    | 572,000   |  |
| 9843 | ニトリホールディングス          | 100   | 16,795.00 | 1,679,500 |  |
| 9861 | 吉野家ホールディングス          | 100   | 2,276.00  | 227,600   |  |
| 9948 | アークス                 | 100   | 2,035.00  | 203,500   |  |

|      |                     |        |          |            |  |
|------|---------------------|--------|----------|------------|--|
| 9956 | パローホールディングス         | 100    | 2,009.00 | 200,900    |  |
| 9989 | サンドラッグ              | 100    | 3,640.00 | 364,000    |  |
| 9997 | ペルーナ                | 100    | 502.00   | 50,200     |  |
| 7161 | じもとホールディングス         | 200    | 93.00    | 18,600     |  |
| 7167 | めぶきフィナンシャルグループ      | 1,700  | 231.00   | 392,700    |  |
| 7180 | 九州フィナンシャルグループ       | 500    | 440.00   | 220,000    |  |
| 7182 | ゆうちょ銀行              | 1,100  | 1,010.00 | 1,111,000  |  |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 2,100  | 324.00   | 680,400    |  |
| 7189 | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 200    | 611.00   | 122,200    |  |
| 7321 | 関西みらいフィナンシャルグループ    | 100    | 344.00   | 34,400     |  |
| 7327 | 第四北越フィナンシャルグループ     | 100    | 2,263.00 | 226,300    |  |
| 8303 | 新生銀行                | 300    | 1,321.00 | 396,300    |  |
| 8304 | あおぞら銀行              | 200    | 1,895.00 | 379,000    |  |
| 8306 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ   | 24,100 | 419.20   | 10,102,720 |  |
| 8308 | りそなホールディングス         | 3,900  | 324.50   | 1,265,550  |  |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス   | 700    | 3,061.00 | 2,142,700  |  |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ     | 2,600  | 2,763.50 | 7,185,100  |  |
| 8331 | 千葉銀行                | 1,400  | 491.00   | 687,400    |  |
| 8334 | 群馬銀行                | 700    | 333.00   | 233,100    |  |
| 8336 | 武蔵野銀行               | 100    | 1,324.00 | 132,400    |  |
| 8337 | 千葉興業銀行              | 100    | 233.00   | 23,300     |  |
| 8338 | 筑波銀行                | 200    | 166.00   | 33,200     |  |
| 8341 | 七十七銀行               | 100    | 1,385.00 | 138,500    |  |
| 8346 | 東邦銀行                | 300    | 238.00   | 71,400     |  |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ     | 200    | 1,574.00 | 314,800    |  |
| 8355 | 静岡銀行                | 900    | 646.00   | 581,400    |  |
| 8358 | スルガ銀行               | 400    | 369.00   | 147,600    |  |
| 8359 | 八十二銀行               | 600    | 363.00   | 217,800    |  |
| 8361 | 大垣共立銀行              | 100    | 2,206.00 | 220,600    |  |
| 8366 | 滋賀銀行                | 100    | 2,559.00 | 255,900    |  |
| 8368 | 百五銀行                | 300    | 307.00   | 92,100     |  |
| 8369 | 京都銀行                | 100    | 3,655.00 | 365,500    |  |
| 8370 | 紀陽銀行                | 100    | 1,587.00 | 158,700    |  |
| 8377 | ほくほくフィナンシャルグループ     | 200    | 866.00   | 173,200    |  |
| 8379 | 広島銀行                | 600    | 442.00   | 265,200    |  |
| 8381 | 山陰合同銀行              | 200    | 548.00   | 109,600    |  |
| 8382 | 中国銀行                | 200    | 994.00   | 198,800    |  |
| 8385 | 伊予銀行                | 500    | 585.00   | 292,500    |  |
| 8387 | 四国銀行                | 100    | 856.00   | 85,600     |  |
| 8388 | 阿波銀行                | 100    | 2,275.00 | 227,500    |  |
| 8399 | 琉球銀行                | 100    | 1,021.00 | 102,100    |  |
| 8410 | セブン銀行               | 1,600  | 280.00   | 448,000    |  |

|      |                          |        |          |           |  |
|------|--------------------------|--------|----------|-----------|--|
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ           | 33,700 | 122.60   | 4,131,620 |  |
| 8418 | 山口フィナンシャルグループ            | 500    | 570.00   | 285,000   |  |
| 8524 | 北洋銀行                     | 500    | 191.00   | 95,500    |  |
| 8544 | 京葉銀行                     | 200    | 517.00   | 103,400   |  |
| 8550 | 栃木銀行                     | 200    | 157.00   | 31,400    |  |
| 8558 | 東和銀行                     | 100    | 658.00   | 65,800    |  |
| 8600 | トモニホールディングス              | 200    | 346.00   | 69,200    |  |
| 8713 | フィデアホールディングス             | 300    | 106.00   | 31,800    |  |
| 8714 | 池田泉州ホールディングス             | 400    | 167.00   | 66,800    |  |
| 7148 | F P G                    | 100    | 515.00   | 51,500    |  |
| 8473 | S B Iホールディングス            | 400    | 2,112.00 | 844,800   |  |
| 8601 | 大和証券グループ本社               | 3,100  | 432.00   | 1,339,200 |  |
| 8604 | 野村ホールディングス               | 6,000  | 441.10   | 2,646,600 |  |
| 8609 | 岡三証券グループ                 | 300    | 323.00   | 96,900    |  |
| 8613 | 丸三証券                     | 100    | 412.00   | 41,200    |  |
| 8614 | 東洋証券                     | 100    | 121.00   | 12,100    |  |
| 8616 | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 400    | 228.00   | 91,200    |  |
| 8622 | 水戸証券                     | 100    | 191.00   | 19,100    |  |
| 8624 | いちよし証券                   | 100    | 456.00   | 45,600    |  |
| 8628 | 松井証券                     | 200    | 759.00   | 151,800   |  |
| 8698 | マネックスグループ                | 300    | 219.00   | 65,700    |  |
| 8708 | 藍澤證券                     | 100    | 695.00   | 69,500    |  |
| 7181 | かんぽ生命保険                  | 100    | 1,290.00 | 129,000   |  |
| 8630 | S O M P Oホールディングス        | 700    | 3,244.00 | 2,270,800 |  |
| 8725 | M S & A Dインシュアランスグループホール | 1,000  | 2,963.00 | 2,963,000 |  |
| 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス       | 300    | 1,985.00 | 595,500   |  |
| 8750 | 第一生命ホールディングス             | 1,900  | 1,296.50 | 2,463,350 |  |
| 8766 | 東京海上ホールディングス             | 1,100  | 4,447.00 | 4,891,700 |  |
| 8795 | T & Dホールディングス            | 1,100  | 876.00   | 963,600   |  |
| 7164 | 全国保証                     | 100    | 3,195.00 | 319,500   |  |
| 8253 | クレディセゾン                  | 200    | 1,189.00 | 237,800   |  |
| 8425 | みずほリース                   | 100    | 2,069.00 | 206,900   |  |
| 8439 | 東京センチュリー                 | 100    | 3,585.00 | 358,500   |  |
| 8511 | 日本証券金融                   | 100    | 487.00   | 48,700    |  |
| 8515 | アイフル                     | 500    | 244.00   | 122,000   |  |
| 8570 | イオンフィナンシャルサービス           | 200    | 1,074.00 | 214,800   |  |
| 8572 | アコム                      | 700    | 435.00   | 304,500   |  |
| 8585 | オリエントコーポレーション            | 700    | 121.00   | 84,700    |  |
| 8586 | 日立キャピタル                  | 100    | 2,060.00 | 206,000   |  |
| 8589 | アプラスフィナンシャル              | 200    | 62.00    | 12,400    |  |
| 8591 | オリックス                    | 2,100  | 1,248.00 | 2,620,800 |  |
| 8593 | 三菱ＵＦＪリース                 | 700    | 504.00   | 352,800   |  |

|      |                  |       |          |           |  |
|------|------------------|-------|----------|-----------|--|
| 8697 | 日本取引所グループ        | 1,000 | 2,120.00 | 2,120,000 |  |
| 2337 | いちご              | 500   | 274.00   | 137,000   |  |
| 3003 | ヒューリック           | 700   | 1,021.00 | 714,700   |  |
| 3231 | 野村不動産ホールディングス    | 300   | 1,837.00 | 551,100   |  |
| 3232 | 三重交通グループホールディングス | 100   | 485.00   | 48,500    |  |
| 3284 | フージャースホールディングス   | 100   | 611.00   | 61,100    |  |
| 3288 | オープンハウス          | 100   | 2,398.00 | 239,800   |  |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス    | 500   | 529.00   | 264,500   |  |
| 3291 | 飯田グループホールディングス   | 300   | 1,432.00 | 429,600   |  |
| 8801 | 三井不動産            | 1,900 | 1,896.00 | 3,602,400 |  |
| 8802 | 三菱地所             | 2,600 | 1,781.50 | 4,631,900 |  |
| 8803 | 平和不動産            | 100   | 2,929.00 | 292,900   |  |
| 8804 | 東京建物             | 400   | 1,205.00 | 482,000   |  |
| 8806 | ダイビル             | 100   | 1,000.00 | 100,000   |  |
| 8818 | 京阪神ビルディング        | 100   | 1,425.00 | 142,500   |  |
| 8830 | 住友不動産            | 500   | 2,866.00 | 1,433,000 |  |
| 8841 | テオーシー            | 100   | 692.00   | 69,200    |  |
| 8848 | レオパレス２１          | 200   | 246.00   | 49,200    |  |
| 8892 | 日本エスコン           | 100   | 729.00   | 72,900    |  |
| 8897 | タカラレーベン          | 100   | 355.00   | 35,500    |  |
| 8905 | イオンモール           | 100   | 1,425.00 | 142,500   |  |
| 8918 | ランド              | 1,400 | 9.00     | 12,600    |  |
| 8919 | カチタス             | 100   | 2,003.00 | 200,300   |  |
| 8923 | トーセイ             | 100   | 1,018.00 | 101,800   |  |
| 9706 | 日本空港ビルデング        | 100   | 3,945.00 | 394,500   |  |
| 2120 | ＬＩＦＵＬＬ           | 100   | 355.00   | 35,500    |  |
| 2127 | 日本Ｍ＆Ａセンター        | 200   | 3,655.00 | 731,000   |  |
| 2157 | コシダカホールディングス     | 100   | 467.00   | 46,700    |  |
| 2170 | リンクアンドモチベーション    | 100   | 354.00   | 35,400    |  |
| 2175 | エス・エム・エス         | 100   | 2,396.00 | 239,600   |  |
| 2181 | パーソルホールディングス     | 300   | 1,210.00 | 363,000   |  |
| 2193 | クックパッド           | 100   | 347.00   | 34,700    |  |
| 2331 | 総合警備保障           | 200   | 5,110.00 | 1,022,000 |  |
| 2371 | カカクコム            | 200   | 2,200.00 | 440,000   |  |
| 2398 | ツクイ              | 100   | 465.00   | 46,500    |  |
| 2412 | ベネフィット・ワン        | 100   | 1,935.00 | 193,500   |  |
| 2413 | エムスリー            | 700   | 3,930.00 | 2,751,000 |  |
| 2427 | アウトソーシング         | 200   | 560.00   | 112,000   |  |
| 2432 | ディー・エヌ・エー        | 200   | 1,307.00 | 261,400   |  |
| 2433 | 博報堂ＤＹホールディングス    | 400   | 1,161.00 | 464,400   |  |
| 2440 | ぐるなび             | 100   | 599.00   | 59,900    |  |
| 2461 | ファンコミュニケーションズ    | 100   | 452.00   | 45,200    |  |
| 2492 | インフォマート          | 500   | 813.00   | 406,500   |  |

|      |                     |         |           |             |  |
|------|---------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 2749 | J Pホールディングス         | 100     | 275.00    | 27,500      |  |
| 3521 | エコナックホールディングス       | 100     | 90.00     | 9,000       |  |
| 4290 | プレステージ・インターナショナル    | 100     | 849.00    | 84,900      |  |
| 4321 | ケネディクス              | 300     | 490.00    | 147,000     |  |
| 4324 | 電通グループ              | 400     | 2,244.00  | 897,600     |  |
| 4544 | みらかホールディングス         | 100     | 2,549.00  | 254,900     |  |
| 4661 | オリエンタルランド           | 500     | 13,730.00 | 6,865,000   |  |
| 4680 | ラウンドワン              | 100     | 881.00    | 88,100      |  |
| 4681 | リゾートトラスト            | 100     | 1,127.00  | 112,700     |  |
| 4714 | リソー教育               | 200     | 267.00    | 53,400      |  |
| 4732 | ユー・エス・エス            | 400     | 1,740.00  | 696,000     |  |
| 4751 | サイバーエージェント          | 200     | 4,520.00  | 904,000     |  |
| 4755 | 楽天                  | 1,500   | 956.00    | 1,434,000   |  |
| 6028 | テクノプロ・ホールディングス      | 100     | 5,990.00  | 599,000     |  |
| 6055 | ジャパンマテリアル           | 100     | 1,537.00  | 153,700     |  |
| 6098 | リクルートホールディングス       | 3,300   | 3,149.00  | 10,391,700  |  |
| 6178 | 日本郵政                | 1,400   | 814.10    | 1,139,740   |  |
| 6183 | ベルシステム 2 4 ホールディングス | 100     | 1,252.00  | 125,200     |  |
| 6197 | ソラスト                | 100     | 1,120.00  | 112,000     |  |
| 7085 | カーブスホールディングス        | 100     | 552.00    | 55,200      |  |
| 8876 | リログループ              | 100     | 2,268.00  | 226,800     |  |
| 9603 | エイチ・アイ・エス           | 100     | 1,477.00  | 147,700     |  |
| 9678 | カナモト                | 100     | 2,141.00  | 214,100     |  |
| 9681 | 東京ドーム               | 100     | 803.00    | 80,300      |  |
| 9704 | アゴーラ・ホスピタリティー・グループ  | 200     | 21.00     | 4,200       |  |
| 9716 | 乃村工藝社               | 200     | 836.00    | 167,200     |  |
| 9735 | セコム                 | 400     | 9,029.00  | 3,611,600   |  |
| 9757 | 船井総研ホールディングス        | 100     | 2,345.00  | 234,500     |  |
| 9783 | ベネッセホールディングス        | 100     | 3,110.00  | 311,000     |  |
| 9792 | ニチイ学館               | 100     | 1,155.00  | 115,500     |  |
| 合 計  |                     | 366,500 |           | 670,339,660 |  |

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（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】

### 【ＭＡＸＩＳカーボン・エフィシエント日本株上場投信】

#### 【純資産額計算書】

令和 2年 5月29日現在

（単位：円）

|                 |             |
|-----------------|-------------|
| 資産総額            | 741,556,428 |
| 負債総額            | 8,110,853   |
| 純資産総額（ - ）      | 733,445,575 |
| 発行済口数           | 35,492口     |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 20,665      |

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第１【委託会社等の概況】

##### １【委託会社等の概況】

< 更新後 >

##### （１）資本金の額等

2020年5月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

##### （２）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にて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。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### < 更新後 >

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年 5月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

| 商品分類       | 本 数<br>( 本 ) | 純資産総額<br>( 百万円 ) |
|------------|--------------|------------------|
| 追加型株式投資信託  | 873          | 13,785,240       |
| 追加型公社債投資信託 | 16           | 1,281,989        |
| 単位型株式投資信託  | 64           | 346,738          |
| 単位型公社債投資信託 | 18           | 91,403           |
| 合 計        | 971          | 15,505,370       |

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

## 3【委託会社等の経理状況】

### < 更新後 >

### （１）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

### （２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

### （１）【貸借対照表】

(単位：千円)

|        | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|--------|------------------------|-----------------------|
| (資産の部) |                        |                       |

|                 |   |            |   |            |
|-----------------|---|------------|---|------------|
| <b>流動資産</b>     |   |            |   |            |
| 現金及び預金          | 2 | 53,969,686 | 2 | 56,398,457 |
| 有価証券            |   | 1,403,513  |   | 1,960,318  |
| 前払費用            |   | 514,587    |   | 575,904    |
| 未収入金            |   | 2,284      |   | 14,559     |
| 未収委託者報酬         |   | 9,995,458  |   | 10,296,453 |
| 未収収益            | 2 | 560,483    | 2 | 638,994    |
| 金銭の信託           | 2 | 100,000    | 2 | 100,000    |
| その他             |   | 153,256    |   | 254,330    |
| 流動資産合計          |   | 66,699,271 |   | 70,239,017 |
| <b>固定資産</b>     |   |            |   |            |
| <b>有形固定資産</b>   |   |            |   |            |
| 建物              | 1 | 617,032    | 1 | 584,048    |
| 器具備品            | 1 | 665,247    | 1 | 871,893    |
| 土地              |   | 628,433    |   | 628,433    |
| 有形固定資産合計        |   | 1,910,713  |   | 2,084,375  |
| <b>無形固定資産</b>   |   |            |   |            |
| 電話加入権           |   | 15,822     |   | 15,822     |
| ソフトウェア          |   | 3,670,753  |   | 3,369,611  |
| ソフトウェア仮勘定       |   | 536,345    |   | 1,374,932  |
| 無形固定資産合計        |   | 4,222,921  |   | 4,760,365  |
| <b>投資その他の資産</b> |   |            |   |            |
| 投資有価証券          |   | 21,408,781 |   | 16,704,756 |
| 関係会社株式          |   | 320,136    |   | 320,136    |
| 投資不動産           | 1 | 824,268    | 1 | 819,255    |
| 長期差入保証金         |   | 593,536    |   | 565,358    |
| 前払年金費用          |   | 415,234    |   | 375,031    |
| 繰延税金資産          |   | 1,496,180  |   | 1,912,824  |
| その他             |   | 45,230     |   | 45,230     |
| 貸倒引当金           |   | 23,600     |   | 23,600     |
| 投資その他の資産合計      |   | 25,079,767 |   | 20,718,993 |
| 固定資産合計          |   | 31,213,401 |   | 27,563,734 |
| 資産合計            |   | 97,912,673 |   | 97,802,752 |

(単位：千円)

|         | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) |           | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |           |
|---------|------------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| (負債の部)  |                        |           |                       |           |
| 流動負債    |                        |           |                       |           |
| 預り金     |                        | 293,258   |                       | 687,565   |
| 未払金     |                        |           |                       |           |
| 未払収益分配金 |                        | 170,281   |                       | 131,478   |
| 未払償還金   |                        | 448,695   |                       | 395,400   |
| 未払手数料   | 2                      | 3,990,054 | 2                     | 4,026,078 |
| その他未払金  | 2                      | 3,961,765 | 2                     | 3,818,195 |
| 未払費用    | 2                      | 3,803,995 | 2                     | 4,402,578 |
| 未払消費税等  |                        | 194,852   |                       | 629,469   |
| 未払法人税等  |                        | 573,657   |                       | 617,341   |
| 賞与引当金   |                        | 901,135   |                       | 933,517   |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 役員賞与引当金   | 140,100    | 124,590    |
| その他       | 868,992    | 701,285    |
| 流動負債合計    | 15,346,788 | 16,467,499 |
| 固定負債      |            |            |
| 長期未払金     | 43,200     | 32,400     |
| 退職給付引当金   | 860,851    | 1,010,401  |
| 役員退職慰労引当金 | 144,303    | 130,784    |
| 時効後支払損引当金 | 247,767    | 238,811    |
| 固定負債合計    | 1,296,122  | 1,412,398  |
| 負債合計      | 16,642,910 | 17,879,897 |
| (純資産の部)   |            |            |
| 株主資本      |            |            |
| 資本金       | 2,000,131  | 2,000,131  |
| 資本剰余金     |            |            |
| 資本準備金     | 3,572,096  | 3,572,096  |
| その他資本剰余金  | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計   | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金     |            |            |
| 利益準備金     | 342,589    | 342,589    |
| その他利益剰余金  |            |            |
| 別途積立金     | 6,998,000  | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金   | 26,069,594 | 25,847,605 |
| 利益剰余金合計   | 33,410,184 | 33,188,194 |
| 株主資本合計    | 80,143,028 | 79,921,039 |

(単位：千円)

|              | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|-----------------------|
| 評価・換算差額等     |                        |                       |
| その他有価証券評価差額金 | 1,126,733              | 1,815                 |
| 評価・換算差額等合計   | 1,126,733              | 1,815                 |
| 純資産合計        | 81,269,762             | 79,922,854            |
| 負債純資産合計      | 97,912,673             | 97,802,752            |

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

|         | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|---------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益    |                                       |                                      |
| 委託者報酬   | 70,375,414                            | 67,967,489                           |
| 投資顧問料   | 2,505,299                             | 2,385,084                            |
| その他営業収益 | 18,844                                | 16,085                               |
| 営業収益合計  | 72,899,557                            | 70,368,658                           |
| 営業費用    |                                       |                                      |

|             |   |            |   |            |
|-------------|---|------------|---|------------|
| 支払手数料       | 2 | 28,533,952 | 2 | 27,106,451 |
| 広告宣伝費       |   | 739,643    |   | 696,418    |
| 公告費         |   | 500        |   | 1,000      |
| 調査費         |   |            |   |            |
| 調査費         |   | 1,794,755  |   | 1,857,271  |
| 委託調査費       |   | 12,194,996 |   | 11,579,175 |
| 事務委託費       |   | 1,016,816  |   | 847,769    |
| 営業雑経費       |   |            |   |            |
| 通信費         |   | 170,794    |   | 153,731    |
| 印刷費         |   | 427,442    |   | 427,118    |
| 協会費         |   | 48,375     |   | 52,053     |
| 諸会費         |   | 16,175     |   | 15,990     |
| 事務機器関連費     |   | 1,841,631  |   | 1,953,926  |
| 営業費用合計      |   | 46,785,083 |   | 44,690,907 |
| 一般管理費       |   |            |   |            |
| 給料          |   |            |   |            |
| 役員報酬        |   | 349,083    |   | 331,987    |
| 給料・手当       |   | 6,453,717  |   | 6,611,427  |
| 賞与引当金繰入     |   | 901,135    |   | 933,517    |
| 役員賞与引当金繰入   |   | 140,100    |   | 124,590    |
| 福利厚生費       |   | 1,234,293  |   | 1,276,950  |
| 交際費         |   | 13,011     |   | 11,871     |
| 旅費交通費       |   | 200,426    |   | 165,891    |
| 租税公課        |   | 373,201    |   | 360,165    |
| 不動産賃借料      |   | 654,886    |   | 647,402    |
| 退職給付費用      |   | 428,912    |   | 422,919    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |   | 51,159     |   | 48,183     |
| 固定資産減価償却費   |   | 1,252,321  |   | 1,307,555  |
| 諸経費         |   | 523,213    |   | 427,212    |
| 一般管理費合計     |   | 12,575,461 |   | 12,669,674 |
| 営業利益        |   | 13,539,012 |   | 13,008,076 |

(単位：千円)

|             | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業外収益       |                                       |                                      |
| 受取配当金       | 181,073                               | 90,965                               |
| 受取利息        | 2 1,913                               | 2 4,169                              |
| 投資有価証券償還益   | 416,706                               | 585,179                              |
| 収益分配金等時効完成分 | 44,392                                | 101,734                              |
| 受取賃貸料       | 2 38,388                              | 2 65,808                             |
| その他         | 11,871                                | 19,987                               |
| 営業外収益合計     | 694,346                               | 867,845                              |
| 営業外費用       |                                       |                                      |
| 投資有価証券償還損   | 118,173                               | 96,379                               |
| 時効後支払損引当金繰入 | 1,166                                 | -                                    |
| 事務過誤費       | 420                                   | 3,483                                |
| 賃貸関連費用      | 35,994                                | 20,339                               |
| その他         | 1,481                                 | 1,920                                |
| 営業外費用合計     | 157,235                               | 122,122                              |

|              |   |            |   |            |
|--------------|---|------------|---|------------|
| 経常利益         |   | 14,076,123 |   | 13,753,799 |
| 特別利益         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却益    |   | 501,778    |   | 174,842    |
| 特別利益合計       |   | 501,778    |   | 174,842    |
| 特別損失         |   |            |   |            |
| 投資有価証券売却損    |   | 135,399    |   | 75,963     |
| 投資有価証券評価損    |   | 62,310     |   | 163,865    |
| 固定資産除却損      | 1 | 4,848      | 1 | 8,832      |
| 固定資産売却損      |   | 225        |   | 435        |
| システム関連費      |   | 322,986    |   | -          |
| 商標使用料        |   | 90,000     |   | -          |
| 特別損失合計       |   | 615,770    |   | 249,096    |
| 税引前当期純利益     |   | 13,962,130 |   | 13,679,545 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 | 4,420,179  | 2 | 4,146,534  |
| 法人税等調整額      |   | 100,112    |   | 79,824     |
| 法人税等合計       |   | 4,320,066  |   | 4,226,359  |
| 当期純利益        |   | 9,642,064  |   | 9,453,186  |

## （３）【株主資本等変動計算書】

第34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      |           |              |             |           |           |             |            | 株主資本合計     |             |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|-----------|-------------|------------|------------|-------------|
|                             | 資本金       | 資本剰余金     |              |             | 利益剰余金     |           |             | 株主資本合計     |            |             |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             |            |            | 利益剰余金<br>合計 |
|                             |           |           |              |             |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |            |            |             |
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 27,790,911  | 35,131,500 | 81,864,344 |             |
| 当期変動額                       |           |           |              |             |           |           |             |            |            |             |
| 剰余金の配当                      |           |           |              |             |           |           | 11,363,380  | 11,363,380 | 11,363,380 |             |
| 当期純利益                       |           |           |              |             |           |           | 9,642,064   | 9,642,064  | 9,642,064  |             |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |              |             |           |           |             |            |            |             |
| 当期変動額合計                     | —         | —         | —            | —           | —         | —         | 1,721,316   | 1,721,316  | 1,721,316  |             |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616   | 44,732,712  | 342,589   | 6,998,000 | 26,069,594  | 33,410,184 | 80,143,028 |             |

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計      |
|---------------------|--------------|------------|------------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |            |
| 当期首残高               | 1,484,913    | 1,484,913  | 83,349,257 |
| 当期変動額               |              |            |            |
| 剰余金の配当              |              |            | 11,363,380 |
| 当期純利益               |              |            | 9,642,064  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 358,179      | 358,179    | 358,179    |
| 当期変動額合計             | 358,179      | 358,179    | 2,079,495  |
| 当期末残高               | 1,126,733    | 1,126,733  | 81,269,762 |

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

（単位：千円）

|  | 株主資本 |       |          |         |       |          |         |         | 株主資本合計 |
|--|------|-------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|--------|
|  | 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 |         | 利益剰余金合計 |        |
|  |      |       |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |        |

|                             |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
|-----------------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 当期首残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 26,069,594 | 33,410,184 | 80,143,028 |
| 当期変動額                       |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当                      |           |           |            |            |         |           | 9,675,175  | 9,675,175  | 9,675,175  |
| 当期純利益                       |           |           |            |            |         |           | 9,453,186  | 9,453,186  | 9,453,186  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 当期変動額合計                     | —         | —         | —          | —          | —       | —         | 221,989    | 221,989    | 221,989    |
| 当期末残高                       | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 25,847,605 | 33,188,194 | 79,921,039 |

|                             | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                             | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                       | 1,126,733            | 1,126,733      | 81,269,762 |
| 当期変動額                       |                      |                |            |
| 剰余金の配当                      |                      |                | 9,675,175  |
| 当期純利益                       |                      |                | 9,453,186  |
| 株主資本以外の<br>項目の当期変動額<br>(純額) | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,124,917  |
| 当期変動額合計                     | 1,124,917            | 1,124,917      | 1,346,907  |
| 当期末残高                       | 1,815                | 1,815          | 79,922,854 |

## [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) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (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)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成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。

|       |        |
|-------|--------|
| 建物    | 5年～50年 |
| 器具備品  | 2年～20年 |
| 投資不動産 | 3年～47年 |

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等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、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、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、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産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

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6)時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価

中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

#### (1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

#### (2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

#### (3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

#### （貸借対照表関係）

##### 1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

|       | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|-------|------------------------|-----------------------|
| 建物    | 551,025千円              | 599,542千円             |
| 器具備品  | 1,350,407千円            | 1,408,613千円           |
| 投資不動産 | 138,024千円              | 145,391千円             |

##### 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|        | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|--------|------------------------|-----------------------|
| 預金     | 240,211千円              | 314,247千円             |
| 未収収益   | 25,307千円               | 15,773千円              |
| 金銭の信託  | 100,000千円              | 100,000千円             |
| 未払手数料  | 671,568千円              | 712,210千円             |
| その他未払金 | 3,217,341千円            | 3,029,426千円           |
| 未払費用   | 444,754千円              | 432,019千円             |

#### （損益計算書関係）

##### 1.固定資産除却損の内訳

|      | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 建物   | 2,547千円                               | —                                    |
| 器具備品 | 2,301千円                               | 8,832千円                              |
| 計    | 4,848千円                               | 8,832千円                              |

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

|              | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 支払手数料        | 5,298,064千円                           | 5,234,629千円                          |
| 受取利息         | 3千円                                   | 2千円                                  |
| 受取賃貸料        | 38,388千円                              | 65,808千円                             |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,216,517千円                           | 3,030,180千円                          |

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>株式数 (株) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 発行済株式 |                    |                    |                    |                   |
| 普通株式  | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |
| 合計    | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |              |
|----------|--------------|
| 配当金の総額   | 11,363,380千円 |
| 1株当たり配当額 | 53,707円      |
| 基準日      | 平成30年3月31日   |
| 効力発生日    | 平成30年6月28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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,675,175千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金       |
| 1株当たり配当額 | 45,728円     |
| 基準日      | 平成31年3月31日  |
| 効力発生日    | 令和 元年6月27日  |

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

|       | 当事業年度期首<br>株式数 (株) | 当事業年度増加<br>株式数 (株) | 当事業年度減少<br>株式数 (株) | 当事業年度末<br>株式数 (株) |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 発行済株式 |                    |                    |                    |                   |
| 普通株式  | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |
| 合計    | 211,581            | -                  | -                  | 211,581           |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,675,175千円 |
| 1株当たり配当額 | 45,728円     |
| 基準日      | 平成31年3月31日  |
| 効力発生日    | 令和 元年6月27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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

|          |             |
|----------|-------------|
| 配当金の総額   | 9,457,670千円 |
| 配当の原資    | 利益剰余金       |
| 1株当たり配当額 | 44,700円     |
| 基準日      | 令和2年3月31日   |
| 効力発生日    | 令和2年6月29日   |

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

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

|     | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|-----|------------------------|-----------------------|
| 1年内 | 675,956千円              | 675,956千円             |
| 1年超 | 675,956千円              | —                     |
| 合計  | 1,351,912千円            | 675,956千円             |

（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

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

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、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第34期(平成31年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 53,969,686       | 53,969,686 | -      |
| (2) 有価証券    | 1,403,513        | 1,403,513  | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 9,995,458        | 9,995,458  | -      |
| (4) 投資有価証券  | 21,353,421       | 21,353,421 | -      |
| 資産計         | 86,722,080       | 86,722,080 | -      |
| (1) 未払手数料   | 3,990,054        | 3,990,054  | -      |
| 負債計         | 3,990,054        | 3,990,054  | -      |

第35期(令和2年3月31日現在)

|             | 貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 56,398,457       | 56,398,457 | -      |
| (2) 有価証券    | 1,960,318        | 1,960,318  | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,296,453       | 10,296,453 | -      |
| (4) 投資有価証券  | 16,673,396       | 16,673,396 | -      |
| 資産計         | 85,328,625       | 85,328,625 | -      |
| (1) 未払手数料   | 4,026,078        | 4,026,078  | -      |

|     |           |           |   |
|-----|-----------|-----------|---|
| 負債計 | 4,026,078 | 4,026,078 | - |
|-----|-----------|-----------|---|

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

（1）現金及び預金、（3）未収委託者報酬

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

（2）有価証券、（4）投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

（1）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

（単位：千円）

| 区分     | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|--------|------------------------|-----------------------|
| 非上場株式  | 55,360                 | 31,360                |
| 子会社株式  | 160,600                | 160,600               |
| 関連会社株式 | 159,536                | 159,536               |

非上場株式は、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ため、「（4）投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、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ため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(平成31年3月31日現在)

（単位：千円）

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 53,969,686 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 9,995,458  | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 1,403,513  | 9,358,708   | 5,874,634    | 90,573 |
| 合計                | 65,368,659 | 9,358,708   | 5,874,634    | 90,573 |

第35期(令和2年3月31日現在)

（単位：千円）

|                   | 1年以内       | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超   |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金            | 56,398,457 | -           | -            | -      |
| 未収委託者報酬           | 10,296,453 | -           | -            | -      |
| 有価証券及び投資有価証券      |            |             |              |        |
| その他有価証券のうち満期があるもの |            |             |              |        |
| 投資信託              | 1,960,318  | 5,652,257   | 4,813,929    | 27,375 |
| 合計                | 68,655,228 | 5,652,257   | 4,813,929    | 27,375 |

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）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ため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第34期(平成31年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 14,744,545       | 12,559,380   | 2,185,164 |
|                      | 小計  | 14,744,545       | 12,559,380   | 2,185,164 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 8,012,389        | 8,573,551    | 561,161   |
|                      | 小計  | 8,012,389        | 8,573,551    | 561,161   |
| 合計                   |     | 22,756,935       | 21,132,932   | 1,624,002 |

第35期(令和2年3月31日現在)

|                      | 種類  | 貸借対照表計上額<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|----------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
|                      | 小計  | 9,859,345        | 8,694,010    | 1,165,334 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 株式  | -                | -            | -         |
|                      | 債券  | -                | -            | -         |
|                      | その他 | 8,774,369        | 9,937,087    | 1,162,718 |
|                      | 小計  | 8,774,369        | 9,937,087    | 1,162,718 |
| 合計                   |     | 18,633,714       | 18,631,098   | 2,616     |

## 3. 売却したその他有価証券

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

| 種類  | 売却額(千円)   | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | 140,240   | 58,440      | -           |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 5,222,594 | 443,338     | 135,399     |
| 合計  | 5,362,834 | 501,778     | 135,399     |

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類  | 売却額(千円)   | 売却益の合計額(千円) | 売却損の合計額(千円) |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式  | 8,940     | -           | 15,060      |
| 債券  | -         | -           | -           |
| その他 | 2,035,469 | 174,842     | 60,903      |
| 合計  | 2,044,409 | 174,842     | 75,963      |

## 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62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

## （退職給付関係）

## 1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）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

|              | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高  | 3,729,252 千円                          | 3,712,289 千円                         |
| 勤務費用         | 193,531                               | 204,225                              |
| 利息費用         | 24,351                                | 17,557                               |
| 数理計算上の差異の発生額 | 15,898                                | 52,430                               |
| 退職給付の支払額     | 218,947                               | 162,904                              |
| 過去勤務費用の発生額   | -                                     | -                                    |
| 退職給付債務の期末残高  | 3,712,289                             | 3,718,736                            |

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 年金資産の期首残高    | 2,723,393 千円                          | 2,666,937 千円                         |
| 期待運用収益       | 48,664                                | 47,757                               |
| 数理計算上の差異の発生額 | 4,606                                 | 164,633                              |
| 事業主からの拠出額    | 102,564                               | 51,282                               |
| 退職給付の支払額     | 203,077                               | 140,518                              |
| 年金資産の期末残高    | 2,666,937                             | 2,460,824                            |

## (3)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及び前払年金費用の調整表

|                     | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|---------------------|------------------------|-----------------------|
| 積立型制度の退職給付債務        | 3,125,760 千円           | 2,969,807 千円          |
| 年金資産                | 2,666,937              | 2,460,824             |
|                     | 458,822                | 508,982               |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 586,529                | 748,929               |
| 未積立退職給付債務           | 1,045,351              | 1,257,911             |
| 未認識数理計算上の差異         | 114,968                | 203,136               |
| 未認識過去勤務費用           | 484,766                | 419,405               |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 445,616                | 635,370               |
| 退職給付引当金             | 860,851                | 1,010,401             |
| 前払年金費用              | 415,234                | 375,031               |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 445,616                | 635,370               |

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

|      | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 勤務費用 | 193,531 千円                            | 204,225 千円                           |
| 利息費用 | 24,351                                | 17,557                               |

|                 |         |         |
|-----------------|---------|---------|
| 期待運用収益          | 48,664  | 47,757  |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 43,633  | 24,035  |
| 過去勤務費用の費用処理額    | 65,361  | 65,361  |
| その他             | 5,986   | 6,427   |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 284,199 | 269,848 |

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額です。

#### (5) 年金資産に関する事項

##### 年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

|     | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|-----|------------------------|-----------------------|
| 債券  | 63.9 %                 | 64.7 %                |
| 株式  | 33.2                   | 32.3                  |
| その他 | 2.9                    | 3.0                   |
| 合計  | 100                    | 100                   |

##### 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

#### (6) 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

|           | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|-----------------------|
| 割引率       | 0.035 ~ 0.49%          | 0.095 ~ 0.52%         |
| 長期期待運用収益率 | 1.5 ~ 1.8%             | 1.5 ~ 1.8%            |

#### 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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

#### （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

|               | 第34期<br>(平成31年3月31日現在) | 第35期<br>(令和2年3月31日現在) |
|---------------|------------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産        |                        |                       |
| 減損損失          | 436,050千円              | 427,046千円             |
| 投資有価証券評価損     | 223,821                | 226,322               |
| 未払事業税         | 109,109                | 117,461               |
| 賞与引当金         | 275,927                | 285,842               |
| 役員賞与引当金       | 19,428                 | 19,703                |
| 役員退職慰労引当金     | 44,185                 | 40,046                |
| 退職給付引当金       | 263,592                | 309,384               |
| 減価償却超過額       | 157,741                | 96,767                |
| 委託者報酬         | 264,398                | 213,044               |
| 長期差入保証金       | 31,721                 | 40,180                |
| 時効後支払損引当金     | 75,866                 | 73,124                |
| 連結納税適用による時価評価 | 148,858                | 57,656                |
| その他           | 71,320                 | 123,248               |
| 繰延税金資産 小計     | 2,122,023              | 2,029,829             |
| 評価性引当額        | -                      | -                     |

|               |           |           |
|---------------|-----------|-----------|
| 繰延税金資産 合計     | 2,122,023 | 2,029,829 |
| 繰延税金負債        |           |           |
| 前払年金費用        | 127,144   | 114,834   |
| 連結納税適用による時価評価 | 1,320     | 1,260     |
| その他有価証券評価差額金  | 497,269   | 801       |
| その他           | 108       | 109       |
| 繰延税金負債 合計     | 625,842   | 117,005   |
| 繰延税金資産の純額     | 1,496,180 | 1,912,824 |

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2年3月31日現在）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[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]

当社は、資産運用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。

[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、資産運用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。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用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。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 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（注4） | 科目 | 期末残高（注4） |
|----|--------|-----|-----|-------|----------------|-----------|-------|----------|----|----------|
|----|--------|-----|-----|-------|----------------|-----------|-------|----------|----|----------|

|     |                              |                 |                  |             |                     |                                                                         |                                                            |                                      |                   |                                    |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|---------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>（注1）                                      | 3,216,517<br>千円                      | その他未払金            | 3,217,341<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0% | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>（注2）<br><br>投資助言料<br>（注3） | 5,298,064<br>千円<br><br>695,834<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 671,568<br>千円<br><br>365,510<br>千円 |

## 第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類  | 会社等の<br>名称                   | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容   | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                                           | 取引の内容                                                      | 取引金額<br>（注4）                         | 科目                | 期末残高<br>（注4）                       |
|-----|------------------------------|-----------------|------------------|-------------|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|--------------------------------------|-------------------|------------------------------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJ<br>フィナンシャル・<br>グループ | 東京都<br>千代田<br>区 | 2,141,513<br>百万円 | 銀行持株<br>会社業 | 被所有<br>間接<br>100.0%        | 連結納税                                                                    | 連結納税に<br>伴う支払<br>（注1）                                      | 3,030,180<br>千円                      | その他未払金            | 3,029,426<br>千円                    |
| 親会社 | 三菱UFJ<br>信託銀行(株)             | 東京都<br>千代田<br>区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>100.0%        | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>投資の助言<br><br>役員の兼任 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>（注2）<br><br>投資助言料<br>（注3） | 5,234,629<br>千円<br><br>583,270<br>千円 | 未払手数料<br><br>未払費用 | 712,210<br>千円<br><br>302,681<br>千円 |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注）１．連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
- ２．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
- ３．投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
- ４．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## (2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称     | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                             | 取引の内容                                                                                                     | 取引金額<br>（注4）                                               | 科目                                  | 期末残高<br>（注4）                                             |
|-------------|----------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | (株)三菱UFJ<br>銀行 | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし<br>（注1）                 | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>取引銀行 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>（注2）<br><br>コーラブル預<br>金の預入<br>（注3）<br><br>コーラブル預<br>金に係る受取<br>利息<br>（注3） | 4,629,670<br>千円<br><br>20,000,000<br>千円<br><br>1,578<br>千円 | 未払手数料<br><br>現金及び<br>預金<br><br>未収収益 | 734,633<br>千円<br><br>20,000,000<br>千円<br><br>1,578<br>千円 |

|             |                                  |                 |               |     |    |                                               |                                       |                 |       |               |
|-------------|----------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料の<br>支払<br>(注2) | 6,152,016<br>千円 | 未払手数料 | 962,840<br>千円 |
|-------------|----------------------------------|-----------------|---------------|-----|----|-----------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------|-------|---------------|

## 第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

| 種類          | 会社等の<br>名称                       | 所在地             | 資本金              | 事業の<br>内容 | 議決権等<br>の所有<br>(被所有)<br>割合 | 関連当事者<br>との関係                                             | 取引の内容                                 | 取引金額<br>(注4)     | 科目         | 期末残高<br>(注4)     |
|-------------|----------------------------------|-----------------|------------------|-----------|----------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------------------------------|------------------|------------|------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>銀行                      | 東京都<br>千代田<br>区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等<br><br>取引銀行 | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注2) | 4,073,855<br>千円  | 未払手数料      | 697,109<br>千円    |
|             |                                  |                 |                  |           |                            |                                                           | コーラブル預<br>金の払戻<br>(注3)                | 20,000,000<br>千円 |            |                  |
|             |                                  |                 |                  |           |                            |                                                           | コーラブル預<br>金の預入<br>(注3)                | 20,000,000<br>千円 | 現金及び<br>預金 | 20,000,000<br>千円 |
|             |                                  |                 |                  |           |                            |                                                           | コーラブル預<br>金に係る受取<br>利息<br>(注3)        | 4,126<br>千円      | 未収収益       | 997<br>千円        |
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ<br>モルガン・<br>スタンレー<br>証券(株) | 東京都<br>千代田<br>区 | 40,500<br>百万円    | 証券業       | なし                         | 当社投資信託の<br>募集の取扱及び<br>投資信託に係る<br>事務代行の委託<br>等             | 投資信託に<br>係る事務代<br>行手数料<br>の支払<br>(注2) | 5,714,501<br>千円  | 未払手数料      | 944,351<br>千円    |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。
- なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）  
三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

|              | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 384,107.08円                           | 377,741.17円                          |
| 1株当たり当期純利益金額 | 45,571.50円                            | 44,678.80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. 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。

|                     | 第34期<br>(自 平成30年4月1日<br>至 平成31年3月31日) | 第35期<br>(自 平成31年4月1日<br>至 令和2年3月31日) |
|---------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円)        | 9,642,064                             | 9,453,186                            |
| 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) | 9,642,064                             | 9,453,186                            |
| 普通株式の期中平均株式数 (株)    | 211,581                               | 211,581                              |

## 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】

<更新後>

#### (1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2019年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

| 名称                    | 資本金の額<br>(2019年9月末現在) | 事業の内容                         |
|-----------------------|-----------------------|-------------------------------|
| 三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 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。 |
| 野村證券株式会社              | 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。 |
| BNPパリバ証券株式会社          | 102,025 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。 |

### 3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2019年10月末現在)

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581株)を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年5月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

# 独立監査人の監査報告書

令和２年６月10日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御中

PWCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているMAXISカーボン・エフィシエント日本株上場投信の令和２年２月５日から令和２年５月10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、MAXISカーボン・エフィシエント日本株上場投信の令和２年５月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 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、三菱ＵＦＪ国際投信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

三菱ＵＦＪ国際投信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）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

令和2年6月26日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御 中

有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 青木 裕晃 印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也 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菱ＵＦＪ国際投信株式会社の平成31年4月1日から令和2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、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社の令和2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、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。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、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

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）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。