

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年8月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C 日本株式インデックス・オープンS
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックス・オープンス

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2020年 8月29日から2021年 2月26日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニ ア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

ないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

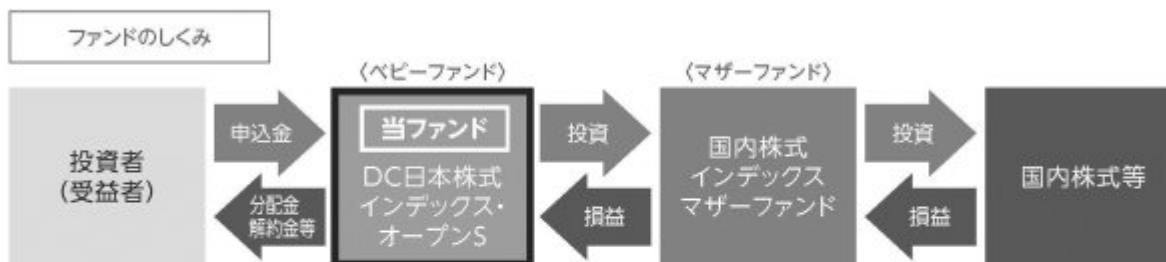
[特殊型]

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

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

<ファンドの特色>

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



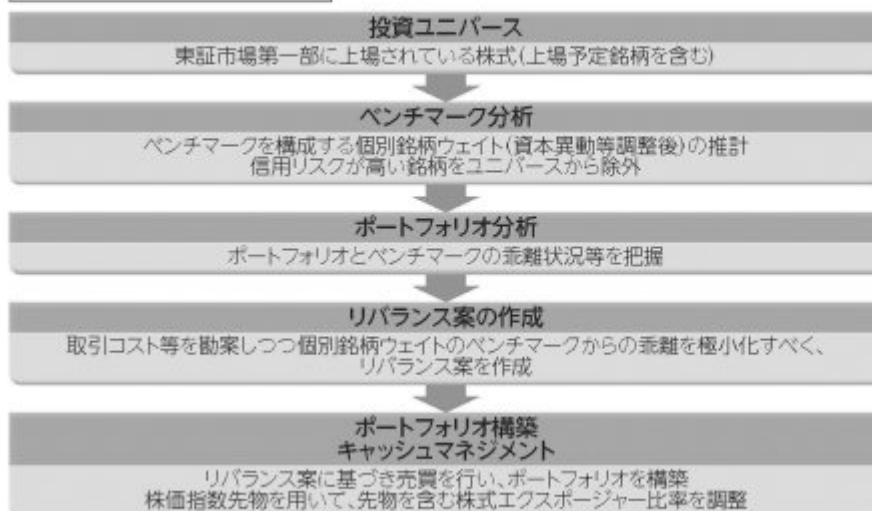
? ファミリーファンド方式とは

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

<マザーファンドの概要>

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

? TOPIX(東証株価指数)とは

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

分配方針

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年 6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

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

投資対象

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

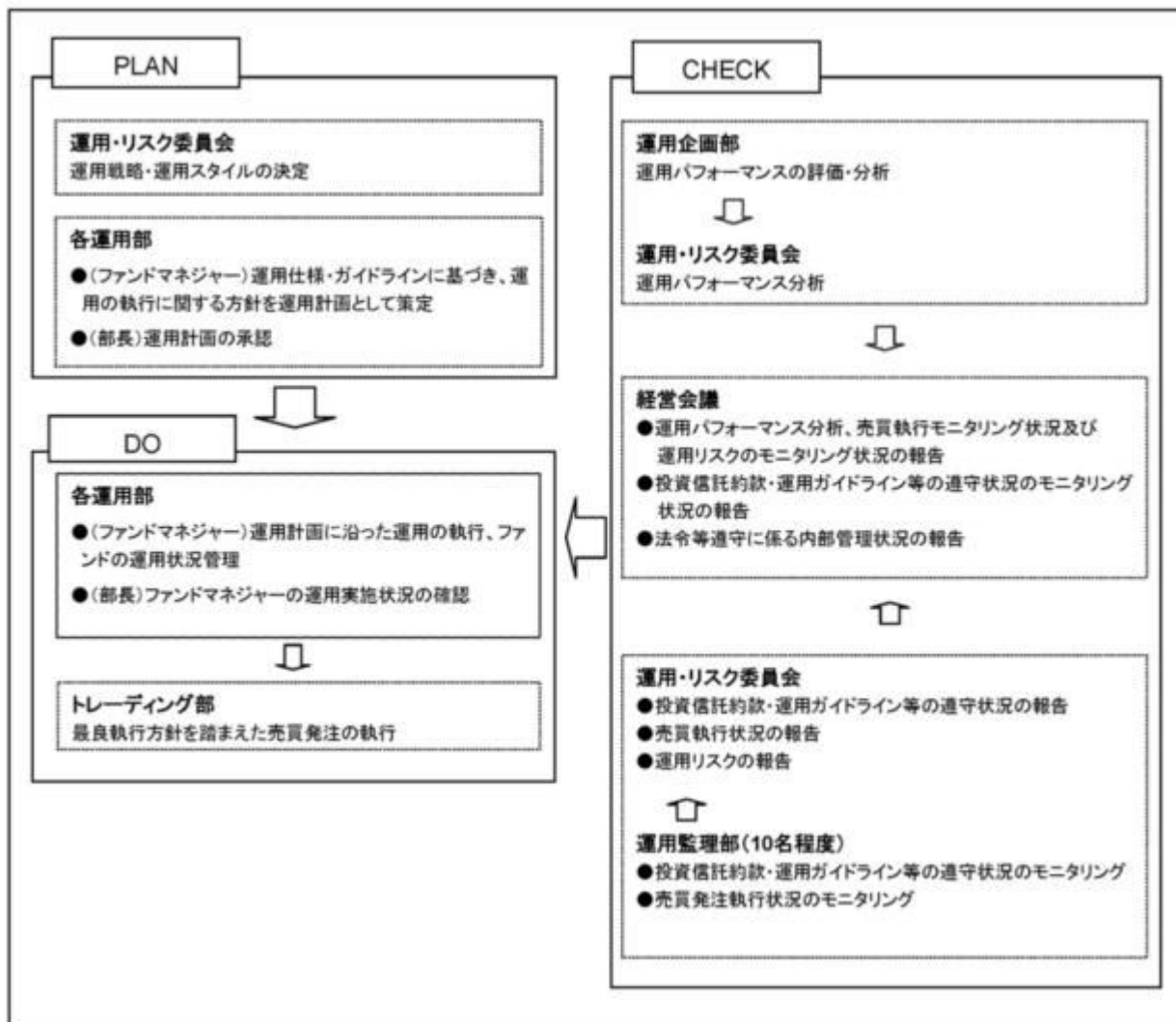
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財

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

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

（３）【運用体制】

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



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

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

り受け取っております。

（４）【分配方針】

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

・ 分配対象額の範囲

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

・ 分配対象額についての分配方針

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

・ 留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

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

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

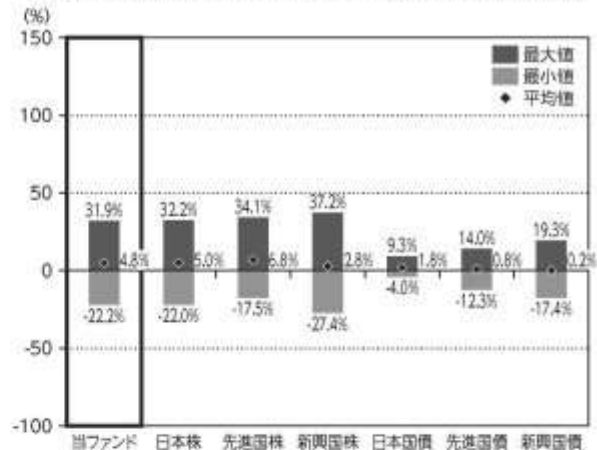
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2015年7月～2020年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした株価変動加算型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、延滞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・グローバル・エマージング・ マーケット・グローバル・ハイ・イールド・インデックス	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの同意による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.22%（税抜 0.2%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.121%（税抜 0.11%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.066%（税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033%（税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年6月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年6月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックス・オープンS】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,407,107,275	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,174,319	0.05
合計(純資産総額)		10,412,281,594	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	7,061,410,826	1.4761	10,423,855,112	1.4738	10,407,107,275	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第4期計算期間末 (2011年 5月30日)	421,953,122	421,953,122	5,642	5,642
第5期計算期間末 (2012年 5月29日)	613,845,546	613,845,546	5,085	5,085
第6期計算期間末 (2013年 5月29日)	1,147,627,730	1,147,627,730	8,412	8,412
第7期計算期間末 (2014年 5月29日)	1,866,071,421	1,866,071,421	8,721	8,721
第8期計算期間末 (2015年 5月29日)	3,443,138,694	3,443,138,694	12,356	12,356
第9期計算期間末 (2016年 5月30日)	4,142,221,031	4,142,221,031	10,268	10,268
第10期計算期間末 (2017年 5月29日)	5,687,450,621	5,687,450,621	12,038	12,038
第11期計算期間末 (2018年 5月29日)	8,282,015,684	8,282,015,684	13,768	13,768
第12期計算期間末 (2019年 5月29日)	8,975,168,901	8,975,168,901	12,265	12,265
第13期計算期間末 (2020年 5月29日)	10,382,988,624	10,382,988,624	12,781	12,781
2019年 6月末日	9,185,391,138		12,400	
7月末日	9,326,385,597		12,510	
8月末日	9,158,370,036		12,085	
9月末日	9,680,929,532		12,811	
10月末日	10,219,514,044		13,449	
11月末日	10,443,865,793		13,708	
12月末日	10,684,137,507		13,903	
2020年 1月末日	10,527,702,986		13,603	
2月末日	9,483,717,138		12,203	
3月末日	9,133,393,729		11,475	
4月末日	9,585,435,596		11,970	

5月末日	10,382,988,624		12,781	
6月末日	10,412,281,594		12,758	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	0
第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	0
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	0
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	0
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	0
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	0
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	0
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	0
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	0
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	4.6
第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	9.9
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	65.4
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	3.7
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	41.7
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	16.9
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	17.2
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	14.4
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	10.9
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	4.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第4期計算期間	2010年 6月 1日～2011年 5月30日	354,364,758	77,390,119	747,886,152
第5期計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月29日	576,981,785	117,785,884	1,207,082,053
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	463,692,194	306,529,942	1,364,244,305

第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	1,119,419,055	344,003,784	2,139,659,576
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	1,337,445,052	690,529,107	2,786,575,521
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	2,058,315,332	810,869,903	4,034,020,950
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	1,869,056,255	1,178,642,386	4,724,434,819
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	2,181,025,603	889,936,203	6,015,524,219
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	2,438,617,340	1,136,275,137	7,317,866,422
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	2,341,470,930	1,535,472,847	8,123,864,505

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	317,813,283,870	98.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,035,403,784	1.25
合計(純資産総額)		321,848,687,654	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,005,345,000	1.24

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,621,500	6,768.89	10,975,768,126	6,762.00	10,964,583,000	3.41
日本	株式	ソニー	電気機器	910,400	6,901.78	6,283,388,728	7,384.00	6,722,393,600	2.09

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,131,500	4,857.37	5,496,116,909	5,450.00	6,166,675,000	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	131,700	44,369.40	5,843,450,296	45,030.00	5,930,451,000	1.84
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,906,300	2,448.03	4,666,682,260	2,515.50	4,795,297,650	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,209,100	4,183.19	5,057,895,892	3,848.00	4,652,616,800	1.45
日本	株式	任天堂	その他製品	89,100	43,679.51	3,891,844,444	48,010.00	4,277,691,000	1.33
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,804,900	445.12	4,364,357,190	421.60	4,133,745,840	1.28
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	994,900	3,720.01	3,701,046,566	3,682.00	3,663,221,800	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	415,900	10,034.12	4,173,194,234	8,806.00	3,662,415,400	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,039,700	3,139.64	3,264,283,708	3,234.00	3,362,389,800	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	185,200	15,895.06	2,943,766,832	17,335.00	3,210,442,000	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,144,200	2,792.29	3,194,943,736	2,755.50	3,152,843,100	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	244,400	12,617.73	3,083,773,840	12,595.00	3,078,218,000	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	991,300	3,127.84	3,100,628,390	3,032.00	3,005,621,600	0.93
日本	株式	花王	化学	348,000	8,656.42	3,012,437,008	8,540.00	2,971,920,000	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	288,300	10,109.96	2,914,704,277	10,260.00	2,957,958,000	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,019,800	2,949.27	3,007,668,084	2,882.00	2,939,063,600	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	427,000	6,035.90	2,577,330,918	6,316.00	2,696,932,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	136,700	19,269.50	2,634,140,650	19,260.00	2,632,842,000	0.82
日本	株式	中外製薬	医薬品	454,500	5,300.28	2,408,978,518	5,765.00	2,620,192,500	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,476,700	134.80	2,625,468,508	132.20	2,574,819,740	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	349,800	6,640.08	2,322,702,434	7,196.00	2,517,160,800	0.78
日本	株式	S M C	機械	45,600	54,473.00	2,483,969,011	55,180.00	2,516,208,000	0.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	92,200	21,632.04	1,994,474,912	26,440.00	2,437,768,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	506,800	4,682.07	2,372,875,868	4,698.00	2,380,946,400	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	698,300	3,464.77	2,419,451,599	3,403.00	2,376,314,900	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,001,100	2,312.68	2,315,233,134	2,321.50	2,324,053,650	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,260,000	1,909.96	2,406,551,006	1,799.50	2,267,370,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	938,500	2,513.81	2,359,210,685	2,270.00	2,130,395,000	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.56
		食料品	3.89
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23

化学	7.22
医薬品	6.81
石油・石炭製品	0.41
ゴム製品	0.62
ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.56
非鉄金属	0.67
金属製品	0.54
機械	5.21
電気機器	14.93
輸送用機器	7.19
精密機器	2.61
その他製品	2.46
電気・ガス業	1.54
陸運業	3.97
海運業	0.13
空運業	0.34
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.83
卸売業	4.41
小売業	4.92
銀行業	4.89
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	1.98
その他金融業	1.12
不動産業	1.99
サービス業	5.22
小計	98.75
合計	98.75

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	257円		4,075,394,300	4,005,345,000	1.24

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2007年8月31日

作成基準日：2020年6月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 12,758円

純資産総額 104.12億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

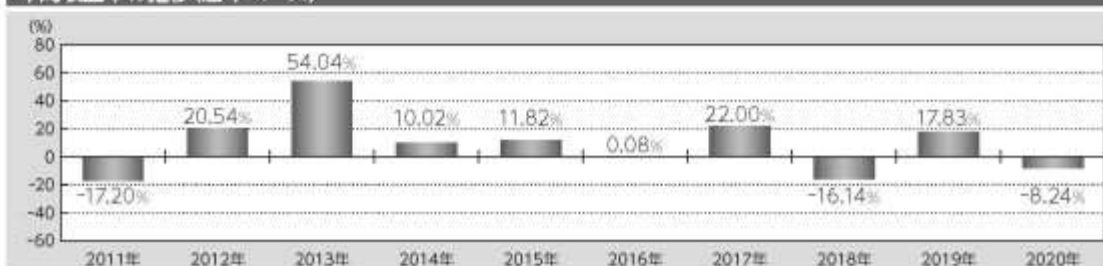
決算期	分配金
2016年5月	0円
2017年5月	0円
2018年5月	0円
2019年5月	0円
2020年5月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.4%
ソニー	日本	株式	電気機器	2.1%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.9%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.4%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

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

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すこと

ができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2007年 8月31日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

<受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(2019年5月30日から2020年5月29日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックス・オープンS】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2019年 5月29日現在)	第13期 (2020年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	7,312,557
コール・ローン	24,070,653	32,089,268
親投資信託受益証券	8,970,638,831	10,377,751,172
未収入金	-	13,497,602
流動資産合計	8,994,709,484	10,430,650,599
資産合計		
	8,994,709,484	10,430,650,599
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,595,970	36,297,845
未払受託者報酬	1,421,032	1,625,117
未払委託者報酬	8,052,450	9,208,927
未払利息	38	87
その他未払費用	471,093	529,999
流動負債合計	19,540,583	47,661,975
負債合計		
	19,540,583	47,661,975
純資産の部		
元本等		
元本	7,317,866,422	8,123,864,505
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,657,302,479	2,259,124,119
(分配準備積立金)	1,270,070,296	1,039,442,051
元本等合計	8,975,168,901	10,382,988,624
純資産合計		
	8,975,168,901	10,382,988,624
負債純資産合計		
	8,994,709,484	10,430,650,599

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2018年 5月30日	至 2019年 5月29日	自 2019年 5月30日	至 2020年 5月29日
営業収益				
受取利息		1		57
有価証券売買等損益		966,220,436		436,611,601
営業収益合計		966,220,435		436,611,658
営業費用				
支払利息		13,705		10,969
受託者報酬		2,827,242		3,180,736
委託者報酬		16,020,921		18,024,041
その他費用		472,109		530,004
営業費用合計		19,333,977		21,745,750
営業利益又は営業損失（ ）		985,554,412		414,865,908
経常利益又は経常損失（ ）		985,554,412		414,865,908
当期純利益又は当期純損失（ ）		985,554,412		414,865,908
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		75,815,097		46,567,699
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,266,491,465		1,657,302,479
剰余金増加額又は欠損金減少額		716,589,067		590,838,259
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		716,589,067		590,838,259
剰余金減少額又は欠損金増加額		416,038,738		357,314,828
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		416,038,738		357,314,828
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,657,302,479		2,259,124,119

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2019年 5月29日現在)	第13期 (2020年 5月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,317,866,422口	8,123,864,505口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2265円 (12,265円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2781円 (12,781円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29日	第13期 自 2019年 5月30日 至 2020年 5月29日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,428,211,010円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,270,070,296円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>5,698,281,306円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>7,317,866,422口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,786円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	4,428,211,010円	分配準備積立金額	D	1,270,070,296円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,698,281,306円	当ファンドの期末残存口数	F	7,317,866,422口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>5,286,448,823円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,039,442,051円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>6,325,890,874円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>8,123,864,505口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>7,786円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	5,286,448,823円	分配準備積立金額	D	1,039,442,051円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,325,890,874円	当ファンドの期末残存口数	F	8,123,864,505口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	4,428,211,010円																																																											
分配準備積立金額	D	1,270,070,296円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,698,281,306円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	7,317,866,422口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	- 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	5,286,448,823円																																																											
分配準備積立金額	D	1,039,442,051円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,325,890,874円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	8,123,864,505口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,786円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2019年 5月30日 至 2020年 5月29日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第13期 (2020年 5月29日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期
	自 2018年 5月30日 至 2019年 5月29日	自 2019年 5月30日 至 2020年 5月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,015,524,219円	7,317,866,422円
期中追加設定元本額	2,438,617,340円	2,341,470,930円
期中一部解約元本額	1,136,275,137円	1,535,472,847円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期	第13期
	(2019年 5月29日現在)	(2020年 5月29日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	927,167,040	421,661,804
合計	927,167,040	421,661,804

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	7,030,044,149	10,377,751,172	
合計		7,030,044,149	10,377,751,172	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2020年 5月29日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	721,985,689
コール・ローン	3,168,247,689
株式	304,033,610,080
派生商品評価勘定	364,316,000
未収入金	2,770,751,262
未収配当金	3,191,234,325
流動資産合計	314,250,145,045
資産合計	314,250,145,045
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,431,750
前受金	350,911,200
未払金	84,503,000
未払解約金	353,225,006
未払利息	8,602
流動負債合計	802,079,558
負債合計	802,079,558
純資産の部	
元本等	
元本	212,335,378,830
剰余金	
剰余金又は欠損金()	101,112,686,657
元本等合計	313,448,065,487
純資産合計	313,448,065,487
負債純資産合計	314,250,145,045

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 5月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 5月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	212,335,378,830口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4762円 (1万口当たり純資産額) (14,762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

	2020年 5月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 5月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2020年 5月29日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 5月30日
期首元本額	192,648,275,463円
期中追加設定元本額	57,404,489,163円
期中一部解約元本額	37,717,385,796円
期末元本額	212,335,378,830円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	584,094,810円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,052,532,100円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,227,555円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,597,759,896円
世界経済インデックスファンド	2,238,030,171円
日本株式インデックス・オープン	4,272,449,559円
DCマイセレクション25	7,529,986,081円
DCマイセレクション50	20,076,868,336円
DCマイセレクション75	18,038,129,668円
DC日本株式インデックス・オープン	5,859,526,247円

区分	2020年 5月29日現在
DCマイセレクションS25	3,227,803,983円
DCマイセレクションS50	8,608,682,819円
DCマイセレクションS75	5,385,777,867円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,030,044,149円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	342,138,642円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,749,358円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	468,469,284円
DC世界経済インデックスファンド	2,894,315,806円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,064,693,052円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	16,669,302円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	36,718,016円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	40,561,470円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	262,426,915円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,628,611円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	74,781,332円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	262,532,624円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,956,109円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	295,806,428円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,672,213,786円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	685,206,125円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,086,047,882円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	631,511,562円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	40,131,391円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	774,615,025円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	34,958,991円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	449,394,641円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	573,894,818円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	52,628,155円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	856,763,230円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,460,291円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,123,000円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,002,792,632円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,033,776,175円
分散投資コア戦略ファンドA	5,599,750,637円
分散投資コア戦略ファンドS	15,498,874,548円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	322,645,065円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	345,589,296円
コア投資戦略ファンド（切替型）	561,696,405円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,812,783円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,032,673円
SMT インデックスバランス・オープン	67,960,476円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	13,556,829,429円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	495,066,105円

区分	2020年 5月29日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,297,368円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	76,211,965円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	13,088,994円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,775,748円
グローバル経済コア	269,825,330円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,089,720円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	49,383,233円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,529,303円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	239,188,128円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,642,992円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	123,495円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	192,405円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	76,163円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	63,745円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	51,398,165,781円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	557,996,502円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	30,632,949円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	11,959,698円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 5月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,524,095,172
合計	6,524,095,172

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 5月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引			
	買建	5,089,998,800	-	5,440,910,000
合計		5,089,998,800	-	5,440,910,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,600	2,695.00	17,787,000	
日本水産	188,000	499.00	93,812,000	
マルハニチロ	27,200	2,331.00	63,403,200	
カネコ種苗	5,700	1,426.00	8,128,200	
サカタのタネ	22,400	3,700.00	82,880,000	
ホクト	14,300	2,007.00	28,700,100	
ホクリヨウ	2,900	655.00	1,899,500	
住石ホールディングス	38,000	114.00	4,332,000	
日鉄鉱業	4,300	4,580.00	19,694,000	
三井松島ホールディングス	7,300	868.00	6,336,400	
国際石油開発帝石	754,300	750.90	566,403,870	
石油資源開発	24,600	2,024.00	49,790,400	
K&Oエナジーグループ	9,100	1,558.00	14,177,800	
ヒノキヤグループ	4,700	1,650.00	7,755,000	
ショーボンドホールディングス	29,300	4,985.00	146,060,500	
ミライト・ホールディングス	55,900	1,539.00	86,030,100	
タマホーム	10,100	1,304.00	13,170,400	
サンヨーホームズ	1,600	635.00	1,016,000	
日本アクア	7,500	609.00	4,567,500	
ファーストコーポレーション	5,700	537.00	3,060,900	
ベステラ	3,200	1,019.00	3,260,800	
TATERU	38,800	166.00	6,440,800	
キャンディル	3,100	546.00	1,692,600	
スペースバリューホールディングス	22,900	354.00	8,106,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	997.00	3,589,200	
第一カッター興業	2,300	1,853.00	4,261,900	
明豊ファシリティワークス	6,000	571.00	3,426,000	
安藤・間	112,000	697.00	78,064,000	
東急建設	55,100	588.00	32,398,800	
コムシスホールディングス	66,700	3,000.00	200,100,000	
ピーアールホールディングス	20,500	580.00	11,890,000	
高松コンストラクショングループ	11,700	2,563.00	29,987,100	
東建コーポレーション	5,800	7,390.00	42,862,000	

ソネック	1,900	815.00	1,548,500
ヤマウラ	8,200	814.00	6,674,800
大成建設	144,800	3,740.00	541,552,000
大林組	434,200	997.00	432,897,400
清水建設	440,700	912.00	401,918,400
飛島建設	12,500	1,115.00	13,937,500
長谷工コーポレーション	168,100	1,313.00	220,715,300
松井建設	17,100	620.00	10,602,000
銭高組	1,900	3,640.00	6,916,000
鹿島建設	340,900	1,222.00	416,579,800
不動テトラ	11,300	1,417.00	16,012,100
大末建設	5,000	780.00	3,900,000
鉄建建設	9,400	2,223.00	20,896,200
西松建設	33,500	2,108.00	70,618,000
三井住友建設	104,900	453.00	47,519,700
大豊建設	9,700	2,505.00	24,298,500
前田建設工業	108,800	845.00	91,936,000
佐田建設	9,300	411.00	3,822,300
ナカノフドー建設	11,900	387.00	4,605,300
奥村組	23,600	2,600.00	61,360,000
東鉄工業	18,600	2,877.00	53,512,200
イチケン	3,100	1,505.00	4,665,500
富士ピー・エス	6,400	567.00	3,628,800
浅沼組	4,900	4,230.00	20,727,000
戸田建設	180,300	664.00	119,719,200
熊谷組	20,100	2,633.00	52,923,300
北野建設	2,600	2,633.00	6,845,800
植木組	1,900	2,465.00	4,683,500
矢作建設工業	19,200	771.00	14,803,200
ピーエス三菱	14,300	553.00	7,907,900
日本ハウスホールディングス	29,600	315.00	9,324,000
大東建託	47,400	11,385.00	539,649,000
新日本建設	18,500	754.00	13,949,000
N I P P O	35,900	2,675.00	96,032,500
東亜道路工業	2,700	3,255.00	8,788,500
前田道路	38,300	2,009.00	76,944,700
日本道路	4,200	7,100.00	29,820,000
東亜建設工業	13,500	1,645.00	22,207,500
日本国土開発	42,200	551.00	23,252,200
若築建設	7,800	1,156.00	9,016,800
東洋建設	48,700	429.00	20,892,300
五洋建設	172,100	562.00	96,720,200

世紀東急工業	20,800	802.00	16,681,600
福田組	5,000	4,885.00	24,425,000
住友林業	110,000	1,371.00	150,810,000
日本基礎技術	14,600	422.00	6,161,200
バコーポレーション	19,300	368.00	7,102,400
大和ハウス工業	429,600	2,674.50	1,148,965,200
ライト工業	24,800	1,462.00	36,257,600
積水ハウス	470,900	2,052.50	966,522,250
日特建設	11,300	726.00	8,203,800
北陸電気工事	7,500	936.00	7,020,000
ユアテック	24,800	631.00	15,648,800
日本リーテック	9,100	2,076.00	18,891,600
四電工	2,400	2,340.00	5,616,000
中電工	17,500	2,315.00	40,512,500
関電工	61,800	984.00	60,811,200
きんでん	103,200	1,803.00	186,069,600
東京エネシス	14,400	746.00	10,742,400
トーエネック	4,400	3,900.00	17,160,000
住友電設	12,300	2,503.00	30,786,900
日本電設工業	23,800	2,383.00	56,715,400
協和エクシオ	65,800	2,474.00	162,789,200
新日本空調	11,500	2,537.00	29,175,500
九電工	30,500	2,993.00	91,286,500
三機工業	31,300	1,373.00	42,974,900
日揮ホールディングス	133,700	1,159.00	154,958,300
中外炉工業	4,700	1,591.00	7,477,700
ヤマト	13,900	662.00	9,201,800
太平電業	10,500	2,369.00	24,874,500
高砂熱学工業	37,700	1,830.00	68,991,000
三晃金属工業	1,900	2,059.00	3,912,100
朝日工業社	2,900	3,100.00	8,990,000
明星工業	28,100	756.00	21,243,600
大気社	21,100	3,365.00	71,001,500
ダイダン	10,400	2,895.00	30,108,000
日比谷総合設備	14,000	1,962.00	27,468,000
フィル・カンパニー	2,500	3,105.00	7,762,500
OSJBホールディングス	68,500	248.00	16,988,000
東洋エンジニアリング	18,200	404.00	7,352,800
レイズネクスト	23,300	1,282.00	29,870,600
日本製粉	40,700	1,632.00	66,422,400
日清製粉グループ本社	157,000	1,679.00	263,603,000
日東富士製粉	1,000	6,130.00	6,130,000

昭和産業	12,800	3,295.00	42,176,000
鳥越製粉	12,300	897.00	11,033,100
中部飼料	17,000	1,667.00	28,339,000
フィード・ワン	93,300	186.00	17,353,800
東洋精糖	2,300	1,251.00	2,877,300
日本甜菜製糖	7,200	1,691.00	12,175,200
三井製糖	12,200	2,083.00	25,412,600
塩水港精糖	15,000	210.00	3,150,000
日新製糖	6,600	1,953.00	12,889,800
森永製菓	32,600	4,625.00	150,775,000
中村屋	3,600	4,065.00	14,634,000
江崎グリコ	41,200	5,210.00	214,652,000
名糖産業	6,700	1,302.00	8,723,400
井村屋グループ	7,900	2,046.00	16,163,400
不二家	7,800	2,172.00	16,941,600
山崎製パン	104,200	1,931.00	201,210,200
第一屋製パン	2,400	953.00	2,287,200
モロゾフ	2,400	5,960.00	14,304,000
亀田製菓	7,900	5,420.00	42,818,000
寿スピリッツ	13,400	5,250.00	70,350,000
カルビー	63,300	3,115.00	197,179,500
森永乳業	25,700	4,530.00	116,421,000
六甲バター	9,200	1,592.00	14,646,400
ヤクルト本社	95,600	6,600.00	630,960,000
明治ホールディングス	91,900	8,110.00	745,309,000
雪印メグミルク	33,500	2,645.00	88,607,500
プリマハム	21,700	2,639.00	57,266,300
日本ハム	53,100	3,980.00	211,338,000
林兼産業	4,600	578.00	2,658,800
丸大食品	14,800	1,945.00	28,786,000
S Foods	11,100	2,553.00	28,338,300
柿安本店	4,800	2,618.00	12,566,400
伊藤ハム米久ホールディングス	89,500	670.00	59,965,000
サッポロホールディングス	47,400	2,155.00	102,147,000
アサヒグループホールディングス	291,000	4,058.00	1,180,878,000
キリンホールディングス	589,400	2,207.50	1,301,100,500
宝ホールディングス	103,000	869.00	89,507,000
オエノンホールディングス	36,700	395.00	14,496,500
養命酒製造	4,300	1,885.00	8,105,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	97,500	2,140.00	208,650,000
サントリー食品インターナショナル	93,000	4,400.00	409,200,000
ダイドーグループホールディングス	7,100	5,280.00	37,488,000

伊藤園	42,200	6,180.00	260,796,000
キーコーヒー	13,700	2,351.00	32,208,700
ユニカフェ	3,600	964.00	3,470,400
ジャパンフーズ	2,000	1,188.00	2,376,000
日清オイリオグループ	17,900	3,440.00	61,576,000
不二製油グループ本社	33,900	2,891.00	98,004,900
かどや製油	1,500	3,715.00	5,572,500
J・オイルミルズ	7,200	4,325.00	31,140,000
キッコーマン	100,000	5,420.00	542,000,000
味の素	306,900	1,837.00	563,775,300
キューピー	77,400	2,109.00	163,236,600
ハウス食品グループ本社	52,000	3,645.00	189,540,000
カゴメ	52,700	3,035.00	159,944,500
焼津水産化学工業	6,700	926.00	6,204,200
アリアケジャパン	12,700	7,480.00	94,996,000
ピエトロ	1,800	1,612.00	2,901,600
エバラ食品工業	3,400	2,203.00	7,490,200
やまみ	1,200	2,305.00	2,766,000
ニチレイ	66,200	3,035.00	200,917,000
東洋水産	71,500	5,630.00	402,545,000
イトアンド	4,800	1,789.00	8,587,200
大冷	1,800	1,956.00	3,520,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,700	1,168.00	8,993,600
日清食品ホールディングス	59,100	9,000.00	531,900,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,203.00	14,980,400
一正蒲鉾	5,400	989.00	5,340,600
フジッコ	15,000	1,991.00	29,865,000
ロック・フィールド	15,000	1,394.00	20,910,000
日本たばこ産業	802,400	2,137.50	1,715,130,000
ケンコーマヨネーズ	7,800	2,144.00	16,723,200
わらべや日洋ホールディングス	9,100	1,755.00	15,970,500
なとり	7,800	1,751.00	13,657,800
イフジ産業	2,400	802.00	1,924,800
ピククルスコーポレーション	3,000	2,299.00	6,897,000
北の達人コーポレーション	48,500	521.00	25,268,500
ユーグレナ	59,900	744.00	44,565,600
ミヨシ油脂	5,300	1,163.00	6,163,900
理研ビタミン	13,100	2,260.00	29,606,000
片倉工業	20,100	1,210.00	24,321,000
ゲンゼ	10,100	3,835.00	38,733,500
東洋紡	53,900	1,509.00	81,335,100
ユニチカ	41,000	354.00	14,514,000

富士紡ホールディングス	6,700	3,225.00	21,607,500
倉敷紡績	13,700	2,426.00	33,236,200
シキボウ	7,100	1,059.00	7,518,900
日本毛織	45,100	1,006.00	45,370,600
トーア紡コーポレーション	5,400	513.00	2,770,200
帝国繊維	15,500	2,290.00	35,495,000
帝人	110,900	1,764.00	195,627,600
東レ	982,700	523.90	514,836,530
サカイオーベックス	3,800	2,166.00	8,230,800
住江織物	3,000	1,930.00	5,790,000
日本フェルト	8,600	478.00	4,110,800
イチカワ	2,300	1,371.00	3,153,300
日東製網	1,600	1,431.00	2,289,600
アツギ	11,300	618.00	6,983,400
ダイニック	5,100	772.00	3,937,200
セーレン	33,700	1,336.00	45,023,200
ソトー	5,500	959.00	5,274,500
東海染工	2,000	1,117.00	2,234,000
小松マテーレ	22,400	741.00	16,598,400
ワコールホールディングス	35,400	2,231.00	78,977,400
ホギメディカル	15,500	3,530.00	54,715,000
クラウディアホールディングス	3,600	431.00	1,551,600
T S Iホールディングス	45,700	462.00	21,113,400
マツオカコーポレーション	3,900	2,417.00	9,426,300
ワールド	19,300	1,567.00	30,243,100
三陽商会	7,200	906.00	6,523,200
ナイガイ	5,200	360.00	1,872,000
オンワードホールディングス	81,700	370.00	30,229,000
ルックホールディングス	4,700	859.00	4,037,300
ゴールドウイン	24,600	6,890.00	169,494,000
デサント	26,500	1,603.00	42,479,500
キング	6,600	515.00	3,399,000
ヤマトインターナショナル	12,200	354.00	4,318,800
特種東海製紙	8,600	4,330.00	37,238,000
王子ホールディングス	566,900	541.00	306,692,900
日本製紙	60,000	1,591.00	95,460,000
三菱製紙	15,400	380.00	5,852,000
北越コーポレーション	80,800	406.00	32,804,800
中越パルプ工業	5,700	1,473.00	8,396,100
巴川製紙所	4,000	882.00	3,528,000
大王製紙	59,800	1,457.00	87,128,600
阿波製紙	3,500	551.00	1,928,500

レンゴー	128,200	852.00	109,226,400
トーモク	8,300	1,722.00	14,292,600
ザ・バック	10,300	3,120.00	32,136,000
クラレ	213,600	1,132.00	241,795,200
旭化成	898,800	850.00	763,980,000
共和レザー	7,400	675.00	4,995,000
昭和電工	96,500	2,575.00	248,487,500
住友化学	996,300	334.00	332,764,200
住友精化	6,000	3,040.00	18,240,000
日産化学	75,300	4,755.00	358,051,500
ラサ工業	4,800	1,484.00	7,123,200
クレハ	11,600	4,745.00	55,042,000
多木化学	5,300	7,200.00	38,160,000
テイカ	9,900	1,575.00	15,592,500
石原産業	24,300	762.00	18,516,600
片倉コープアグリ	3,500	1,197.00	4,189,500
日本曹達	20,100	2,991.00	60,119,100
東ソー	209,600	1,498.00	313,980,800
トクヤマ	39,100	2,576.00	100,721,600
セントラル硝子	27,700	1,964.00	54,402,800
東亜合成	85,100	1,031.00	87,738,100
大阪ソーダ	13,800	2,620.00	36,156,000
関東電化工業	32,200	929.00	29,913,800
デンカ	49,500	2,639.00	130,630,500
信越化学工業	232,800	12,620.00	2,937,936,000
日本カーバイド工業	4,600	1,421.00	6,536,600
堺化学工業	8,800	1,990.00	17,512,000
第一稀元素化学工業	14,700	789.00	11,598,300
エア・ウォーター	126,100	1,565.00	197,346,500
大陽日酸	130,300	1,812.00	236,103,600
日本化学工業	4,200	2,376.00	9,979,200
東邦アセチレン	2,000	1,282.00	2,564,000
日本パーカライズニング	68,400	1,148.00	78,523,200
高压ガス工業	21,500	772.00	16,598,000
チタン工業	1,700	1,881.00	3,197,700
四国化成工業	20,900	1,146.00	23,951,400
戸田工業	3,100	1,700.00	5,270,000
ステラ ケミファ	7,400	2,651.00	19,617,400
保土谷化学工業	5,100	4,195.00	21,394,500
日本触媒	21,000	6,030.00	126,630,000
大日精化工業	12,000	2,495.00	29,940,000
カネカ	35,100	2,873.00	100,842,300

三菱瓦斯化学	126,200	1,604.00	202,424,800
三井化学	123,100	2,240.00	275,744,000
J S R	126,400	2,112.00	266,956,800
東京応化工業	23,300	4,990.00	116,267,000
大阪有機化学工業	12,500	1,875.00	23,437,500
三菱ケミカルホールディングス	906,500	634.30	574,992,950
K Hネオケム	23,900	2,120.00	50,668,000
ダイセル	176,600	912.00	161,059,200
住友ベークライト	21,300	3,030.00	64,539,000
積水化学工業	291,600	1,505.00	438,858,000
日本ゼオン	122,300	1,037.00	126,825,100
アイカ工業	40,700	3,210.00	130,647,000
宇部興産	68,500	1,925.00	131,862,500
積水樹脂	24,400	2,369.00	57,803,600
タキロンシーアイ	29,300	736.00	21,564,800
旭有機材	7,700	1,522.00	11,719,400
ニチバン	7,100	1,528.00	10,848,800
リケンテクノス	34,100	434.00	14,799,400
大倉工業	6,400	1,646.00	10,534,400
積水化成品工業	18,200	605.00	11,011,000
群栄化学工業	3,100	2,738.00	8,487,800
タイガースポリマー	7,100	467.00	3,315,700
ミライアル	4,800	1,291.00	6,196,800
ダイキアクシス	4,800	791.00	3,796,800
ダイキョーニシカワ	28,600	608.00	17,388,800
竹本容器	4,800	742.00	3,561,600
森六ホールディングス	7,300	1,600.00	11,680,000
日本化薬	83,900	1,082.00	90,779,800
カーリットホールディングス	14,500	553.00	8,018,500
日本精化	10,900	1,476.00	16,088,400
扶桑化学工業	13,700	4,015.00	55,005,500
トリケミカル研究所	3,000	10,690.00	32,070,000
A D E K A	62,400	1,499.00	93,537,600
日油	51,100	3,830.00	195,713,000
新日本理化	22,400	180.00	4,032,000
ハリマ化成グループ	11,200	995.00	11,144,000
花王	331,500	8,647.00	2,866,480,500
第一工業製薬	5,100	4,715.00	24,046,500
石原ケミカル	3,700	1,949.00	7,211,300
日華化学	4,600	940.00	4,324,000
ニイタカ	2,800	3,665.00	10,262,000
三洋化成工業	8,100	4,940.00	40,014,000

有機合成薬品工業	10,400	383.00	3,983,200
大日本塗料	15,300	984.00	15,055,200
日本ペイントホールディングス	111,900	7,510.00	840,369,000
関西ペイント	152,400	2,232.00	340,156,800
神東塗料	10,700	180.00	1,926,000
中国塗料	38,600	818.00	31,574,800
日本特殊塗料	10,100	903.00	9,120,300
藤倉化成	18,300	500.00	9,150,000
太陽ホールディングス	10,000	5,060.00	50,600,000
D I C	57,300	2,811.00	161,070,300
サカタインクス	29,600	1,073.00	31,760,800
東洋インキS Cホールディングス	28,700	2,081.00	59,724,700
T & K T O K A	10,500	798.00	8,379,000
富士フィルムホールディングス	265,500	4,981.00	1,322,455,500
資生堂	275,100	6,570.00	1,807,407,000
ライオン	180,000	2,465.00	443,700,000
高砂香料工業	8,700	2,474.00	21,523,800
マンダム	31,100	2,177.00	67,704,700
ミルボン	18,500	5,310.00	98,235,000
ファンケル	56,000	3,060.00	171,360,000
コーセー	26,000	13,490.00	350,740,000
コタ	8,000	1,204.00	9,632,000
シーボン	1,800	2,142.00	3,855,600
ポーラ・オルビスホールディングス	59,100	2,096.00	123,873,600
ノエビアホールディングス	11,700	4,820.00	56,394,000
アジュバンコスメジャパン	3,100	950.00	2,945,000
エステー	8,900	1,657.00	14,747,300
アグロ カネショウ	5,800	1,465.00	8,497,000
コニシ	22,700	1,527.00	34,662,900
長谷川香料	23,900	2,384.00	56,977,600
星光P M C	7,900	720.00	5,688,000
小林製薬	38,800	9,600.00	372,480,000
荒川化学工業	12,400	1,301.00	16,132,400
メック	9,500	2,087.00	19,826,500
日本高純度化学	3,800	2,684.00	10,199,200
タカラバイオ	36,200	2,874.00	104,038,800
J C U	16,800	3,250.00	54,600,000
新田ゼラチン	8,700	724.00	6,298,800
O A T アグリオ	2,400	1,139.00	2,733,600
デクセリアルズ	35,800	858.00	30,716,400
アース製薬	10,400	7,120.00	74,048,000
北興化学工業	14,200	611.00	8,676,200

大成ラミック	4,500	2,684.00	12,078,000
クミアイ化学工業	57,300	870.00	49,851,000
日本農薬	24,700	493.00	12,177,100
アキレス	9,500	1,695.00	16,102,500
有沢製作所	21,900	811.00	17,760,900
日東電工	95,500	5,830.00	556,765,000
レック	14,800	1,598.00	23,650,400
三光合成	15,800	318.00	5,024,400
きもと	23,500	157.00	3,689,500
藤森工業	12,400	3,515.00	43,586,000
前澤化成工業	8,800	1,041.00	9,160,800
未来工業	7,400	1,957.00	14,481,800
ウェーブロックホールディングス	4,800	783.00	3,758,400
J S P	8,100	1,479.00	11,979,900
エフピコ	15,200	7,910.00	120,232,000
天馬	9,200	1,825.00	16,790,000
信越ポリマー	24,900	950.00	23,655,000
東リ	34,500	261.00	9,004,500
ニフコ	50,800	2,358.00	119,786,400
バルカー	11,200	2,081.00	23,307,200
ユニ・チャーム	266,900	4,010.00	1,070,269,000
ショーエイコーポレーション	2,100	882.00	1,852,200
協和キリン	139,300	2,922.00	407,034,600
武田薬品工業	1,152,000	4,191.00	4,828,032,000
アステラス製薬	1,200,500	1,914.50	2,298,357,250
大日本住友製薬	102,600	1,523.00	156,259,800
塩野義製薬	174,100	6,361.00	1,107,450,100
わかもと製薬	16,500	252.00	4,158,000
あすか製薬	15,800	1,180.00	18,644,000
日本新薬	36,200	9,280.00	335,936,000
ビオフェルミン製薬	2,400	2,284.00	5,481,600
中外製薬	144,400	15,890.00	2,294,516,000
科研製薬	23,700	5,920.00	140,304,000
エーザイ	165,700	8,438.00	1,398,176,600
ロート製薬	71,100	3,310.00	235,341,000
小野薬品工業	318,000	3,077.00	978,486,000
久光製薬	36,600	5,430.00	198,738,000
持田製薬	19,200	4,175.00	80,160,000
参天製薬	257,900	1,990.00	513,221,000
扶桑薬品工業	4,900	2,556.00	12,524,400
日本ケミファ	1,800	2,744.00	4,939,200
ツムラ	42,900	2,996.00	128,528,400

日医工	39,200	1,310.00	51,352,000
キッセイ薬品工業	24,500	2,730.00	66,885,000
生化学工業	26,900	1,147.00	30,854,300
栄研化学	24,300	1,845.00	44,833,500
日水製薬	5,800	1,259.00	7,302,200
鳥居薬品	8,700	3,245.00	28,231,500
JCRファーマ	9,800	12,370.00	121,226,000
東和薬品	17,700	2,267.00	40,125,900
富士製薬工業	9,400	1,242.00	11,674,800
沢井製薬	28,400	5,940.00	168,696,000
ゼリア新薬工業	25,100	2,125.00	53,337,500
第一三共	396,200	10,085.00	3,995,677,000
キョーリン製薬ホールディングス	30,600	2,331.00	71,328,600
大幸薬品	16,900	2,247.00	37,974,300
ダイト	8,400	4,360.00	36,624,000
大塚ホールディングス	263,800	4,864.00	1,283,123,200
大正製薬ホールディングス	29,300	6,840.00	200,412,000
ペプチドリーム	70,400	4,835.00	340,384,000
日本コークス工業	117,000	63.00	7,371,000
ニチレキ	16,300	1,665.00	27,139,500
ユシロ化学工業	7,800	1,235.00	9,633,000
ビーピー・カストロール	4,900	1,303.00	6,384,700
富士石油	37,000	185.00	6,845,000
MORESCO	5,000	1,054.00	5,270,000
出光興産	153,700	2,390.00	367,343,000
JXTGホールディングス	2,082,900	414.30	862,945,470
コスモエネルギーホールディングス	40,100	1,705.00	68,370,500
横浜ゴム	80,200	1,627.00	130,485,400
TOYO TIRE	79,500	1,529.00	121,555,500
ブリヂストン	398,800	3,577.00	1,426,507,600
住友ゴム工業	124,400	1,096.00	136,342,400
藤倉コンポジット	12,100	383.00	4,634,300
オカモト	8,400	3,825.00	32,130,000
フコク	6,100	689.00	4,202,900
ニッタ	15,600	2,234.00	34,850,400
住友理工	26,800	634.00	16,991,200
三ツ星ベルト	18,200	1,637.00	29,793,400
バンドー化学	24,400	627.00	15,298,800
日東紡績	20,600	5,900.00	121,540,000
AGC	136,900	3,050.00	417,545,000
日本板硝子	66,200	409.00	27,075,800
石塚硝子	2,500	2,155.00	5,387,500

日本山村硝子	5,800	847.00	4,912,600
日本電気硝子	55,600	1,708.00	94,964,800
オハラ	5,500	971.00	5,340,500
住友大阪セメント	26,200	3,790.00	99,298,000
太平洋セメント	87,500	2,547.00	222,862,500
日本ヒューム	13,900	745.00	10,355,500
日本コンクリート工業	29,900	273.00	8,162,700
三谷セキサン	6,500	5,160.00	33,540,000
アジアパイルホールディングス	19,700	462.00	9,101,400
東海カーボン	145,100	979.00	142,052,900
日本カーボン	7,100	3,420.00	24,282,000
東洋炭素	8,100	1,626.00	13,170,600
ノリタケカンパニーリミテド	7,700	3,670.00	28,259,000
TOTO	98,900	4,270.00	422,303,000
日本碍子	166,200	1,579.00	262,429,800
日本特殊陶業	105,300	1,737.00	182,906,100
MARUWA	5,300	8,220.00	43,566,000
品川リフラクトリーズ	3,700	2,465.00	9,120,500
黒崎播磨	2,800	3,945.00	11,046,000
ヨータイ	11,000	697.00	7,667,000
イソライト工業	7,200	517.00	3,722,400
東京窯業	17,700	308.00	5,451,600
ニッカトー	6,300	678.00	4,271,400
フジインコーポレーテッド	12,300	3,105.00	38,191,500
クニミネ工業	5,600	998.00	5,588,800
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,211.00	2,785,300
ニチアス	37,900	2,485.00	94,181,500
ニチハ	19,300	2,334.00	45,046,200
日本製鉄	612,800	992.60	608,265,280
神戸製鋼所	250,800	401.00	100,570,800
中山製鋼所	19,200	354.00	6,796,800
合同製鐵	7,400	2,131.00	15,769,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	369,900	792.00	292,960,800
東京製鐵	66,800	698.00	46,626,400
共英製鋼	15,500	1,424.00	22,072,000
大和工業	29,100	2,225.00	64,747,500
東京鐵鋼	5,700	1,365.00	7,780,500
大阪製鐵	7,300	1,298.00	9,475,400
淀川製鋼所	18,500	1,720.00	31,820,000
丸一鋼管	44,500	2,759.00	122,775,500
モリ工業	4,100	2,400.00	9,840,000
大同特殊鋼	22,400	3,695.00	82,768,000

日本高周波鋼業	5,200	391.00	2,033,200	
日本冶金工業	11,400	1,721.00	19,619,400	
山陽特殊製鋼	9,400	983.00	9,240,200	
愛知製鋼	7,700	3,030.00	23,331,000	
日立金属	147,600	1,242.00	183,319,200	
日本金属	3,200	705.00	2,256,000	
大太平洋金属	9,300	1,690.00	15,717,000	
新日本電工	88,600	156.00	13,821,600	
栗本鐵工所	6,800	1,869.00	12,709,200	
虹技	2,100	1,201.00	2,522,100	
三菱製鋼	10,200	714.00	7,282,800	
日亜鋼業	20,300	275.00	5,582,500	
日本精線	2,300	3,260.00	7,498,000	
エンビプロ・ホールディングス	5,900	670.00	3,953,000	
シンニッタン	21,500	284.00	6,106,000	
新家工業	3,200	1,144.00	3,660,800	
大紀アルミニウム工業所	22,700	610.00	13,847,000	
日本軽金属ホールディングス	347,100	185.00	64,213,500	
三井金属鉱業	37,000	2,322.00	85,914,000	
東邦亜鉛	7,100	1,498.00	10,635,800	
三菱マテリアル	90,500	2,453.00	221,996,500	
住友金属鉱山	175,100	3,001.00	525,475,100	
D O W Aホールディングス	34,700	3,460.00	120,062,000	
古河機械金属	24,400	1,116.00	27,230,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,300	1,035.00	14,800,500	
東邦チタニウム	24,700	672.00	16,598,400	
U A C J	20,800	1,990.00	41,392,000	
C Kサンエツ	2,900	3,225.00	9,352,500	
古河電気工業	42,600	2,632.00	112,123,200	
住友電気工業	512,000	1,254.50	642,304,000	
フジクラ	165,700	317.00	52,526,900	
昭和電線ホールディングス	15,900	1,158.00	18,412,200	
東京特殊電線	2,100	2,327.00	4,886,700	
タツタ電線	27,300	628.00	17,144,400	
カナレ電気	2,300	1,754.00	4,034,200	
平河ヒューテック	6,900	1,134.00	7,824,600	
リョービ	16,900	1,401.00	23,676,900	
アーレスティ	18,200	369.00	6,715,800	
アサヒホールディングス	24,000	2,770.00	66,480,000	
稲葉製作所	7,700	1,391.00	10,710,700	
宮地エンジニアリンググループ	4,200	1,675.00	7,035,000	
トーカロ	38,000	1,056.00	40,128,000	

アルファCo	4,800	950.00	4,560,000
SUMCO	162,700	1,651.00	268,617,700
川田テクノロジーズ	2,800	5,100.00	14,280,000
RS Technologies	3,900	3,445.00	13,435,500
信和	7,900	702.00	5,545,800
東洋製罐グループホールディングス	87,200	1,146.00	99,931,200
ホッカンホールディングス	7,500	1,716.00	12,870,000
コロナ	7,600	936.00	7,113,600
横河ブリッジホールディングス	25,500	2,180.00	55,590,000
駒井ハルテック	2,600	1,506.00	3,915,600
高田機工	1,300	2,316.00	3,010,800
三和ホールディングス	129,100	924.00	119,288,400
文化シャッター	40,300	806.00	32,481,800
三協立山	17,600	962.00	16,931,200
アルインコ	9,900	954.00	9,444,600
東洋シャッター	3,300	693.00	2,286,900
LIXILグループ	202,000	1,504.00	303,808,000
日本フィルコン	10,500	542.00	5,691,000
ノーリツ	28,400	1,261.00	35,812,400
長府製作所	13,900	2,326.00	32,331,400
リンナイ	26,600	9,070.00	241,262,000
ダイニチ工業	7,400	699.00	5,172,600
日東精工	18,900	493.00	9,317,700
三洋工業	1,800	1,812.00	3,261,600
岡部	27,700	818.00	22,658,600
ジーテクト	17,000	1,134.00	19,278,000
東プレ	25,500	1,295.00	33,022,500
高周波熱錬	26,400	558.00	14,731,200
東京製綱	9,800	580.00	5,684,000
サンコール	10,200	412.00	4,202,400
モリテック スチール	10,700	313.00	3,349,100
パイオラックス	20,200	1,714.00	34,622,800
エイチワン	13,400	548.00	7,343,200
日本発條	146,900	741.00	108,852,900
中央発條	1,600	2,847.00	4,555,200
アドバネクス	2,000	1,343.00	2,686,000
立川ブラインド工業	6,000	1,184.00	7,104,000
三益半導体工業	10,700	2,238.00	23,946,600
日本ドライケミカル	3,400	1,600.00	5,440,000
日本製綱所	41,600	1,590.00	66,144,000
三浦工業	59,300	4,600.00	272,780,000
タクマ	46,500	1,405.00	65,332,500

ツガミ	28,500	1,003.00	28,585,500
オークマ	16,000	4,490.00	71,840,000
芝浦機械	15,500	2,373.00	36,781,500
アマダ	170,000	961.00	163,370,000
アイダエンジニアリング	36,000	735.00	26,460,000
滝澤鉄工所	4,300	1,046.00	4,497,800
F U J I	58,900	1,987.00	117,034,300
牧野フライス製作所	16,100	3,335.00	53,693,500
オーエスジー	63,400	1,527.00	96,811,800
ダイジェット工業	1,600	1,346.00	2,153,600
旭ダイヤモンド工業	36,200	511.00	18,498,200
D M G 森精機	86,700	1,309.00	113,490,300
ソディック	32,300	828.00	26,744,400
ディスコ	18,600	24,060.00	447,516,000
日東工器	7,500	1,979.00	14,842,500
日進工具	5,400	2,821.00	15,233,400
パンチ工業	12,500	448.00	5,600,000
富士ダイス	6,200	632.00	3,918,400
豊和工業	7,700	843.00	6,491,100
O K K	5,900	440.00	2,596,000
東洋機械金属	10,000	425.00	4,250,000
津田駒工業	2,800	857.00	2,399,600
エンシュウ	3,400	962.00	3,270,800
島精機製作所	21,600	1,632.00	35,251,200
オプトラン	15,300	2,828.00	43,268,400
N C ホールディングス	4,300	563.00	2,420,900
イワキポンプ	8,800	1,020.00	8,976,000
フリー	13,500	919.00	12,406,500
ヤマシンフィルタ	29,800	996.00	29,680,800
日阪製作所	17,000	756.00	12,852,000
やまびこ	26,600	981.00	26,094,600
平田機工	6,500	6,190.00	40,235,000
ペガサスミシン製造	14,100	335.00	4,723,500
マルマエ	5,100	881.00	4,493,100
タツモ	6,400	1,549.00	9,913,600
ナプテスコ	80,700	3,345.00	269,941,500
三井海洋開発	14,600	1,624.00	23,710,400
レオン自動機	13,500	1,306.00	17,631,000
S M C	43,400	54,370.00	2,359,658,000
ホソカワミクロン	4,800	6,090.00	29,232,000
ユニオンツール	5,100	2,810.00	14,331,000
オイレス工業	17,800	1,420.00	25,276,000

日精エー・エス・ピー機械	4,000	3,435.00	13,740,000
サトーホールディングス	19,500	2,485.00	48,457,500
技研製作所	12,100	4,900.00	59,290,000
日本エアージェット	4,800	1,074.00	5,155,200
カワタ	4,100	771.00	3,161,100
日精樹脂工業	11,600	905.00	10,498,000
オカダアイヨン	4,400	971.00	4,272,400
ワイエイシーホールディングス	5,900	483.00	2,849,700
小松製作所	627,200	2,180.00	1,367,296,000
住友重機械工業	79,300	2,460.00	195,078,000
日立建機	55,500	2,830.00	157,065,000
日工	19,100	658.00	12,567,800
巴工業	5,900	1,808.00	10,667,200
井関農機	13,900	1,232.00	17,124,800
TOWA	14,100	1,119.00	15,777,900
丸山製作所	2,900	1,260.00	3,654,000
北川鉄工所	6,300	1,725.00	10,867,500
ローツェ	6,100	4,875.00	29,737,500
タカキタ	5,000	583.00	2,915,000
クボタ	734,700	1,449.50	1,064,947,650
荏原実業	3,500	2,620.00	9,170,000
三菱化工機	4,800	1,789.00	8,587,200
月島機械	25,600	1,287.00	32,947,200
帝国電機製作所	11,500	1,310.00	15,065,000
新東工業	33,000	789.00	26,037,000
澁谷工業	12,100	3,080.00	37,268,000
アイチ コーポレーション	24,100	749.00	18,050,900
小森コーポレーション	35,300	780.00	27,534,000
鶴見製作所	10,700	1,962.00	20,993,400
住友精密工業	2,100	2,349.00	4,932,900
日本ギア工業	5,800	296.00	1,716,800
酒井重工業	2,700	2,240.00	6,048,000
荏原製作所	57,300	2,597.00	148,808,100
石井鐵工所	1,800	2,601.00	4,681,800
西島製作所	14,100	837.00	11,801,700
北越工業	14,300	1,025.00	14,657,500
ダイキン工業	176,400	15,850.00	2,795,940,000
オルガノ	5,000	6,060.00	30,300,000
トーヨーカネツ	6,100	2,128.00	12,980,800
栗田工業	75,000	2,987.00	224,025,000
椿本チエイン	19,800	2,785.00	55,143,000
大同工業	6,800	650.00	4,420,000

木村化工機	11,800	485.00	5,723,000	
アネスト岩田	21,600	863.00	18,640,800	
ダイフク	70,800	8,380.00	593,304,000	
サムコ	3,500	1,923.00	6,730,500	
加藤製作所	7,700	1,225.00	9,432,500	
油研工業	2,400	1,501.00	3,602,400	
タダノ	67,000	856.00	57,352,000	
フジテック	50,400	1,612.00	81,244,800	
C K D	38,000	1,858.00	70,604,000	
キトー	10,500	1,183.00	12,421,500	
平和	38,700	1,829.00	70,782,300	
理想科学工業	12,300	1,320.00	16,236,000	
S A N K Y O	30,800	2,775.00	85,470,000	
日本金銭機械	15,400	568.00	8,747,200	
マースグループホールディングス	8,800	1,634.00	14,379,200	
フクシマガリレイ	8,600	3,315.00	28,509,000	
オーイズミ	6,000	440.00	2,640,000	
ダイコク電機	6,400	1,262.00	8,076,800	
竹内製作所	23,200	1,779.00	41,272,800	
アマノ	36,300	2,329.00	84,542,700	
J U K I	19,300	624.00	12,043,200	
蛇の目マシン工業	12,800	461.00	5,900,800	
マックス	21,200	1,658.00	35,149,600	
グローリー	35,600	2,558.00	91,064,800	
新晃工業	12,900	1,533.00	19,775,700	
大和冷機工業	20,100	979.00	19,677,900	
セガサミーホールディングス	137,400	1,404.00	192,909,600	
日本ピストンリング	5,100	1,231.00	6,278,100	
リケン	6,400	2,828.00	18,099,200	
T P R	18,700	1,469.00	27,470,300	
ツバキ・ナカシマ	28,300	950.00	26,885,000	
ホシザキ	40,500	8,700.00	352,350,000	
大豊工業	11,400	531.00	6,053,400	
日本精工	260,800	788.00	205,510,400	
N T N	320,800	226.00	72,500,800	
ジェイテクト	132,900	869.00	115,490,100	
不二越	12,900	3,475.00	44,827,500	
日本トムソン	41,300	407.00	16,809,100	
T H K	80,600	2,800.00	225,680,000	
ユースン精機	10,800	697.00	7,527,600	
前澤給装工業	5,100	2,028.00	10,342,800	
イーグル工業	17,200	758.00	13,037,600	

前澤工業	9,400	353.00	3,318,200
日本ピラー工業	14,100	1,435.00	20,233,500
キッツ	56,200	718.00	40,351,600
マキタ	180,600	3,650.00	659,190,000
日立造船	110,100	410.00	45,141,000
三菱重工業	232,100	2,787.50	646,978,750
I H I	99,800	1,549.00	154,590,200
スター精密	21,400	1,288.00	27,563,200
日清紡ホールディングス	92,400	801.00	74,012,400
イビデン	84,900	2,852.00	242,134,800
コニカミノルタ	303,700	399.00	121,176,300
ブラザー工業	169,300	2,029.00	343,509,700
ミネベアミツミ	257,300	1,891.00	486,554,300
日立製作所	665,300	3,455.00	2,298,611,500
三菱電機	1,384,600	1,418.50	1,964,055,100
富士電機	83,500	2,879.00	240,396,500
東洋電機製造	5,100	1,266.00	6,456,600
安川電機	149,100	3,870.00	577,017,000
シンフォニアテクノロジー	18,000	1,091.00	19,638,000
明電舎	25,500	1,822.00	46,461,000
オリジン	3,800	1,500.00	5,700,000
山洋電気	6,800	4,900.00	33,320,000
デンヨー	11,900	1,920.00	22,848,000
東芝テック	17,400	3,745.00	65,163,000
芝浦メカトロニクス	2,600	2,722.00	7,077,200
マブチモーター	38,500	3,560.00	137,060,000
日本電産	333,300	6,622.00	2,207,112,600
トレックス・セミコンダクター	8,400	1,168.00	9,811,200
東光高岳	8,200	1,053.00	8,634,600
ダイヘン	15,200	3,615.00	54,948,000
ヤーマン	23,300	738.00	17,195,400
JVCケンウッド	115,700	176.00	20,363,200
ミマキエンジニアリング	13,600	408.00	5,548,800
第一精工	5,800	2,580.00	14,964,000
日新電機	32,600	1,122.00	36,577,200
大崎電気工業	27,800	518.00	14,400,400
オムロン	124,100	7,140.00	886,074,000
日東工業	20,400	1,911.00	38,984,400
I D E C	20,100	1,781.00	35,798,100
正興電機製作所	3,700	1,177.00	4,354,900
不二電機工業	2,700	1,284.00	3,466,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,500	1,906.00	88,629,000

サクサホールディングス	3,300	1,747.00	5,765,100
メルコホールディングス	5,000	2,697.00	13,485,000
テクノメディカ	3,400	1,812.00	6,160,800
日本電気	168,000	4,835.00	812,280,000
富士通	133,500	11,100.00	1,481,850,000
沖電気工業	56,400	1,066.00	60,122,400
岩崎通信機	6,100	853.00	5,203,300
電気興業	6,700	2,646.00	17,728,200
サンケン電気	15,200	2,492.00	37,878,400
ナカヨ	2,800	1,403.00	3,928,400
アイホン	7,900	1,585.00	12,521,500
ルネサスエレクトロニクス	663,200	559.00	370,728,800
セイコーエプソン	171,900	1,214.00	208,686,600
ワコム	94,100	486.00	45,732,600
アルバック	25,500	3,235.00	82,492,500
アクセル	6,400	845.00	5,408,000
E I Z O	10,800	4,020.00	43,416,000
日本信号	35,400	1,213.00	42,940,200
京三製作所	32,700	531.00	17,363,700
能美防災	18,600	2,014.00	37,460,400
ホーチキ	10,400	1,366.00	14,206,400
星和電機	7,600	721.00	5,479,600
エレコム	15,400	5,110.00	78,694,000
パナソニック	1,582,100	963.00	1,523,562,300
シャープ	160,300	1,167.00	187,070,100
アンリツ	89,200	2,123.00	189,371,600
富士通ゼネラル	37,600	2,105.00	79,148,000
ソニー	867,400	6,874.00	5,962,507,600
T D K	66,900	10,080.00	674,352,000
帝国通信工業	6,500	1,191.00	7,741,500
タムラ製作所	46,500	454.00	21,111,000
アルプスアルパイン	122,900	1,302.00	160,015,800
池上通信機	4,400	898.00	3,951,200
鈴木	7,400	794.00	5,875,600
日本トリム	2,000	3,235.00	6,470,000
ローランド ディー . ジー .	8,000	1,257.00	10,056,000
フォスター電機	14,600	1,225.00	17,885,000
S M K	3,600	2,560.00	9,216,000
ヨコオ	9,100	2,834.00	25,789,400
ホシデン	38,400	940.00	36,096,000
ヒロセ電機	21,500	12,870.00	276,705,000
日本航空電子工業	31,800	1,493.00	47,477,400

TOA	15,000	762.00	11,430,000
マクセルホールディングス	30,300	1,077.00	32,633,100
古野電気	18,400	902.00	16,596,800
ユニデンホールディングス	3,900	1,992.00	7,768,800
スミダコーポレーション	11,300	736.00	8,316,800
アイコム	7,700	2,976.00	22,915,200
リオン	6,000	2,413.00	14,478,000
本多通信工業	13,000	437.00	5,681,000
横河電機	127,100	1,552.00	197,259,200
新電元工業	4,900	2,658.00	13,024,200
アズビル	87,400	2,749.00	240,262,600
東亜ディーケーケー	7,400	909.00	6,726,600
日本光電工業	57,400	3,595.00	206,353,000
チノー	4,900	1,445.00	7,080,500
共和電業	14,800	408.00	6,038,400
日本電子材料	5,600	1,028.00	5,756,800
堀場製作所	27,400	5,670.00	155,358,000
アドバンテスト	103,000	5,320.00	547,960,000
小野測器	6,700	543.00	3,638,100
エスペック	12,600	1,762.00	22,201,200
キーエンス	125,500	44,350.00	5,565,925,000
日置電機	7,400	3,460.00	25,604,000
シスメックス	99,000	8,610.00	852,390,000
日本マイクロニクス	24,700	1,033.00	25,515,100
メガチップス	13,100	1,917.00	25,112,700
OBARA GROUP	8,200	3,200.00	26,240,000
澤藤電機	1,900	1,584.00	3,009,600
原田工業	7,100	828.00	5,878,800
コーセル	19,000	934.00	17,746,000
イリソ電子工業	11,800	3,435.00	40,533,000
オブテックスグループ	23,100	1,455.00	33,610,500
千代田インテグレ	6,700	1,767.00	11,838,900
アイ・オー・データ機器	5,000	971.00	4,855,000
レーザーテック	60,900	8,850.00	538,965,000
スタンレー電気	97,500	2,619.00	255,352,500
岩崎電気	5,700	1,819.00	10,368,300
ウシオ電機	76,800	1,281.00	98,380,800
岡谷電機産業	12,300	325.00	3,997,500
ヘリオス テクノ ホールディング	14,200	362.00	5,140,400
エノモト	4,600	1,093.00	5,027,800
日本セラミック	14,300	2,066.00	29,543,800
遠藤照明	7,800	566.00	4,414,800

古河電池	10,700	601.00	6,430,700
双信電機	8,000	397.00	3,176,000
山一電機	10,300	1,641.00	16,902,300
図研	9,200	2,602.00	23,938,400
日本電子	27,500	3,220.00	88,550,000
カシオ計算機	122,500	1,897.00	232,382,500
ファナック	131,600	19,215.00	2,528,694,000
日本シイエムケイ	33,800	408.00	13,790,400
エンプラス	7,300	2,301.00	16,797,300
大真空	5,300	1,995.00	10,573,500
ローム	61,500	7,250.00	445,875,000
浜松ホトニクス	99,400	4,880.00	485,072,000
三井ハイテック	15,600	1,399.00	21,824,400
新光電気工業	46,800	1,368.00	64,022,400
京セラ	194,900	5,831.00	1,136,461,900
太陽誘電	61,700	3,000.00	185,100,000
村田製作所	406,800	6,015.00	2,446,902,000
双葉電子工業	22,400	996.00	22,310,400
北陸電気工業	6,100	947.00	5,776,700
ニチコン	47,600	777.00	36,985,200
日本ケミコン	10,500	1,551.00	16,285,500
K O A	21,400	989.00	21,164,600
市光工業	21,600	541.00	11,685,600
小糸製作所	83,100	4,565.00	379,351,500
ミツバ	26,600	438.00	11,650,800
S C R E E Nホールディングス	24,000	4,825.00	115,800,000
キャノン電子	14,800	1,720.00	25,456,000
キャノン	745,400	2,219.00	1,654,042,600
リコー	352,400	796.00	280,510,400
象印マホービン	40,900	1,695.00	69,325,500
M U T O Hホールディングス	2,100	1,585.00	3,328,500
東京エレクトロン	87,900	21,500.00	1,889,850,000
トヨタ紡織	40,400	1,518.00	61,327,200
芦森工業	2,900	914.00	2,650,600
ユニプレス	26,900	1,044.00	28,083,600
豊田自動織機	112,100	5,510.00	617,671,000
モリタホールディングス	24,200	1,813.00	43,874,600
三櫻工業	17,600	814.00	14,326,400
デンソー	304,900	4,131.00	1,259,541,900
東海理化電機製作所	36,500	1,577.00	57,560,500
三井E & Sホールディングス	50,000	565.00	28,250,000
川崎重工業	107,700	1,706.00	183,736,200

名村造船所	44,600	174.00	7,760,400
日本車輛製造	5,000	2,789.00	13,945,000
三菱ロジスネクスト	18,300	1,049.00	19,196,700
近畿車輛	2,100	1,263.00	2,652,300
日産自動車	1,633,000	400.90	654,669,700
いすゞ自動車	401,200	1,009.50	405,011,400
トヨタ自動車	1,544,900	6,755.00	10,435,799,500
日野自動車	172,900	729.00	126,044,100
三菱自動車工業	512,500	304.00	155,800,000
エフテック	9,800	525.00	5,145,000
レシップホールディングス	5,400	593.00	3,202,200
G M B	2,600	685.00	1,781,000
ファルテック	2,500	730.00	1,825,000
武蔵精密工業	30,900	971.00	30,003,900
日産車体	27,000	1,014.00	27,378,000
新明和工業	37,300	1,067.00	39,799,100
極東開発工業	25,700	1,377.00	35,388,900
日信工業	28,200	2,210.00	62,322,000
トピー工業	11,400	1,330.00	15,162,000
ティラド	5,100	1,413.00	7,206,300
曙ブレーキ工業	76,000	191.00	14,516,000
タチエス	22,800	894.00	20,383,200
N O K	74,500	1,379.00	102,735,500
フタバ産業	38,600	523.00	20,187,800
K Y B	15,500	2,135.00	33,092,500
大同メタル工業	26,700	570.00	15,219,000
プレス工業	68,900	266.00	18,327,400
ミクニ	17,800	295.00	5,251,000
太平洋工業	29,100	987.00	28,721,700
ケーヒン	31,800	2,544.00	80,899,200
河西工業	18,800	517.00	9,719,600
アイシン精機	114,000	3,395.00	387,030,000
マツダ	407,400	689.00	280,698,600
今仙電機製作所	12,900	747.00	9,636,300
本田技研工業	1,090,200	2,784.00	3,035,116,800
スズキ	274,400	3,746.00	1,027,902,400
S U B A R U	429,800	2,378.50	1,022,279,300
安永	6,700	1,019.00	6,827,300
ヤマハ発動機	180,600	1,555.00	280,833,000
ショーワ	32,700	2,249.00	73,542,300
T B K	16,600	465.00	7,719,000
エクセディ	18,800	1,733.00	32,580,400

豊田合成	44,700	2,303.00	102,944,100
愛三工業	21,800	580.00	12,644,000
盟和産業	2,200	967.00	2,127,400
日本プラスト	11,000	469.00	5,159,000
ヨロズ	13,000	1,160.00	15,080,000
エフ・シー・シー	22,700	1,830.00	41,541,000
シマノ	51,800	19,810.00	1,026,158,000
テイ・エス テック	32,200	3,030.00	97,566,000
ジャムコ	7,000	792.00	5,544,000
テルモ	391,800	4,230.00	1,657,314,000
クリエートメディック	4,600	982.00	4,517,200
日機装	41,600	998.00	41,516,800
日本エム・ディ・エム	8,000	1,729.00	13,832,000
島津製作所	165,500	2,915.00	482,432,500
JMS	11,700	842.00	9,851,400
長野計器	10,100	1,048.00	10,584,800
ブイ・テクノロジー	6,500	4,095.00	26,617,500
東京計器	8,800	967.00	8,509,600
愛知時計電機	1,800	4,375.00	7,875,000
インターアクション	7,400	2,209.00	16,346,600
オーバル	12,500	229.00	2,862,500
東京精密	25,100	3,485.00	87,473,500
マニー	55,200	2,840.00	156,768,000
ニコン	211,500	990.00	209,385,000
トプコン	69,800	945.00	65,961,000
オリンパス	766,100	1,871.50	1,433,756,150
理研計器	12,200	2,426.00	29,597,200
タムロン	11,200	2,031.00	22,747,200
H O Y A	276,500	10,110.00	2,795,415,000
シード	5,900	795.00	4,690,500
ノーリツ鋼機	9,400	1,445.00	13,583,000
エー・アンド・デイ	12,700	754.00	9,575,800
朝日インテック	156,800	3,300.00	517,440,000
シチズン時計	162,300	385.00	62,485,500
リズム時計工業	4,400	608.00	2,675,200
大研医器	9,600	635.00	6,096,000
メニコン	19,600	5,480.00	107,408,000
シンシア	1,600	451.00	721,600
松風	6,300	1,637.00	10,313,100
セイコーホールディングス	19,600	1,824.00	35,750,400
ニプロ	95,800	1,260.00	120,708,000
中本パックス	3,500	1,595.00	5,582,500

スノーピーク	7,400	1,001.00	7,407,400
パラマウントベッドホールディングス	14,600	4,185.00	61,101,000
トランザクション	7,600	1,029.00	7,820,400
粧美堂	4,000	361.00	1,444,000
ニホンフラッシュ	12,900	1,403.00	18,098,700
前田工織	15,300	2,335.00	35,725,500
永大産業	18,100	301.00	5,448,100
アートネイチャー	14,800	638.00	9,442,400
バンダイナムコホールディングス	143,100	5,996.00	858,027,600
アイフィスジャパン	3,500	682.00	2,387,000
共立印刷	23,100	143.00	3,303,300
S H O E I	12,100	2,467.00	29,850,700
フランスベッドホールディングス	19,600	842.00	16,503,200
パイロットコーポレーション	22,600	3,685.00	83,281,000
萩原工業	7,700	1,402.00	10,795,400
トッパン・フォームズ	29,700	1,121.00	33,293,700
フジシールインターナショナル	31,000	2,224.00	68,944,000
タカラトミー	62,100	921.00	57,194,100
廣濟堂	9,600	847.00	8,131,200
エステールホールディングス	3,700	601.00	2,223,700
アーク	52,800	113.00	5,966,400
タカノ	5,400	707.00	3,817,800
プロネクサス	11,900	1,095.00	13,030,500
ホクシン	8,500	125.00	1,062,500
ウッドワン	4,700	1,126.00	5,292,200
大建工業	9,300	1,728.00	16,070,400
凸版印刷	195,400	1,843.00	360,122,200
大日本印刷	181,200	2,449.00	443,758,800
共同印刷	4,300	2,996.00	12,882,800
N I S S H A	28,400	953.00	27,065,200
光村印刷	1,200	1,512.00	1,814,400
T A K A R A & C O M P A N Y	6,700	1,887.00	12,642,900
アシックス	114,300	1,145.00	130,873,500
ツツミ	4,300	1,725.00	7,417,500
小松ウオール工業	4,200	1,935.00	8,127,000
ヤマハ	82,300	5,240.00	431,252,000
河合楽器製作所	4,300	2,931.00	12,603,300
クリナップ	12,900	520.00	6,708,000
ピジョン	83,700	4,200.00	351,540,000
オリバー	2,900	2,625.00	7,612,500
兼松サステック	900	1,439.00	1,295,100
キングジム	11,500	944.00	10,856,000

リンテック	32,900	2,565.00	84,388,500
イトーキ	29,400	409.00	12,024,600
任天堂	84,900	43,540.00	3,696,546,000
三菱鉛筆	22,800	1,474.00	33,607,200
タカスタンダード	28,600	1,574.00	45,016,400
コクヨ	66,400	1,402.00	93,092,800
ナカバヤシ	13,600	642.00	8,731,200
グロープライド	6,200	2,321.00	14,390,200
オカムラ	48,300	882.00	42,600,600
美津濃	12,600	2,043.00	25,741,800
東京電力ホールディングス	1,105,300	363.00	401,223,900
中部電力	423,600	1,451.00	614,643,600
関西電力	524,600	1,073.50	563,158,100
中国電力	199,700	1,480.00	295,556,000
北陸電力	126,600	706.00	89,379,600
東北電力	345,900	1,116.00	386,024,400
四国電力	124,700	808.00	100,757,600
九州電力	285,400	896.00	255,718,400
北海道電力	129,600	435.00	56,376,000
沖縄電力	26,890	2,018.00	54,264,020
電源開発	110,200	2,033.00	224,036,600
エフオン	7,400	623.00	4,610,200
イーレックス	19,700	1,472.00	28,998,400
レノバ	23,100	942.00	21,760,200
東京瓦斯	266,300	2,570.50	684,524,150
大阪瓦斯	268,700	2,153.00	578,511,100
東邦瓦斯	68,100	5,310.00	361,611,000
北海道瓦斯	7,400	1,563.00	11,566,200
広島ガス	28,500	360.00	10,260,000
西部瓦斯	15,600	2,627.00	40,981,200
静岡ガス	39,300	990.00	38,907,000
メタウォーター	6,700	4,805.00	32,193,500
SBSホールディングス	12,000	2,403.00	28,836,000
東武鉄道	144,300	3,820.00	551,226,000
相鉄ホールディングス	44,300	3,095.00	137,108,500
東急	349,200	1,708.00	596,433,600
京浜急行電鉄	177,800	1,801.00	320,217,800
小田急電鉄	205,900	2,689.00	553,665,100
京王電鉄	71,800	6,400.00	459,520,000
京成電鉄	96,400	3,535.00	340,774,000
富士急行	18,900	3,495.00	66,055,500
新京成電鉄	3,600	2,140.00	7,704,000

東日本旅客鉄道	243,700	8,450.00	2,059,265,000
西日本旅客鉄道	123,400	6,951.00	857,753,400
東海旅客鉄道	115,100	18,435.00	2,121,868,500
西武ホールディングス	185,800	1,408.00	261,606,400
鴻池運輸	22,000	1,240.00	27,280,000
西日本鉄道	38,400	2,906.00	111,590,400
ハマキョウレックス	10,600	3,250.00	34,450,000
サカイ引越センター	7,300	6,110.00	44,603,000
近鉄グループホールディングス	131,100	5,290.00	693,519,000
阪急阪神ホールディングス	174,900	3,980.00	696,102,000
南海電気鉄道	62,200	2,611.00	162,404,200
京阪ホールディングス	58,400	5,120.00	299,008,000
神戸電鉄	3,100	3,770.00	11,687,000
名古屋鉄道	107,800	3,250.00	350,350,000
山陽電気鉄道	9,400	2,240.00	21,056,000
日本通運	45,400	5,540.00	251,516,000
ヤマトホールディングス	229,900	2,384.00	548,081,600
山九	36,400	4,395.00	159,978,000
丸運	7,500	239.00	1,792,500
丸全昭和運輸	10,600	2,874.00	30,464,400
センコーグループホールディングス	72,300	860.00	62,178,000
トナミホールディングス	3,100	6,040.00	18,724,000
ニッコンホールディングス	46,900	2,182.00	102,335,800
日本石油輸送	1,400	3,175.00	4,445,000
福山通運	16,800	3,540.00	59,472,000
セイノーホールディングス	98,200	1,474.00	144,746,800
エスライン	3,900	1,005.00	3,919,500
神奈川中央交通	3,200	4,130.00	13,216,000
日立物流	24,000	2,963.00	71,112,000
丸和運輸機関	13,800	2,953.00	40,751,400
C & F ロジホールディングス	13,300	1,525.00	20,282,500
九州旅客鉄道	115,000	3,055.00	351,325,000
S Gホールディングス	137,600	3,515.00	483,664,000
日本郵船	110,300	1,553.00	171,295,900
商船三井	83,400	1,909.00	159,210,600
川崎汽船	40,400	1,111.00	44,884,400
N S ユナイテッド海運	7,900	1,420.00	11,218,000
飯野海運	64,800	342.00	22,161,600
共栄タンカー	3,400	886.00	3,012,400
乾汽船	7,600	1,163.00	8,838,800
日本航空	231,900	2,117.00	490,932,300
A N A ホールディングス	239,700	2,599.00	622,980,300

パスコ	2,500	1,453.00	3,632,500
トランコム	3,700	6,730.00	24,901,000
日新	11,300	1,595.00	18,023,500
三菱倉庫	41,600	2,768.00	115,148,800
三井倉庫ホールディングス	15,000	1,603.00	24,045,000
住友倉庫	47,200	1,340.00	63,248,000
澁澤倉庫	7,200	2,124.00	15,292,800
東陽倉庫	23,700	340.00	8,058,000
日本トランスシティ	28,900	518.00	14,970,200
ケイヒン	2,500	1,310.00	3,275,000
中央倉庫	8,000	1,018.00	8,144,000
川西倉庫	2,400	1,016.00	2,438,400
安田倉庫	10,800	891.00	9,622,800
ファイズホールディングス	2,800	1,105.00	3,094,000
東洋埠頭	4,000	1,349.00	5,396,000
宇徳	11,200	459.00	5,140,800
上組	73,200	2,105.00	154,086,000
サンリツ	3,100	601.00	1,863,100
キムラユニティー	3,500	1,039.00	3,636,500
キューソー流通システム	3,300	1,751.00	5,778,300
近鉄エクスプレス	27,900	1,737.00	48,462,300
東海運	7,500	266.00	1,995,000
エーアイティー	9,300	789.00	7,337,700
内外トランスライン	4,600	1,036.00	4,765,600
日本コンセプト	4,200	1,501.00	6,304,200
NEC ネットエスアイ	38,700	2,025.00	78,367,500
クロスキャット	3,800	1,036.00	3,936,800
システナ	48,600	1,540.00	74,844,000
デジタルアーツ	6,700	8,590.00	57,553,000
日鉄ソリューションズ	20,500	2,952.00	60,516,000
キューブシステム	7,600	772.00	5,867,200
エイジア	2,700	1,362.00	3,677,400
コア	6,000	1,233.00	7,398,000
ラクーンホールディングス	6,400	780.00	4,992,000
ソリトンシステムズ	6,200	1,344.00	8,332,800
ソフトクリエイティブホールディングス	6,100	2,220.00	13,542,000
T I S	136,000	2,297.00	312,392,000
ネオス	5,400	716.00	3,866,400
電算システム	5,300	3,510.00	18,603,000
グリー	84,000	442.00	37,128,000
コーエーテクモホールディングス	27,900	3,110.00	86,769,000
三菱総合研究所	5,900	4,145.00	24,455,500

電算	1,600	2,173.00	3,476,800
A G S	8,000	851.00	6,808,000
ファインデックス	11,700	973.00	11,384,100
ブレインパッド	3,500	4,945.00	17,307,500
K L a b	26,300	779.00	20,487,700
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,700	960.00	16,032,000
イーブুকイニシアティブジャパン	2,100	2,505.00	5,260,500
ネクソン	379,100	2,246.00	851,458,600
アイスタイル	38,900	308.00	11,981,200
エムアップホールディングス	4,000	2,639.00	10,556,000
エイチーム	9,700	768.00	7,449,600
エニグモ	13,100	1,010.00	13,231,000
テクノスジャパン	11,000	604.00	6,644,000
コロプラ	44,800	1,077.00	48,249,600
ブロードリーフ	67,800	559.00	37,900,200
クロス・マーケティンググループ	6,900	333.00	2,297,700
デジタルハーツホールディングス	7,500	877.00	6,577,500
システム情報	10,400	1,152.00	11,980,800
メディアドゥホールディングス	4,300	4,305.00	18,511,500
じげん	34,400	379.00	13,037,600
エンカレッジ・テクノロジー	3,300	851.00	2,808,300
サイバーリンクス	2,300	1,796.00	4,130,800
フィックスターズ	14,700	1,317.00	19,359,900
C A R T A H O L D I N G S	6,800	1,073.00	7,296,400
オブティム	7,200	2,775.00	19,980,000
セレス	4,700	1,247.00	5,860,900
S H I F T	5,500	10,180.00	55,990,000
ティーガイア	12,200	2,290.00	27,938,000
セック	2,100	3,605.00	7,570,500
日本アジアグループ	14,300	317.00	4,533,100
テクマトリックス	9,700	3,275.00	31,767,500
プロシップ	4,200	1,303.00	5,472,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32,900	1,753.00	57,673,700
G M O ペイメントゲートウェイ	28,800	12,130.00	349,344,000
ザッパラス	6,600	384.00	2,534,400
システムリサーチ	3,800	1,893.00	7,193,400
インターネットイニシアティブ	20,200	3,805.00	76,861,000
さくらインターネット	15,000	649.00	9,735,000
ヴィンクス	4,100	1,088.00	4,460,800
G M O クラウド	2,600	5,570.00	14,482,000
S R A ホールディングス	7,300	2,487.00	18,155,100
システムインテグレータ	4,600	900.00	4,140,000

朝日ネット	9,900	1,077.00	10,662,300
e B A S E	16,500	1,300.00	21,450,000
アバント	13,200	1,127.00	14,876,400
アドソル日進	4,900	2,593.00	12,705,700
フリービット	7,400	876.00	6,482,400
コムチュア	15,300	2,967.00	45,395,100
サイバーコム	2,600	1,894.00	4,924,400
アステリア	8,800	510.00	4,488,000
アイル	7,700	1,776.00	13,675,200
マークラインズ	6,900	2,031.00	14,013,900
メディカル・データ・ビジョン	10,600	1,072.00	11,363,200
ショーケース	3,600	634.00	2,282,400
モバイルファクトリー	3,300	1,190.00	3,927,000
テラスカイ	5,000	2,841.00	14,205,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,500	1,494.00	8,217,000
P C Iホールディングス	5,400	964.00	5,205,600
パイプドHD	1,900	1,586.00	3,013,400
アイビーシー	2,500	1,023.00	2,557,500
ネオジャパン	2,800	1,372.00	3,841,600
P R T I M E S	1,300	2,415.00	3,139,500
ランドコンピュータ	2,300	1,119.00	2,573,700
ダブルスタンダード	1,800	4,885.00	8,793,000
オープンドア	6,900	1,256.00	8,666,400
マイネット	4,400	1,214.00	5,341,600
アカツキ	4,900	4,075.00	19,967,500
ベネフィットジャパン	1,200	1,562.00	1,874,400
U b i c o mホールディングス	3,200	1,648.00	5,273,600
L I N E	31,200	5,390.00	168,168,000
カナミックネットワーク	12,700	896.00	11,379,200
ノムラシステムコーポレーション	3,500	514.00	1,799,000
チェンジ	4,800	5,280.00	25,344,000
シンクロ・フード	6,500	366.00	2,379,000
オークネット	8,600	1,130.00	9,718,000
セグエグループ	3,300	905.00	2,986,500
エイトレッド	2,400	1,981.00	4,754,400
A O I T Y O H o l d i n g s	14,300	505.00	7,221,500
マクロミル	28,100	731.00	20,541,100
ビーグリー	2,800	1,564.00	4,379,200
オロ	3,700	2,941.00	10,881,700
ユーザーローカル	1,400	3,220.00	4,508,000
テモナ	3,300	774.00	2,554,200
ニーズウェル	3,000	705.00	2,115,000

サインポスト	3,000	1,711.00	5,133,000
ソルクシーズ	6,200	718.00	4,451,600
フェイス	5,200	664.00	3,452,800
プロトコーポレーション	12,400	1,154.00	14,309,600
ハイマックス	1,700	1,983.00	3,371,100
野村総合研究所	192,700	2,848.00	548,809,600
サイバネットシステム	10,100	676.00	6,827,600
C Eホールディングス	7,700	497.00	3,826,900
日本システム技術	2,400	1,328.00	3,187,200
インテージホールディングス	17,300	870.00	15,051,000
東邦システムサイエンス	3,900	896.00	3,494,400
ソースネクスト	65,300	328.00	21,418,400
インフォコム	15,000	2,807.00	42,105,000
HEROZ	2,000	3,945.00	7,890,000
ラクスル	11,000	2,906.00	31,966,000
F I G	15,700	273.00	4,286,100
システムサポート	3,200	1,970.00	6,304,000
イーソル	6,700	1,470.00	9,849,000
アルテリア・ネットワークス	15,200	1,983.00	30,141,600
東海ソフト	1,200	1,360.00	1,632,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,106.00	2,875,600
トピラシステムズ	1,800	1,786.00	3,214,800
フォーカスシステムズ	8,700	922.00	8,021,400
クレスコ	8,400	1,561.00	13,112,400
フジ・メディア・ホールディングス	131,100	1,082.00	141,850,200
オービック	47,100	18,680.00	879,828,000
ジャストシステム	22,100	7,400.00	163,540,000
T D Cソフト	12,200	948.00	11,565,600
Zホールディングス	1,866,400	440.00	821,216,000
トレンドマイクロ	60,500	5,920.00	358,160,000
I Dホールディングス	5,400	1,522.00	8,218,800
日本オラクル	27,600	12,580.00	347,208,000
アルファシステムズ	4,300	3,960.00	17,028,000
フューチャー	16,600	1,789.00	29,697,400
C A C Holdings	9,100	1,298.00	11,811,800
S Bテクノロジー	5,000	2,793.00	13,965,000
トーセ	4,000	861.00	3,444,000
オービックビジネスコンサルタント	13,900	5,600.00	77,840,000
伊藤忠テクノソリューションズ	62,000	3,640.00	225,680,000
アイティフォー	16,800	725.00	12,180,000
東計電算	2,100	4,050.00	8,505,000
エクスネット	2,400	952.00	2,284,800

大塚商会	73,600	5,200.00	382,720,000
サイボウズ	16,000	2,774.00	44,384,000
ソフトブレーン	8,500	529.00	4,496,500
電通国際情報サービス	8,500	5,030.00	42,755,000
A C C E S S	13,000	958.00	12,454,000
デジタルガレージ	24,500	3,825.00	93,712,500
E Mシステムズ	19,400	840.00	16,296,000
ウェザーニューズ	4,700	3,775.00	17,742,500
C I J	9,600	946.00	9,081,600
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,692.00	4,576,400
日本エンタープライズ	14,800	278.00	4,114,400
WOWOW	6,600	2,560.00	16,896,000
スカラ	9,400	707.00	6,645,800
インテリジェント ウェイブ	8,300	773.00	6,415,900
I M A G I C A G R O U P	12,300	422.00	5,190,600
ネットワンシステムズ	51,800	3,260.00	168,868,000
システムソフト	32,700	84.00	2,746,800
アルゴグラフィックス	11,600	3,715.00	43,094,000
マーベラス	21,100	780.00	16,458,000
エイベックス	23,600	953.00	22,490,800
日本ユニシス	42,500	3,330.00	141,525,000
兼松エレクトロニクス	7,500	3,970.00	29,775,000
東京放送ホールディングス	82,800	1,693.00	140,180,400
日本テレビホールディングス	113,600	1,244.00	141,318,400
朝日放送グループホールディングス	13,900	735.00	10,216,500
テレビ朝日ホールディングス	37,500	1,692.00	63,450,000
スカパーJ S A Tホールディングス	90,000	439.00	39,510,000
テレビ東京ホールディングス	11,300	2,452.00	27,707,600
日本BS放送	4,800	1,128.00	5,414,400
ビジョン	13,000	851.00	11,063,000
スマートバリュー	3,800	1,185.00	4,503,000
ワイヤレスゲート	6,900	564.00	3,891,600
コネクシオ	7,900	1,482.00	11,707,800
クロップス	2,900	711.00	2,061,900
日本電信電話	1,816,300	2,444.00	4,439,037,200
K D D I	1,012,600	3,136.00	3,175,513,600
ソフトバンク	1,234,900	1,366.00	1,686,873,400
光通信	14,000	23,610.00	330,540,000
N T T ドコモ	971,600	2,951.50	2,867,677,400
エムティーアイ	13,600	601.00	8,173,600
G M Oインターネット	53,700	2,728.00	146,493,600
ファイバーゲート	4,600	1,386.00	6,375,600

アйдママーケティングコミュニケーション	4,600	489.00	2,249,400	
KADOKAWA	36,700	1,772.00	65,032,400	
学研ホールディングス	18,400	1,661.00	30,562,400	
ゼンリン	27,300	1,364.00	37,237,200	
昭文社ホールディングス	7,000	404.00	2,828,000	
インプレスホールディングス	11,200	152.00	1,702,400	
アイネット	7,200	1,537.00	11,066,400	
松竹	9,000	14,100.00	126,900,000	
東宝	80,200	3,960.00	317,592,000	
東映	5,100	14,690.00	74,919,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	362,000	1,245.00	450,690,000	
ピー・シー・エー	2,400	4,200.00	10,080,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	2,657.00	6,376,800	
D T S	30,500	2,295.00	69,997,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,000	5,230.00	303,340,000	
シーイーシー	14,700	1,870.00	27,489,000	
カブコン	64,100	3,805.00	243,900,500	
アイ・エス・ピー	2,800	2,131.00	5,966,800	
ジャステック	8,900	1,135.00	10,101,500	
S C S K	31,400	5,270.00	165,478,000	
日本システムウエア	4,600	2,357.00	10,842,200	
アイネス	13,600	1,402.00	19,067,200	
T K C	11,500	5,640.00	64,860,000	
富士ソフト	17,400	4,540.00	78,996,000	
N S D	43,800	1,684.00	73,759,200	
コナミホールディングス	49,400	3,785.00	186,979,000	
福井コンピュータホールディングス	5,400	3,140.00	16,956,000	
J B C Cホールディングス	9,300	1,635.00	15,205,500	
ミロク情報サービス	12,100	2,506.00	30,322,600	
ソフトバンクグループ	1,078,100	4,832.00	5,209,379,200	
ハウスイ	1,100	921.00	1,013,100	
高千穂交易	5,300	981.00	5,199,300	
カワニシホールディングス	1,600	1,339.00	2,142,400	
伊藤忠食品	3,400	4,690.00	15,946,000	
エレマテック	12,800	890.00	11,392,000	
J A L U X	3,900	1,813.00	7,070,700	
あらた	10,900	4,555.00	49,649,500	
トーメンデバイス	2,100	3,540.00	7,434,000	
東京エレクトロン デバイス	4,900	2,824.00	13,837,600	
フィールズ	10,400	384.00	3,993,600	
双日	753,200	251.00	189,053,200	
アルフレッサ ホールディングス	151,600	2,173.00	329,426,800	

横浜冷凍	35,700	918.00	32,772,600
ラサ商事	7,200	903.00	6,501,600
アルコニックス	14,500	1,271.00	18,429,500
神戸物産	47,100	5,580.00	262,818,000
ハイパー	2,100	581.00	1,220,100
あい ホールディングス	19,500	1,444.00	28,158,000
ディーブイエックス	4,900	935.00	4,581,500
ダイワボウホールディングス	11,600	7,230.00	83,868,000
マクニカ・富士エレホールディングス	32,500	1,733.00	56,322,500
ラクト・ジャパン	5,100	3,840.00	19,584,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,700	1,066.00	27,396,200
八洲電機	10,600	901.00	9,550,600
メディアスホールディングス	7,800	981.00	7,651,800
レスターホールディングス	14,200	2,078.00	29,507,600
ジューテックホールディングス	3,100	980.00	3,038,000
大光	5,800	684.00	3,967,200
O C H Iホールディングス	4,000	1,451.00	5,804,000
T O K A Iホールディングス	72,100	1,006.00	72,532,600
黒谷	3,800	492.00	1,869,600
C o m i n i x	2,400	752.00	1,804,800
三洋貿易	13,700	960.00	13,152,000
ビューティガレージ	2,200	1,742.00	3,832,400
ウイン・パートナーズ	9,900	1,021.00	10,107,900
ミタチ産業	4,100	608.00	2,492,800
シップヘルスケアホールディングス	21,900	4,660.00	102,054,000
明治電機工業	4,300	1,375.00	5,912,500
デリカフーズホールディングス	4,800	650.00	3,120,000
スターティアホールディングス	3,100	730.00	2,263,000
コメダホールディングス	29,700	1,865.00	55,390,500
ピーバンドットコム	1,400	1,000.00	1,400,000
アセンテック	1,500	3,120.00	4,680,000
富士興産	4,200	512.00	2,150,400
協栄産業	1,500	1,235.00	1,852,500
小野建	12,200	1,294.00	15,786,800
南陽	3,000	1,480.00	4,440,000
佐島電機	9,300	840.00	7,812,000
エコトレーディング	3,200	521.00	1,667,200
伯東	8,300	986.00	8,183,800
コンドーテック	10,600	1,063.00	11,267,800
中山福	7,900	447.00	3,531,300
ナガイレーベン	18,100	2,670.00	48,327,000
三菱食品	15,000	2,725.00	40,875,000

松田産業	10,000	1,445.00	14,450,000
第一興商	20,300	3,790.00	76,937,000
メディパルホールディングス	147,200	2,137.00	314,566,400
S P K	5,900	1,411.00	8,324,900
萩原電気ホールディングス	5,100	2,222.00	11,332,200
アズワン	8,900	11,890.00	105,821,000
スズデン	4,700	1,202.00	5,649,400
尾家産業	4,000	1,490.00	5,960,000
シモジマ	8,400	1,259.00	10,575,600
ドウシシャ	12,900	1,566.00	20,201,400
小津産業	3,000	1,804.00	5,412,000
高速	8,100	1,474.00	11,939,400
たけびし	4,800	1,467.00	7,041,600
リックス	3,100	1,525.00	4,727,500
丸文	12,100	483.00	5,844,300
ハピネット	11,400	1,071.00	12,209,400
橋本総業ホールディングス	2,800	1,862.00	5,213,600
日本ライフライン	40,400	1,452.00	58,660,800
タカショー	8,900	471.00	4,191,900
マルカ	4,800	1,845.00	8,856,000
I D O M	36,800	518.00	19,062,400
進和	8,100	1,929.00	15,624,900
エスケイジャパン	3,000	313.00	939,000
ダイトロン	5,800	1,695.00	9,831,000
シークス	17,400	1,060.00	18,444,000
田中商事	4,200	693.00	2,910,600
オーハシテクニカ	7,700	1,626.00	12,520,200
白銅	4,900	1,414.00	6,928,600
伊藤忠商事	953,800	2,310.00	2,203,278,000
丸紅	1,419,500	523.30	742,824,350
高島	2,200	1,685.00	3,707,000
長瀬産業	76,700	1,338.00	102,624,600
蝶理	8,700	1,821.00	15,842,700
豊田通商	152,200	2,730.00	415,506,000
三共生興	20,700	449.00	9,294,300
兼松	50,900	1,337.00	68,053,300
ツカモトコーポレーション	2,400	1,114.00	2,673,600
三井物産	1,180,800	1,635.50	1,931,198,400
日本紙パルプ商事	7,800	3,895.00	30,381,000
カメイ	17,800	1,076.00	19,152,800
東都水産	1,700	3,235.00	5,499,500
O U G ホールディングス	2,200	2,684.00	5,904,800

スターゼン	5,000	4,630.00	23,150,000
山善	53,300	936.00	49,888,800
椿本興業	2,500	3,265.00	8,162,500
住友商事	860,400	1,298.00	1,116,799,200
内田洋行	5,400	5,640.00	30,456,000
三菱商事	957,000	2,515.00	2,406,855,000
第一実業	6,700	3,775.00	25,292,500
キャノンマーケティングジャパン	33,800	2,196.00	74,224,800
西華産業	7,700	1,208.00	9,301,600
佐藤商事	11,300	903.00	10,203,900
菱洋エレクトロ	13,800	2,672.00	36,873,600
東京産業	12,400	559.00	6,931,600
ユアサ商事	12,900	3,155.00	40,699,500
神鋼商事	3,400	1,950.00	6,630,000
トルク	8,200	302.00	2,476,400
阪和興業	25,500	1,986.00	50,643,000
正栄食品工業	8,800	4,400.00	38,720,000
カナデン	11,100	1,275.00	14,152,500
菱電商事	9,800	1,413.00	13,847,400
フルサト工業	7,500	1,445.00	10,837,500
岩谷産業	30,300	3,800.00	115,140,000
ナイス	5,800	832.00	4,825,600
昭光通商	4,400	611.00	2,688,400
ニチモウ	2,100	1,817.00	3,815,700
極東貿易	3,900	1,480.00	5,772,000
イワキ	17,900	490.00	8,771,000
三愛石油	33,600	1,104.00	37,094,400
稲畑産業	30,000	1,319.00	39,570,000
G S Iクレオス	3,400	1,158.00	3,937,200
明和産業	12,600	491.00	6,186,600
クワザワ	4,900	525.00	2,572,500
ヤマエ久野	9,900	1,264.00	12,513,600
ワキタ	29,100	1,032.00	30,031,200
東邦ホールディングス	43,800	2,151.00	94,213,800
サンゲツ	37,200	1,595.00	59,334,000
ミツウロコグループホールディングス	20,100	1,204.00	24,200,400
シナネンホールディングス	5,600	2,730.00	15,288,000
伊藤忠エネクス	30,200	862.00	26,032,400
サンリオ	38,300	1,806.00	69,169,800
サンワテクノス	9,700	890.00	8,633,000
リョーサン	15,100	2,440.00	36,844,000
新光商事	21,400	906.00	19,388,400

トーホー	6,200	1,894.00	11,742,800
三信電気	7,300	1,654.00	12,074,200
東陽テクニカ	14,600	1,046.00	15,271,600
モスフードサービス	17,900	3,000.00	53,700,000
加賀電子	13,600	2,335.00	31,756,000
ソーダニッカ	14,100	525.00	7,402,500
立花エレテック	10,100	1,768.00	17,856,800
フォーバル	6,000	1,167.00	7,002,000
PALTA C	21,900	5,280.00	115,632,000
三谷産業	18,000	391.00	7,038,000
西本Wismettacホールディングス	2,500	1,919.00	4,797,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,939.00	2,326,800
国際紙パルプ商事	32,400	284.00	9,201,600
ヤマタネ	6,800	1,233.00	8,384,400
丸紅建材リース	1,300	1,557.00	2,024,100
日鉄物産	9,700	3,730.00	36,181,000
泉州電業	4,200	2,693.00	11,310,600
トラスコ中山	28,400	2,484.00	70,545,600
オートバックスセブン	50,600	1,322.00	66,893,200
モリト	10,000	681.00	6,810,000
加藤産業	19,700	3,770.00	74,269,000
北恵	3,500	912.00	3,192,000
イノテック	7,100	1,113.00	7,902,300
イエローハット	25,800	1,536.00	39,628,800
J Kホールディングス	12,300	858.00	10,553,400
日伝	12,300	2,289.00	28,154,700
北沢産業	10,300	277.00	2,853,100
杉本商事	7,400	1,853.00	13,712,200
因幡電機産業	38,800	2,459.00	95,409,200
東テク	4,500	2,234.00	10,053,000
ミスミグループ本社	170,900	2,862.00	489,115,800
アルテック	10,900	236.00	2,572,400
タキヒヨー	4,100	1,714.00	7,027,400
蔵王産業	2,600	1,452.00	3,775,200
スズケン	57,800	3,915.00	226,287,000
ジェコス	9,400	995.00	9,353,000
グローセル	13,700	435.00	5,959,500
ローソン	34,500	5,960.00	205,620,000
サンエー	11,400	4,295.00	48,963,000
カワチ薬品	10,600	2,632.00	27,899,200
エービーシー・マート	21,300	6,550.00	139,515,000
ハードオフコーポレーション	5,700	732.00	4,172,400

アスクル	14,300	3,250.00	46,475,000
ゲオホールディングス	24,700	1,348.00	33,295,600
アダストリア	19,000	1,754.00	33,326,000
ジーフット	8,200	479.00	3,927,800
くら寿司	7,200	4,920.00	35,424,000
キャンドウ	6,600	1,882.00	12,421,200
パルグループホールディングス	14,100	1,386.00	19,542,600
エディオン	62,800	1,000.00	62,800,000
サーラコーポレーション	28,000	572.00	16,016,000
ワッツ	6,300	760.00	4,788,000
ハローズ	5,200	3,100.00	16,120,000
フジオフードシステム	11,600	1,669.00	19,360,400
あみやき亭	3,000	3,170.00	9,510,000
ひらまつ	25,100	203.00	5,095,300
大黒天物産	3,300	4,030.00	13,299,000
ハニーズホールディングス	12,200	1,238.00	15,103,600
ファーマライズホールディングス	3,600	663.00	2,386,800
アルペン	10,600	1,763.00	18,687,800
ハブ	4,200	737.00	3,095,400
クオールホールディングス	20,200	1,289.00	26,037,800
ジinzホールディングス	7,200	6,830.00	49,176,000
ビックカメラ	81,100	1,135.00	92,048,500
D C Mホールディングス	75,700	1,120.00	84,784,000
Monotaro	97,000	3,915.00	379,755,000
東京一番フーズ	3,900	519.00	2,024,100
DDホールディングス	5,400	1,035.00	5,589,000
きちりホールディングス	3,900	670.00	2,613,000
アークランドサービスホールディングス	10,100	1,913.00	19,321,300
J．フロント リテイリング	163,100	915.00	149,236,500
ドトール・日レスホールディングス	19,700	1,838.00	36,208,600
マツモトキヨシホールディングス	56,400	4,035.00	227,574,000
ブロンコビリー	7,200	2,430.00	17,496,000
Z O Z O	93,900	1,984.00	186,297,600
トレジャー・ファクトリー	4,300	735.00	3,160,500
物語コーポレーション	3,700	7,850.00	29,045,000
ココカラファイン	14,300	5,440.00	77,792,000
三越伊勢丹ホールディングス	238,700	721.00	172,102,700
Hamee	5,000	1,284.00	6,420,000
ウエルシアホールディングス	40,600	9,050.00	367,430,000
クリエイトSDホールディングス	23,000	3,410.00	78,430,000
丸善CHIホールディングス	15,900	384.00	6,105,600
ティーライフ	2,200	1,160.00	2,552,000

チムニー	4,300	1,805.00	7,761,500
シュッピン	9,500	823.00	7,818,500
オイシックス・ラ・大地	13,500	2,304.00	31,104,000
ネクステージ	19,800	894.00	17,701,200
ジョイフル本田	40,100	1,345.00	53,934,500
鳥貴族	4,100	1,874.00	7,683,400
キリン堂ホールディングス	5,500	2,196.00	12,078,000
ホットランド	9,300	1,243.00	11,559,900
すかいらーくホールディングス	152,900	1,747.00	267,116,300
SFPホールディングス	7,900	1,688.00	13,335,200
綿半ホールディングス	5,200	1,879.00	9,770,800
ヨシックス	2,300	2,476.00	5,694,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,800	1,128.00	44,894,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	592.00	3,907,200
B E E N O S	6,500	1,079.00	7,013,500
あさひ	10,300	1,550.00	15,965,000
日本調剤	8,400	1,729.00	14,523,600
コスモス薬品	12,100	15,470.00	187,187,000
トーエル	6,900	718.00	4,954,200
オンリー	2,700	604.00	1,630,800
セブン&アイ・ホールディングス	533,500	3,687.00	1,967,014,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	73,500	832.00	61,152,000
ツルハホールディングス	29,700	15,920.00	472,824,000
サンマルクホールディングス	10,900	1,870.00	20,383,000
フェリシモ	3,200	1,055.00	3,376,000
トリドールホールディングス	33,900	1,221.00	41,391,900
T O K Y O B A S E	12,900	355.00	4,579,500
ウイルプラスホールディングス	2,000	747.00	1,494,000
J Mホールディングス	10,400	2,746.00	28,558,400
サツドラホールディングス	2,100	2,021.00	4,244,100
アレンザホールディングス	7,100	871.00	6,184,100
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,762.00	5,109,800
パロックジャパンリミテッド	9,800	650.00	6,370,000
クスリのアオキホールディングス	12,200	8,900.00	108,580,000
力の源ホールディングス	6,500	776.00	5,044,000
スシローグローバルホールディングス	74,900	2,280.00	170,772,000
L I X I L ビバ	13,500	2,413.00	32,575,500
メディカルシステムネットワーク	13,600	471.00	6,405,600
はるやまホールディングス	6,700	745.00	4,991,500
ノジマ	24,300	2,509.00	60,968,700
カッパ・クリエイト	19,100	1,514.00	28,917,400

ライトオン	10,200	550.00	5,610,000
良品計画	181,200	1,629.00	295,174,800
三城ホールディングス	15,200	304.00	4,620,800
アドヴァン	21,000	1,210.00	25,410,000
アルビス	5,300	2,126.00	11,267,800
コナカ	16,700	329.00	5,494,300
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,609.00	2,896,200
G - 7ホールディングス	8,100	2,356.00	19,083,600
イオン北海道	18,200	782.00	14,232,400
コジマ	23,900	497.00	11,878,300
ヒマラヤ	5,000	821.00	4,105,000
コーナン商事	19,500	3,145.00	61,327,500
エコス	5,100	1,905.00	9,715,500
ワタミ	16,300	1,052.00	17,147,600
マルシェ	3,900	646.00	2,519,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	299,800	2,171.00	650,865,800
西松屋チェーン	30,100	924.00	27,812,400
ゼンショーホールディングス	65,400	2,295.00	150,093,000
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,786.00	15,716,800
ハークスレイ	3,000	1,000.00	3,000,000
サイゼリヤ	20,300	2,294.00	46,568,200
V Tホールディングス	57,100	382.00	21,812,200
魚力	3,900	1,581.00	6,165,900
フジ・コーポレーション	3,700	2,008.00	7,429,600
ユナイテッドアローズ	14,400	1,851.00	26,654,400
ハイデイ日高	19,800	1,910.00	37,818,000
京都きもの友禅	9,500	237.00	2,251,500
コロワイド	45,300	1,612.00	73,023,600
ピーシーデポコーポレーション	18,400	630.00	11,592,000
壱番屋	9,600	5,580.00	53,568,000
P L A N T	3,800	599.00	2,276,200
スギホールディングス	27,300	6,960.00	190,008,000
薬王堂ホールディングス	6,000	2,692.00	16,152,000
スクロール	21,500	373.00	8,019,500
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,965.00	27,510,000
ファミリーマート	109,000	2,019.00	220,071,000
木曽路	17,900	2,540.00	45,466,000
S R Sホールディングス	16,300	922.00	15,028,600
タカキュー	12,000	141.00	1,692,000
リテールパートナーズ	18,200	1,588.00	28,901,600
ケーヨー	28,300	647.00	18,310,100
上新電機	16,100	2,231.00	35,919,100

日本瓦斯	21,600	4,275.00	92,340,000
ロイヤルホールディングス	23,900	1,976.00	47,226,400
いなげや	17,000	1,688.00	28,696,000
鳥忠	25,700	2,927.00	75,223,900
チヨダ	14,500	1,054.00	15,283,000
ライフコーポレーション	10,400	3,375.00	35,100,000
リンガーハット	16,900	2,441.00	41,252,900
MrMaxHD	19,200	441.00	8,467,200
テンアライド	12,600	389.00	4,901,400
AOKIホールディングス	27,600	688.00	18,988,800
オークワ	21,500	1,524.00	32,766,000
コメリ	21,100	2,658.00	56,083,800
青山商事	28,400	821.00	23,316,400
しまむら	15,900	7,580.00	120,522,000
はせがわ	7,700	346.00	2,664,200
高島屋	99,500	1,035.00	102,982,500
松屋	27,700	684.00	18,946,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	64,800	844.00	54,691,200
近鉄百貨店	5,300	3,225.00	17,092,500
丸井グループ	125,100	1,943.00	243,069,300
アクシアル リテイリング	11,400	4,125.00	47,025,000
イオン	524,800	2,383.50	1,250,860,800
イズミ	27,800	3,385.00	94,103,000
平和堂	27,800	1,936.00	53,820,800
フジ	16,500	1,883.00	31,069,500
ヤオコー	15,500	7,050.00	109,275,000
ゼビオホールディングス	16,700	933.00	15,581,100
ケーズホールディングス	131,700	1,380.00	181,746,000
Olympicグループ	7,300	687.00	5,015,100
日産東京販売ホールディングス	21,000	233.00	4,893,000
シルバーライフ	1,900	2,377.00	4,516,300
一家ダイニングプロジェクト	1,400	665.00	931,000
Genky DrugStores	6,100	2,841.00	17,330,100
ナルミヤ・インターナショナル	3,300	785.00	2,590,500
ブックオフグループホールディングス	7,900	872.00	6,888,800
アインホールディングス	16,800	6,960.00	116,928,000
元気寿司	3,500	2,417.00	8,459,500
ヤマダ電機	415,900	524.00	217,931,600
アークランドサカモト	21,500	1,190.00	25,585,000
ニトリホールディングス	59,000	19,535.00	1,152,565,000
グルメ杵屋	9,900	1,033.00	10,226,700
愛眼	10,900	218.00	2,376,200

ケーユーホールディングス	7,400	839.00	6,208,600
吉野家ホールディングス	44,900	2,471.00	110,947,900
松屋フーズホールディングス	6,600	3,955.00	26,103,000
サガミホールディングス	18,400	1,294.00	23,809,600
関西スーパーマーケット	11,500	1,126.00	12,949,000
王将フードサービス	10,000	6,280.00	62,800,000
プレナス	15,400	1,875.00	28,875,000
ミニストップ	10,200	1,515.00	15,453,000
アークス	28,000	2,180.00	61,040,000
パローホールディングス	30,300	2,115.00	64,084,500
ベルク	6,800	6,640.00	45,152,000
大庄	7,400	1,410.00	10,434,000
ファーストリテイリング	18,200	60,530.00	1,101,646,000
サンドラッグ	51,400	3,630.00	186,582,000
サックスパー ホールディングス	11,900	554.00	6,592,600
ヤマザワ	3,300	1,716.00	5,662,800
やまや	2,900	2,241.00	6,498,900
ベルーナ	29,700	541.00	16,067,700
島根銀行	3,600	519.00	1,868,400
じもとホールディングス	92,300	96.00	8,860,800
めぶきフィナンシャルグループ	709,600	244.00	173,142,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	1,082.00	19,908,800
九州フィナンシャルグループ	298,800	458.00	136,850,400
ゆうちょ銀行	386,900	890.00	344,341,000
富山第一銀行	32,600	267.00	8,704,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	780,000	352.00	274,560,000
西日本フィナンシャルホールディングス	90,900	742.00	67,447,800
関西みらいフィナンシャルグループ	80,100	390.00	31,239,000
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,542.00	19,583,400
第四北越フィナンシャルグループ	23,700	2,262.00	53,609,400
新生銀行	100,200	1,375.00	137,775,000
あおぞら銀行	81,400	2,002.00	162,962,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,341,800	444.20	4,149,627,560
りそなホールディングス	1,498,600	387.80	581,157,080
三井住友トラスト・ホールディングス	258,100	3,171.00	818,435,100
三井住友フィナンシャルグループ	944,500	3,119.00	2,945,895,500
千葉銀行	455,700	512.00	233,318,400
群馬銀行	262,300	337.00	88,395,100
武蔵野銀行	20,300	1,517.00	30,795,100
千葉興業銀行	37,400	251.00	9,387,400
筑波銀行	56,800	185.00	10,508,000
七十七銀行	46,100	1,537.00	70,855,700

青森銀行	10,600	2,183.00	23,139,800
秋田銀行	8,800	1,553.00	13,666,400
山形銀行	15,300	1,345.00	20,578,500
岩手銀行	8,900	2,484.00	22,107,600
東邦銀行	122,100	236.00	28,815,600
東北銀行	6,500	944.00	6,136,000
みちのく銀行	8,800	1,208.00	10,630,400
ふくおかフィナンシャルグループ	115,000	1,753.00	201,595,000
静岡銀行	338,200	686.00	232,005,200
十六銀行	17,100	2,099.00	35,892,900
スルガ銀行	139,700	391.00	54,622,700
八十二銀行	329,600	398.00	131,180,800
山梨中央銀行	15,900	929.00	14,771,100
大垣共立銀行	27,000	2,274.00	61,398,000
福井銀行	11,700	1,654.00	19,351,800
北國銀行	13,600	2,763.00	37,576,800
清水銀行	5,600	1,852.00	10,371,200
富山銀行	2,600	2,276.00	5,917,600
滋賀銀行	27,400	2,507.00	68,691,800
南都銀行	22,700	2,251.00	51,097,700
百五銀行	122,900	319.00	39,205,100
京都銀行	48,900	3,870.00	189,243,000
紀陽銀行	48,400	1,672.00	80,924,800
ほくほくフィナンシャルグループ	90,900	908.00	82,537,200
広島銀行	201,600	505.00	101,808,000
山陰合同銀行	81,000	531.00	43,011,000
中国銀行	117,500	968.00	113,740,000
鳥取銀行	4,700	1,245.00	5,851,500
伊予銀行	194,900	609.00	118,694,100
百十四銀行	14,500	1,965.00	28,492,500
四国銀行	20,700	828.00	17,139,600
阿波銀行	22,300	2,474.00	55,170,200
大分銀行	7,900	2,525.00	19,947,500
宮崎銀行	9,100	2,339.00	21,284,900
佐賀銀行	8,300	1,115.00	9,254,500
沖縄銀行	12,500	3,310.00	41,375,000
琉球銀行	31,500	970.00	30,555,000
セブン銀行	456,200	307.00	140,053,400
みずほフィナンシャルグループ	18,556,600	134.50	2,495,862,700
高知銀行	5,000	727.00	3,635,000
山口フィナンシャルグループ	170,500	644.00	109,802,000
長野銀行	4,500	1,155.00	5,197,500

名古屋銀行	10,200	2,360.00	24,072,000
北洋銀行	205,900	203.00	41,797,700
愛知銀行	4,900	3,020.00	14,798,000
中京銀行	5,600	2,139.00	11,978,400
大光銀行	4,700	1,535.00	7,214,500
愛媛銀行	19,100	1,192.00	22,767,200
トマト銀行	5,300	1,046.00	5,543,800
京葉銀行	58,200	518.00	30,147,600
栃木銀行	66,000	166.00	10,956,000
北日本銀行	4,300	1,976.00	8,496,800
東和銀行	24,000	708.00	16,992,000
福島銀行	12,900	182.00	2,347,800
大東銀行	7,100	682.00	4,842,200
トモニホールディングス	105,600	347.00	36,643,200
フィデアホールディングス	132,600	107.00	14,188,200
池田泉州ホールディングス	157,000	169.00	26,533,000
F P G	42,400	608.00	25,779,200
マーキュリアインベストメント	6,400	562.00	3,596,800
S B Iホールディングス	152,600	2,309.00	352,353,400
ジャフコ	21,000	3,620.00	76,020,000
大和証券グループ本社	1,096,200	446.70	489,672,540
野村ホールディングス	2,403,300	462.90	1,112,487,570
岡三証券グループ	116,900	350.00	40,915,000
丸三証券	41,000	455.00	18,655,000
東洋証券	50,200	134.00	6,726,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157,500	252.00	39,690,000
光世証券	3,600	522.00	1,879,200
水戸証券	40,400	206.00	8,322,400
いちよし証券	25,900	459.00	11,888,100
松井証券	78,200	847.00	66,235,400
だいこう証券ビジネス	6,800	918.00	6,242,400
マネックスグループ	101,000	240.00	24,240,000
極東証券	18,700	527.00	9,854,900
岩井コスモホールディングス	13,100	985.00	12,903,500
藍澤證券	24,800	694.00	17,211,200
マネーパートナーズグループ	15,400	213.00	3,280,200
スパークス・グループ	63,900	222.00	14,185,800
かんぽ生命保険	48,400	1,368.00	66,211,200
S O M P Oホールディングス	256,800	3,832.00	984,057,600
アニコム ホールディングス	11,300	5,320.00	60,116,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	357,100	3,165.00	1,130,221,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	112,200	2,596.00	291,271,200

第一生命ホールディングス	772,800	1,403.00	1,084,238,400
東京海上ホールディングス	482,800	4,668.00	2,253,710,400
T & Dホールディングス	408,200	973.00	397,178,600
アドバンスクリエイト	2,800	2,290.00	6,412,000
全国保証	38,500	4,145.00	159,582,500
ジェイリース	3,800	409.00	1,554,200
イントラスト	4,800	744.00	3,571,200
日本モーゲージサービス	2,800	2,001.00	5,602,800
C a s a	4,800	1,250.00	6,000,000
アルヒ	21,700	1,494.00	32,419,800
プレミアグループ	7,400	1,955.00	14,467,000
クレディセゾン	95,700	1,283.00	122,783,100
芙蓉総合リース	14,300	6,180.00	88,374,000
みずほリース	21,100	2,376.00	50,133,600
東京センチュリー	27,500	4,685.00	128,837,500
日本証券金融	60,200	505.00	30,401,000
アイフル	208,300	267.00	55,616,100
リコーリース	10,700	3,135.00	33,544,500
イオンフィナンシャルサービス	83,600	1,213.00	101,406,800
アコム	274,500	439.00	120,505,500
ジャックス	15,100	1,888.00	28,508,800
オリエントコーポレーション	369,400	128.00	47,283,200
日立キャピタル	32,200	2,274.00	73,222,800
アプラスフィナンシャル	65,500	69.00	4,519,500
オリックス	854,100	1,429.00	1,220,508,900
三菱UFJリース	346,600	526.00	182,311,600
九州リースサービス	6,700	490.00	3,283,000
日本取引所グループ	392,000	2,317.00	908,264,000
イー・ギャランティ	14,600	2,184.00	31,886,400
アサックス	7,100	638.00	4,529,800
NECキャピタルソリューション	5,600	2,032.00	11,379,200
いちご	180,300	307.00	55,352,100
日本駐車場開発	149,100	141.00	21,023,100
スター・マイカ・ホールディングス	8,300	1,498.00	12,433,400
ADワークスグループ	25,300	186.00	4,705,800
ヒューリック	293,500	1,090.00	319,915,000
三栄建築設計	7,100	1,204.00	8,548,400
野村不動産ホールディングス	83,900	1,994.00	167,296,600
三重交通グループホールディングス	31,700	477.00	15,120,900
サムティ	20,800	1,468.00	30,534,400
ディア・ライフ	23,600	475.00	11,210,000
日本商業開発	10,000	1,528.00	15,280,000

ハウスコム	3,800	1,342.00	5,099,600
日本管理センター	10,700	1,209.00	12,936,300
サンセイランディック	6,400	871.00	5,574,400
フージャースホールディングス	27,200	616.00	16,755,200
オープンハウス	40,400	2,978.00	120,311,200
東急不動産ホールディングス	375,000	546.00	204,750,000
飯田グループホールディングス	115,200	1,600.00	184,320,000
イーランド	5,100	664.00	3,386,400
ムゲンエステート	13,200	534.00	7,048,800
ハウストゥ	6,700	1,027.00	6,880,900
シーアールイー	4,900	1,180.00	5,782,000
グッドコムアセット	4,500	1,651.00	7,429,500
ジェイ・エス・ビー	3,700	2,367.00	8,757,900
テンポイノベーション	5,600	725.00	4,060,000
パーク24	74,300	2,091.00	155,361,300
パラカ	4,700	1,800.00	8,460,000
三井不動産	674,500	2,073.50	1,398,575,750
三菱地所	958,000	1,713.00	1,641,054,000
平和不動産	25,700	2,945.00	75,686,500
東京建物	145,300	1,389.00	201,821,700
ダイビル	37,100	1,050.00	38,955,000
京阪神ビルディング	23,300	1,495.00	34,833,500
住友不動産	307,700	2,984.50	918,330,650
テーオーシー	29,700	700.00	20,790,000
東京楽天地	2,700	4,540.00	12,258,000
スターツコーポレーション	19,500	2,191.00	42,724,500
フジ住宅	19,500	527.00	10,276,500
空港施設	18,100	438.00	7,927,800
明和地所	11,900	427.00	5,081,300
ゴールドクレスト	12,000	1,578.00	18,936,000
エスリード	6,700	1,515.00	10,150,500
日神グループホールディングス	25,000	411.00	10,275,000
日本エスコン	24,700	807.00	19,932,900
タカラレーベン	62,400	375.00	23,400,000
A V A N T I A	10,300	784.00	8,075,200
イオンモール	69,800	1,515.00	105,747,000
毎日コムネット	5,800	835.00	4,843,000
ファースト住建	7,900	919.00	7,260,100
カチタス	34,700	2,405.00	83,453,500
トーセイ	20,700	1,071.00	22,169,700
穴吹興産	4,200	1,739.00	7,303,800
サンフロンティア不動産	21,100	942.00	19,876,200

エフ・ジェー・ネクスト	14,200	883.00	12,538,600
インテリックス	3,800	523.00	1,987,400
ランドビジネス	4,600	351.00	1,614,600
日本社宅サービス	6,000	1,106.00	6,636,000
グランディハウス	15,600	395.00	6,162,000
日本空港ビルデング	44,000	4,740.00	208,560,000
日本工営	8,900	3,295.00	29,325,500
L I F U L L	46,500	425.00	19,762,500
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	1,381.00	12,429,000
日本M&Aセンター	100,000	4,330.00	433,000,000
メンバーズ	4,000	1,830.00	7,320,000
中広	2,100	532.00	1,117,200
UTグループ	20,900	2,020.00	42,218,000
アイティメディア	5,400	1,063.00	5,740,200
タケエイ	12,800	967.00	12,377,600
E・Jホールディングス	2,400	1,562.00	3,748,800
ビーネックスグループ	16,700	819.00	13,677,300
コシダカホールディングス	32,100	537.00	17,237,700
アルトナー	3,400	768.00	2,611,200
パソナグループ	14,400	1,280.00	18,432,000
C D S	3,400	1,326.00	4,508,400
リンクアンドモチベーション	29,500	454.00	13,393,000
G C A	16,200	656.00	10,627,200
エス・エム・エス	41,200	2,677.00	110,292,400
サニーサイドアップグループ	4,700	829.00	3,896,300
パーソルホールディングス	132,400	1,425.00	188,670,000
リニカル	6,500	950.00	6,175,000
クックパッド	46,600	314.00	14,632,400
エスクリ	4,400	448.00	1,971,200
アイ・ケイ・ケイ	6,700	608.00	4,073,600
学情	4,800	1,332.00	6,393,600
スタジオアリス	6,700	1,638.00	10,974,600
シミックホールディングス	6,600	1,526.00	10,071,600
エプコ	2,900	1,156.00	3,352,400
N J S	3,000	1,788.00	5,364,000
総合警備保障	52,700	5,300.00	279,310,000
カカクコム	97,800	2,606.00	254,866,800
アイロムグループ	4,700	2,288.00	10,753,600
セントケア・ホールディング	8,900	431.00	3,835,900
サイネックス	2,400	665.00	1,596,000
ルネサンス	7,500	1,176.00	8,820,000
ディップ	18,700	2,545.00	47,591,500

オプトホールディング	7,300	1,529.00	11,161,700
ツクイ	31,400	503.00	15,794,200
キャリアデザインセンター	3,200	983.00	3,145,600
ベネフィット・ワン	48,200	2,354.00	113,462,800
エムスリー	291,800	4,340.00	1,266,412,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,700	420.00	3,654,000
プラス	1,900	563.00	1,069,700
アウトソーシング	75,900	633.00	48,044,700
ウェルネット	13,500	714.00	9,639,000
ワールドホールディングス	4,600	1,805.00	8,303,000
ディー・エヌ・エー	64,900	1,480.00	96,052,000
博報堂D Yホールディングス	184,100	1,339.00	246,509,900
ぐるなび	23,200	659.00	15,288,800
タカミヤ	14,300	500.00	7,150,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,400	877.00	9,120,800
ファンコミュニケーションズ	36,700	476.00	17,469,200
ライク	4,400	1,606.00	7,066,400
ビジネス・ブレークスルー	5,900	379.00	2,236,100
エスプール	34,100	755.00	25,745,500
WDBホールディングス	6,100	2,699.00	16,463,900
手間いらず	900	4,755.00	4,279,500
ティア	8,000	537.00	4,296,000
C D G	1,500	1,547.00	2,320,500
バリューコマース	7,500	2,694.00	20,205,000
インフォーマート	145,100	904.00	131,170,400
J Pホールディングス	42,000	283.00	11,886,000
エコナックホールディングス	25,200	100.00	2,520,000
E P Sホールディングス	18,000	1,108.00	19,944,000
レッグス	3,400	1,039.00	3,532,600
プレステージ・インターナショナル	49,700	952.00	47,314,400
アミューズ	7,300	2,403.00	17,541,900
ドリームインキュベータ	4,100	1,546.00	6,338,600
クイック	8,300	1,252.00	10,391,600
T A C	8,700	185.00	1,609,500
ケネディクス	123,500	586.00	72,371,000
電通グループ	136,400	2,885.00	393,514,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	680.00	3,536,000
ぴあ	3,800	3,795.00	14,421,000
イオンファンタジー	5,200	1,905.00	9,906,000
シーティーエス	15,100	708.00	10,690,800
ネクシィーズグループ	4,200	1,083.00	4,548,600
みらかホールディングス	37,100	2,506.00	92,972,600

アルプス技研	11,800	1,944.00	22,939,200
ダイオーズ	2,700	1,134.00	3,061,800
日本空調サービス	14,000	726.00	10,164,000
オリエンタルランド	140,700	15,615.00	2,197,030,500
ダスキン	32,900	2,950.00	97,055,000
明光ネットワークジャパン	16,900	860.00	14,534,000
ファルコホールディングス	7,400	1,665.00	12,321,000
ラウンドワン	37,100	917.00	34,020,700
リゾートトラスト	60,700	1,352.00	82,066,400
ビー・エム・エル	17,100	3,035.00	51,898,500
ワタベウェディング	2,500	428.00	1,070,000
りらいあコミュニケーションズ	24,000	1,225.00	29,400,000
リソー教育	60,900	305.00	18,574,500
早稲田アカデミー	5,900	980.00	5,782,000
ユー・エス・エス	148,200	1,878.00	278,319,600
東京個別指導学院	4,900	608.00	2,979,200
サイバーエージェント	81,500	5,430.00	442,545,000
楽天	616,800	976.00	601,996,800
クリーク・アンド・リバー社	7,000	1,060.00	7,420,000
テー・オー・ダブリュー	21,400	355.00	7,597,000
山田コンサルティンググループ	8,700	1,316.00	11,449,200
セントラルスポーツ	5,000	2,600.00	13,000,000
フルキャストホールディングス	13,300	1,581.00	21,027,300
エン・ジャパン	23,600	2,906.00	68,581,600
リソルホールディングス	1,500	3,590.00	5,385,000
テクノプロ・ホールディングス	26,400	6,450.00	170,280,000
アトラ	3,500	269.00	941,500
インターワークス	2,900	394.00	1,142,600
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	9,550.00	51,570,000
K e e P e r 技研	5,000	1,641.00	8,205,000
ファーストロジック	2,800	612.00	1,713,600
三機サービス	2,700	1,106.00	2,986,200
G u n o s y	8,400	926.00	7,778,400
デザインワン・ジャパン	4,400	267.00	1,174,800
イー・ガーディアン	5,900	2,545.00	15,015,500
リブセンス	9,000	281.00	2,529,000
ジャパンマテリアル	40,800	1,754.00	71,563,200
ベクトル	16,600	853.00	14,159,800
ウチヤマホールディングス	6,900	378.00	2,608,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,400	897.00	10,225,800
ライクキッズ	2,400	739.00	1,773,600
キャリアリンク	4,600	574.00	2,640,400

I B J	9,200	842.00	7,746,400
アサンテ	5,400	1,539.00	8,310,600
N・フィールド	9,300	535.00	4,975,500
バリューHR	5,300	1,463.00	7,753,900
M&Aキャピタルパートナーズ	10,800	4,005.00	43,254,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,700.00	8,670,000
E R Iホールディングス	3,900	673.00	2,624,700
アビスト	2,100	2,449.00	5,142,900
シグマクシス	9,100	1,909.00	17,371,900
ウィルグループ	8,800	728.00	6,406,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,900	204.00	3,855,600
リクルートホールディングス	947,900	3,710.00	3,516,709,000
エラン	7,900	1,799.00	14,212,100
土木管理総合試験所	6,100	387.00	2,360,700
ネットマーケティング	5,300	682.00	3,614,600
日本郵政	1,084,600	784.10	850,434,860
ベルシステム24ホールディングス	22,300	1,357.00	30,261,100
鎌倉新書	10,100	1,197.00	12,089,700
S M N	3,000	913.00	2,739,000
一蔵	1,800	428.00	770,400
L I T A L I C O	4,600	2,813.00	12,939,800
グローバルキッズCOMPANY	2,600	624.00	1,622,400
エアトリ	6,900	1,255.00	8,659,500
アトラエ	4,000	3,215.00	12,860,000
ストライク	5,000	4,800.00	24,000,000
ソラスト	36,600	1,248.00	45,676,800
セラク	4,300	978.00	4,205,400
インソース	5,500	2,908.00	15,994,000
ベйкаレント・コンサルティング	8,000	7,570.00	60,560,000
Orchestra Holdings	2,900	1,288.00	3,735,200
アイモバイル	4,900	747.00	3,660,300
キャリアインデックス	5,800	335.00	1,943,000
MS - Japan	4,400	901.00	3,964,400
船場	2,300	965.00	2,219,500
グレイステクノロジー	6,100	4,335.00	26,443,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	14,000	3,325.00	46,550,000
フルテック	2,000	1,306.00	2,612,000
グリーンズ	3,600	551.00	1,983,600
ツナググループ・ホールディングス	2,500	476.00	1,190,000
GameWith	4,100	666.00	2,730,600
ソウルドアウト	2,800	2,218.00	6,210,400
MS&Consulting	2,700	647.00	1,746,900

ミダック	1,800	1,644.00	2,959,200
日総工産	9,000	705.00	6,345,000
キュービーネットホールディングス	5,500	2,144.00	11,792,000
RPAホールディングス	10,200	917.00	9,353,400
スプリックス	3,900	896.00	3,494,400
マネジメントソリューションズ	5,900	1,080.00	6,372,000
プロレド・パートナーズ	1,800	5,240.00	9,432,000
and factory	1,400	1,257.00	1,759,800
ギークス	1,500	1,360.00	2,040,000
カーブスホールディングス	36,500	661.00	24,126,500
フォーラムエンジニアリング	7,000	918.00	6,426,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,800	903.00	6,140,400
リログループ	72,400	2,461.00	178,176,400
東祥	8,300	1,418.00	11,769,400
エイチ・アイ・エス	20,600	1,977.00	40,726,200
ラックランド	3,100	2,101.00	6,513,100
共立メンテナンス	22,000	3,440.00	75,680,000
イチネンホールディングス	14,900	1,223.00	18,222,700
建設技術研究所	9,200	1,758.00	16,173,600
スペース	8,700	1,013.00	8,813,100
長大	5,400	1,030.00	5,562,000
燦ホールディングス	5,900	1,180.00	6,962,000
スバル興業	800	7,870.00	6,296,000
東京テアトル	5,300	1,274.00	6,752,200
タナベ経営	2,600	1,283.00	3,335,800
ナガワ	4,200	8,000.00	33,600,000
よみうりランド	2,900	3,750.00	10,875,000
東京都競馬	8,700	3,545.00	30,841,500
カナモト	21,700	2,322.00	50,387,400
東京ドーム	53,700	900.00	48,330,000
西尾レントオール	12,300	2,370.00	29,151,000
トランス・コスモス	12,600	2,535.00	31,941,000
乃村工藝社	56,800	976.00	55,436,800
藤田観光	5,800	1,888.00	10,950,400
KNT-CTホールディングス	8,200	1,209.00	9,913,800
日本管財	14,200	1,855.00	26,341,000
トーカイ	12,800	2,751.00	35,212,800
白洋舎	1,600	2,880.00	4,608,000
セコム	140,400	9,334.00	1,310,493,600
セントラル警備保障	6,400	4,535.00	29,024,000
丹青社	25,200	753.00	18,975,600
メイテック	16,200	5,200.00	84,240,000

応用地質	14,300	1,343.00	19,204,900	
船井総研ホールディングス	27,400	2,535.00	69,459,000	
進学会ホールディングス	5,400	516.00	2,786,400	
オオバ	9,600	656.00	6,297,600	
いであ	3,300	1,775.00	5,857,500	
学究社	4,000	1,130.00	4,520,000	
ベネッセホールディングス	44,100	2,917.00	128,639,700	
イオンディライト	16,300	3,085.00	50,285,500	
ナック	7,500	926.00	6,945,000	
ニチイ学館	18,900	1,635.00	30,901,500	
ダイセキ	22,200	2,809.00	62,359,800	
ステップ	4,900	1,460.00	7,154,000	
合計	162,264,790		304,033,610,080	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	38,100	-	
	合計	38,100	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックス・オープンS】

【純資産額計算書】

(2020年 6月30日現在)

資産総額	10,426,015,413円
負債総額	13,733,819円
純資産総額（ - ）	10,412,281,594円
発行済口数	8,161,649,723口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2758円
（1万口当たり純資産額）	（12,758円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 6月30日現在)

資産総額	324,397,326,919円
負債総額	2,548,639,265円
純資産総額（ - ）	321,848,687,654円
発行済口数	218,384,436,086口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4738円
（1万口当たり純資産額）	（14,738円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年における資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2020年 8月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	12,437,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	292,295
単位型公社債投資信託	32	234,734
合計	643	12,964,574

3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者の財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載していましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに变更いたしました。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
固定負債		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			

当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 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

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「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」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
	ユーロ	2	-	0	0
合計	1,346	-	7	7	

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル		3,432	-	13
	英ポンド		2,575	-	50
	カナダドル	有価証券	40	-	0
	スイスフラン	投資有価証券	34	-	0
	香港ドル	子会社株式	566	-	2
	人民元		1,725	-	9
	ユーロ		262	-	6
	買建				
	ユーロ		6	-	0
	合計		8,643	-	82

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

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19百万円、当事業年度44百万円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年 8月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円 (2020年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額 (百万円) (2020年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態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及び監査等委員会の責任

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。

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年7月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 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DC日本株式インデックス・オープンSの2019年5月30日から2020年5月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンSの2020年5月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的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。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。