

【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10月27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】	インデックスコレクション（国内株式）
【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】

インデックスコレクション（国内株式）

（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10月28日から2021年 4月27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

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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2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、金融商品取引所（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所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込

み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、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

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	年1回	グローバル	ファミリーファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般						
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株		日本		なし		
債券	年4回		ファン		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ド・オ		()	ショート型/ 絶対収益追求
公債	(隔月)	欧州	ブ・ファンズ			型
社債						
その他債券	年12回	アジア				その他
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア				()
不動産投信	日々					
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ()	中南米				
資産複合 ()		アフリカ				
資産配分 固定型		中近東 (中東)				
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>

東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

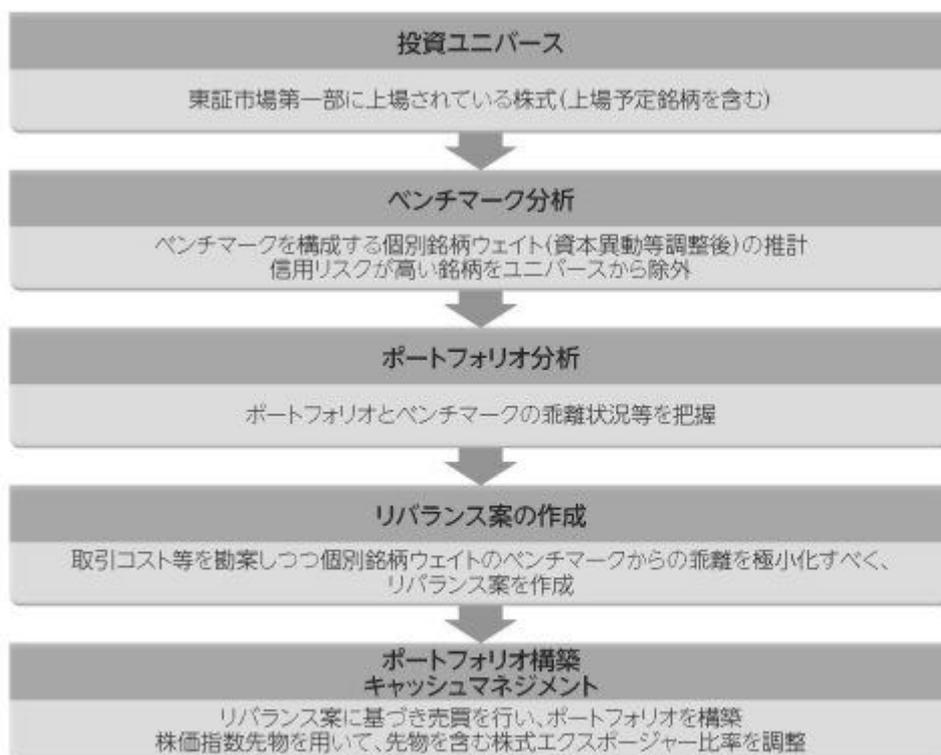
TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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

TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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

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。

ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。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。



分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
 - 分配対象額は、経費控除後の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。
 - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※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。

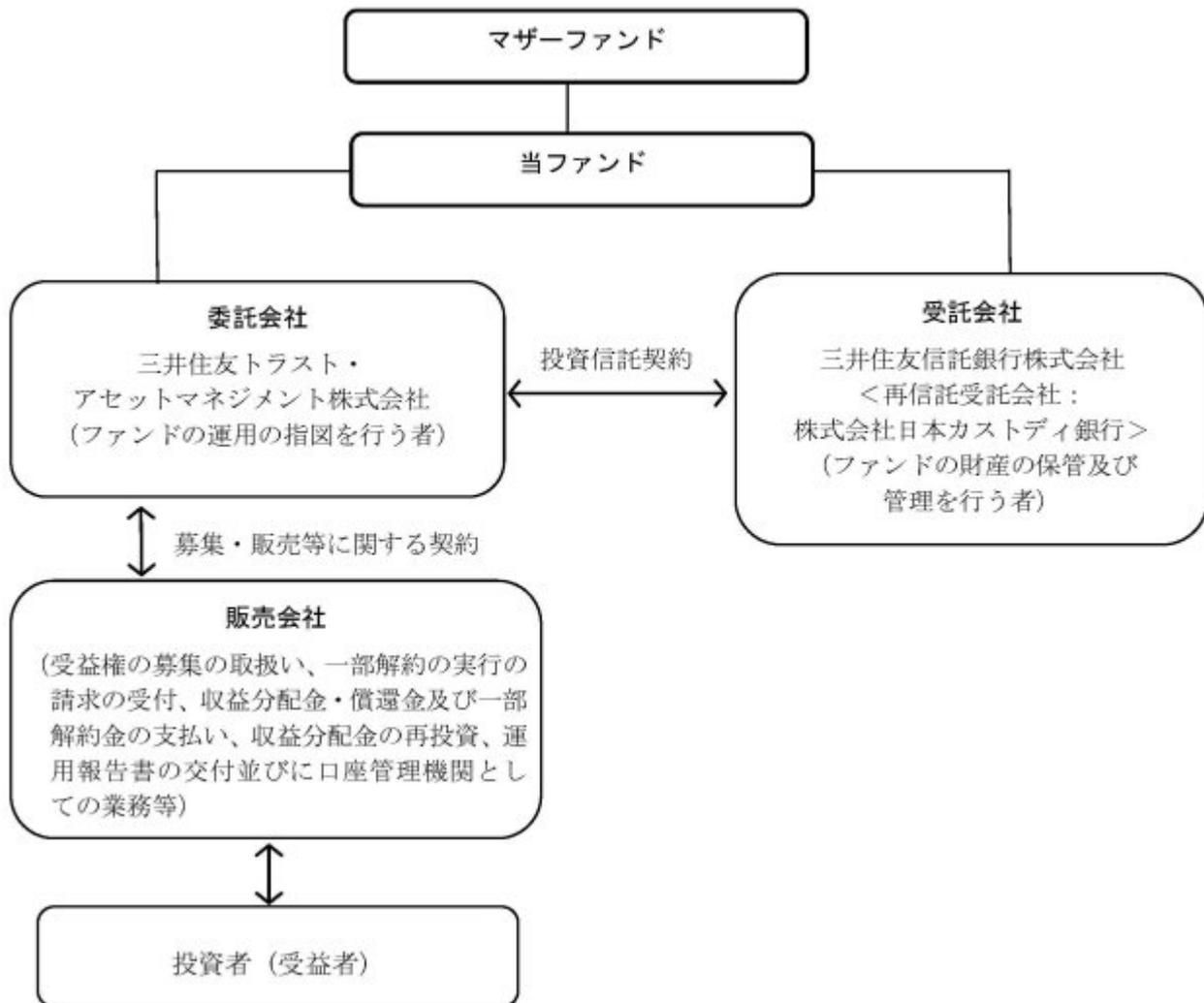
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

- 2010年10月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
- 2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
当ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（国内株式）からインデックスコレクション（国内株式）に変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式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 8月31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】

運用方針

当ファンドは、主としてわが国の金融商品取引所（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）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う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に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．株式への実質投資は、原則として東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式への実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- D．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- E．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- F．国内において行われ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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡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。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．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、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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親投資信託「日本株式マザーファンド」の

受益証券及び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きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（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. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
9. 資産の流動化に関する法律に定め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、上記1. から11. までの証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国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、振替受益権を含みます。）
14. 投資証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す。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1. の証券又は証書並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記1. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2. から6. までの証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13. の証券及び上記14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A. 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上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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A.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

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所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

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、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、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並びに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。

国内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、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためスワップ取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%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。

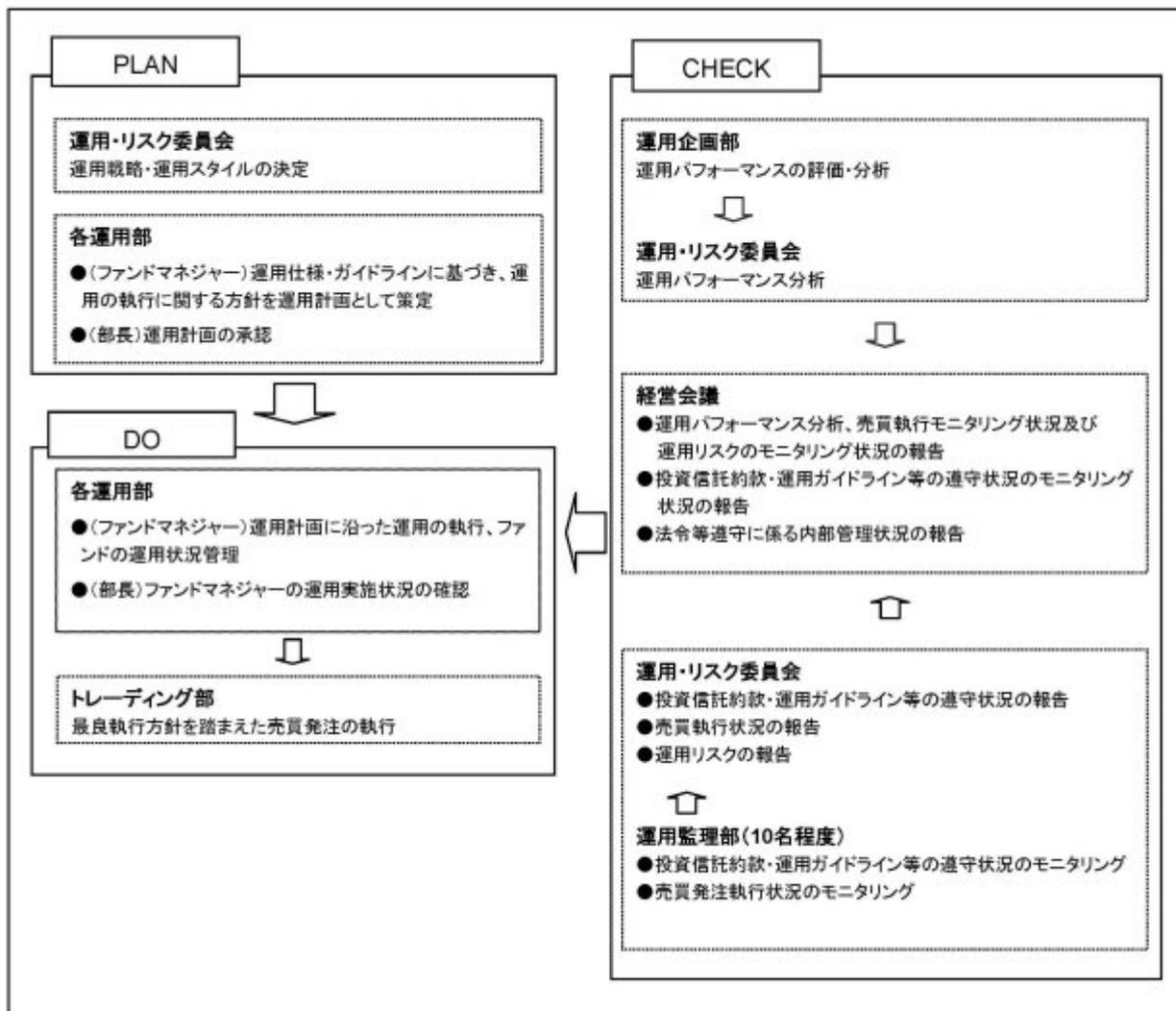
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、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７月２５日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A．分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B．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。
- C．収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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 >

- A．株式への投資割合
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- B．外貨建資産への投資割合
外貨建資産への投資は行いません。
- C．新株引受権証券等への投資割合
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、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- D．同一銘柄の株式への投資割合
同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- E．同一銘柄の転換社債等への投資割合
同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合
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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- G．投資信託証券への投資割合
投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- H．投資する株式等の範囲
イ．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、わが国の金融商品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、金融商品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。

ロ．上記イ．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。

I．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

- a. 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、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。
- b. 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、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。
- ロ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記イ. a. 及び b. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ. 委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N. 公社債の空売りの指図及び範囲
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O.の規定により借入れた公社債を売付けの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債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ます。
- ロ. 上記イ. の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O. 公社債の借入れの指図及び範囲
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ. 上記イ. の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ. 上記イ. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q. 再投資の指図
- 委託会社は、上記P.の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R. 資金の借入れ
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用並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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借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てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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。
- ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、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。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｓ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ｔ．利害関係人等との取引等
- イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からＲ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からＲ．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。
- 二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。
- Ｕ．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。
- Ｖ．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、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、配当込み）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。

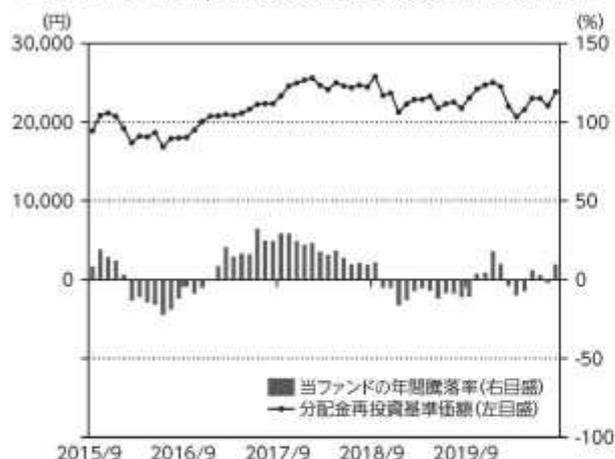
（２）リスクの管理体制

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】

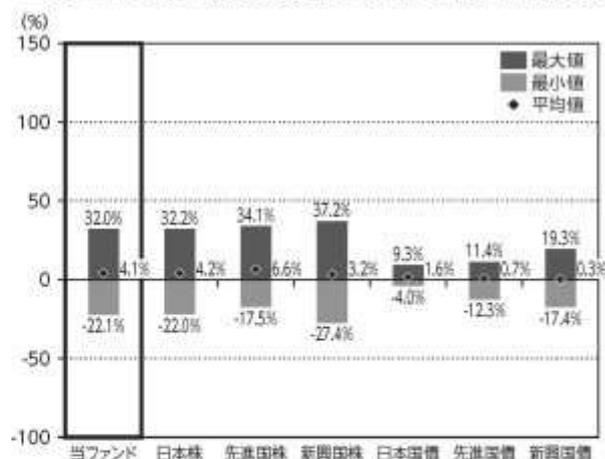
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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9月～2020年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
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定期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、本ファンドの世帯、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または虚証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・エマージング・マーケットローバル・デベロップメント	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「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す。

(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0.154%（税抜 0.14%）（ ）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 0.099% (税抜 0.09%)	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 0.033% (税抜 0.03%)	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 0.022% (税抜 0.02%)	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。

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 8月31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8月31日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（国内株式）】

（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	33,401,053,686	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		16,571,031	0.05
合計（純資産総額）		33,417,624,717	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	日本株式マザーファンド	18,830,225,328	1.7282	32,542,395,412	1.7738	33,401,053,686	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。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2011年 7月25日)	2,242,098,660	2,242,098,660	10,591	10,591
第2期計算期間末	(2012年 7月25日)	2,181,674,909	2,181,674,909	8,866	8,866
第3期計算期間末	(2013年 7月25日)	4,950,385,305	4,950,385,305	15,402	15,402
第4期計算期間末	(2014年 7月25日)	6,251,826,293	6,251,826,293	16,719	16,719
第5期計算期間末	(2015年 7月27日)	10,200,033,831	10,200,033,831	21,740	21,740
第6期計算期間末	(2016年 7月25日)	13,369,082,820	13,369,082,820	17,936	17,936
第7期計算期間末	(2017年 7月25日)	16,262,626,850	16,262,626,850	22,325	22,325
第8期計算期間末	(2018年 7月25日)	19,530,530,250	19,530,530,250	24,692	24,692
第9期計算期間末	(2019年 7月25日)	19,117,989,629	19,117,989,629	22,712	22,712
第10期計算期間末	(2020年 7月27日)	32,473,093,017	32,473,093,017	23,254	23,254
	2019年 8月末日	18,569,125,914		21,768	
	9月末日	19,421,361,240		23,077	
	10月末日	20,315,019,317		24,226	

11月末日	20,567,025,204		24,694
12月末日	33,676,761,963		25,048
2020年 1月末日	33,072,895,814		24,508
2月末日	29,691,737,876		21,988
3月末日	28,189,276,962		20,675
4月末日	29,807,332,564		21,569
5月末日	32,440,862,415		23,032
6月末日	32,216,182,677		22,992
7月末日	30,900,164,143		22,065
8月末日	33,417,624,717		23,862

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	0
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	0
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	5.9
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	16.3
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	73.7
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	8.6
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	30.0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	17.5
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	24.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	10.6
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8.0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.4

(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1期計算期間	2010年10月20日～2011年 7月25日	2,143,063,857	26,011,252	2,117,052,605
第2期計算期間	2011年 7月26日～2012年 7月25日	741,819,458	398,079,618	2,460,792,445
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	2,497,513,783	1,744,270,721	3,214,035,507
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	2,209,325,421	1,683,922,165	3,739,438,763
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	3,196,935,023	2,244,613,052	4,691,760,734
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	4,461,283,277	1,699,251,185	7,453,792,826
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	2,054,493,182	2,223,946,014	7,284,339,994
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	2,213,016,681	1,587,730,357	7,909,626,318
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,929,446,327	1,421,681,154	8,417,391,491
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	8,607,498,848	3,060,539,864	13,964,350,475

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)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)

日本株式マザーファンド

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	247,712,173,690	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,494,814,279	1.00
合計(純資産総額)		250,206,987,969	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	2,327,040,000	0.93

(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	1,219,100	7,739.83	9,435,626,753	7,006.00	8,541,014,600	3.41
日本	株式	ソニー	電気機器	684,500	7,857.84	5,378,691,480	8,309.00	5,687,510,500	2.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	850,800	4,842.21	4,119,752,268	6,598.00	5,613,578,400	2.24
日本	株式	キーエンス	電気機器	99,000	39,541.36	3,914,594,640	43,680.00	4,324,320,000	1.73
日本	株式	任天堂	その他製品	67,000	43,053.27	2,884,569,090	56,740.00	3,801,580,000	1.52
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	909,100	4,344.54	3,949,621,314	3,959.00	3,599,126,900	1.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,433,300	2,815.45	4,035,384,485	2,411.50	3,456,402,950	1.38
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,371,900	571.46	4,212,745,974	442.50	3,262,065,750	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	748,000	4,277.20	3,199,345,600	4,026.00	3,011,448,000	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	312,700	7,434.48	2,324,761,896	9,447.00	2,954,076,900	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	139,200	16,138.49	2,246,477,808	19,965.00	2,779,128,000	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	781,700	3,260.86	2,549,014,262	3,078.00	2,406,072,600	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	183,700	12,618.50	2,318,018,450	12,885.00	2,366,974,500	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	860,300	2,993.73	2,575,505,919	2,729.00	2,347,758,700	0.94
日本	株式	日本電産	電気機器	263,000	7,738.93	2,035,338,590	8,911.00	2,343,593,000	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	745,300	3,886.96	2,896,951,288	3,118.00	2,323,845,400	0.93
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	766,800	3,098.34	2,375,807,112	2,959.00	2,268,961,200	0.91
日本	株式	HOYA	精密機器	216,800	10,950.66	2,374,103,088	10,415.00	2,257,972,000	0.90
日本	株式	花王	化学	261,600	9,110.14	2,383,212,624	8,069.00	2,110,850,400	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,643,600	163.53	2,394,667,908	143.80	2,105,749,680	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	752,700	2,566.95	1,932,143,265	2,723.50	2,049,978,450	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	321,000	6,643.24	2,132,480,040	6,280.00	2,015,880,000	0.81
日本	株式	S M C	機械	34,300	52,298.60	1,793,841,980	58,250.00	1,997,975,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	102,800	20,360.80	2,093,090,240	18,605.00	1,912,594,000	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,300	24,864.07	1,723,080,051	27,150.00	1,881,495,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	381,000	6,028.28	2,296,774,680	4,890.00	1,863,090,000	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	525,000	4,447.40	2,334,885,000	3,530.00	1,853,250,000	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	931,800	1,958.94	1,825,340,292	1,914.00	1,783,465,200	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	705,600	2,861.39	2,018,996,784	2,512.50	1,772,820,000	0.71
日本	株式	中外製薬	医薬品	341,800	3,581.50	1,224,156,700	4,721.00	1,613,637,800	0.64

(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	0.17
		建設業	2.51
		食料品	3.74
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.10
		医薬品	6.50
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.58
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.55
		機械	5.39
		電気機器	14.90
		輸送用機器	7.23
		精密機器	2.59
		その他製品	2.67
		電気・ガス業	1.42
		陸運業	3.80
		海運業	0.14
		空運業	0.36
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	10.07
		卸売業	4.72
		小売業	4.93
		銀行業	4.93
		証券、商品先物取引業	0.82
		保険業	1.98
		その他金融業	1.11
不動産業	1.97		
サービス業	5.44		
	小計	99.00	
合計		99.00	

(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	144	円	2,292,102,550	2,327,040,000	0.93

(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：2010年10月20日

作成基準日：2020年8月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 23,862円

純資産総額 334.18億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

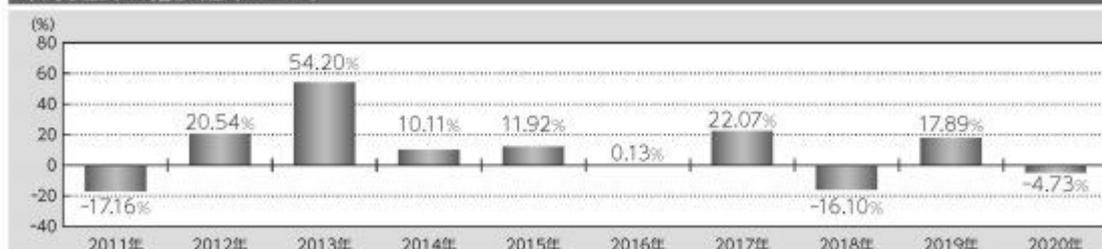
決算期	分配金
2016年7月	0円
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※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	2.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.2%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.7%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.4%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.4%
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	1.2%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.2%

※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。

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2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込み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

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なります。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2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。

< 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、5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、金融商品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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付け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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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及び借入公社債を除きます。）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>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）の評価方法
計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式の評価方法

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。

（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

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。（2010年10月20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】

当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2010年10月20日から2011年7月25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30億口を下回るようになった場合
- ・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）に係る書面決議の手続き

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、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を

記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・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又はファンドの併合を行う場合は、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等に係る書面決議の手続き

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。）又はファンドの併合について、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又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記 から までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 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。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、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等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

< 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10期計算期間(2019年7月26日から2020年7月27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】

【インデックスコレクション（国内株式）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2019年 7月25日現在）	第10期 （2020年 7月27日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,655,296	81,870,451
親投資信託受益証券	19,108,447,723	32,456,895,197
未収入金	16,189,866	25,492,879
流動資産合計	19,161,292,885	32,564,258,527
資産合計	19,161,292,885	32,564,258,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,685,996	66,598,615
未払受託者報酬	2,014,218	3,393,496
未払委託者報酬	14,099,460	20,360,959
未払利息	84	82
その他未払費用	503,498	812,358
流動負債合計	43,303,256	91,165,510
負債合計	43,303,256	91,165,510
純資産の部		
元本等		
元本	8,417,391,491	13,964,350,475
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,700,598,138	18,508,742,542
（分配準備積立金）	3,607,981,519	3,372,716,992
元本等合計	19,117,989,629	32,473,093,017
純資産合計	19,117,989,629	32,473,093,017
負債純資産合計	19,161,292,885	32,564,258,527

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自	2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
営業収益				
受取利息		22		425
有価証券売買等損益		1,519,258,706		335,564,405
営業収益合計		1,519,258,684		335,563,980
営業費用				
支払利息		33,489		39,857
受託者報酬		4,081,048		5,799,414
委託者報酬		28,567,189		35,834,865
その他費用		1,022,628		1,399,276
営業費用合計		33,704,354		43,073,412
営業利益又は営業損失（ ）		1,552,963,038		378,637,392
経常利益又は経常損失（ ）		1,552,963,038		378,637,392
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,552,963,038		378,637,392
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（ ）		189,991,857		175,301,458
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,620,903,932		10,700,598,138
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,511,506,305		12,086,365,720
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,511,506,305		12,086,365,720
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,068,840,918		4,074,885,382
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,068,840,918		4,074,885,382
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,700,598,138		18,508,742,542

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第10期計算期間は2019年7月26日から2020年7月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2019年7月25日現在)	第10期 (2020年7月27日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,417,391,491口	13,964,350,475口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2712円 (22,712円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3254円 (23,254円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 2018年7月26日 至 2019年7月25日			第10期 自 2019年7月26日 至 2020年7月27日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	416,421,147円	費用控除後の配当等収益額	A	603,361,092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	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	7,824,452,363円	収益調整金額	C	16,233,520,432円
分配準備積立金額	D	3,191,560,372円	分配準備積立金額	D	2,769,355,900円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,432,433,882円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,606,237,424円
当ファンドの期末残存口数	F	8,417,391,491口	当ファンドの期末残存口数	F	13,964,350,475口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	13,581円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,040円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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10期 (2020年 7月27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9期	第10期
	自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,909,626,318円	8,417,391,491円
期中追加設定元本額	1,929,446,327円	8,607,498,848円
期中一部解約元本額	1,421,681,154円	3,060,539,864円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 (2019年 7月25日現在)	第10期 (2020年 7月27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	1,409,686,067	304,051,530
合計	1,409,686,067	304,051,530

（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	日本株式マザーファンド	18,779,665,103	32,456,895,197	
合計		18,779,665,103	32,456,895,197	

(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。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年 7月27日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,685,622,764
株式	242,055,356,100
派生商品評価勘定	14,659,800
未収入金	29,729,500
未収配当金	367,626,198
前払金	7,450,900
差入委託証拠金	66,884,300
流動資産合計	244,227,329,562
資産合計	244,227,329,562
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,118,400
未払解約金	194,068,400
未払利息	1,699
流動負債合計	216,188,499
負債合計	216,188,499
純資産の部	
元本等	
元本	141,188,957,091
剰余金	
剰余金又は欠損金()	102,822,183,972

	2020年 7月27日現在
項目	金額（円）
元本等合計	244,011,141,063
純資産合計	244,011,141,063
負債純資産合計	244,227,329,562

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 7月27日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 7月27日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,188,957,091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 1.7283円 (1万口当たり純資産額) (17,283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 7月27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 7月27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 7月27日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 7月27日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	132,121,145,523円
期中追加設定元本額	30,005,424,209円
期中一部解約元本額	20,937,612,641円
期末元本額	141,188,957,091円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	685,120,870円
D C日本株式インデックスファンド	316,226,306円
D C日本株式インデックスファンドL	53,828,032,728円
D C日本株式インデックスファンドA	1,046,394,666円
D Cバランスファンド3 0	2,356,797,991円
D Cバランスファンド5 0	3,591,387,758円
D Cバランスファンド7 0	1,908,058,711円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	609,680,554円
日本株式インデックスe	1,639,873,322円
インデックスコレクション（国内株式）	18,779,665,103円

区分	2020年 7月27日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	13,085,065,639円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,383,317,353円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,834,147,653円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,561,299,634円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,687,745,204円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,364,532,003円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	79,868,931円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	907,297,792円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	109,087,666円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	385,096,402円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	3,538,484円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	761,543,953円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,111,559,493円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	588,732,400円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,731,258,805円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	850,404,996円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	130,746,682円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,636,302,663円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	43,472,978円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	194,239,331円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,503,042,391円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	76,498,383円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	78,986,563円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	39,948,949円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	900,548,362円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	394,847,426円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,621,219,697円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	123,878,361円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	53,114,218円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,864,808円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	172,518,631円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	1,993,231円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	22,207,367,164
合計	22,207,367,164

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」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 7月27日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,122,640,900	-	2,115,190,000	7,450,900
合計		2,122,640,900	-	2,115,190,000	7,450,900

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	2,720.00	14,144,000	
日本水産	148,800	468.00	69,638,400	
マルハニチロ	21,500	2,142.00	46,053,000	
カネコ種苗	4,500	1,450.00	6,525,000	
サカタのタネ	17,700	3,335.00	59,029,500	
ホクト	11,300	2,100.00	23,730,000	
ホクリヨウ	2,300	641.00	1,474,300	
住石ホールディングス	30,000	126.00	3,780,000	
日鉄鉱業	3,400	4,365.00	14,841,000	
三井松島ホールディングス	5,800	772.00	4,477,600	
国際石油開発帝石	596,800	668.00	398,662,400	
石油資源開発	19,400	1,859.00	36,064,600	
K & O エナジーグループ	7,200	1,527.00	10,994,400	
ヒノキヤグループ	3,700	1,560.00	5,772,000	
ショーボンドホールディングス	23,200	4,790.00	111,128,000	
ミライト・ホールディングス	44,200	1,598.00	70,631,600	
タマホーム	8,000	1,189.00	9,512,000	
サンヨーホームズ	1,300	612.00	795,600	
日本アクア	5,900	638.00	3,764,200	

ファーストコーポレーション	4,500	600.00	2,700,000	
ベストテラ	2,600	1,009.00	2,623,400	
TATERU	30,700	164.00	5,034,800	
キャンディル	2,500	562.00	1,405,000	
スペースバリューホールディングス	18,100	365.00	6,606,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	706.00	2,047,400	
第一カッター興業	1,800	2,511.00	4,519,800	
明豊ファシリティワークス	4,800	595.00	2,856,000	
安藤・間	88,600	601.00	53,248,600	
東急建設	43,600	542.00	23,631,200	
コムシスホールディングス	52,700	3,235.00	170,484,500	
ビーアールホールディングス	16,200	604.00	9,784,800	
高松コンストラクショングループ	9,300	2,322.00	21,594,600	
東建コーポレーション	4,600	7,130.00	32,798,000	
ソネック	1,500	821.00	1,231,500	
ヤマウラ	6,500	835.00	5,427,500	
大成建設	114,500	3,845.00	440,252,500	
大林組	343,500	998.00	342,813,000	
清水建設	348,600	843.00	293,869,800	
飛鳥建設	9,900	1,100.00	10,890,000	
長谷工コーポレーション	133,000	1,307.00	173,831,000	
松井建設	13,500	671.00	9,058,500	
銭高組	1,500	3,980.00	5,970,000	
鹿島建設	269,700	1,239.00	334,158,300	
不動テトラ	9,000	1,428.00	12,852,000	
大末建設	4,000	822.00	3,288,000	
鉄建建設	7,500	2,029.00	15,217,500	
西松建設	26,500	2,102.00	55,703,000	
三井住友建設	83,000	458.00	38,014,000	
大豊建設	7,700	2,418.00	18,618,600	
前田建設工業	86,000	760.00	65,360,000	
佐田建設	7,400	415.00	3,071,000	
ナカノフドー建設	9,400	399.00	3,750,600	
奥村組	18,600	2,589.00	48,155,400	
東鉄工業	14,700	2,711.00	39,851,700	
イチケン	2,500	1,541.00	3,852,500	
富士ピー・エス	5,100	598.00	3,049,800	
浅沼組	3,800	4,210.00	15,998,000	
戸田建設	142,600	705.00	100,533,000	
熊谷組	15,900	2,590.00	41,181,000	
北野建設	2,100	2,671.00	5,609,100	
植木組	1,500	2,444.00	3,666,000	

矢作建設工業	15,200	809.00	12,296,800
ピーエス三菱	11,300	520.00	5,876,000
日本ハウスホールディングス	23,400	268.00	6,271,200
大東建託	37,500	10,135.00	380,062,500
新日本建設	14,600	877.00	12,804,200
N I P P O	28,400	2,867.00	81,422,800
東亜道路工業	2,100	3,210.00	6,741,000
前田道路	30,300	2,009.00	60,872,700
日本道路	3,300	7,540.00	24,882,000
東亜建設工業	10,700	1,585.00	16,959,500
日本国土開発	33,400	560.00	18,704,000
若築建設	6,200	1,232.00	7,638,400
東洋建設	38,500	399.00	15,361,500
五洋建設	136,200	574.00	78,178,800
世紀東急工業	16,500	748.00	12,342,000
福田組	4,000	4,915.00	19,660,000
住友林業	87,000	1,317.00	114,579,000
日本基礎技術	11,500	403.00	4,634,500
巴コーポレーション	15,200	343.00	5,213,600
大和ハウス工業	339,900	2,540.00	863,346,000
ライト工業	19,700	1,528.00	30,101,600
積水ハウス	372,600	2,103.50	783,764,100
日特建設	9,000	788.00	7,092,000
北陸電気工事	5,900	1,002.00	5,911,800
ユアテック	19,600	658.00	12,896,800
日本リーテック	7,200	3,200.00	23,040,000
四電工	1,900	2,414.00	4,586,600
中電工	13,800	2,289.00	31,588,200
関電工	48,900	894.00	43,716,600
きんでん	81,600	1,716.00	140,025,600
東京エネシス	11,400	785.00	8,949,000
トーエネック	3,500	3,695.00	12,932,500
住友電設	9,700	2,389.00	23,173,300
日本電設工業	18,800	2,381.00	44,762,800
協和エクシオ	52,100	2,625.00	136,762,500
新日本空調	9,100	2,389.00	21,739,900
九電工	24,100	3,205.00	77,240,500
三機工業	24,800	1,263.00	31,322,400
日揮ホールディングス	105,700	1,144.00	120,920,800
中外炉工業	3,700	1,647.00	6,093,900
ヤマト	11,000	657.00	7,227,000
太平電業	8,300	2,169.00	18,002,700

高砂熱学工業	29,800	1,525.00	45,445,000
三晃金属工業	1,500	2,097.00	3,145,500
朝日工業社	2,300	3,170.00	7,291,000
明星工業	22,200	891.00	19,780,200
大気社	16,700	3,240.00	54,108,000
ダイダン	8,200	2,807.00	23,017,400
日比谷総合設備	11,100	1,913.00	21,234,300
フィル・カンパニー	2,000	1,837.00	3,674,000
OSJBホールディングス	54,200	244.00	13,224,800
東洋エンジニアリング	14,400	353.00	5,083,200
レイズネクスト	18,400	1,237.00	22,760,800
日本製粉	32,200	1,697.00	54,643,400
日清製粉グループ本社	124,200	1,576.00	195,739,200
日東富士製粉	800	6,050.00	4,840,000
昭和産業	10,100	3,450.00	34,845,000
鳥越製粉	9,700	932.00	9,040,400
中部飼料	13,400	1,674.00	22,431,600
フィード・ワン	73,800	202.00	14,907,600
東洋精糖	1,900	1,194.00	2,268,600
日本甜菜製糖	5,700	1,814.00	10,339,800
三井製糖	9,600	2,032.00	19,507,200
塩水港精糖	11,900	216.00	2,570,400
日新製糖	5,200	1,864.00	9,692,800
森永製菓	25,800	3,965.00	102,297,000
中村屋	2,800	4,100.00	11,480,000
江崎グリコ	32,600	5,030.00	163,978,000
名糖産業	5,300	1,381.00	7,319,300
井村屋グループ	6,200	2,350.00	14,570,000
不二家	6,100	2,188.00	13,346,800
山崎製パン	82,400	1,817.00	149,720,800
第一屋製パン	1,900	983.00	1,867,700
モロゾフ	1,900	5,450.00	10,355,000
亀田製菓	6,300	5,550.00	34,965,000
寿スピリッツ	10,600	4,060.00	43,036,000
カルビー	50,100	3,090.00	154,809,000
森永乳業	20,300	4,835.00	98,150,500
六甲バター	7,300	1,596.00	11,650,800
ヤクルト本社	75,600	6,410.00	484,596,000
明治ホールディングス	72,700	8,440.00	613,588,000
雪印メグミルク	26,500	2,538.00	67,257,000
プリマハム	17,200	2,752.00	47,334,400
日本ハム	42,000	4,325.00	181,650,000

林兼産業	3,600	572.00	2,059,200
丸大食品	11,700	1,943.00	22,733,100
S Foods	8,800	2,564.00	22,563,200
柿安本店	3,800	2,609.00	9,914,200
伊藤ハム米久ホールディングス	70,800	643.00	45,524,400
サッポロホールディングス	37,500	1,935.00	72,562,500
アサヒグループホールディングス	230,200	3,610.00	831,022,000
キリンホールディングス	466,300	2,083.00	971,302,900
宝ホールディングス	81,500	942.00	76,773,000
オエノンホールディングス	29,000	419.00	12,151,000
養命酒製造	3,400	1,828.00	6,215,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,200	1,749.00	135,022,800
サントリー食品インターナショナル	73,600	4,135.00	304,336,000
ダイトーグループホールディングス	5,600	4,685.00	26,236,000
伊藤園	33,400	6,290.00	210,086,000
キーコーヒー	10,800	2,216.00	23,932,800
ユニカフェ	2,800	1,015.00	2,842,000
ジャパンフーズ	1,600	1,218.00	1,948,800
日清オイリオグループ	14,100	3,345.00	47,164,500
不二製油グループ本社	26,800	2,849.00	76,353,200
かどや製油	1,200	3,765.00	4,518,000
J - オイルミルズ	5,700	4,080.00	23,256,000
キッコーマン	79,100	4,895.00	387,194,500
味の素	242,800	1,731.50	420,408,200
キューピー	61,200	1,946.00	119,095,200
ハウス食品グループ本社	41,100	3,355.00	137,890,500
カゴメ	41,700	3,140.00	130,938,000
焼津水産化学工業	5,300	900.00	4,770,000
アリアケジャパン	10,000	6,670.00	66,700,000
ピエトロ	1,400	1,650.00	2,310,000
エバラ食品工業	2,700	2,190.00	5,913,000
やまみ	900	2,227.00	2,004,300
ニチレイ	52,400	2,916.00	152,798,400
東洋水産	56,600	6,330.00	358,278,000
イトアンド	3,800	1,800.00	6,840,000
大冷	1,400	2,073.00	2,902,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,100	903.00	5,508,300
日清食品ホールディングス	46,700	9,510.00	444,117,000
永谷園ホールディングス	5,400	2,196.00	11,858,400
一正蒲鉾	4,300	1,003.00	4,312,900
フジッコ	11,900	2,081.00	24,763,900
ロック・フィールド	11,800	1,291.00	15,233,800

日本たばこ産業	634,800	1,897.50	1,204,533,000
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,902.00	11,792,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,576.00	11,347,200
なとり	6,100	1,820.00	11,102,000
イフジ産業	1,900	834.00	1,584,600
ピクルスコーポレーション	2,400	2,809.00	6,741,600
北の達人コーポレーション	38,400	528.00	20,275,200
ユーグレナ	47,400	766.00	36,308,400
ミヨシ油脂	4,200	1,131.00	4,750,200
理研ビタミン	10,400	2,359.00	24,533,600
片倉工業	15,900	1,137.00	18,078,300
ゲンゼ	8,000	4,055.00	32,440,000
東洋紡	42,600	1,531.00	65,220,600
ユニチカ	32,400	358.00	11,599,200
富士紡ホールディングス	5,300	3,040.00	16,112,000
倉敷紡績	10,800	2,139.00	23,101,200
シキボウ	5,600	1,051.00	5,885,600
日本毛織	35,600	957.00	34,069,200
トーア紡コーポレーション	4,300	482.00	2,072,600
帝国繊維	12,200	2,443.00	29,804,600
帝人	87,700	1,660.00	145,582,000
東レ	777,500	499.30	388,205,750
サカイオーベックス	3,000	2,225.00	6,675,000
住江織物	2,400	1,978.00	4,747,200
日本フェルト	6,800	485.00	3,298,000
イチカワ	1,800	1,300.00	2,340,000
日東製網	1,200	1,397.00	1,676,400
アツギ	9,000	583.00	5,247,000
ダイニック	4,000	787.00	3,148,000
セーレン	26,600	1,328.00	35,324,800
ソトー	4,300	958.00	4,119,400
東海染工	1,500	1,125.00	1,687,500
小松マテーレ	17,700	748.00	13,239,600
ワコールホールディングス	27,600	1,961.00	54,123,600
ホギメディカル	12,300	3,275.00	40,282,500
クラウディアホールディングス	2,800	332.00	929,600
T S Iホールディングス	36,100	322.00	11,624,200
マツオカコーポレーション	3,100	1,853.00	5,744,300
ワールド	15,300	1,398.00	21,389,400
三陽商会	5,600	628.00	3,516,800
ナイガイ	4,100	354.00	1,451,400
オンワードホールディングス	64,700	311.00	20,121,700

ルックホールディングス	3,800	734.00	2,789,200	
ゴールドウイン	19,500	6,610.00	128,895,000	
デサント	21,000	1,807.00	37,947,000	
キング	5,200	535.00	2,782,000	
ヤマトインターナショナル	9,600	340.00	3,264,000	
特種東海製紙	6,800	4,765.00	32,402,000	
王子ホールディングス	448,500	477.00	213,934,500	
日本製紙	47,400	1,434.00	67,971,600	
三菱製紙	12,200	349.00	4,257,800	
北越コーポレーション	64,000	373.00	23,872,000	
中越パルプ工業	4,500	1,561.00	7,024,500	
巴川製紙所	3,200	879.00	2,812,800	
大王製紙	47,300	1,437.00	67,970,100	
阿波製紙	2,800	486.00	1,360,800	
レンゴー	101,400	833.00	84,466,200	
トモク	6,600	1,819.00	12,005,400	
ザ・パック	8,100	2,858.00	23,149,800	
クラレ	169,000	1,100.00	185,900,000	
旭化成	711,100	812.00	577,413,200	
共和レザー	5,800	642.00	3,723,600	
昭和電工	76,400	2,366.00	180,762,400	
住友化学	788,200	332.00	261,682,400	
住友精化	4,800	3,430.00	16,464,000	
日産化学	59,600	5,700.00	339,720,000	
ラサ工業	3,800	1,584.00	6,019,200	
クレハ	9,200	4,640.00	42,688,000	
多木化学	4,200	7,100.00	29,820,000	
テイカ	7,900	1,369.00	10,815,100	
石原産業	19,200	731.00	14,035,200	
片倉コープアグリ	2,800	1,242.00	3,477,600	
日本曹達	15,900	2,846.00	45,251,400	
東ソー	165,800	1,479.00	245,218,200	
トクヤマ	30,900	2,621.00	80,988,900	
セントラル硝子	21,900	2,037.00	44,610,300	
東亜合成	67,300	1,087.00	73,155,100	
大阪ソーダ	10,900	2,378.00	25,920,200	
関東電化工業	25,400	857.00	21,767,800	
デンカ	39,200	2,701.00	105,879,200	
信越化学工業	184,200	13,525.00	2,491,305,000	
日本カーバイド工業	3,700	1,231.00	4,554,700	
堺化学工業	6,900	2,140.00	14,766,000	
第一稀元素化学工業	11,600	788.00	9,140,800	

エア・ウォーター	99,800	1,466.00	146,306,800
大陽日酸	103,100	1,887.00	194,549,700
日本化学工業	3,300	2,228.00	7,352,400
東邦アセチレン	1,600	1,232.00	1,971,200
日本パーカライジング	54,100	1,124.00	60,808,400
高压ガス工業	17,000	850.00	14,450,000
チタン工業	1,300	1,770.00	2,301,000
四国化成工業	16,500	1,142.00	18,843,000
戸田工業	2,500	1,794.00	4,485,000
ステラ ケミファ	5,800	2,827.00	16,396,600
保土谷化学工業	4,000	4,705.00	18,820,000
日本触媒	16,700	5,580.00	93,186,000
大日精化工業	9,500	2,479.00	23,550,500
カネカ	27,800	2,683.00	74,587,400
三菱瓦斯化学	99,800	1,676.00	167,264,800
三井化学	97,400	2,200.00	214,280,000
J S R	100,000	2,273.00	227,300,000
東京応化工業	18,400	5,720.00	105,248,000
大阪有機化学工業	9,900	2,822.00	27,937,800
三菱ケミカルホールディングス	717,200	622.10	446,170,120
K Hネオケム	18,900	2,127.00	40,200,300
ダイセル	139,700	797.00	111,340,900
住友ベークライト	16,900	2,903.00	49,060,700
積水化学工業	226,900	1,526.00	346,249,400
日本ゼオン	96,800	1,046.00	101,252,800
アイカ工業	32,200	3,620.00	116,564,000
宇部興産	54,200	1,806.00	97,885,200
積水樹脂	19,300	2,234.00	43,116,200
タキロンシーアイ	23,200	707.00	16,402,400
旭有機材	6,100	1,409.00	8,594,900
ニチバン	5,600	1,558.00	8,724,800
リケンテクノス	27,000	421.00	11,367,000
大倉工業	5,100	1,550.00	7,905,000
積水化成成品工業	14,400	573.00	8,251,200
群栄化学工業	2,400	2,437.00	5,848,800
タイガースポリマー	5,600	474.00	2,654,400
ミライアル	3,800	1,114.00	4,233,200
ダイキアクシス	3,800	791.00	3,005,800
ダイキョーニシカワ	22,600	502.00	11,345,200
竹本容器	3,800	705.00	2,679,000
森六ホールディングス	5,800	1,669.00	9,680,200
日本化薬	66,400	1,079.00	71,645,600

カーリットホールディングス	11,500	520.00	5,980,000	
日本精化	8,600	1,459.00	12,547,400	
扶桑化学工業	10,900	4,220.00	45,998,000	
トリケミカル研究所	2,400	11,150.00	26,760,000	
A D E K A	49,400	1,492.00	73,704,800	
日油	40,400	4,000.00	161,600,000	
新日本理化	17,800	164.00	2,919,200	
ハリマ化成グループ	8,900	987.00	8,784,300	
花王	262,300	8,544.00	2,241,091,200	
第一工業製薬	4,000	4,950.00	19,800,000	
石原ケミカル	2,900	2,023.00	5,866,700	
日華化学	3,600	876.00	3,153,600	
ニイタカ	2,200	3,245.00	7,139,000	
三洋化成工業	6,400	4,815.00	30,816,000	
有機合成薬品工業	8,200	358.00	2,935,600	
大日本塗料	12,100	996.00	12,051,600	
日本ペイントホールディングス	88,500	7,640.00	676,140,000	
関西ペイント	120,500	2,156.00	259,798,000	
神東塗料	8,400	167.00	1,402,800	
中国塗料	30,500	866.00	26,413,000	
日本特殊塗料	8,000	1,037.00	8,296,000	
藤倉化成	14,500	554.00	8,033,000	
太陽ホールディングス	7,900	5,160.00	40,764,000	
D I C	45,300	2,728.00	123,578,400	
サカタインクス	23,400	1,063.00	24,874,200	
東洋インキＳＣホールディングス	22,700	2,059.00	46,739,300	
T & K T O K A	8,300	841.00	6,980,300	
富士フイルムホールディングス	210,000	4,777.00	1,003,170,000	
資生堂	217,700	6,615.00	1,440,085,500	
ライオン	142,400	2,771.00	394,590,400	
高砂香料工業	6,900	2,167.00	14,952,300	
マンダム	24,600	1,861.00	45,780,600	
ミルボン	14,600	5,080.00	74,168,000	
ファンケル	44,300	3,195.00	141,538,500	
コーセー	20,600	12,030.00	247,818,000	
コタ	6,300	1,210.00	7,623,000	
シーボン	1,400	1,913.00	2,678,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,800	1,752.00	81,993,600	
ノエビアホールディングス	9,300	4,570.00	42,501,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	939.00	2,253,600	
エステー	7,000	1,850.00	12,950,000	
アグロ カネショウ	4,600	1,433.00	6,591,800	

コニシ	18,000	1,513.00	27,234,000
長谷川香料	18,900	2,291.00	43,299,900
星光P M C	6,300	735.00	4,630,500
小林製薬	30,700	9,100.00	279,370,000
荒川化学工業	9,800	1,258.00	12,328,400
メック	7,500	2,023.00	15,172,500
日本高純度化学	3,000	2,585.00	7,755,000
タカラバイオ	28,700	2,914.00	83,631,800
J C U	13,300	3,270.00	43,491,000
新田ゼラチン	6,900	667.00	4,602,300
O A T アグリオ	1,900	1,082.00	2,055,800
デクセリアルズ	28,300	878.00	24,847,400
アース製薬	8,300	7,370.00	61,171,000
北興化学工業	11,200	602.00	6,742,400
大成ラミック	3,600	2,790.00	10,044,000
クミアイ化学工業	45,300	1,079.00	48,878,700
日本農薬	19,500	537.00	10,471,500
アキレス	7,600	1,942.00	14,759,200
有沢製作所	17,300	796.00	13,770,800
日東電工	75,600	6,290.00	475,524,000
レック	11,700	1,621.00	18,965,700
三光合成	12,500	277.00	3,462,500
きもと	18,600	180.00	3,348,000
藤森工業	9,800	3,585.00	35,133,000
前澤化成工業	7,000	1,002.00	7,014,000
未来工業	5,900	1,926.00	11,363,400
ウェーブロックホールディングス	3,800	825.00	3,135,000
J S P	6,400	1,485.00	9,504,000
エフピコ	12,000	8,520.00	102,240,000
天馬	7,300	1,682.00	12,278,600
信越ポリマー	19,700	1,002.00	19,739,400
東リ	27,300	272.00	7,425,600
ニフコ	40,200	2,518.00	101,223,600
バルカー	8,900	1,917.00	17,061,300
ユニ・チャーム	211,100	4,779.00	1,008,846,900
ショーエイコーポレーション	1,600	959.00	1,534,400
協和キリン	110,200	2,686.00	295,997,200
武田薬品工業	911,400	3,807.00	3,469,699,800
アステラス製薬	949,700	1,739.50	1,652,003,150
大日本住友製薬	81,200	1,376.00	111,731,200
塩野義製薬	137,800	6,374.00	878,337,200
わかもと製薬	13,000	267.00	3,471,000

あすか製薬	12,500	1,200.00	15,000,000
日本新薬	28,700	8,430.00	241,941,000
ピオフェルミン製薬	1,900	2,415.00	4,588,500
中外製薬	342,600	5,095.00	1,745,547,000
科研製薬	18,700	4,985.00	93,219,500
エーザイ	131,100	8,746.00	1,146,600,600
ロート製薬	56,200	3,355.00	188,551,000
小野薬品工業	251,600	3,039.00	764,612,400
久光製薬	29,000	4,780.00	138,620,000
持田製薬	15,200	3,965.00	60,268,000
参天製薬	204,100	1,872.00	382,075,200
扶桑薬品工業	3,900	2,490.00	9,711,000
日本ケミファ	1,400	2,549.00	3,568,600
ツムラ	33,900	2,754.00	93,360,600
日医工	31,000	1,292.00	40,052,000
キッセイ薬品工業	19,400	2,306.00	44,736,400
生化学工業	21,300	1,092.00	23,259,600
栄研化学	19,300	1,677.00	32,366,100
日水製薬	4,600	1,137.00	5,230,200
鳥居薬品	6,900	3,500.00	24,150,000
JCRファーマ	7,700	10,380.00	79,926,000
東和薬品	14,000	1,987.00	27,818,000
富士製薬工業	7,400	1,155.00	8,547,000
沢井製薬	22,500	5,330.00	119,925,000
ゼリア新薬工業	19,900	1,932.00	38,446,800
第一三共	313,500	8,666.00	2,716,791,000
キョーリン製薬ホールディングス	24,200	2,010.00	48,642,000
大幸薬品	13,400	2,170.00	29,078,000
ダイト	6,700	3,145.00	21,071,500
大塚ホールディングス	208,700	4,508.00	940,819,600
大正製薬ホールディングス	23,200	6,350.00	147,320,000
ペプチドリーム	55,700	4,520.00	251,764,000
日本コークス工業	92,500	65.00	6,012,500
ニチレキ	12,900	1,681.00	21,684,900
ユシロ化学工業	6,100	1,330.00	8,113,000
ビーピー・カストロール	3,900	1,153.00	4,496,700
富士石油	29,200	164.00	4,788,800
MORESCO	4,000	1,021.00	4,084,000
出光興産	121,600	2,307.00	280,531,200
Eneosホールディングス	1,647,800	392.80	647,255,840
コスモエネルギーホールディングス	31,700	1,640.00	51,988,000
横浜ゴム	63,400	1,520.00	96,368,000

TOYO TIRE	62,900	1,497.00	94,161,300
ブリヂストン	315,500	3,428.00	1,081,534,000
住友ゴム工業	98,400	980.00	96,432,000
藤倉コンポジット	9,600	382.00	3,667,200
オカモト	6,700	4,210.00	28,207,000
フコク	4,800	630.00	3,024,000
ニッタ	12,400	2,337.00	28,978,800
住友理工	21,200	585.00	12,402,000
三ツ星ベルト	14,400	1,867.00	26,884,800
バンドー化学	19,300	666.00	12,853,800
日東紡績	16,300	5,050.00	82,315,000
A G C	108,300	3,095.00	335,188,500
日本板硝子	52,400	402.00	21,064,800
石塚硝子	2,000	1,837.00	3,674,000
日本山村硝子	4,600	879.00	4,043,400
日本電気硝子	44,000	1,724.00	75,856,000
オハラ	4,400	1,037.00	4,562,800
住友大阪セメント	20,700	3,740.00	77,418,000
太平洋セメント	69,200	2,433.00	168,363,600
日本ヒューム	11,000	802.00	8,822,000
日本コンクリート工業	23,700	278.00	6,588,600
三谷セキサン	5,100	5,700.00	29,070,000
アジアパイルホールディングス	15,600	490.00	7,644,000
東海カーボン	114,800	970.00	111,356,000
日本カーボン	5,600	3,480.00	19,488,000
東洋炭素	6,400	1,759.00	11,257,600
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	3,340.00	20,374,000
T O T O	78,300	4,200.00	328,860,000
日本碍子	131,500	1,460.00	191,990,000
日本特殊陶業	83,300	1,550.00	129,115,000
M A R U W A	4,200	8,610.00	36,162,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,241.00	6,498,900
黒崎播磨	2,200	3,540.00	7,788,000
ヨータイ	8,700	730.00	6,351,000
イソライト工業	5,700	434.00	2,473,800
東京窯業	14,000	311.00	4,354,000
ニッカトー	5,000	730.00	3,650,000
フジミインコーポレーテッド	9,800	3,630.00	35,574,000
クニミネ工業	4,400	988.00	4,347,200
エーアンドエーマテリアル	1,900	1,036.00	1,968,400
ニチアス	30,000	2,432.00	72,960,000
ニチハ	15,200	2,360.00	35,872,000

日本製鉄	484,800	985.50	477,770,400
神戸製鋼所	198,400	383.00	75,987,200
中山製鋼所	15,200	369.00	5,608,800
合同製鐵	5,900	1,813.00	10,696,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	292,600	786.00	229,983,600
東京製鐵	52,800	640.00	33,792,000
共英製鋼	12,300	1,281.00	15,756,300
大和工業	23,000	2,231.00	51,313,000
東京鐵鋼	4,500	1,532.00	6,894,000
大阪製鐵	5,800	1,232.00	7,145,600
淀川製鋼所	14,700	1,920.00	28,224,000
丸一鋼管	35,200	2,675.00	94,160,000
モリ工業	3,300	2,254.00	7,438,200
大同特殊鋼	17,700	3,495.00	61,861,500
日本高周波鋼業	4,100	337.00	1,381,700
日本冶金工業	9,000	1,596.00	14,364,000
山陽特殊製鋼	7,500	879.00	6,592,500
愛知製鋼	6,100	2,896.00	17,665,600
日立金属	116,700	1,353.00	157,895,100
日本金属	2,500	597.00	1,492,500
大平洋金属	7,400	1,601.00	11,847,400
新日本電工	70,100	153.00	10,725,300
栗本鐵工所	5,400	1,646.00	8,888,400
虹技	1,600	1,278.00	2,044,800
三菱製鋼	8,100	612.00	4,957,200
日亜鋼業	16,000	303.00	4,848,000
日本精線	1,800	3,545.00	6,381,000
エンビプロ・ホールディングス	4,700	528.00	2,481,600
シンニッタン	17,000	233.00	3,961,000
新家工業	2,500	1,186.00	2,965,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	549.00	9,882,000
日本軽金属ホールディングス	274,700	186.00	51,094,200
三井金属鋳業	29,300	2,377.00	69,646,100
東邦亜鉛	5,600	1,626.00	9,105,600
三菱マテリアル	71,600	2,283.00	163,462,800
住友金属鋳山	138,500	3,309.00	458,296,500
D O W A ホールディングス	27,400	3,255.00	89,187,000
古河機械金属	19,400	1,108.00	21,495,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,400	916.00	10,442,400
東邦チタニウム	19,600	676.00	13,249,600
U A C J	16,500	1,878.00	30,987,000
C K サンエツ	2,300	3,095.00	7,118,500

古河電気工業	33,700	2,628.00	88,563,600
住友電気工業	405,100	1,258.50	509,818,350
フジクラ	130,800	314.00	41,071,200
昭和電線ホールディングス	12,600	1,313.00	16,543,800
東京特殊電線	1,700	2,290.00	3,893,000
タツタ電線	21,700	567.00	12,303,900
カナレ電気	1,900	1,698.00	3,226,200
平河ヒューテック	5,500	964.00	5,302,000
リョービ	13,400	1,160.00	15,544,000
アーレスティ	14,500	360.00	5,220,000
アサヒホールディングス	19,000	3,145.00	59,755,000
稲葉製作所	6,100	1,426.00	8,698,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,643.00	5,421,900
トーカロ	30,100	1,211.00	36,451,100
アルファC o	3,800	952.00	3,617,600
SUMCO	128,700	1,669.00	214,800,300
川田テクノロジーズ	2,200	4,650.00	10,230,000
RS Technologies	3,100	3,950.00	12,245,000
信和	6,200	707.00	4,383,400
東洋製罐グループホールディングス	69,000	1,216.00	83,904,000
ホッカンホールディングス	6,000	1,853.00	11,118,000
コロナ	6,000	1,023.00	6,138,000
横河ブリッジホールディングス	20,100	2,083.00	41,868,300
駒井ハルテック	2,000	1,378.00	2,756,000
高田機工	1,000	2,417.00	2,417,000
三和ホールディングス	102,100	923.00	94,238,300
文化シャッター	31,900	719.00	22,936,100
三協立山	14,000	924.00	12,936,000
アルインコ	7,900	922.00	7,283,800
東洋シャッター	2,600	700.00	1,820,000
LIXILグループ	159,800	1,533.00	244,973,400
日本フィルコン	8,300	484.00	4,017,200
ノーリツ	22,500	1,356.00	30,510,000
長府製作所	11,000	2,270.00	24,970,000
リンナイ	21,100	8,980.00	189,478,000
ダイニチ工業	5,800	674.00	3,909,200
日東精工	15,000	452.00	6,780,000
三洋工業	1,400	1,962.00	2,746,800
岡部	22,000	826.00	18,172,000
ジーテクト	13,400	970.00	12,998,000
東プレ	20,200	1,148.00	23,189,600
高周波熱錬	20,800	520.00	10,816,000

東京製綱	7,700	571.00	4,396,700
サンコール	8,100	415.00	3,361,500
モリテック スチール	8,400	308.00	2,587,200
パイオラックス	16,000	1,620.00	25,920,000
エイチワン	10,600	558.00	5,914,800
日本発條	116,200	667.00	77,505,400
中央発條	1,300	2,722.00	3,538,600
アドバネクス	1,600	1,385.00	2,216,000
立川ブラインド工業	4,800	1,200.00	5,760,000
三益半導体工業	8,500	2,359.00	20,051,500
日本ドライケミカル	2,700	1,637.00	4,419,900
日本製鋼所	32,900	1,590.00	52,311,000
三浦工業	46,900	4,195.00	196,745,500
タクマ	36,800	1,506.00	55,420,800
ツガミ	22,600	941.00	21,266,600
オークマ	12,700	4,600.00	58,420,000
芝浦機械	12,300	2,114.00	26,002,200
アマダ	134,500	780.00	104,910,000
アイダエンジニアリング	28,500	720.00	20,520,000
滝澤鉄工所	3,400	1,035.00	3,519,000
F U J I	46,600	1,990.00	92,734,000
牧野フライス製作所	12,700	3,505.00	44,513,500
オーエスジー	50,100	1,620.00	81,162,000
ダイジェット工業	1,300	1,472.00	1,913,600
旭ダイヤモンド工業	28,600	483.00	13,813,800
D M G 森精機	68,600	1,257.00	86,230,200
ソディック	25,500	867.00	22,108,500
ディスコ	14,700	26,810.00	394,107,000
日東工器	6,000	2,079.00	12,474,000
日進工具	4,300	2,717.00	11,683,100
パンチ工業	9,900	429.00	4,247,100
富士ダイス	4,900	708.00	3,469,200
豊和工業	6,100	824.00	5,026,400
O K K	4,400	373.00	1,641,200
東洋機械金属	7,900	408.00	3,223,200
津田駒工業	2,200	860.00	1,892,000
エンシュウ	2,700	936.00	2,527,200
島精機製作所	17,100	1,410.00	24,111,000
オプトラン	12,100	2,473.00	29,923,300
N C ホールディングス	3,400	579.00	1,968,600
イワキポンプ	6,900	969.00	6,686,100
フリュー	10,600	975.00	10,335,000

ヤマシンフィルタ	23,600	1,033.00	24,378,800
日阪製作所	13,400	789.00	10,572,600
やまびこ	21,100	970.00	20,467,000
平田機工	5,100	6,230.00	31,773,000
ペガサスミシン製造	11,200	310.00	3,472,000
マルマエ	4,100	1,020.00	4,182,000
タツモ	5,100	1,652.00	8,425,200
ナブテスコ	63,900	3,495.00	223,330,500
三井海洋開発	11,500	1,570.00	18,055,000
レオン自動機	10,700	1,324.00	14,166,800
S M C	34,400	58,420.00	2,009,648,000
ホソカワミクロン	3,800	6,080.00	23,104,000
ユニオンツール	4,100	2,743.00	11,246,300
オイレス工業	14,000	1,485.00	20,790,000
日精エー・エス・ビー機械	3,200	2,939.00	9,404,800
サトーホールディングス	15,500	2,345.00	36,347,500
技研製作所	9,500	4,290.00	40,755,000
日本エアージェット	3,900	1,401.00	5,463,900
カワタ	3,300	751.00	2,478,300
日精樹脂工業	9,200	825.00	7,590,000
オカダアイヨン	3,500	932.00	3,262,000
ワイエイシイホールディングス	4,600	707.00	3,252,200
小松製作所	496,200	2,344.50	1,163,340,900
住友重機械工業	62,700	2,350.00	147,345,000
日立建機	43,900	3,290.00	144,431,000
日工	15,100	634.00	9,573,400
巴工業	4,700	1,887.00	8,868,900
井関農機	11,000	1,221.00	13,431,000
T O W A	11,100	1,382.00	15,340,200
丸山製作所	2,300	1,236.00	2,842,800
北川鉄工所	5,000	1,625.00	8,125,000
ローツェ	4,800	5,900.00	28,320,000
タカキタ	3,900	648.00	2,527,200
クボタ	581,200	1,611.00	936,313,200
荏原実業	2,800	2,907.00	8,139,600
三菱化工機	3,800	1,875.00	7,125,000
月島機械	20,300	1,224.00	24,847,200
帝国電機製作所	9,100	1,226.00	11,156,600
新東工業	26,100	761.00	19,862,100
澁谷工業	9,600	2,940.00	28,224,000
アイチ コーポレーション	19,100	805.00	15,375,500
小森コーポレーション	27,900	733.00	20,450,700

鶴見製作所	8,500	1,894.00	16,099,000
住友精密工業	1,700	2,272.00	3,862,400
日本ギア工業	4,600	281.00	1,292,600
酒井重工業	2,100	2,240.00	4,704,000
荏原製作所	45,400	2,706.00	122,852,400
石井鐵工所	1,500	2,515.00	3,772,500
西島製作所	11,200	896.00	10,035,200
北越工業	11,300	1,195.00	13,503,500
ダイキン工業	139,600	19,365.00	2,703,354,000
オルガノ	4,000	5,590.00	22,360,000
トーヨーカネツ	4,800	2,125.00	10,200,000
栗田工業	59,300	3,020.00	179,086,000
椿本チエイン	15,700	2,666.00	41,856,200
大同工業	5,400	635.00	3,429,000
木村化工機	9,400	443.00	4,164,200
アネスト岩田	17,100	847.00	14,483,700
ダイフク	56,000	9,960.00	557,760,000
サムコ	2,800	2,935.00	8,218,000
加藤製作所	6,100	1,281.00	7,814,100
油研工業	1,900	1,562.00	2,967,800
タダノ	53,000	912.00	48,336,000
フジテック	39,800	1,827.00	72,714,600
C K D	30,100	2,184.00	65,738,400
キトー	8,300	1,211.00	10,051,300
平和	30,600	1,850.00	56,610,000
理想科学工業	9,700	1,431.00	13,880,700
S A N K Y O	24,400	2,738.00	66,807,200
日本金銭機械	12,200	572.00	6,978,400
マースグループホールディングス	7,000	1,687.00	11,809,000
フクシマガリレイ	6,800	3,345.00	22,746,000
オーイズミ	4,700	378.00	1,776,600
ダイコク電機	5,100	1,289.00	6,573,900
竹内製作所	18,400	1,918.00	35,291,200
アマノ	28,700	2,191.00	62,881,700
J U K I	15,200	500.00	7,600,000
蛇の目マシン工業	10,100	463.00	4,676,300
マックス	16,800	1,551.00	26,056,800
グローリー	28,200	2,498.00	70,443,600
新晃工業	10,200	1,459.00	14,881,800
大和冷機工業	15,900	975.00	15,502,500
セガサミーホールディングス	108,700	1,302.00	141,527,400
日本ピストンリング	4,000	1,241.00	4,964,000

リケン	5,100	2,809.00	14,325,900
T P R	14,800	1,421.00	21,030,800
ツバキ・ナカシマ	22,400	823.00	18,435,200
ホシザキ	32,000	8,510.00	272,320,000
大豊工業	9,000	565.00	5,085,000
日本精工	206,300	788.00	162,564,400
N T N	253,800	213.00	54,059,400
ジェイテクト	105,100	818.00	85,971,800
不二越	10,200	3,320.00	33,864,000
日本トムソン	32,700	346.00	11,314,200
T H K	63,800	2,694.00	171,877,200
ユーシン精機	8,600	710.00	6,106,000
前澤給装工業	4,000	2,037.00	8,148,000
イーグル工業	13,600	705.00	9,588,000
前澤工業	7,400	398.00	2,945,200
日本ピラー工業	11,100	1,534.00	17,027,400
キッツ	44,500	710.00	31,595,000
マキタ	142,900	4,120.00	588,748,000
日立造船	87,100	385.00	33,533,500
三菱重工業	183,600	2,668.50	489,936,600
I H I	79,000	1,565.00	123,635,000
スター精密	16,900	1,277.00	21,581,300
日清紡ホールディングス	73,100	760.00	55,556,000
イビデン	67,200	2,980.00	200,256,000
コニカミノルタ	240,600	369.00	88,781,400
ブラザー工業	134,000	1,880.00	251,920,000
ミネベアミツミ	203,600	1,876.00	381,953,600
日立製作所	526,400	3,340.00	1,758,176,000
三菱電機	1,095,400	1,427.00	1,563,135,800
富士電機	66,000	2,914.00	192,324,000
東洋電機製造	4,100	1,164.00	4,772,400
安川電機	117,900	3,745.00	441,535,500
シンフォニアテクノロジー	14,300	1,108.00	15,844,400
明電舎	20,200	1,732.00	34,986,400
オリジン	3,000	1,308.00	3,924,000
山洋電気	5,400	5,000.00	27,000,000
デンヨー	9,400	2,075.00	19,505,000
東芝テック	13,700	4,435.00	60,759,500
芝浦メカトロニクス	2,100	2,805.00	5,890,500
マブチモーター	30,400	3,405.00	103,512,000
日本電産	263,700	8,395.00	2,213,761,500
トレックス・セミコンダクター	6,600	1,199.00	7,913,400

東光高岳	6,500	1,029.00	6,688,500
ダイヘン	12,000	4,055.00	48,660,000
ヤーマン	18,300	1,019.00	18,647,700
JVCケンウッド	92,100	157.00	14,459,700
ミマキエンジニアリング	11,100	388.00	4,306,800
第一精工	4,700	1,984.00	9,324,800
日新電機	25,800	1,043.00	26,909,400
大崎電気工業	22,000	521.00	11,462,000
オムロン	98,200	7,490.00	735,518,000
日東工業	16,100	1,821.00	29,318,100
I D E C	15,900	1,735.00	27,586,500
正興電機製作所	3,000	1,014.00	3,042,000
不二電機工業	2,200	1,327.00	2,919,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,800	1,817.00	66,865,600
サクサホールディングス	2,600	1,513.00	3,933,800
メルコホールディングス	3,900	3,200.00	12,480,000
テクノメディカ	2,700	1,857.00	5,013,900
日本電気	132,900	5,930.00	788,097,000
富士通	105,600	14,010.00	1,479,456,000
沖電気工業	44,600	1,086.00	48,435,600
岩崎通信機	4,800	843.00	4,046,400
電気興業	5,300	2,488.00	13,186,400
サンケン電気	12,000	2,160.00	25,920,000
ナカヨ	2,200	1,481.00	3,258,200
アイホン	6,300	1,532.00	9,651,600
ルネサスエレクトロニクス	525,700	574.00	301,751,800
セイコーエプソン	136,000	1,245.00	169,320,000
ワコム	74,500	593.00	44,178,500
アルバック	20,200	3,350.00	67,670,000
アクセル	5,200	865.00	4,498,000
E I Z O	8,500	4,160.00	35,360,000
日本信号	28,000	1,070.00	29,960,000
京三製作所	25,800	556.00	14,344,800
能美防災	14,700	2,163.00	31,796,100
ホーチキ	8,300	1,199.00	9,951,700
星和電機	6,100	611.00	3,727,100
エレコム	12,300	5,440.00	66,912,000
パナソニック	1,251,600	1,039.00	1,300,412,400
シャープ	126,800	1,171.00	148,482,800
アンリツ	70,600	2,459.00	173,605,400
富士通ゼネラル	29,800	2,603.00	77,569,400
ソニー	686,200	8,196.00	5,624,095,200

TDK	52,900	10,700.00	566,030,000	
帝国通信工業	5,200	1,215.00	6,318,000	
タムラ製作所	36,800	463.00	17,038,400	
アルプスアルパイン	97,300	1,422.00	138,360,600	
池上通信機	3,500	879.00	3,076,500	
鈴木	6,000	685.00	4,110,000	
日本トリム	1,600	3,190.00	5,104,000	
ローランド ディー・ジー・	6,400	1,224.00	7,833,600	
フォスター電機	11,600	1,122.00	13,015,200	
SMK	2,800	2,658.00	7,442,400	
ヨコオ	7,300	2,687.00	19,615,100	
ホシデン	30,400	943.00	28,667,200	
ヒロセ電機	17,000	11,670.00	198,390,000	
日本航空電子工業	25,200	1,429.00	36,010,800	
TOA	11,900	759.00	9,032,100	
マクセルホールディングス	24,000	926.00	22,224,000	
古野電気	14,600	1,019.00	14,877,400	
ユニデンホールディングス	3,100	1,759.00	5,452,900	
スミダコーポレーション	9,000	712.00	6,408,000	
アイコム	6,100	3,020.00	18,422,000	
リオン	4,800	2,069.00	9,931,200	
本多通信工業	10,400	430.00	4,472,000	
横河電機	100,500	1,692.00	170,046,000	
新電元工業	3,900	2,142.00	8,353,800	
アズビル	69,200	3,530.00	244,276,000	
東亜ディーケーケー	6,000	862.00	5,172,000	
日本光電工業	45,400	3,700.00	167,980,000	
チノー	3,800	1,409.00	5,354,200	
共和電業	11,700	428.00	5,007,600	
日本電子材料	4,400	1,266.00	5,570,400	
堀場製作所	21,700	5,730.00	124,341,000	
アドバンテスト	81,500	6,650.00	541,975,000	
小野測器	5,500	508.00	2,794,000	
エスペック	10,000	1,888.00	18,880,000	
キーエンス	99,300	46,140.00	4,581,702,000	
日置電機	5,900	3,340.00	19,706,000	
シスメックス	78,400	8,177.00	641,076,800	
日本マイクロニクス	19,500	1,095.00	21,352,500	
メガチップス	10,400	2,124.00	22,089,600	
OBARA GROUP	6,500	3,580.00	23,270,000	
澤藤電機	1,600	1,638.00	2,620,800	
原田工業	5,700	898.00	5,118,600	

コーセル	15,100	880.00	13,288,000
イリソ電子工業	9,300	3,405.00	31,666,500
オブテックスグループ	18,300	1,228.00	22,472,400
千代田インテグレ	5,300	1,664.00	8,819,200
アイ・オー・データ機器	4,000	1,016.00	4,064,000
レーザーテック	48,100	9,760.00	469,456,000
スタンレー電気	77,000	2,669.00	205,513,000
岩崎電気	4,500	1,850.00	8,325,000
ウシオ電機	60,800	1,329.00	80,803,200
岡谷電機産業	10,000	302.00	3,020,000
ハリオス テクノ ホールディング	11,500	309.00	3,553,500
エノモト	3,700	1,073.00	3,970,100
日本セラミック	11,300	2,158.00	24,385,400
遠藤照明	6,300	629.00	3,962,700
古河電池	8,200	1,155.00	9,471,000
双信電機	6,400	403.00	2,579,200
山一電機	8,300	1,339.00	11,113,700
図研	7,300	3,100.00	22,630,000
日本電子	21,800	2,919.00	63,634,200
カシオ計算機	96,900	1,834.00	177,714,600
ファナック	103,000	20,745.00	2,136,735,000
日本シイエムケイ	26,900	434.00	11,674,600
エンプラス	5,800	2,279.00	13,218,200
大真空	4,200	2,209.00	9,277,800
ローム	48,700	7,040.00	342,848,000
浜松ホトニクス	78,700	4,835.00	380,514,500
三井ハイテック	12,400	1,617.00	20,050,800
新光電気工業	37,100	1,708.00	63,366,800
京セラ	154,200	5,917.00	912,401,400
太陽誘電	48,900	3,245.00	158,680,500
村田製作所	321,800	6,712.00	2,159,921,600
双葉電子工業	17,800	968.00	17,230,400
北陸電気工業	4,900	897.00	4,395,300
ニチコン	37,800	718.00	27,140,400
日本ケミコン	8,300	1,891.00	15,695,300
K O A	17,000	994.00	16,898,000
市光工業	17,300	506.00	8,753,800
小糸製作所	65,700	4,585.00	301,234,500
ミツバ	21,200	395.00	8,374,000
S C R E E Nホールディングス	19,000	5,430.00	103,170,000
キヤノン電子	11,800	1,540.00	18,172,000
キヤノン	589,700	2,098.50	1,237,485,450

リコー	278,800	798.00	222,482,400
象印マホービン	32,400	1,376.00	44,582,400
MUTOHホールディングス	1,700	1,532.00	2,604,400
東京エレクトロン	69,500	28,870.00	2,006,465,000
トヨタ紡織	32,000	1,427.00	45,664,000
芦森工業	2,300	989.00	2,274,700
ユニプレス	21,300	935.00	19,915,500
豊田自動織機	88,700	5,790.00	513,573,000
モリタホールディングス	19,200	1,908.00	36,633,600
三櫻工業	14,000	675.00	9,450,000
デンソー	241,200	4,150.00	1,000,980,000
東海理化電機製作所	28,900	1,520.00	43,928,000
三井E & Sホールディングス	39,600	461.00	18,255,600
川崎重工業	85,200	1,621.00	138,109,200
名村造船所	35,200	172.00	6,054,400
日本車輛製造	4,000	2,625.00	10,500,000
三菱ロジスネクスト	14,500	1,029.00	14,920,500
近畿車輛	1,600	1,228.00	1,964,800
日産自動車	1,291,900	429.40	554,741,860
いすゞ自動車	317,400	936.60	297,276,840
トヨタ自動車	1,222,200	6,737.00	8,233,961,400
日野自動車	136,800	719.00	98,359,200
三菱自動車工業	405,500	269.00	109,079,500
エフテック	7,800	497.00	3,876,600
レシップホールディングス	4,300	563.00	2,420,900
G M B	2,000	607.00	1,214,000
ファルテック	2,000	639.00	1,278,000
武蔵精密工業	24,400	909.00	22,179,600
日産車体	21,400	938.00	20,073,200
新明和工業	29,500	1,025.00	30,237,500
極東開発工業	20,300	1,499.00	30,429,700
日信工業	22,300	2,200.00	49,060,000
トピー工業	9,100	1,210.00	11,011,000
ティラド	4,000	1,347.00	5,388,000
曙ブレーキ工業	60,100	175.00	10,517,500
タチエス	18,000	932.00	16,776,000
N O K	58,900	1,280.00	75,392,000
フタバ産業	30,600	457.00	13,984,200
K Y B	12,300	1,945.00	23,923,500
大同メタル工業	21,100	552.00	11,647,200
プレス工業	54,500	314.00	17,113,000
ミクニ	14,100	271.00	3,821,100

太平洋工業	23,000	916.00	21,068,000
ケーヒン	25,200	2,544.00	64,108,800
河西工業	14,900	444.00	6,615,600
アイシン精機	90,200	3,180.00	286,836,000
マツダ	322,300	699.00	225,287,700
今仙電機製作所	10,200	738.00	7,527,600
本田技研工業	862,500	2,758.00	2,378,775,000
スズキ	217,100	3,702.00	803,704,200
S U B A R U	340,100	2,246.00	763,864,600
安永	5,300	1,042.00	5,522,600
ヤマハ発動機	142,800	1,666.00	237,904,800
ショーワ	25,900	2,250.00	58,275,000
T B K	13,100	455.00	5,960,500
エクセディ	14,900	1,599.00	23,825,100
豊田合成	35,400	2,138.00	75,685,200
愛三工業	17,300	510.00	8,823,000
盟和産業	1,700	897.00	1,524,900
日本プラスト	8,700	434.00	3,775,800
ヨロズ	10,300	1,107.00	11,402,100
エフ・シー・シー	17,900	1,890.00	33,831,000
シマノ	41,000	21,720.00	890,520,000
テイ・エス テック	25,500	2,939.00	74,944,500
ジャムコ	5,600	726.00	4,065,600
テルモ	310,000	4,012.00	1,243,720,000
クリエートメディック	3,600	996.00	3,585,600
日機装	32,900	973.00	32,011,700
日本エム・ディ・エム	6,300	1,672.00	10,533,600
島津製作所	130,900	2,810.00	367,829,000
J M S	9,300	813.00	7,560,900
長野計器	8,000	986.00	7,888,000
ブイ・テクノロジー	5,100	3,675.00	18,742,500
東京計器	7,000	1,003.00	7,021,000
愛知時計電機	1,400	4,460.00	6,244,000
インターアクション	5,900	1,681.00	9,917,900
オーバル	9,900	224.00	2,217,600
東京精密	19,900	3,465.00	68,953,500
マニー	43,600	2,838.00	123,736,800
ニコン	167,300	844.00	141,201,200
トプコン	55,200	806.00	44,491,200
オリンパス	606,100	1,973.00	1,195,835,300
理研計器	9,700	2,513.00	24,376,100
タムロン	8,800	1,787.00	15,725,600

HOYA	217,300	10,490.00	2,279,477,000
シード	4,700	684.00	3,214,800
ノーリツ鋼機	7,400	1,525.00	11,285,000
エー・アンド・デイ	10,000	682.00	6,820,000
朝日インテック	124,100	2,986.00	370,562,600
シチズン時計	128,400	327.00	41,986,800
リズム時計工業	3,500	615.00	2,152,500
大研医器	7,600	565.00	4,294,000
メニコン	15,500	5,090.00	78,895,000
シンシア	1,200	362.00	434,400
松風	5,000	1,418.00	7,090,000
セイコーホールディングス	15,500	1,615.00	25,032,500
ニプロ	75,800	1,178.00	89,292,400
中本パックス	2,800	1,505.00	4,214,000
スノーピーク	5,800	1,123.00	6,513,400
パラマウントベッドホールディングス	11,600	4,530.00	52,548,000
トランザクション	6,000	1,092.00	6,552,000
粧美堂	3,200	353.00	1,129,600
ニホンフラッシュ	10,200	1,515.00	15,453,000
前田工織	12,100	2,549.00	30,842,900
永大産業	14,300	290.00	4,147,000
アートネイチャー	11,700	630.00	7,371,000
バンダイナムコホールディングス	113,200	6,100.00	690,520,000
アイフィスジャパン	2,800	731.00	2,046,800
共立印刷	18,300	137.00	2,507,100
SHOEI	9,600	2,820.00	27,072,000
フランスベッドホールディングス	15,500	846.00	13,113,000
パイロットコーポレーション	17,900	3,260.00	58,354,000
萩原工業	6,100	1,423.00	8,680,300
トッパン・フォームズ	23,500	1,079.00	25,356,500
フジシールインターナショナル	24,600	1,977.00	48,634,200
タカラトミー	49,100	866.00	42,520,600
廣済堂	7,600	804.00	6,110,400
エステールホールディングス	2,900	646.00	1,873,400
アーク	41,800	112.00	4,681,600
タカノ	4,300	714.00	3,070,200
プロネクサス	9,400	1,196.00	11,242,400
ホクシン	6,800	118.00	802,400
ウッドワン	3,700	1,178.00	4,358,600
大建工業	7,400	1,896.00	14,030,400
凸版印刷	154,600	1,695.00	262,047,000
大日本印刷	143,300	2,422.00	347,072,600

共同印刷	3,400	2,734.00	9,295,600
N I S S H A	22,500	1,094.00	24,615,000
光村印刷	900	1,524.00	1,371,600
T A K A R A & C O M P A N Y	5,300	2,328.00	12,338,400
アシックス	90,400	1,266.00	114,446,400
ツツミ	3,400	1,920.00	6,528,000
小松ウオール工業	3,300	1,733.00	5,718,900
ヤマハ	65,100	4,990.00	324,849,000
河合楽器製作所	3,400	2,734.00	9,295,600
クリナップ	10,200	577.00	5,885,400
ピジョン	66,200	4,345.00	287,639,000
オリバー	2,300	2,520.00	5,796,000
兼松サステック	700	1,478.00	1,034,600
キングジム	9,100	866.00	7,880,600
リンテック	26,100	2,573.00	67,155,300
イトーキ	23,300	338.00	7,875,400
任天堂	67,200	47,500.00	3,192,000,000
三菱鉛筆	18,000	1,326.00	23,868,000
タカラスタANDARD	22,600	1,542.00	34,849,200
コクヨ	52,500	1,226.00	64,365,000
ナカバヤシ	10,800	602.00	6,501,600
グローブライド	4,900	2,094.00	10,260,600
オカムラ	38,200	761.00	29,070,200
美津濃	9,900	2,008.00	19,879,200
東京電力ホールディングス	874,400	323.00	282,431,200
中部電力	335,100	1,344.50	450,541,950
関西電力	415,000	1,063.50	441,352,500
中国電力	158,000	1,345.00	212,510,000
北陸電力	100,100	672.00	67,267,200
東北電力	273,600	1,034.00	282,902,400
四国電力	98,600	779.00	76,809,400
九州電力	225,800	931.00	210,219,800
北海道電力	102,500	414.00	42,435,000
沖縄電力	21,300	1,737.00	36,998,100
電源開発	87,200	1,688.00	147,193,600
エフオン	5,900	604.00	3,563,600
イーレックス	15,600	1,545.00	24,102,000
レノバ	18,300	1,061.00	19,416,300
東京瓦斯	210,700	2,695.00	567,836,500
大阪瓦斯	212,600	2,160.00	459,216,000
東邦瓦斯	53,900	5,220.00	281,358,000
北海道瓦斯	5,900	1,560.00	9,204,000

広島ガス	22,500	362.00	8,145,000
西部瓦斯	12,300	2,627.00	32,312,100
静岡ガス	31,100	875.00	27,212,500
メタウォーター	5,300	4,680.00	24,804,000
SBSホールディングス	9,500	2,345.00	22,277,500
東武鉄道	114,200	3,395.00	387,709,000
相鉄ホールディングス	35,000	2,815.00	98,525,000
東急	276,300	1,332.00	368,031,600
京浜急行電鉄	140,700	1,585.00	223,009,500
小田急電鉄	162,900	2,562.00	417,349,800
京王電鉄	56,800	5,940.00	337,392,000
京成電鉄	76,200	2,984.00	227,380,800
富士急行	14,900	3,300.00	49,170,000
新京成電鉄	2,800	2,243.00	6,280,400
東日本旅客鉄道	192,800	6,976.00	1,344,972,800
西日本旅客鉄道	97,600	5,168.00	504,396,800
東海旅客鉄道	91,100	14,455.00	1,316,850,500
西武ホールディングス	143,000	1,038.00	148,434,000
鴻池運輸	17,400	1,125.00	19,575,000
西日本鉄道	30,400	2,849.00	86,609,600
ハマキョウレックス	8,400	3,215.00	27,006,000
サカイ引越センター	5,800	4,935.00	28,623,000
近鉄グループホールディングス	103,700	4,600.00	477,020,000
阪急阪神ホールディングス	138,400	3,390.00	469,176,000
南海電気鉄道	49,200	2,420.00	119,064,000
京阪ホールディングス	46,200	4,665.00	215,523,000
神戸電鉄	2,500	3,595.00	8,987,500
名古屋鉄道	85,300	2,893.00	246,772,900
山陽電気鉄道	7,400	2,235.00	16,539,000
日本通運	35,900	5,560.00	199,604,000
ヤマトホールディングス	181,900	2,735.00	497,496,500
山九	28,800	3,895.00	112,176,000
丸運	5,900	225.00	1,327,500
丸全昭和運輸	8,400	3,175.00	26,670,000
センコーグループホールディングス	57,200	812.00	46,446,400
トナミホールディングス	2,500	6,000.00	15,000,000
ニッコンホールディングス	37,100	2,065.00	76,611,500
日本石油輸送	1,100	3,070.00	3,377,000
福山通運	13,300	3,810.00	50,673,000
セイノーホールディングス	77,700	1,364.00	105,982,800
エスライン	3,100	946.00	2,932,600
神奈川中央交通	2,600	3,910.00	10,166,000

日立物流	19,000	3,015.00	57,285,000
丸和運輸機関	10,900	3,290.00	35,861,000
C & F ロジホールディングス	10,500	1,679.00	17,629,500
九州旅客鉄道	90,900	2,358.00	214,342,200
S Gホールディングス	108,900	3,705.00	403,474,500
日本郵船	87,200	1,408.00	122,777,600
商船三井	66,000	1,871.00	123,486,000
川崎汽船	31,900	1,031.00	32,888,900
N S ユナイテッド海運	6,200	1,552.00	9,622,400
飯野海運	51,200	326.00	16,691,200
共栄タンカー	2,700	795.00	2,146,500
乾汽船	6,000	807.00	4,842,000
日本航空	183,500	1,894.50	347,640,750
A N Aホールディングス	189,600	2,373.00	449,920,800
パスコ	2,000	1,421.00	2,842,000
ランコム	2,900	7,270.00	21,083,000
日新	9,000	1,539.00	13,851,000
三菱倉庫	32,900	2,735.00	89,981,500
三井倉庫ホールディングス	11,800	1,550.00	18,290,000
住友倉庫	37,300	1,268.00	47,296,400
澁澤倉庫	5,700	1,961.00	11,177,700
東陽倉庫	18,700	331.00	6,189,700
日本トランスシティ	22,800	499.00	11,377,200
ケイヒン	2,000	1,269.00	2,538,000
中央倉庫	6,300	1,000.00	6,300,000
川西倉庫	1,900	1,032.00	1,960,800
安田倉庫	8,500	921.00	7,828,500
ファイズホールディングス	2,200	1,071.00	2,356,200
東洋埠頭	3,200	1,437.00	4,598,400
宇徳	8,900	482.00	4,289,800
上組	57,900	2,038.00	118,000,200
サンリツ	2,500	578.00	1,445,000
キムラユニティー	2,800	1,033.00	2,892,400
キューソー流通システム	2,600	1,506.00	3,915,600
近鉄エクスプレス	22,000	1,907.00	41,954,000
東海運	5,900	275.00	1,622,500
エーアイティー	7,300	946.00	6,905,800
内外トランスライン	3,600	1,052.00	3,787,200
日本コンセプト	3,300	1,254.00	4,138,200
N E C ネットズエスアイ	30,600	2,212.00	67,687,200
クロスキャット	3,000	1,128.00	3,384,000
システナ	38,500	1,440.00	55,440,000

デジタルアーツ	5,300	9,360.00	49,608,000
日鉄ソリューションズ	16,200	3,065.00	49,653,000
キューブシステム	6,000	1,066.00	6,396,000
エイジア	2,100	1,418.00	2,977,800
コア	4,800	1,257.00	6,033,600
ラクーンホールディングス	5,100	1,099.00	5,604,900
ソリトンシステムズ	4,900	1,545.00	7,570,500
ソフトクリエイティブホールディングス	4,800	2,379.00	11,419,200
T I S	107,600	2,273.00	244,574,800
ネオス	4,300	626.00	2,691,800
電算システム	4,200	4,795.00	20,139,000
グリー	66,500	453.00	30,124,500
コーエーテクモホールディングス	22,100	3,420.00	75,582,000
三菱総合研究所	4,700	4,300.00	20,210,000
電算	1,300	2,238.00	2,909,400
A G S	6,400	860.00	5,504,000
ファインデックス	9,300	975.00	9,067,500
ブレインパッド	2,800	4,190.00	11,732,000
K L a b	20,800	714.00	14,851,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	861.00	11,451,300
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	3,315.00	5,304,000
ネクソン	300,300	2,482.00	745,344,600
アイスタイル	31,100	274.00	8,521,400
エムアップホールディングス	3,200	2,332.00	7,462,400
エイチーム	7,700	889.00	6,845,300
エニグモ	10,300	1,322.00	13,616,600
テクノスジャパン	8,700	813.00	7,073,100
コロプラ	35,500	968.00	34,364,000
ブロードリーフ	53,800	563.00	30,289,400
クロス・マーケティンググループ	5,400	331.00	1,787,400
デジタルハーツホールディングス	6,000	869.00	5,214,000
システム情報	8,200	1,462.00	11,988,400
メディアドゥ	3,400	5,400.00	18,360,000
じげん	27,400	303.00	8,302,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,700	787.00	2,124,900
サイバーリンクス	1,800	2,253.00	4,055,400
フィックスターズ	11,600	1,181.00	13,699,600
C A R T A H O L D I N G S	5,400	1,336.00	7,214,400
オブティム	5,700	3,395.00	19,351,500
セレス	3,700	1,200.00	4,440,000
S H I F T	4,400	11,770.00	51,788,000
ティーガイア	9,700	1,936.00	18,779,200

セック	1,700	3,025.00	5,142,500
日本アジアグループ	11,300	291.00	3,288,300
テクマトリックス	15,300	1,781.00	27,249,300
プロシップ	3,300	1,499.00	4,946,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,000	1,953.00	50,778,000
GMOペイメントゲートウェイ	22,800	11,190.00	255,132,000
ザッパラス	5,300	402.00	2,130,600
システムリサーチ	3,000	2,086.00	6,258,000
インターネットイニシアティブ	16,000	3,690.00	59,040,000
さくらインターネット	11,900	625.00	7,437,500
ヴィンクス	3,200	1,258.00	4,025,600
GMOクラウド	2,000	7,740.00	15,480,000
SRAホールディングス	5,800	2,349.00	13,624,200
システムインテグレータ	3,700	816.00	3,019,200
朝日ネット	7,800	1,162.00	9,063,600
eBASE	13,000	1,536.00	19,968,000
アバント	10,500	1,054.00	11,067,000
アドソル日進	3,900	2,346.00	9,149,400
フリービット	5,900	803.00	4,737,700
コムチュア	12,200	2,715.00	33,123,000
サイバーコム	2,100	1,836.00	3,855,600
アステリア	7,100	486.00	3,450,600
アイル	6,100	1,577.00	9,619,700
マークライنز	5,500	2,138.00	11,759,000
メディカル・データ・ビジョン	8,400	1,417.00	11,902,800
ショーケース	2,900	696.00	2,018,400
モバイルファクトリー	2,600	1,055.00	2,743,000
テラスカイ	4,000	4,860.00	19,440,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,379.00	6,067,600
PCIホールディングス	4,300	1,166.00	5,013,800
パイプドHD	1,600	1,415.00	2,264,000
アイビーシー	2,000	939.00	1,878,000
ネオジャパン	2,100	2,258.00	4,741,800
PR TIMES	1,000	3,985.00	3,985,000
ランドコンピュータ	1,900	990.00	1,881,000
ダブルスタンダード	1,400	5,590.00	7,826,000
オープンドア	5,500	1,055.00	5,802,500
マイネット	3,500	1,378.00	4,823,000
アカツキ	3,900	3,875.00	15,112,500
ベネフィットジャパン	1,000	1,625.00	1,625,000
Ubicomホールディングス	2,500	2,259.00	5,647,500
LINE	24,700	5,550.00	137,085,000

カナミックネットワーク	10,100	917.00	9,261,700
ノムラシステムコーポレーション	5,500	462.00	2,541,000
チェンジ	3,800	8,470.00	32,186,000
シンクロ・フード	5,400	339.00	1,830,600
オークネット	6,900	1,088.00	7,507,200
セグエグループ	2,600	913.00	2,373,800
エイトレッド	1,900	2,000.00	3,800,000
AOI TYO Holdings	11,500	411.00	4,726,500
マクロミル	22,300	754.00	16,814,200
ビーグリー	2,200	2,145.00	4,719,000
オロ	2,900	3,030.00	8,787,000
ユーザーローカル	1,100	3,835.00	4,218,500
テモナ	2,600	968.00	2,516,800
ニーズウェル	2,400	709.00	1,701,600
サインポスト	2,400	1,385.00	3,324,000
ソルクシーズ	4,900	755.00	3,699,500
フェイス	4,200	698.00	2,931,600
プロトコーポレーション	9,900	930.00	9,207,000
ハイマックス	1,400	2,010.00	2,814,000
野村総合研究所	152,400	2,804.00	427,329,600
サイバネットシステム	8,000	666.00	5,328,000
CEホールディングス	6,100	585.00	3,568,500
日本システム技術	1,900	1,770.00	3,363,000
インテージホールディングス	13,700	900.00	12,330,000
東邦システムサイエンス	3,100	964.00	2,988,400
ソースネクスト	51,900	273.00	14,168,700
インフォコム	11,800	3,295.00	38,881,000
HEROZ	1,600	3,195.00	5,112,000
ラクスル	8,700	3,175.00	27,622,500
FIG	12,600	250.00	3,150,000
システムサポート	2,500	1,934.00	4,835,000
イーソル	5,300	1,106.00	5,861,800
アルテリア・ネットワークス	12,000	2,000.00	24,000,000
東海ソフト	900	1,221.00	1,098,900
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,100	1,050.00	2,205,000
トビラシステムズ	1,400	1,898.00	2,657,200
フォーカスシステムズ	7,000	806.00	5,642,000
クレスコ	6,700	1,382.00	9,259,400
フジ・メディア・ホールディングス	103,800	1,024.00	106,291,200
オービック	37,300	19,060.00	710,938,000
ジャストシステム	17,500	8,120.00	142,100,000
TDCソフト	9,700	916.00	8,885,200

Zホールディングス	1,476,600	532.00	785,551,200
トレンドマイクロ	47,800	6,200.00	296,360,000
IDホールディングス	4,300	1,562.00	6,716,600
日本オラクル	21,800	12,690.00	276,642,000
アルファシステムズ	3,400	4,180.00	14,212,000
フューチャー	13,100	1,791.00	23,462,100
CAC Holdings	7,200	1,235.00	8,892,000
SBテクノロジー	3,900	3,980.00	15,522,000
トーセ	3,200	859.00	2,748,800
オービックビジネスコンサルタント	11,000	6,130.00	67,430,000
伊藤忠テクノソリューションズ	49,000	4,220.00	206,780,000
アイティフォー	13,400	745.00	9,983,000
東計電算	1,600	4,000.00	6,400,000
エクスネット	2,000	975.00	1,950,000
大塚商会	58,200	5,540.00	322,428,000
サイボウズ	12,600	3,300.00	41,580,000
ソフトブレーン	6,900	431.00	2,973,900
電通国際情報サービス	6,700	5,630.00	37,721,000
ACCESS	10,300	847.00	8,724,100
デジタルガレージ	19,400	3,750.00	72,750,000
EMシステムズ	15,400	921.00	14,183,400
ウェザーニューズ	3,700	4,010.00	14,837,000
CIJ	7,600	800.00	6,080,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	2,695.00	3,503,500
日本エンタープライズ	11,900	361.00	4,295,900
WOWOW	5,300	2,478.00	13,133,400
スカラ	7,500	637.00	4,777,500
インテリジェント ウェイブ	6,600	807.00	5,326,200
IMAGICA GROUP	9,800	380.00	3,724,000
ネットワンシステムズ	41,000	4,105.00	168,305,000
システムソフト	25,900	99.00	2,564,100
アルゴグラフィックス	9,200	3,385.00	31,142,000
マーベラス	16,800	680.00	11,424,000
エイベックス	18,800	906.00	17,032,800
日本ユニシス	33,600	3,355.00	112,728,000
兼松エレクトロニクス	5,900	4,315.00	25,458,500
東京放送ホールディングス	65,500	1,648.00	107,944,000
日本テレビホールディングス	89,900	1,208.00	108,599,200
朝日放送グループホールディングス	11,000	745.00	8,195,000
テレビ朝日ホールディングス	29,700	1,559.00	46,302,300
スカパーJSATホールディングス	71,400	420.00	29,988,000
テレビ東京ホールディングス	8,900	2,318.00	20,630,200

日本BS放送	3,900	1,098.00	4,282,200
ビジョン	10,400	666.00	6,926,400
スマートバリュー	3,000	1,141.00	3,423,000
ワイヤレスゲート	5,400	851.00	4,595,400
コネクシオ	6,300	1,403.00	8,838,900
クロップス	2,300	731.00	1,681,300
日本電信電話	1,436,900	2,552.50	3,667,687,250
KDDI	783,700	3,364.00	2,636,366,800
ソフトバンク	977,000	1,429.00	1,396,133,000
光通信	11,100	23,260.00	258,186,000
NTTドコモ	768,700	3,000.00	2,306,100,000
エムティーアイ	10,800	809.00	8,737,200
GMOインターネット	42,500	3,065.00	130,262,500
ファイバーゲート	3,600	1,991.00	7,167,600
アйдママーケティングコミュニケーション	3,800	436.00	1,656,800
KADOKAWA	29,100	2,280.00	66,348,000
学研ホールディングス	14,600	1,432.00	20,907,200
ゼンリン	21,700	1,178.00	25,562,600
昭文社ホールディングス	5,600	447.00	2,503,200
インプレスホールディングス	8,900	149.00	1,326,100
アイネット	5,700	1,657.00	9,444,900
松竹	7,100	12,890.00	91,519,000
東宝	63,500	3,345.00	212,407,500
東映	4,000	14,640.00	58,560,000
エヌ・ティ・ティ・データ	286,400	1,246.00	356,854,400
ピー・シー・エー	1,900	3,910.00	7,429,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	1,266.00	4,937,400
DTS	24,100	2,412.00	58,129,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,900	5,820.00	267,138,000
シーイーシー	11,700	1,596.00	18,673,200
カブコン	50,700	4,005.00	203,053,500
アイ・エス・ビー	2,200	2,417.00	5,317,400
ジャステック	7,000	1,202.00	8,414,000
SSK	24,900	5,370.00	133,713,000
日本システムウエア	3,700	2,190.00	8,103,000
アイネス	10,800	1,533.00	16,556,400
TKC	9,100	5,950.00	54,145,000
富士ソフト	13,800	4,640.00	64,032,000
NSD	34,700	2,048.00	71,065,600
コナミホールディングス	39,100	3,440.00	134,504,000
福井コンピュータホールディングス	4,300	2,602.00	11,188,600
JBCホールディングス	7,400	1,510.00	11,174,000

ミロク情報サービス	9,600	2,204.00	21,158,400
ソフトバンクグループ	852,900	6,499.00	5,542,997,100
ハウスイ	900	885.00	796,500
高千穂交易	4,200	923.00	3,876,600
カワニシホールディングス	1,300	1,315.00	1,709,500
伊藤忠食品	2,700	4,785.00	12,919,500
エレマテック	10,100	919.00	9,281,900
JALUX	3,100	1,731.00	5,366,100
あらた	8,600	4,855.00	41,753,000
トーメンデバイス	1,600	4,020.00	6,432,000
東京エレクトロン デバイス	3,900	3,810.00	14,859,000
フィールズ	8,300	350.00	2,905,000
双日	595,900	237.00	141,228,300
アルフレッサ ホールディングス	119,900	2,250.00	269,775,000
横浜冷凍	28,200	899.00	25,351,800
ラサ商事	5,700	949.00	5,409,300
アルコニックス	11,500	1,312.00	15,088,000
神戸物産	37,200	6,660.00	247,752,000
ハイパー	1,700	563.00	957,100
あい ホールディングス	15,400	1,524.00	23,469,600
ディーブイエックス	3,900	911.00	3,552,900
ダイワボウホールディングス	9,200	7,990.00	73,508,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,700	1,661.00	42,687,700
ラクト・ジャパン	4,000	3,705.00	14,820,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,300	1,061.00	21,538,300
八洲電機	8,400	958.00	8,047,200
メディアスホールディングス	6,100	893.00	5,447,300
レスターホールディングス	11,200	2,009.00	22,500,800
ジュテックホールディングス	2,500	1,025.00	2,562,500
大光	4,600	676.00	3,109,600
OCHIホールディングス	3,100	1,532.00	4,749,200
TOKAIホールディングス	57,000	997.00	56,829,000
黒谷	3,000	518.00	1,554,000
Cominix	1,900	683.00	1,297,700
三洋貿易	10,900	979.00	10,671,100
ビューティガレージ	1,700	1,911.00	3,248,700
ウイン・パートナーズ	7,800	960.00	7,488,000
ミタチ産業	3,300	566.00	1,867,800
シップヘルスケアホールディングス	17,300	4,570.00	79,061,000
明治電機工業	3,400	1,392.00	4,732,800
デリカフーズホールディングス	3,800	628.00	2,386,400
スターティアホールディングス	2,500	620.00	1,550,000

コメダホールディングス	23,500	1,813.00	42,605,500
ピーバンドットコム	1,100	938.00	1,031,800
アセンテック	1,200	3,800.00	4,560,000
富士興産	3,300	446.00	1,471,800
協栄産業	1,200	1,228.00	1,473,600
小野建	9,700	1,229.00	11,921,300
南陽	2,400	1,566.00	3,758,400
佐島電機	7,300	835.00	6,095,500
エコートレーディング	2,500	530.00	1,325,000
伯東	6,600	957.00	6,316,200
コンドーテック	8,400	1,150.00	9,660,000
中山福	6,200	455.00	2,821,000
ナガイレーベン	14,300	2,783.00	39,796,900
三菱食品	11,900	2,661.00	31,665,900
松田産業	7,900	1,582.00	12,497,800
第一興商	16,100	3,140.00	50,554,000
メディパルホールディングス	116,400	2,014.00	234,429,600
S P K	4,600	1,335.00	6,141,000
萩原電気ホールディングス	4,000	2,038.00	8,152,000
アズワン	7,000	11,350.00	79,450,000
スズデン	3,800	1,217.00	4,624,600
尾家産業	3,200	1,500.00	4,800,000
シモジマ	6,600	1,236.00	8,157,600
ドウシシャ	10,200	1,698.00	17,319,600
小津産業	2,400	1,759.00	4,221,600
高速	6,400	1,435.00	9,184,000
たけびし	3,800	1,513.00	5,749,400
リックス	2,400	1,663.00	3,991,200
丸文	9,600	509.00	4,886,400
ハビネット	9,000	1,175.00	10,575,000
橋本総業ホールディングス	2,200	1,970.00	4,334,000
日本ライフライン	32,000	1,365.00	43,680,000
タカショー	7,000	499.00	3,493,000
マルカ	3,800	1,817.00	6,904,600
I D O M	29,100	505.00	14,695,500
進和	6,400	1,951.00	12,486,400
エスケイジャパン	2,400	297.00	712,800
ダイトロン	4,600	1,502.00	6,909,200
シークス	13,700	949.00	13,001,300
田中商事	3,300	708.00	2,336,400
オーハシテクニカ	6,000	1,660.00	9,960,000
白銅	3,900	1,450.00	5,655,000

ダイコー通産	700	1,212.00	848,400
伊藤忠商事	754,600	2,371.00	1,789,156,600
丸紅	1,123,000	515.10	578,457,300
高島	1,700	1,839.00	3,126,300
長瀬産業	60,700	1,326.00	80,488,200
蝶理	6,900	1,747.00	12,054,300
豊田通商	120,400	2,830.00	340,732,000
三共生興	16,400	435.00	7,134,000
兼松	40,200	1,292.00	51,938,400
ツカモトコーポレーション	1,900	1,164.00	2,211,600
三井物産	934,100	1,645.50	1,537,061,550
日本紙パルプ商事	6,100	3,840.00	23,424,000
カメイ	14,100	1,050.00	14,805,000
東都水産	1,400	3,230.00	4,522,000
OUGホールディングス	1,700	2,666.00	4,532,200
スターゼン	4,000	4,180.00	16,720,000
山善	42,200	1,018.00	42,959,600
椿本興業	2,000	3,360.00	6,720,000
住友商事	680,700	1,252.50	852,576,750
内田洋行	4,300	6,800.00	29,240,000
三菱商事	707,400	2,253.00	1,593,772,200
第一実業	5,300	3,680.00	19,504,000
キャノンマーケティングジャパン	26,800	2,192.00	58,745,600
西華産業	6,100	1,259.00	7,679,900
佐藤商事	8,900	938.00	8,348,200
菱洋エレクトロ	10,900	3,190.00	34,771,000
東京産業	9,800	522.00	5,115,600
ユアサ商事	10,200	2,956.00	30,151,200
神鋼商事	2,700	1,929.00	5,208,300
トルク	6,500	301.00	1,956,500
阪和興業	20,200	2,157.00	43,571,400
正栄食品工業	7,000	3,880.00	27,160,000
カナデン	8,800	1,360.00	11,968,000
菱電商事	7,800	1,486.00	11,590,800
フルサト工業	6,000	1,430.00	8,580,000
岩谷産業	23,900	3,805.00	90,939,500
ナイス	4,600	1,017.00	4,678,200
昭光通商	3,400	609.00	2,070,600
ニチモウ	1,700	1,903.00	3,235,100
極東貿易	3,100	1,358.00	4,209,800
イワキ	14,200	491.00	6,972,200
三愛石油	26,600	907.00	24,126,200

稲畑産業	23,800	1,255.00	29,869,000
G S Iクレオス	2,700	1,188.00	3,207,600
明和産業	10,000	461.00	4,610,000
クワザワ	3,900	532.00	2,074,800
ヤマエ久野	7,900	1,244.00	9,827,600
ワキタ	23,000	976.00	22,448,000
東邦ホールディングス	34,600	1,892.00	65,463,200
サンゲツ	29,400	1,543.00	45,364,200
ミツウロコグループホールディングス	15,900	1,164.00	18,507,600
シナネンホールディングス	4,400	2,941.00	12,940,400
伊藤忠エネクス	23,900	843.00	20,147,700
サンリオ	30,300	1,655.00	50,146,500
サンワテクノス	7,700	855.00	6,583,500
リョーサン	11,900	2,148.00	25,561,200
新光商事	16,900	875.00	14,787,500
トーホー	4,900	1,901.00	9,314,900
三信電気	5,800	1,839.00	10,666,200
東陽テクニカ	11,600	995.00	11,542,000
モスフードサービス	14,200	2,886.00	40,981,200
加賀電子	10,700	2,111.00	22,587,700
ソーダニッカ	11,200	533.00	5,969,600
立花エレテック	8,000	1,765.00	14,120,000
フォーバル	4,700	1,010.00	4,747,000
P A L T A C	17,300	5,240.00	90,652,000
三谷産業	14,200	339.00	4,813,800
西本Wismettacホールディングス	2,000	2,119.00	4,238,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,513.00	1,513,000
国際紙パルプ商事	25,600	279.00	7,142,400
ヤマタネ	5,400	1,312.00	7,084,800
丸紅建材リース	1,100	1,582.00	1,740,200
日鉄物産	7,700	3,445.00	26,526,500
泉州電業	3,300	2,937.00	9,692,100
トラスコ中山	22,500	2,600.00	58,500,000
オートバックスセブン	40,000	1,339.00	53,560,000
モリト	7,900	609.00	4,811,100
加藤産業	15,600	3,420.00	53,352,000
北恵	2,700	960.00	2,592,000
イノテック	5,600	1,024.00	5,734,400
イエローハット	20,400	1,507.00	30,742,800
J Kホールディングス	9,800	803.00	7,869,400
日伝	9,800	2,414.00	23,657,200
北沢産業	8,200	287.00	2,353,400

杉本商事	5,800	1,920.00	11,136,000
因幡電機産業	30,700	2,480.00	76,136,000
東テク	3,600	2,288.00	8,236,800
ミスミグループ本社	135,200	2,744.00	370,988,800
アルテック	8,600	255.00	2,193,000
タキヒヨー	3,300	1,911.00	6,306,300
蔵王産業	2,100	1,470.00	3,087,000
スズケン	45,700	3,880.00	177,316,000
ジェコス	7,500	973.00	7,297,500
グローセル	10,800	435.00	4,698,000
ローソン	27,300	5,580.00	152,334,000
サンエー	9,000	4,165.00	37,485,000
カワチ薬品	8,400	3,190.00	26,796,000
エービーシー・マート	16,900	6,100.00	103,090,000
ハードオフコーポレーション	4,500	710.00	3,195,000
アスクル	11,300	3,100.00	35,030,000
ゲオホールディングス	19,500	1,501.00	29,269,500
アダストリア	15,000	1,500.00	22,500,000
ジーフット	6,500	525.00	3,412,500
くら寿司	5,700	4,810.00	27,417,000
キャンドウ	5,200	2,439.00	12,682,800
パルグループホールディングス	11,100	1,213.00	13,464,300
エディオン	49,700	1,078.00	53,576,600
サーラコーポレーション	22,200	584.00	12,964,800
ワッツ	4,900	1,000.00	4,900,000
ハローズ	4,100	3,655.00	14,985,500
フジオフードグループ本社	9,200	1,326.00	12,199,200
あみやき亭	2,400	2,783.00	6,679,200
ひらまつ	19,800	177.00	3,504,600
大黒天物産	2,600	6,020.00	15,652,000
ハニーズホールディングス	9,600	1,137.00	10,915,200
ファーマライズホールディングス	2,800	716.00	2,004,800
アルペン	8,400	1,633.00	13,717,200
ハブ	3,300	616.00	2,032,800
クオールホールディングス	16,000	1,135.00	18,160,000
ジズホールディングス	5,700	7,590.00	43,263,000
ビックカメラ	64,100	1,141.00	73,138,100
D C Mホールディングス	59,900	1,321.00	79,127,900
Monotaro	76,700	4,390.00	336,713,000
東京一番フーズ	3,000	515.00	1,545,000
D Dホールディングス	4,300	704.00	3,027,200
きちりホールディングス	3,100	566.00	1,754,600

アークランドサービスホールディングス	8,000	1,975.00	15,800,000
J.フロント リテイリング	129,000	697.00	89,913,000
ドトール・日レスホールディングス	15,600	1,552.00	24,211,200
マツモトキヨシホールディングス	44,600	3,785.00	168,811,000
ブロンコピリー	5,700	2,119.00	12,078,300
Z O Z O	74,300	2,498.00	185,601,400
トレジャー・ファクトリー	3,400	679.00	2,308,600
物語コーポレーション	2,900	8,720.00	25,288,000
ココカラファイン	11,300	6,180.00	69,834,000
三越伊勢丹ホールディングス	188,900	588.00	111,073,200
H a m e e	3,900	1,792.00	6,988,800
ウエルシアホールディングス	32,100	9,630.00	309,123,000
クリエイティブSDホールディングス	18,200	3,735.00	67,977,000
丸善C H Iホールディングス	12,600	394.00	4,964,400
ティーライフ	1,700	1,060.00	1,802,000
チムニー	3,400	1,346.00	4,576,400
シュッピン	7,500	686.00	5,145,000
オイシックス・ラ・大地	10,700	2,200.00	23,540,000
ネクステージ	15,600	1,074.00	16,754,400
ジョイフル本田	31,700	1,502.00	47,613,400
鳥貴族	3,300	1,466.00	4,837,800
麒麟堂ホールディングス	4,300	2,853.00	12,267,900
ホットランド	7,300	1,111.00	8,110,300
すかいらーくホールディングス	121,000	1,620.00	196,020,000
S F Pホールディングス	6,200	1,372.00	8,506,400
綿半ホールディングス	4,100	2,050.00	8,405,000
ヨシックス	1,800	1,854.00	3,337,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,500	1,276.00	40,194,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	501.00	2,655,300
B E E N O S	5,100	1,196.00	6,099,600
あさひ	8,100	1,649.00	13,356,900
日本調剤	6,600	1,664.00	10,982,400
コスモス薬品	9,500	19,270.00	183,065,000
トーエル	5,400	699.00	3,774,600
オンリー	2,100	559.00	1,173,900
セブン&アイ・ホールディングス	422,100	3,463.00	1,461,732,300
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	58,200	560.00	32,592,000
ツルハホールディングス	23,500	14,980.00	352,030,000
サンマルクホールディングス	8,600	1,615.00	13,889,000
フェリシモ	2,500	1,076.00	2,690,000
トリドールホールディングス	26,800	1,227.00	32,883,600

TOKYO BASE	10,200	296.00	3,019,200
ウイルプラスホールディングス	1,600	571.00	913,600
JMホールディングス	8,200	3,525.00	28,905,000
サツドラホールディングス	1,700	1,974.00	3,355,800
アレンザホールディングス	5,500	1,346.00	7,403,000
串カツ田中ホールディングス	2,300	1,720.00	3,956,000
パロックジャパンリミテッド	7,700	623.00	4,797,100
クスリのアオキホールディングス	9,700	9,900.00	96,030,000
力の源ホールディングス	5,100	666.00	3,396,600
スシローグローバルホールディングス	59,300	2,450.00	145,285,000
メディカルシステムネットワーク	10,700	506.00	5,414,200
はるやまホールディングス	5,300	766.00	4,059,800
ノジマ	19,200	2,671.00	51,283,200
カッパ・クリエイト	15,100	1,393.00	21,034,300
ライトオン	8,100	597.00	4,835,700
良品計画	143,300	1,371.00	196,464,300
三城ホールディングス	12,000	270.00	3,240,000
アドヴァン	16,600	1,370.00	22,742,000
アルビス	4,200	2,639.00	11,083,800
コナカ	13,200	299.00	3,946,800
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,599.00	2,238,600
G-7ホールディングス	6,400	2,487.00	15,916,800
イオン北海道	14,400	779.00	11,217,600
コジマ	18,800	559.00	10,509,200
ヒマラヤ	4,000	805.00	3,220,000
コーナン商事	15,400	3,770.00	58,058,000
エコス	4,000	2,325.00	9,300,000
ワタミ	12,900	914.00	11,790,600
マルシェ	3,100	505.00	1,565,500
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	237,200	2,382.00	565,010,400
西松屋チェーン	23,800	1,110.00	26,418,000
ゼンショーホールディングス	51,800	2,108.00	109,194,400
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,609.00	11,102,100
ハークスレイ	2,400	997.00	2,392,800
サイゼリヤ	16,100	1,818.00	29,269,800
VTホールディングス	45,100	339.00	15,288,900
魚力	3,100	1,576.00	4,885,600
フジ・コーポレーション	2,900	2,001.00	5,802,900
ユナイテッドアローズ	11,400	1,605.00	18,297,000
ハイデイ日高	15,700	1,642.00	25,779,400
京都きもの友禅	7,400	243.00	1,798,200
コロワイド	35,800	1,399.00	50,084,200

ピーシーデポコーポレーション	14,500	656.00	9,512,000	
壱番屋	7,600	5,150.00	39,140,000	
P L A N T	3,000	781.00	2,343,000	
スギホールディングス	21,600	7,730.00	166,968,000	
薬王堂ホールディングス	4,800	2,797.00	13,425,600	
スクロール	16,900	583.00	9,852,700	
ヨンドシーホールディングス	11,100	1,914.00	21,245,400	
ファミリーマート	86,300	2,360.00	203,668,000	
木曽路	14,200	2,375.00	33,725,000	
S R S ホールディングス	12,900	903.00	11,648,700	
タカキュー	8,300	125.00	1,037,500	
リテールパートナーズ	14,400	2,190.00	31,536,000	
ケーヨー	22,300	870.00	19,401,000	
上新電機	12,800	2,240.00	28,672,000	
日本瓦斯	17,100	5,070.00	86,697,000	
ロイヤルホールディングス	18,900	1,742.00	32,923,800	
いなげや	13,400	1,887.00	25,285,800	
島忠	20,300	2,946.00	59,803,800	
チヨダ	11,500	1,074.00	12,351,000	
ライフコーポレーション	8,200	4,845.00	39,729,000	
リンガーハット	13,400	2,302.00	30,846,800	
M r M a x H D	15,100	835.00	12,608,500	
テンアライド	9,900	369.00	3,653,100	
A O K I ホールディングス	21,800	615.00	13,407,000	
オークワ	17,000	1,562.00	26,554,000	
コメリ	16,700	2,900.00	48,430,000	
青山商事	22,500	646.00	14,535,000	
しまむら	12,600	7,720.00	97,272,000	
はせがわ	6,200	284.00	1,760,800	
高島屋	78,700	802.00	63,117,400	
松屋	21,900	673.00	14,738,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,300	712.00	36,525,600	
近鉄百貨店	4,200	2,785.00	11,697,000	
丸井グループ	98,900	1,715.00	169,613,500	
アクシアル リテイリング	9,000	4,680.00	42,120,000	
イオン	415,200	2,552.00	1,059,590,400	
イズミ	22,000	4,185.00	92,070,000	
平和堂	22,000	2,017.00	44,374,000	
フジ	13,100	1,900.00	24,890,000	
ヤオコー	12,300	8,340.00	102,582,000	
ゼビオホールディングス	13,200	768.00	10,137,600	
ケーブホールディングス	104,200	1,413.00	147,234,600	

Olympicグループ	5,700	953.00	5,432,100
日産東京販売ホールディングス	16,500	254.00	4,191,000
シルバーライフ	1,500	1,999.00	2,998,500
一家ダイニングプロジェクト	1,100	589.00	647,900
Genky DrugStores	4,800	3,940.00	18,912,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	565.00	1,469,000
ブックオフグループホールディングス	6,300	799.00	5,033,700
アインホールディングス	13,300	6,910.00	91,903,000
元気寿司	2,800	2,270.00	6,356,000
ヤマダ電機	329,000	485.00	159,565,000
アークランドサカモト	17,000	1,920.00	32,640,000
ニトリホールディングス	46,700	22,590.00	1,054,953,000
グルメ杵屋	7,800	972.00	7,581,600
愛眼	8,600	224.00	1,926,400
ケーユーホールディングス	5,800	892.00	5,173,600
吉野家ホールディングス	35,500	2,089.00	74,159,500
松屋フーズホールディングス	5,200	3,630.00	18,876,000
サガミホールディングス	14,500	1,226.00	17,777,000
関西スーパーマーケット	9,100	1,300.00	11,830,000
王将フードサービス	7,900	5,810.00	45,899,000
プレナス	12,200	1,730.00	21,106,000
ミニストップ	8,100	1,550.00	12,555,000
アークス	22,100	2,531.00	55,935,100
パローホールディングス	23,900	2,299.00	54,946,100
ベルク	5,300	7,710.00	40,863,000
大庄	5,900	1,160.00	6,844,000
ファーストリテイリング	14,400	58,650.00	844,560,000
サンドラッグ	40,600	3,640.00	147,784,000
サックスパーホールディングス	9,400	555.00	5,217,000
ヤマザワ	2,600	1,730.00	4,498,000
やまや	2,300	2,030.00	4,669,000
ベルーナ	23,400	768.00	17,971,200
島根銀行	2,800	536.00	1,500,800
じもとホールディングス	73,000	96.00	7,008,000
めぶきフィナンシャルグループ	561,400	255.00	143,157,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,600	1,166.00	17,023,600
九州フィナンシャルグループ	236,400	454.00	107,325,600
ゆうちょ銀行	306,100	829.00	253,756,900
富山第一銀行	25,800	265.00	6,837,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	617,100	343.00	211,665,300
西日本フィナンシャルホールディングス	71,900	727.00	52,271,300
関西みらいフィナンシャルグループ	63,400	428.00	27,135,200

三十三フィナンシャルグループ	10,000	1,357.00	13,570,000
第四北越フィナンシャルグループ	18,700	2,137.00	39,961,900
新生銀行	79,300	1,303.00	103,327,900
あおぞら銀行	64,400	1,914.00	123,261,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,390,400	415.80	3,072,928,320
りそなホールディングス	1,185,600	376.30	446,141,280
三井住友トラスト・ホールディングス	204,200	2,939.00	600,143,800
三井住友フィナンシャルグループ	747,200	3,027.00	2,261,774,400
千葉銀行	360,500	513.00	184,936,500
群馬銀行	207,500	350.00	72,625,000
武蔵野銀行	16,100	1,539.00	24,777,900
千葉興業銀行	29,600	241.00	7,133,600
筑波銀行	44,900	172.00	7,722,800
七十七銀行	36,500	1,530.00	55,845,000
青森銀行	8,400	2,288.00	19,219,200
秋田銀行	6,900	1,508.00	10,405,200
山形銀行	12,100	1,372.00	16,601,200
岩手銀行	7,100	2,627.00	18,651,700
東邦銀行	96,600	237.00	22,894,200
東北銀行	5,200	970.00	5,044,000
みちのく銀行	6,900	1,015.00	7,003,500
ふくおかフィナンシャルグループ	91,000	1,655.00	150,605,000
静岡銀行	263,800	699.00	184,396,200
十六銀行	13,500	1,894.00	25,569,000
スルガ銀行	110,500	377.00	41,658,500
八十二銀行	260,700	417.00	108,711,900
山梨中央銀行	12,500	841.00	10,512,500
大垣共立銀行	21,300	2,227.00	47,435,100
福井銀行	9,200	1,688.00	15,529,600
北國銀行	10,800	2,989.00	32,281,200
清水銀行	4,500	1,611.00	7,249,500
富山銀行	2,100	2,359.00	4,953,900
滋賀銀行	21,700	2,512.00	54,510,400
南都銀行	18,000	2,058.00	37,044,000
百五銀行	97,200	325.00	31,590,000
京都銀行	38,700	4,050.00	156,735,000
紀陽銀行	38,300	1,630.00	62,429,000
ほくほくフィナンシャルグループ	71,900	964.00	69,311,600
広島銀行	159,500	522.00	83,259,000
山陰合同銀行	64,100	526.00	33,716,600
中国銀行	93,000	957.00	89,001,000
鳥取銀行	3,700	1,163.00	4,303,100

伊予銀行	154,200	647.00	99,767,400
百十四銀行	11,500	1,858.00	21,367,000
四国銀行	16,400	803.00	13,169,200
阿波銀行	17,600	2,420.00	42,592,000
大分銀行	6,200	2,421.00	15,010,200
宮崎銀行	7,200	2,467.00	17,762,400
佐賀銀行	6,600	1,249.00	8,243,400
沖縄銀行	9,900	3,120.00	30,888,000
琉球銀行	24,900	954.00	23,754,600
セブン銀行	360,900	271.00	97,803,900
みずほフィナンシャルグループ	14,680,500	139.60	2,049,397,800
高知銀行	3,900	682.00	2,659,800
山口フィナンシャルグループ	134,900	668.00	90,113,200
長野銀行	3,500	1,119.00	3,916,500
名古屋銀行	8,100	2,430.00	19,683,000
北洋銀行	162,900	218.00	35,512,200
愛知銀行	3,900	2,830.00	11,037,000
中京銀行	4,400	2,099.00	9,235,600
大光銀行	3,700	1,382.00	5,113,400
愛媛銀行	15,100	1,179.00	17,802,900
トマト銀行	4,200	1,020.00	4,284,000
京葉銀行	46,100	525.00	24,202,500
栃木銀行	52,200	169.00	8,821,800
北日本銀行	3,400	1,759.00	5,980,600
東和銀行	19,000	692.00	13,148,000
福島銀行	10,200	164.00	1,672,800
大東銀行	5,600	617.00	3,455,200
トモニホールディングス	83,500	353.00	29,475,500
フィデアホールディングス	104,900	101.00	10,594,900
池田泉州ホールディングス	124,200	165.00	20,493,000
F P G	33,600	539.00	18,110,400
マーキュリアインベストメント	5,000	595.00	2,975,000
S B I ホールディングス	120,700	2,232.00	269,402,400
ジャフコ	16,600	3,955.00	65,653,000
大和証券グループ本社	867,200	478.80	415,215,360
野村ホールディングス	1,901,300	485.60	923,271,280
岡三証券グループ	92,500	349.00	32,282,500
丸三証券	32,400	435.00	14,094,000
東洋証券	39,800	112.00	4,457,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124,700	250.00	31,175,000
光世証券	2,900	575.00	1,667,500
水戸証券	32,000	208.00	6,656,000

いちよし証券	20,500	424.00	8,692,000
松井証券	61,900	906.00	56,081,400
マネックスグループ	79,900	240.00	19,176,000
極東証券	14,800	576.00	8,524,800
岩井コスモホールディングス	10,300	1,279.00	13,173,700
藍澤証券	19,600	703.00	13,778,800
マネーパートナーズグループ	12,200	213.00	2,598,600
スパークス・グループ	50,600	206.00	10,423,600
かんぽ生命保険	38,300	1,478.00	56,607,400
S O M P Oホールディングス	203,100	3,691.00	749,642,100
アニコム ホールディングス	8,900	4,460.00	39,694,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	282,500	2,844.00	803,430,000
第一生命ホールディングス	611,400	1,309.50	800,628,300
東京海上ホールディングス	382,000	4,762.00	1,819,084,000
T & Dホールディングス	322,900	934.00	301,588,600
アドバンスクリエイト	2,200	2,032.00	4,470,400
全国保証	30,400	4,015.00	122,056,000
イントラスト	3,800	825.00	3,135,000
日本モーゲージサービス	2,200	2,059.00	4,529,800
C a s a	3,800	1,136.00	4,316,800
アルヒ	17,200	1,509.00	25,954,800
プレミアグループ	5,900	1,820.00	10,738,000
クレディセゾン	75,700	1,099.00	83,194,300
芙蓉総合リース	11,300	5,950.00	67,235,000
みずほリース	16,700	2,389.00	39,896,300
東京センチュリー	21,800	5,920.00	129,056,000
日本証券金融	47,600	491.00	23,371,600
アイフル	164,800	226.00	37,244,800
リコーリース	8,500	2,907.00	24,709,500
イオンフィナンシャルサービス	66,100	901.00	59,556,100
アコム	217,100	391.00	84,886,100
ジャックス	11,900	1,676.00	19,944,400
オリエントコーポレーション	292,200	110.00	32,142,000
日立キャピタル	25,500	2,552.00	65,076,000
アプラスフィナンシャル	51,800	64.00	3,315,200
オリックス	670,300	1,210.50	811,398,150
三菱U F Jリース	274,200	475.00	130,245,000
九州リースサービス	5,300	563.00	2,983,900
日本取引所グループ	310,100	2,850.00	883,785,000
イー・ギャランティ	11,600	2,638.00	30,600,800
アサックス	5,600	671.00	3,757,600
N E Cキャピタルソリューション	4,400	1,969.00	8,663,600

いちご	142,900	272.00	38,868,800
日本駐車場開発	117,200	140.00	16,408,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,700	1,339.00	8,971,300
A Dワークスグループ	20,000	169.00	3,380,000
ヒューリック	232,100	981.00	227,690,100
三栄建築設計	5,500	1,295.00	7,122,500
野村不動産ホールディングス	66,300	1,907.00	126,434,100
三重交通グループホールディングス	25,000	473.00	11,825,000
サムティ	16,400	1,244.00	20,401,600
ディア・ライフ	18,200	506.00	9,209,200
日本商業開発	7,800	1,524.00	11,887,200
ハウスコム	3,000	1,320.00	3,960,000
日本管理センター	8,300	1,224.00	10,159,200
サンセイランディック	4,900	785.00	3,846,500
フージャースホールディングス	21,500	549.00	11,803,500
オープンハウス	32,200	3,120.00	100,464,000
東急不動産ホールディングス	296,600	444.00	131,690,400
飯田グループホールディングス	91,000	1,770.00	161,070,000
イーランド	3,900	711.00	2,772,900
ムゲンエステート	10,300	497.00	5,119,100
ハウズドゥ	5,300	835.00	4,425,500
シーアールイー	3,800	1,588.00	6,034,400
グッドコムアセット	3,500	1,630.00	5,705,000
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,821.00	8,180,900
テンポイノベーション	4,700	635.00	2,984,500
パーク24	58,800	1,740.00	102,312,000
パラカ	3,700	1,648.00	6,097,600
三井不動産	533,600	1,813.50	967,683,600
三菱地所	757,900	1,586.00	1,202,029,400
平和不動産	20,300	2,844.00	57,733,200
東京建物	115,000	1,209.00	139,035,000
ダイビル	29,300	1,010.00	29,593,000
京阪神ビルディング	18,300	1,323.00	24,210,900
住友不動産	243,400	2,820.50	686,509,700
テーオーシー	23,300	700.00	16,310,000
東京楽天地	2,100	4,050.00	8,505,000
スターツコーポレーション	15,300	2,165.00	33,124,500
フジ住宅	15,300	530.00	8,109,000
空港施設	14,300	422.00	6,034,600
明和地所	9,500	407.00	3,866,500
ゴールドクレスト	9,500	1,463.00	13,898,500
エスリード	5,300	1,373.00	7,276,900

日神グループホールディングス	19,900	372.00	7,402,800
日本エスコン	19,500	829.00	16,165,500
タカラレーベン	49,400	355.00	17,537,000
A V A N T I A	8,000	872.00	6,976,000
イオンモール	55,200	1,348.00	74,409,600
毎日コムネット	4,600	764.00	3,514,400
ファースト住建	6,200	992.00	6,150,400
カチタス	27,300	2,509.00	68,495,700
トーセイ	16,200	877.00	14,207,400
穴吹興産	3,300	1,509.00	4,979,700
サンフロンティア不動産	16,600	858.00	14,242,800
エフ・ジェー・ネクスト	11,100	858.00	9,523,800
インテリックス	3,000	489.00	1,467,000
ランドビジネス	3,600	347.00	1,249,200
サンネクスタグループ	4,700	1,076.00	5,057,200
グランディハウス	12,300	374.00	4,600,200
日本空港ビルデング	34,800	4,070.00	141,636,000
日本工営	7,100	2,942.00	20,888,200
L I F U L L	36,800	426.00	15,676,800
ジェイエシーリクルートメント	7,100	1,094.00	7,767,400
日本M&Aセンター	79,100	4,880.00	386,008,000
メンバーズ	3,200	1,446.00	4,627,200
中広	1,600	500.00	800,000
UTグループ	16,500	2,529.00	41,728,500
アイティメディア	4,300	1,764.00	7,585,200
タケエイ	10,100	1,073.00	10,837,300
E・Jホールディングス	1,900	2,154.00	4,092,600
ビーネックスグループ	13,200	1,085.00	14,322,000
コシダカホールディングス	25,500	404.00	10,302,000
アルトナー	2,700	859.00	2,319,300
パソナグループ	11,400	1,304.00	14,865,600
C D S	2,700	1,252.00	3,380,400
リンクアンドモチベーション	23,400	352.00	8,236,800
G C A	12,900	617.00	7,959,300
エス・エム・エス	32,600	2,489.00	81,141,400
サニーサイドアップグループ	3,800	663.00	2,519,400
パーソルホールディングス	104,700	1,438.00	150,558,600
リニカル	5,200	847.00	4,404,400
クックパッド	36,900	328.00	12,103,200
エスクリ	3,600	360.00	1,296,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	530.00	2,809,000
学情	3,800	1,009.00	3,834,200

スタジオアリス	5,300	1,557.00	8,252,100
シミックホールディングス	5,200	1,321.00	6,869,200
エプロ	2,300	1,304.00	2,999,200
N J S	2,400	1,741.00	4,178,400
総合警備保障	41,700	5,030.00	209,751,000
カカクコム	77,400	2,758.00	213,469,200
アイロムグループ	3,800	2,327.00	8,842,600
セントケア・ホールディング	7,000	436.00	3,052,000
サイネックス	1,900	684.00	1,299,600
ルネサンス	5,900	903.00	5,327,700
ディップ	14,800	2,200.00	32,560,000
デジタルホールディングス	5,700	1,422.00	8,105,400
ツクイ	24,900	492.00	12,250,800
キャリアデザインセンター	2,500	855.00	2,137,500
ベネフィット・ワン	38,100	2,158.00	82,219,800
エムスリー	230,800	5,110.00	1,179,388,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	277.00	1,855,900
プラス	1,600	438.00	700,800
アウトソーシング	60,100	618.00	37,141,800
ウェルネット	10,700	618.00	6,612,600
ワールドホールディングス	3,600	1,561.00	5,619,600
ディー・エヌ・エー	44,400	1,270.00	56,388,000
博報堂D Yホールディングス	145,700	1,243.00	181,105,100
ぐるなび	18,400	635.00	11,684,000
タカミヤ	11,300	540.00	6,102,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,300	811.00	6,731,300
ファンコミュニケーションズ	29,000	447.00	12,963,000
ライク	3,500	1,615.00	5,652,500
ビジネス・ブレークスルー	4,700	374.00	1,757,800
エスプール	27,000	723.00	19,521,000
W D Bホールディングス	4,800	2,703.00	12,974,400
手間いらず	700	3,770.00	2,639,000
ティア	6,300	458.00	2,885,400
C D G	1,200	1,703.00	2,043,600
バリューコマース	5,900	3,350.00	19,765,000
インフォマート	114,800	672.00	77,145,600
J Pホールディングス	33,300	272.00	9,057,600
エコナックホールディングス	20,000	92.00	1,840,000
E P Sホールディングス	14,300	997.00	14,257,100
レッグス	2,700	880.00	2,376,000
プレステージ・インターナショナル	39,300	878.00	34,505,400
アミューズ	5,800	2,130.00	12,354,000

ドリームインキュベータ	3,300	1,365.00	4,504,500
クイック	6,600	1,116.00	7,365,600
T A C	6,900	195.00	1,345,500
ケネディクス	97,700	483.00	47,189,100
電通グループ	107,900	2,554.00	275,576,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	547.00	2,297,400
ぴあ	3,000	3,060.00	9,180,000
イオンファンタジー	4,100	1,569.00	6,432,900
シーティーエス	11,900	836.00	9,948,400
ネクシィーズグループ	3,300	856.00	2,824,800
H . U . グループホールディングス	29,300	2,458.00	72,019,400
アルプス技研	9,300	1,926.00	17,911,800
ダイオーズ	2,200	982.00	2,160,400
日本空調サービス	11,100	742.00	8,236,200
オリエンタルランド	111,300	14,000.00	1,558,200,000
ダスキン	26,100	2,735.00	71,383,500
明光ネットワークジャパン	13,400	771.00	10,331,400
ファルコホールディングス	5,800	1,575.00	9,135,000
ラウンドワン	29,400	727.00	21,373,800
リゾートトラスト	48,100	1,327.00	63,828,700
ビー・エム・エル	13,500	2,706.00	36,531,000
ワタベウェディング	2,000	277.00	554,000
りらいあコミュニケーションズ	19,000	1,164.00	22,116,000
リソー教育	48,200	315.00	15,183,000
早稲田アカデミー	4,700	975.00	4,582,500
ユー・エス・エス	117,200	1,696.00	198,771,200
東京個別指導学院	3,900	532.00	2,074,800
サイバーエージェント	64,500	5,760.00	371,520,000
楽天	488,000	1,004.00	489,952,000
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,200.00	6,720,000
テー・オー・ダブリュー	17,000	288.00	4,896,000
山田コンサルティンググループ	6,900	1,277.00	8,811,300
セントラルスポーツ	3,900	2,191.00	8,544,900
フルキャストホールディングス	10,500	1,303.00	13,681,500
エン・ジャパン	18,600	2,832.00	52,675,200
リソルホールディングス	1,200	3,485.00	4,182,000
テクノプロ・ホールディングス	20,900	5,780.00	120,802,000
アトラ	2,900	240.00	696,000
インターワークス	2,300	351.00	807,300
アイ・アールジャパンホールディングス	4,300	12,500.00	53,750,000
K e e P e r 技研	3,900	1,711.00	6,672,900
ファーストロジック	2,200	647.00	1,423,400

三機サービス	2,100	1,065.00	2,236,500
Gunosy	6,600	799.00	5,273,400
デザインワン・ジャパン	3,500	230.00	805,000
イー・ガーディアン	4,600	3,050.00	14,030,000
リブセンス	7,100	295.00	2,094,500
ジャパンマテリアル	32,300	1,667.00	53,844,100
ベクトル	13,200	790.00	10,428,000
ウチヤマホールディングス	5,500	297.00	1,633,500
チャーム・ケア・コーポレーション	9,000	766.00	6,894,000
キャリアリンク	3,600	808.00	2,908,800
I B J	7,300	679.00	4,956,700
アサンテ	4,300	1,473.00	6,333,900
N・フィールド	7,400	471.00	3,485,400
バリューHR	4,200	1,400.00	5,880,000
M&Aキャピタルパートナーズ	8,500	3,650.00	31,025,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	2,240.00	9,184,000
E R Iホールディングス	3,100	612.00	1,897,200
アビスト	1,700	2,695.00	4,581,500
シグマクシス	7,200	1,584.00	11,404,800
ウィルグループ	7,000	630.00	4,410,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,000	296.00	4,440,000
リクルートホールディングス	749,900	3,558.00	2,668,144,200
エラン	6,200	1,814.00	11,246,800
土木管理総合試験所	4,800	381.00	1,828,800
ネットマーケティング	4,200	565.00	2,373,000
日本郵政	858,000	775.70	665,550,600
ベルシステム24ホールディングス	17,600	1,747.00	30,747,200
鎌倉新書	8,000	842.00	6,736,000
S M N	2,300	1,013.00	2,329,900
一蔵	1,400	379.00	530,600
L I T A L I C O	3,600	2,202.00	7,927,200
グローバルキッズCOMPANY	2,100	660.00	1,386,000
エアトリ	5,500	1,114.00	6,127,000
アトラエ	3,200	2,780.00	8,896,000
ストライク	4,000	4,725.00	18,900,000
ソラスト	29,000	1,082.00	31,378,000
セラク	3,400	1,318.00	4,481,200
インソース	4,400	2,513.00	11,057,200
ベイカレント・コンサルティング	6,400	12,900.00	82,560,000
Orchestra Holdings	2,200	1,662.00	3,656,400
アイモバイル	3,800	728.00	2,766,400
キャリアインデックス	4,600	399.00	1,835,400

MS - J a p a n	3,500	807.00	2,824,500
船場	1,800	940.00	1,692,000
グレイステクノロジー	4,800	5,690.00	27,312,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	11,100	3,550.00	39,405,000
フルテック	1,500	1,325.00	1,987,500
グリーンズ	2,900	464.00	1,345,600
GameWith	3,300	543.00	1,791,900
ソウルドアウト	2,200	2,238.00	4,923,600
MS&Consulting	2,200	574.00	1,262,800
ミダック	1,400	1,570.00	2,198,000
日総工産	7,100	629.00	4,465,900
キュービーネットホールディングス	4,400	1,793.00	7,889,200
RPAホールディングス	8,100	749.00	6,066,900
スプリックス	3,100	696.00	2,157,600
マネジメントソリューションズ	4,600	1,348.00	6,200,800
プロレド・パートナーズ	1,400	5,260.00	7,364,000
and factory	1,000	929.00	929,000
ギークス	1,200	1,089.00	1,306,800
カーブスホールディングス	28,900	573.00	16,559,700
フォーラムエンジニアリング	5,600	747.00	4,183,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,400	825.00	4,455,000
リログループ	57,300	1,965.00	112,594,500
東祥	6,600	1,199.00	7,913,400
エイチ・アイ・エス	16,300	1,556.00	25,362,800
ラックランド	2,500	2,220.00	5,550,000
共立メンテナンス	17,400	3,405.00	59,247,000
イチネンホールディングス	11,800	1,164.00	13,735,200
建設技術研究所	7,300	1,708.00	12,468,400
スペース	6,900	940.00	6,486,000
長大	4,300	1,067.00	4,588,100
燦ホールディングス	4,600	1,205.00	5,543,000
スバル興業	600	7,640.00	4,584,000
東京テアトル	4,200	1,203.00	5,052,600
タナベ経営	2,100	1,305.00	2,740,500
ナガワ	3,400	7,610.00	25,874,000
よみうりランド	2,300	3,595.00	8,268,500
東京都競馬	6,900	4,240.00	29,256,000
カナモト	17,200	2,299.00	39,542,800
東京ドーム	42,500	733.00	31,152,500
西尾レントオール	9,700	2,170.00	21,049,000
トランス・コスモス	10,000	2,596.00	25,960,000
乃村工藝社	45,000	808.00	36,360,000

藤田観光	4,600	1,529.00	7,033,400	
KNT-CTホールディングス	6,500	919.00	5,973,500	
日本管財	11,300	2,013.00	22,746,900	
トーカイ	10,200	2,264.00	23,092,800	
白洋舎	1,200	2,787.00	3,344,400	
セコム	111,100	9,366.00	1,040,562,600	
セントラル警備保障	5,100	3,575.00	18,232,500	
丹青社	19,900	703.00	13,989,700	
メイテック	12,800	5,370.00	68,736,000	
応用地質	11,300	1,449.00	16,373,700	
船井総研ホールディングス	21,700	2,369.00	51,407,300	
進学会ホールディングス	4,300	421.00	1,810,300	
オオバ	7,600	689.00	5,236,400	
いであ	2,600	1,831.00	4,760,600	
学究社	3,200	1,108.00	3,545,600	
ベネッセホールディングス	34,900	2,934.00	102,396,600	
イオンディライト	12,900	3,245.00	41,860,500	
ナック	5,900	930.00	5,487,000	
ニチイ学館	15,000	1,605.00	24,075,000	
ダイセキ	17,600	2,411.00	42,433,600	
ステップ	3,900	1,540.00	6,006,000	
合計	128,415,700		242,055,356,100	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（国内株式）】

【純資産額計算書】

（2020年 8月31日現在）

資産総額	33,548,079,752円
負債総額	130,455,035円
純資産総額（ - ）	33,417,624,717円
発行済口数	14,004,431,348口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3862円
（1万口当たり純資産額）	（23,862円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2020年 8月31日現在）

資産総額	250,353,611,123円
負債総額	146,623,154円
純資産総額（ - ）	250,206,987,969円
発行済口数	141,057,408,392口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7738円
（1万口当たり純資産額）	（17,738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 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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。

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2020年10月27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8月31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	529	12,612,155
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	294,431
単位型公社債投資信託	36	258,622
合計	644	13,165,208

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	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		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10月27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。

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みます。）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9月25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」に掲げられているインデックスコレクション（国内株式）の2019年7月26日から2020年7月27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、インデックスコレクション（国内株式）の2020年7月27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。