

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年1月5日提出
【計算期間】	第2期(自 2020年4月9日至 2020年10月8日)
【ファンド名】	SMDAM トピックス上場投信
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町2番1号

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	E T F	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本	
不動産投信	年4回	北米	
その他資産 ()	年6回(隔月)	欧州	TOPIX
資産複合 ()	年12回(毎月)	アジア	
資産配分固定型 資産配分変更型	日々	オセアニア	
	その他 ()	中南米	
		アフリカ	
		中近東(中東)	その他 ()
		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。

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

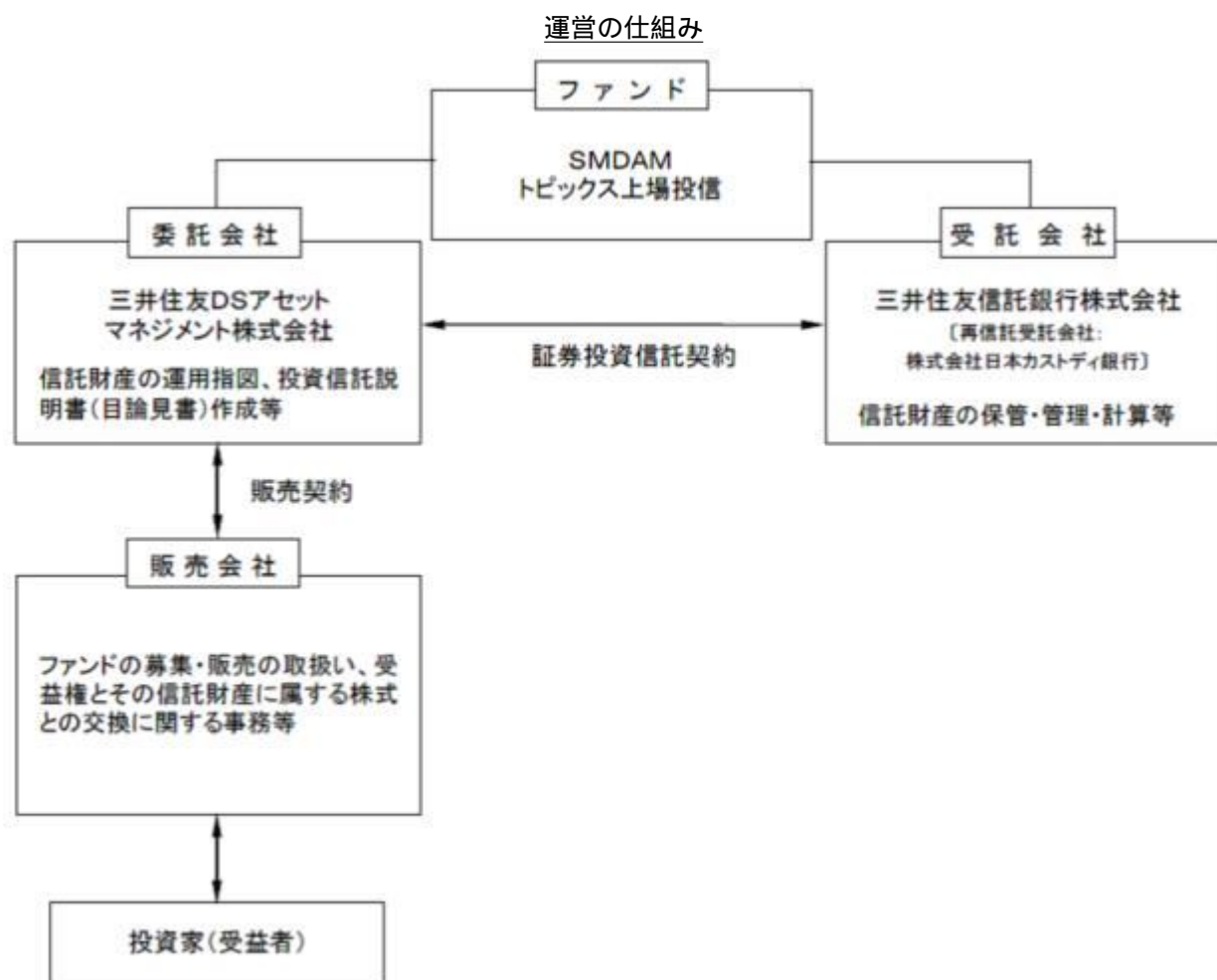
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020年10月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

- 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
- 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

(八) 大株主の状況

(2020年10月30日現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

ファンドの特色

1

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

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

2

上場投資信託(ETF)であり、通常の投資信託とは仕組みが異なります。

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

3

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

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

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

運用プロセス



※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。



完全法とは

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

東証株価指数(TOPIX)について

● 指数の概要

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

● 指数の著作権など

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

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

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

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

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

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株式
2. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

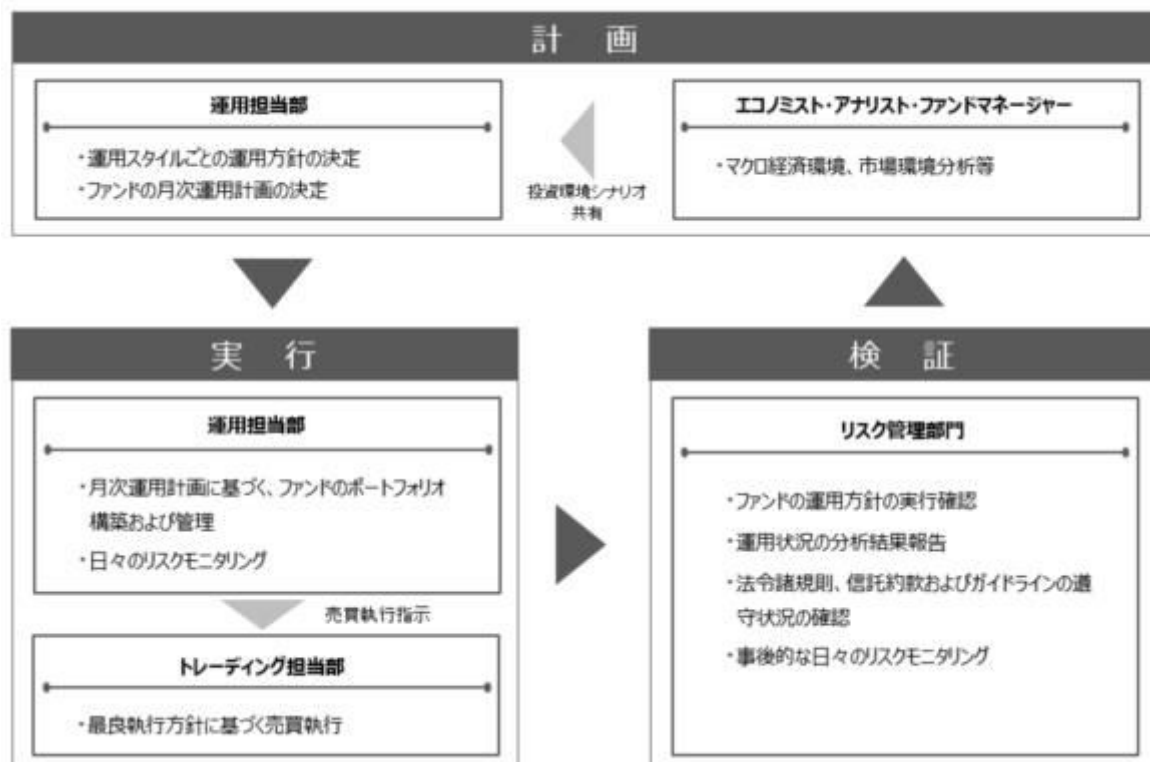
ハ 投資対象とする金融商品

上記ロの規定にかかわらず、この信託の設定、交換、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託財産を次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

(4)【分配方針】

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

(5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ニ 投資する株式の範囲
- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場している株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場することが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ 先物取引等の運用指図
委託会社は、日本の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- ヘ 株式の貸付けの指図
- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、株式の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- ト デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

- イ ファンドのもつリスクの特性
当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。
投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。
当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。
- (イ) 株式市場リスク
内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。
- (ロ) 信用リスク
ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。
- (ハ) 市場流動性リスク

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

(二) 指数の動きと連動しない要因

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

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

(ホ) 基準価額と取引価格の乖離にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。
※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。
※ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)です。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金

額を取得申込者から徴収することができるものとします。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（２）【換金（解約）手数料】

イ 換金手数料

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

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

詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ロ 信託財産留保額

ありません。

（３）【信託報酬等】

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

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

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

なお、2021年1月5日現在における上記イおよびロに規定する率、委託会社と受託会社の配分（税抜き）は以下の通りです。（今後、変更される場合があります。）

イの率および委託会社と受託会社の配分

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

ロの率および委託会社と受託会社の配分

合計	委託会社	受託会社
0.55 （税抜き0.5）	0.25	0.25

上記の配分（税抜き）には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行、名義登録・分配金支払事務等の対価

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

2021年1月5日現在、追加上場料は追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に0.00825%(税抜き0.0075%)の率を乗じた額、年間上場料は毎年末のファンドの純資産総額に最大0.00825%(税抜き0.0075%)の率を乗じた額です。

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

2021年1月5日現在、商標使用料はファンドの純資産総額に最大年0.033%(税抜き0.03%)の率を乗じた額です。ただし、165万円(税抜き150万円)を下回る場合は、165万円(税抜き150万円)となります。

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

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

イ 個人受益者の場合

(イ) 受益権の売却時の課税

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

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

(ロ) 収益分配金の受取り時の課税

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

(ハ) 受益権と現物株式との交換

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

(二) 償還時

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

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

□ 法人受益者の場合

（イ）受益権の売却時の課税

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

（ロ）収益分配金の受取り時の課税

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

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

（ハ）受益権と現物株式との交換

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

（ニ）償還時

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

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用が可能です。

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

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

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

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2020年10月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	12,837,233,180	98.28

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		224,353,654	1.72
合計(純資産総額)		13,061,586,834	100.00

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

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	220,220,000	1.68
合計	買建	-	220,220,000	1.68

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年10月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	64,800	7,034.00	455,803,200	6,803.00	440,834,400	3.38
日本	株式	ソニー	電気機器	36,400	7,832.00	285,084,800	8,674.00	315,733,600	2.42
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	45,200	7,085.00	320,242,000	6,793.00	307,043,600	2.35
日本	株式	キーエンス	電気機器	5,300	49,530.00	262,509,000	47,250.00	250,425,000	1.92
日本	株式	任天堂	その他製品	3,600	58,330.00	209,988,000	56,980.00	205,128,000	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	76,100	2,311.00	175,867,100	2,196.00	167,115,600	1.28
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	391,400	434.30	169,985,020	410.20	160,552,280	1.23
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	40,800	3,876.00	158,140,800	3,887.00	158,589,600	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	39,800	4,309.00	171,498,200	3,970.00	158,006,000	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	48,300	3,655.00	176,536,500	3,239.00	156,443,700	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	14,000	10,180.00	142,520,000	10,500.00	147,000,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	7,400	18,665.00	138,121,000	19,480.00	144,152,000	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	49,800	2,990.00	148,902,000	2,748.00	136,850,400	1.05
日本	株式	信越化学工業	化学	9,800	14,105.00	138,229,000	13,890.00	136,122,000	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	11,500	12,160.00	139,840,000	11,800.00	135,700,000	1.04
日本	株式	村田製作所	電気機器	17,100	6,921.00	118,349,100	7,267.00	124,265,700	0.95
日本	株式	ファナック	電気機器	5,500	20,660.00	113,630,000	22,050.00	121,275,000	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	41,600	2,726.00	113,401,600	2,792.50	116,168,000	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	39,700	3,013.00	119,616,100	2,881.00	114,375,700	0.88

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	45,800	2,601.00	119,125,800	2,435.00	111,523,000	0.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	3,700	28,580.00	105,746,000	27,900.00	103,230,000	0.79
日本	株式	花王	化学	13,900	7,778.00	108,114,200	7,420.00	103,138,000	0.79
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	40,000	2,684.00	107,360,000	2,500.00	100,000,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	77,700	1,345.50	104,545,350	1,281.50	99,572,550	0.76
日本	株式	S M C	機械	1,800	58,310.00	104,958,000	55,300.00	99,540,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	27,900	3,677.00	102,588,300	3,502.00	97,705,800	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	20,300	4,817.00	97,785,100	4,659.00	94,577,700	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	37,500	2,564.00	96,150,000	2,325.50	87,206,250	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	5,900	15,080.00	88,972,000	14,585.00	86,051,500	0.66
日本	株式	エムスリー	サービス業	12,200	6,690.00	81,618,000	7,027.00	85,729,400	0.66

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年10月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.13
		建設業	2.35
		食料品	3.57
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.34
		医薬品	5.75
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.58
		機械	5.41
		電気機器	15.92
		輸送用機器	7.03
		精密機器	2.66
		その他製品	2.75
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	3.45
海運業	0.16		
空運業	0.31		
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	10.29		

	卸売業	4.47
	小売業	4.96
	銀行業	4.66
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.94
	その他金融業	1.07
	不動産業	1.89
	サービス業	5.60
合計		98.28

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

2020年10月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	14	日本円	231,296,100	220,220,000	1.68

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

年月日	純資産総額 (円)		100口当たりの 純資産額(円)		東京証券取引所 取引価格(円)
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第1期 (2020年 4月 8日)	28,476,872,305	28,845,250,742	142,625	144,470	1,403
第2期 (2020年10月 8日)	13,690,167,278	13,800,386,480	165,818	167,153	1,653
2019年12月末日	10,328,155,378		172,360		1,726
2020年 1月末日	10,106,562,558		168,662		1,697
2月末日	15,142,673,738		151,334		1,505
3月末日	28,412,090,836		142,300		1,411
4月末日	29,255,688,221		146,525		1,450
5月末日	31,240,187,109		156,464		1,577
6月末日	9,800,104,278		156,174		1,629
7月末日	9,404,304,550		149,867		1,500

8月末日	10,171,262,632		162,089		1,620
9月末日	13,550,378,841		164,125		1,670
10月末日	13,061,586,834		158,205		1,585

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

【分配の推移】

	計算期間	100口当たり分配金(円)
第1期	2019年12月13日～2020年4月8日	1,845
第2期	2020年4月9日～2020年10月8日	1,335

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	15.7
第2期	17.2

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	21,939,400	1,973,089
第2期	1,981,000	13,691,191

(注1) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(注2) 解約口数は、交換口数を表示しております。

参考情報

基準日:2020年10月30日

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

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

決算期	分配金
2020年10月	1,335円
2020年4月	1,845円
設定来累計	3,180円

※分配金は100口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.72
合計(純資産総額)		100.00

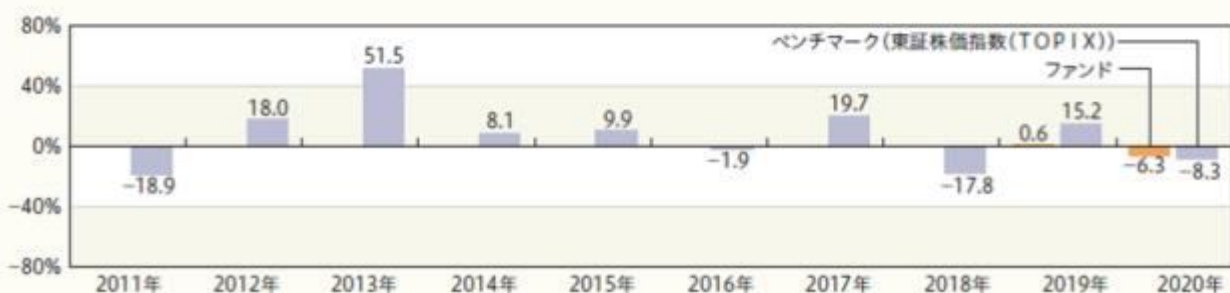
※株価指数先物取引の買建て 1.68%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.38
日本	株式	ソニー	電気機器	2.42
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.35
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.92
日本	株式	任天堂	その他製品	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.28
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.23
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.20

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。
※2019年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2019年12月13日)から年末までの騰落率を表示しています。
※2020年の収益率は、年初から2020年10月30日までの騰落率を表示しています。
※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

- (イ) 当ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
- 当ファンドの取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する株式をもって取得の申込みを行うものとします。当該株式は、対象指数を構成する各銘柄の株式の数の構成比率に相当する比率により構成され、委託会社が対象指数の動きに連動すると想定する、各銘柄の株式からなるポートフォリオ(ユニット)とします。
- なお、当該ユニットの評価額が、取得する受益権口数の評価額(取得申込受益権口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額)に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭をもって支払うものとします。
- (ロ) 当ファンドの取得申込者が、委託会社が別に定める時限(営業日の午後3時)までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その申込みの翌営業日を取得申込受付日として委託会社は当該取得申込みを受け付けます。
- (ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる株式および金銭の受渡または支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- (ニ) 当ファンドの取得申込者が対象指数の構成銘柄である株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みにかかるユニットのうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値(終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。)に取得申込みにかかるユニットに含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該株式の個別銘柄時価総額に0.15%の率を乗じて得た額)を徴収します。
- (ホ) 申込不可日
- 上記にかかわらず、取得申込受付日が以下に定める日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません。
1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々の前営業日から起算して2営業日間
 2. 対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日間
 3. 計算期間終了日の3営業日前から起算して3営業日間(ただし、計算期間終了日が休日(営業日でない日)をいいます。)の場合は、当該計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内)
 4. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
 5. 上記1.~4.のほか、委託会社が運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれのあるやむを得ない事情が生じたものと認めるとき
- ただし、委託会社は、上記に定める日における受益権の取得申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等に鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における受益権の取得申込みについては、当該取得申込みの受け付けを行うことができます。
- (ヘ) 上記(ホ)1.に該当する日(対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々の前営業日を除きます。)において、当ファンドの取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかるユニットのうち、配当落または権利落対象銘柄(以下「対象銘柄」といいます。)の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付ける場合があります。この場合において、委託会社は、当該対象銘柄を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額(当該株式の個別銘柄時価総額に0.15%の率を乗じて得た額)を徴収

します。

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

ハ 申込手数料

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

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

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

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

イ 信託契約の一部解約

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

ロ 交換請求

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

委託会社は、委託会社が別に定める時限（営業日の午後3時）までに交換請求が行われ、販売会社所定の事務手続きが完了した場合には、その請求の翌営業日を交換請求受付日として、当該交換請求を受け付けます。受益者は、交換請求にかかる一定口数（当該口数に交換請求受付日の基準価額を乗じて得た額が、交換請求受付日において委託会社が対象指数の動きに連動すると想定する、対象指数における各構成銘柄の評価額の合計に相当するものとして、委託会社が定める口数をいい、以下「交換請求口数」といいます。）の整数倍の受益権をもって交換請求を行うことができます。

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

- (ロ) 販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとし

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

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

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

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

- (二) 委託会社は、受託会社に対し、上記(八)により計算された口数の受益権と信託財産に属する株式のうち取引所売買単位の整数倍となる株式を交換するよう指図します。ただし、交換の請求を行った受益者が、対象指数の構成銘柄である株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、上記(八)の交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる株式(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、上記(八)の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値(終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。)に上記(八)に基づき計算された数を乗じて得た金額とします。

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

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

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

- (チ) 申込不可日

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

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

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

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

八 受益権の買取請求

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

(イ) 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権

(ロ) 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取請求受付日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせください。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年4月9日から10月8日まで、および10月9日から翌年4月8日までとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が

当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ハ 反対者の買取請求権

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

二 販売会社との契約の更改等

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

ホ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

へ 公告

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

す。

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

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

ト 運用にかかる報告書の開示方法

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

チ 金融商品取引所への上場

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権および名義登録

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

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

なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

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

なお、受益者はファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限り、）を経由して受益者名簿に名義登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴収することができるものとし、

ただし、証券金融会社等は登録を受託会社（受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。

受託会社は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金について未払残高があるときは、当該金額を委託会社に交付するものとし、

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

ロ 償還金請求権

償還は、信託終了日現在において受益者名簿に名義登録されている者を信託終了日現在における受益者(以下「信託終了時受益者」といいます。)として、当該信託終了時受益者に、信託終了時の信託財産の純資産総額に相当する金銭を支払うことにより行います。なお、当該信託終了時受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

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

八 交換請求権および買取請求権

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

二 書面決議における議決権および受益権の買取請求権

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

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(2020年4月9日から2020年10月8日まで)の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2020年4月8日現在)	第2期 (2020年10月8日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	467,982,916	-
コール・ローン	-	206,290,596
株式	27,986,972,900	13,473,695,290
派生商品評価勘定	13,124,500	4,017,300
未収配当金	359,512,179	114,408,625
差入委託証拠金	37,465,000	16,700,000
流動資産合計	28,865,057,495	13,815,111,811
資産合計	28,865,057,495	13,815,111,811
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,602,500	664,300
前受金	8,555,000	3,375,000
未払収益分配金	368,378,437	110,219,202
未払受託者報酬	1,426,559	2,633,375
未払委託者報酬	2,343,595	4,326,206
未払利息	-	534
その他未払費用	2,879,099	3,725,916
流動負債合計	388,185,190	124,944,533
負債合計	388,185,190	124,944,533
純資産の部		
元本等		
元本	34,202,290,743	14,142,733,560
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,725,418,438	452,566,282
元本等合計	28,476,872,305	13,690,167,278
純資産合計	28,476,872,305	13,690,167,278
負債純資産合計	28,865,057,495	13,815,111,811

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2019年12月13日 至 2020年 4月 8日	自	2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日
営業収益				
受取配当金		375,042,535		120,958,839
有価証券売買等損益		1,972,328,506		4,192,456,216
派生商品取引等損益		3,754,000		82,591,100
その他収益		-		108,526
営業収益合計		1,601,039,971		4,396,114,681
営業費用				
支払利息		5,672		77,041
受託者報酬		1,426,559		2,633,375
委託者報酬		2,343,595		4,326,206
その他費用		2,880,279		3,774,117
営業費用合計		6,656,105		10,810,739
営業利益又は営業損失()		1,607,696,076		4,385,303,942
経常利益又は経常損失()		1,607,696,076		4,385,303,942
当期純利益又は当期純損失()		1,607,696,076		4,385,303,942
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()		-		-
期首剰余金又は期首欠損金()		-		5,725,418,438
剰余金増加額又は欠損金減少額		77,051,477		1,197,075,173
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		77,051,477		1,197,075,173
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,826,395,402		199,307,757
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,826,395,402		199,307,757
分配金		368,378,437		110,219,202
期末剰余金又は期末欠損金()		5,725,418,438		452,566,282

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期	
	自 2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期		第2期	
	(2020年 4月 8日現在)		(2020年10月 8日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	19,966,311口		8,256,120口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	5,725,418,438円	元本の欠損	452,566,282円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,426.25円	1口当たり純資産額	1,658.18円
	(100口当たりの純資産額)	142,625円	(100口当たりの純資産額)	165,818円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日	自 2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(368,386,430円)および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は368,386,430円(100口当たり1,845.04円)であり、うち368,378,437円(100口当たり1,845円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(110,256,626円)および分配準備積立金(7,993円)より、分配対象収益は110,264,619円(100口当たり1,335.54円)であり、うち110,219,202円(100口当たり1,335円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自 2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2020年10月8日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2019年12月13日 至 2020年 4月 8日)

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

第2期(自 2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,449,353,052円
合計	1,449,353,052円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2020年 4月 8日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

第2期(2020年10月 8日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	327,747,000	-	331,100,000	3,353,000
	東証株価指数先物	327,747,000	-	331,100,000	3,353,000

合計	327,747,000	-	331,100,000	3,353,000
----	-------------	---	-------------	-----------

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2020年 4月 9日 至 2020年10月 8日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期	第2期
	(2020年 4月 8日現在)	(2020年10月 8日現在)
期首元本額	10,264,638,600円	34,202,290,743円
期中追加設定元本額	27,317,553,600円	3,393,453,000円
期中一部交換元本額	3,379,901,457円	23,453,010,183円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	200	2,786.00	557,200	
日本水産	8,000	443.00	3,544,000	
マルハニチロ	1,100	2,345.00	2,579,500	
カネコ種苗	200	1,502.00	300,400	
サカタのタネ	900	3,800.00	3,420,000	
ホクト	600	2,254.00	1,352,400	
ホクリヨウ	100	685.00	68,500	
住石ホールディングス	1,900	126.00	239,400	

日鉄鉱業	100	4,765.00	476,500
三井松島ホールディングス	200	736.00	147,200
国際石油開発帝石	29,100	577.20	16,796,520
石油資源開発	1,000	1,794.00	1,794,000
K & O エナジーグループ	300	1,518.00	455,400
ヒノキヤグループ	200	1,976.00	395,200
ショーボンドホールディングス	1,300	5,140.00	6,682,000
ミライト・ホールディングス	2,400	1,605.00	3,852,000
タマホーム	500	1,439.00	719,500
サンヨーホームズ	100	687.00	68,700
日本アクア	200	733.00	146,600
ファーストコーポレーション	200	744.00	148,800
ベステラ	100	1,405.00	140,500
T A T E R U	1,800	218.00	392,400
キャンディル	100	695.00	69,500
スペースバリューホールディングス	1,100	585.00	643,500
ダイセキ環境ソリューション	100	708.00	70,800
第一カッター興業	100	2,250.00	225,000
安藤・間	4,700	743.00	3,492,100
東急建設	2,200	477.00	1,049,400
コムシスホールディングス	2,700	2,912.00	7,862,400
ビーアールホールディングス	1,000	764.00	764,000
高松コンストラクショングループ	600	2,293.00	1,375,800
東建コーポレーション	200	7,910.00	1,582,000
ソネック	100	859.00	85,900
ヤマウラ	200	900.00	180,000
大成建設	6,000	3,685.00	22,110,000
大林組	18,200	965.00	17,563,000
清水建設	18,600	795.00	14,787,000
飛鳥建設	600	1,093.00	655,800
長谷工コーポレーション	7,100	1,389.00	9,861,900
松井建設	900	728.00	655,200
銭高組	100	4,715.00	471,500
鹿島建設	14,400	1,265.00	18,216,000
不動テトラ	600	1,527.00	916,200
大末建設	100	925.00	92,500
鉄建建設	300	2,067.00	620,100
西松建設	1,500	2,109.00	3,163,500
三井住友建設	4,200	452.00	1,898,400
大豊建設	500	3,225.00	1,612,500
前田建設工業	4,600	787.00	3,620,200
佐田建設	300	459.00	137,700

ナカノフドー建設	800	412.00	329,600
奥村組	900	2,666.00	2,399,400
東鉄工業	800	2,836.00	2,268,800
イチケン	100	1,693.00	169,300
富士ピー・エス	200	626.00	125,200
浅沼組	100	4,195.00	419,500
戸田建設	7,500	719.00	5,392,500
熊谷組	800	2,674.00	2,139,200
北野建設	100	2,687.00	268,700
植木組	100	2,697.00	269,700
矢作建設工業	1,000	881.00	881,000
ピーエス三菱	600	613.00	367,800
日本ハウスホールディングス	1,500	276.00	414,000
大東建託	2,000	9,289.00	18,578,000
新日本建設	1,000	903.00	903,000
N I P P O	1,500	2,910.00	4,365,000
東亜道路工業	100	3,615.00	361,500
前田道路	1,600	1,861.00	2,977,600
日本道路	100	7,700.00	770,000
東亜建設工業	600	1,799.00	1,079,400
日本国土開発	1,700	622.00	1,057,400
若築建設	200	1,203.00	240,600
東洋建設	2,100	433.00	909,300
五洋建設	7,200	675.00	4,860,000
世紀東急工業	1,000	846.00	846,000
福田組	200	5,060.00	1,012,000
住友林業	4,700	1,737.00	8,163,900
日本基礎技術	800	469.00	375,200
巴コーポレーション	1,000	396.00	396,000
大和ハウス工業	18,000	2,908.50	52,353,000
ライト工業	1,000	1,596.00	1,596,000
積水ハウス	19,700	1,840.00	36,248,000
日特建設	500	799.00	399,500
北陸電気工事	200	1,213.00	242,600
ユアテック	1,300	669.00	869,700
日本リーテック	300	2,507.00	752,100
四電工	100	2,286.00	228,600
中電工	700	2,250.00	1,575,000
関電工	2,500	862.00	2,155,000
きんでん	4,300	1,824.00	7,843,200
東京エネシス	600	765.00	459,000
トーエネック	200	3,555.00	711,000

住友電設	600	2,552.00	1,531,200
日本電設工業	900	2,134.00	1,920,600
協和エクシオ	2,700	2,742.00	7,403,400
新日本空調	600	2,239.00	1,343,400
九電工	1,400	3,100.00	4,340,000
三機工業	1,400	1,184.00	1,657,600
日揮ホールディングス	5,600	1,069.00	5,986,400
中外炉工業	200	1,535.00	307,000
ヤマト	600	699.00	419,400
太平電業	500	2,262.00	1,131,000
高砂熱学工業	1,600	1,528.00	2,444,800
三晃金属工業	100	2,603.00	260,300
朝日工業社	100	3,005.00	300,500
明星工業	1,200	808.00	969,600
大気社	900	2,921.00	2,628,900
ダイダン	500	2,693.00	1,346,500
日比谷総合設備	600	1,753.00	1,051,800
フィル・カンパニー	100	1,905.00	190,500
O S J Bホールディングス	2,900	249.00	722,100
東洋エンジニアリング	900	336.00	302,400
レイズネクスト	900	1,328.00	1,195,200
日本製粉	1,700	1,733.00	2,946,100
日清製粉グループ本社	6,600	1,706.00	11,259,600
日東富士製粉	100	6,540.00	654,000
昭和産業	600	3,385.00	2,031,000
鳥越製粉	600	1,063.00	637,800
中部飼料	700	1,684.00	1,178,800
フィード・ワン	840	929.00	780,360
東洋精糖	100	1,287.00	128,700
日本甜菜製糖	200	1,855.00	371,000
三井製糖	600	1,923.00	1,153,800
塩水港精糖	1,000	229.00	229,000
日新製糖	200	1,906.00	381,200
森永製菓	1,400	4,265.00	5,971,000
中村屋	100	4,195.00	419,500
江崎グリコ	1,600	4,715.00	7,544,000
名糖産業	200	1,509.00	301,800
井村屋グループ	200	2,430.00	486,000
不二家	300	2,429.00	728,700
山崎製パン	4,300	1,829.00	7,864,700
第一屋製パン	100	999.00	99,900
モロゾフ	100	5,980.00	598,000

亀田製菓	400	5,270.00	2,108,000
寿スピリッツ	600	5,730.00	3,438,000
カルビー	2,600	3,430.00	8,918,000
森永乳業	1,000	5,430.00	5,430,000
六甲バター	300	1,811.00	543,300
ヤクルト本社	4,000	5,490.00	21,960,000
明治ホールディングス	3,900	7,890.00	30,771,000
雪印メグミルク	1,500	2,523.00	3,784,500
プリマハム	900	3,145.00	2,830,500
日本ハム	2,300	4,535.00	10,430,500
林兼産業	100	574.00	57,400
丸大食品	700	1,760.00	1,232,000
S Foods	500	2,912.00	1,456,000
柿安本店	100	2,621.00	262,100
伊藤ハム米久ホールディングス	3,800	751.00	2,853,800
サッポロホールディングス	1,900	1,903.00	3,615,700
アサヒグループホールディングス	12,900	3,765.00	48,568,500
キリンホールディングス	24,700	2,000.00	49,400,000
宝ホールディングス	4,300	1,112.00	4,781,600
オエノンホールディングス	1,500	446.00	669,000
養命酒製造	100	1,869.00	186,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	4,400	1,769.00	7,783,600
サントリー食品インターナショナル	4,000	3,950.00	15,800,000
ダイドーグループホールディングス	200	5,230.00	1,046,000
伊藤園	1,700	7,380.00	12,546,000
キーコーヒー	600	2,263.00	1,357,800
ユニカフェ	100	1,049.00	104,900
ジャパンフーズ	100	1,294.00	129,400
日清オイリオグループ	800	3,170.00	2,536,000
不二製油グループ本社	1,500	3,475.00	5,212,500
かどや製油	100	3,940.00	394,000
J - オイルミルズ	400	3,895.00	1,558,000
キッコーマン	4,200	5,450.00	22,890,000
味の素	12,900	2,141.00	27,618,900
キュービー	3,300	2,286.00	7,543,800
ハウス食品グループ本社	2,200	3,655.00	8,041,000
カゴメ	2,400	3,640.00	8,736,000
焼津水産化学工業	200	1,036.00	207,200
アリアケジャパン	600	7,150.00	4,290,000
ピエトロ	100	1,737.00	173,700
エバラ食品工業	100	2,498.00	249,800
ニチレイ	2,700	2,758.00	7,446,600

東洋水産	3,100	5,470.00	16,957,000
イトアンドホールディングス	100	1,912.00	191,200
大冷	100	2,159.00	215,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	200	1,037.00	207,400
日清食品ホールディングス	2,500	9,620.00	24,050,000
永谷園ホールディングス	200	2,459.00	491,800
一正蒲鉾	100	1,161.00	116,100
フジッコ	700	2,052.00	1,436,400
ロック・フィールド	600	1,488.00	892,800
日本たばこ産業	31,200	2,005.00	62,556,000
ケンコーマヨネーズ	200	1,930.00	386,000
わらべや日洋ホールディングス	300	1,577.00	473,100
なとり	200	2,072.00	414,400
イフジ産業	100	950.00	95,000
ピクルスコーポレーション	100	3,135.00	313,500
北の達人コーポレーション	2,100	538.00	1,129,800
ユーグレナ	2,500	884.00	2,210,000
ミヨシ油脂	100	1,170.00	117,000
理研ビタミン	600	2,064.00	1,238,400
片倉工業	800	1,215.00	972,000
ゲンゼ	500	4,010.00	2,005,000
東洋紡	2,300	1,516.00	3,486,800
ユニチカ	1,800	393.00	707,400
富士紡ホールディングス	200	3,600.00	720,000
倉敷紡績	600	1,948.00	1,168,800
シキボウ	200	991.00	198,200
日本毛織	1,800	1,032.00	1,857,600
ダイトウボウ	1,700	109.00	185,300
トーア紡コーポレーション	100	520.00	52,000
ガイドーリミテッド	1,100	208.00	228,800
帝国繊維	700	2,621.00	1,834,700
帝人	4,700	1,712.00	8,046,400
東レ	41,400	493.80	20,443,320
サカイオーベックス	100	2,066.00	206,600
住江織物	100	2,199.00	219,900
日本フェルト	200	493.00	98,600
イチカワ	100	1,442.00	144,200
日東製網	100	1,480.00	148,000
アツギ	500	567.00	283,500
ダイニック	100	833.00	83,300
セーレン	1,400	1,609.00	2,252,600
ソトー	300	955.00	286,500

東海染工	100	1,125.00	112,500
小松マテーレ	1,100	826.00	908,600
ワコールホールディングス	1,500	2,025.00	3,037,500
ホギメディカル	700	3,640.00	2,548,000
クラウディアホールディングス	100	306.00	30,600
T S Iホールディングス	1,800	287.00	516,600
マツオカコーポレーション	100	2,191.00	219,100
ワールド	800	1,382.00	1,105,600
三陽商会	200	574.00	114,800
ナイガイ	100	394.00	39,400
オンワードホールディングス	3,400	263.00	894,200
ルックホールディングス	100	837.00	83,700
キムラタン	2,200	28.00	61,600
ゴールドウイン	1,000	8,210.00	8,210,000
デサント	1,000	1,646.00	1,646,000
キング	200	595.00	119,000
ヤマトインターナショナル	800	358.00	286,400
特種東海製紙	400	4,740.00	1,896,000
王子ホールディングス	23,800	492.00	11,709,600
日本製紙	2,500	1,316.00	3,290,000
三菱製紙	900	347.00	312,300
北越コーポレーション	3,600	378.00	1,360,800
中越パルプ工業	200	1,437.00	287,400
巴川製紙所	100	974.00	97,400
大王製紙	2,500	1,555.00	3,887,500
阿波製紙	100	486.00	48,600
レンゴー	5,400	834.00	4,503,600
トモク	200	1,744.00	348,800
ザ・パック	500	3,050.00	1,525,000
クラレ	9,000	1,059.00	9,531,000
旭化成	37,700	939.90	35,434,230
共和レザー	200	641.00	128,200
昭和電工	4,300	2,023.00	8,698,900
住友化学	42,100	366.00	15,408,600
住友精化	200	3,560.00	712,000
日産化学	3,200	5,550.00	17,760,000
ラサ工業	100	2,229.00	222,900
クレハ	600	4,745.00	2,847,000
多木化学	200	7,030.00	1,406,000
テイカ	500	1,428.00	714,000
石原産業	1,200	733.00	879,600
片倉コープアグリ	100	1,291.00	129,100

日本曹達	800	3,000.00	2,400,000
東ソー	8,900	1,744.00	15,521,600
トクヤマ	1,600	2,587.00	4,139,200
セントラル硝子	1,100	2,268.00	2,494,800
東亜合成	3,500	1,126.00	3,941,000
大阪ソーダ	600	2,661.00	1,596,600
関東電化工業	1,400	731.00	1,023,400
デンカ	2,200	3,205.00	7,051,000
信越化学工業	9,800	14,105.00	138,229,000
日本カーバイド工業	100	1,258.00	125,800
堺化学工業	300	2,027.00	608,100
第一稀元素化学工業	600	733.00	439,800
エア・ウォーター	5,400	1,511.00	8,159,400
日本酸素ホールディングス	5,500	1,679.00	9,234,500
日本化学工業	100	2,273.00	227,300
東邦アセチレン	100	1,280.00	128,000
日本パーカライズング	2,900	1,080.00	3,132,000
高压ガス工業	1,100	841.00	925,100
チタン工業	100	1,774.00	177,400
四国化成工業	800	1,167.00	933,600
戸田工業	100	2,363.00	236,300
ステラ ケミファ	200	3,035.00	607,000
保土谷化学工業	200	4,810.00	962,000
日本触媒	900	6,120.00	5,508,000
大日精化工業	600	2,270.00	1,362,000
カネカ	1,500	3,220.00	4,830,000
三菱瓦斯化学	5,400	2,018.00	10,897,200
三井化学	5,200	2,639.00	13,722,800
J S R	5,400	2,593.00	14,002,200
東京応化工業	900	5,620.00	5,058,000
大阪有機化学工業	600	2,357.00	1,414,200
三菱ケミカルホールディングス	38,200	624.00	23,836,800
K H ネオケム	900	2,559.00	2,303,100
ダイセル	7,600	801.00	6,087,600
住友ベークライト	900	2,938.00	2,644,200
積水化学工業	12,100	1,764.00	21,344,400
日本ゼオン	5,100	1,197.00	6,104,700
アイカ工業	1,700	3,720.00	6,324,000
宇部興産	3,000	1,847.00	5,541,000
積水樹脂	1,000	2,181.00	2,181,000
タキロンシーアイ	1,300	709.00	921,700
旭有機材	200	1,360.00	272,000

ニチバン	200	1,661.00	332,200
リケンテクノス	1,600	424.00	678,400
大倉工業	200	1,699.00	339,800
積水化成成品工業	900	610.00	549,000
群栄化学工業	100	2,697.00	269,700
タイガースポリマー	200	428.00	85,600
ミライアル	100	1,203.00	120,300
ダイキアクシス	100	922.00	92,200
ダイキョーニシカワ	1,300	607.00	789,100
竹本容器	100	995.00	99,500
森六ホールディングス	200	1,812.00	362,400
日本化薬	3,500	936.00	3,276,000
カーリットホールディングス	800	545.00	436,000
日本精化	500	1,594.00	797,000
扶桑化学工業	700	3,700.00	2,590,000
トリケミカル研究所	100	12,330.00	1,233,000
A D E K A	2,600	1,504.00	3,910,400
日油	2,200	4,130.00	9,086,000
新日本理化	1,500	166.00	249,000
ハリマ化成グループ	500	1,142.00	571,000
花王	13,900	7,778.00	108,114,200
第一工業製薬	200	4,045.00	809,000
石原ケミカル	100	2,257.00	225,700
日華化学	100	993.00	99,300
ニイタカ	100	3,190.00	319,000
三洋化成工業	400	5,070.00	2,028,000
有機合成薬品工業	700	350.00	245,000
大日本塗料	600	945.00	567,000
日本ペイントホールディングス	4,700	10,670.00	50,149,000
関西ペイント	6,400	2,614.00	16,729,600
神東塗料	900	186.00	167,400
中国塗料	1,600	1,000.00	1,600,000
日本特殊塗料	500	999.00	499,500
藤倉化成	900	524.00	471,600
太陽ホールディングス	500	5,470.00	2,735,000
D I C	2,400	2,671.00	6,410,400
サカタインクス	1,300	1,099.00	1,428,700
東洋インキS Cホールディングス	1,100	2,031.00	2,234,100
T & K T O K A	500	865.00	432,500
富士フイルムホールディングス	11,200	5,223.00	58,497,600
資生堂	11,500	6,564.00	75,486,000
ライオン	7,500	2,141.00	16,057,500

高砂香料工業	300	2,240.00	672,000
マンダム	1,400	1,813.00	2,538,200
ミルボン	800	5,650.00	4,520,000
ファンケル	2,400	3,605.00	8,652,000
コーセー	1,100	13,970.00	15,367,000
コタ	200	1,381.00	276,200
シーボン	100	1,995.00	199,500
ポーラ・オルビスホールディングス	2,500	2,030.00	5,075,000
ノエビアホールディングス	600	4,740.00	2,844,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,008.00	100,800
エステー	300	2,173.00	651,900
アグロ カネショウ	200	1,700.00	340,000
コニシ	900	1,598.00	1,438,200
長谷川香料	900	2,145.00	1,930,500
星光P M C	200	678.00	135,600
小林製薬	1,600	10,420.00	16,672,000
荒川化学工業	600	1,271.00	762,600
メック	300	1,930.00	579,000
日本高純度化学	100	2,682.00	268,200
タカラバイオ	1,500	2,901.00	4,351,500
J C U	700	3,395.00	2,376,500
新田ゼラチン	300	718.00	215,400
O A T アグリオ	100	1,316.00	131,600
デクセリアルズ	1,500	1,151.00	1,726,500
アース製薬	400	7,190.00	2,876,000
北興化学工業	600	710.00	426,000
大成ラミック	200	2,842.00	568,400
クミアイ化学工業	2,400	1,080.00	2,592,000
日本農薬	1,100	513.00	564,300
アキレス	300	1,743.00	522,900
有沢製作所	900	971.00	873,900
日東電工	4,000	7,090.00	28,360,000
レック	600	1,635.00	981,000
三光合成	900	283.00	254,700
きもと	1,500	167.00	250,500
藤森工業	600	4,260.00	2,556,000
前澤化成工業	300	981.00	294,300
未来工業	200	2,029.00	405,800
ウェーブロックホールディングス	100	747.00	74,700
J S P	200	1,669.00	333,800
エフピコ	1,400	4,255.00	5,957,000
天馬	300	1,823.00	546,900

信越ポリマー	1,200	920.00	1,104,000
東リ	1,800	274.00	493,200
ニフコ	2,200	3,025.00	6,655,000
バルカー	500	1,954.00	977,000
ユニ・チャーム	12,300	4,687.00	57,650,100
ショーエイコーポレーション	100	1,248.00	124,800
協和キリン	5,800	2,805.00	16,269,000
武田薬品工業	48,300	3,655.00	176,536,500
アステラス製薬	50,400	1,514.00	76,305,600
大日本住友製薬	4,300	1,336.00	5,744,800
塩野義製薬	7,300	5,480.00	40,004,000
わかもと製薬	900	268.00	241,200
あすか製薬	700	1,471.00	1,029,700
日本新薬	1,500	8,230.00	12,345,000
ピオフェルミン製薬	100	2,476.00	247,600
中外製薬	18,100	4,672.00	84,563,200
科研製薬	900	4,695.00	4,225,500
エーザイ	7,000	9,614.00	67,298,000
ロート製薬	3,100	3,480.00	10,788,000
小野薬品工業	13,300	3,273.00	43,530,900
久光製薬	1,600	5,360.00	8,576,000
持田製薬	800	4,155.00	3,324,000
参天製薬	10,800	2,112.00	22,809,600
扶桑薬品工業	200	2,698.00	539,600
日本ケミファ	100	2,635.00	263,500
ツムラ	1,800	3,335.00	6,003,000
日医工	1,600	1,166.00	1,865,600
キッセイ薬品工業	1,000	2,279.00	2,279,000
生化学工業	1,000	1,059.00	1,059,000
栄研化学	1,000	2,337.00	2,337,000
日水製薬	200	1,128.00	225,600
鳥居薬品	300	3,025.00	907,500
JCRファーマ	2,000	2,977.00	5,954,000
東和薬品	800	2,030.00	1,624,000
富士製薬工業	300	1,245.00	373,500
沢井製薬	1,100	5,130.00	5,643,000
ゼリア新薬工業	1,000	2,004.00	2,004,000
第一三共	49,800	2,990.00	148,902,000
キョーリン製薬ホールディングス	1,400	2,133.00	2,986,200
大幸薬品	800	2,125.00	1,700,000
ダイト	300	3,555.00	1,066,500
大塚ホールディングス	12,100	4,319.00	52,259,900

大正製薬ホールディングス	1,300	6,910.00	8,983,000	
ペプチドリーム	3,000	4,865.00	14,595,000	
日本コークス工業	5,300	64.00	339,200	
ニチレキ	700	1,712.00	1,198,400	
ユシロ化学工業	200	1,390.00	278,000	
ビーピー・カストロール	100	1,243.00	124,300	
富士石油	1,600	190.00	304,000	
MORESCO	100	1,039.00	103,900	
出光興産	6,500	2,281.00	14,826,500	
Eneosホールディングス	87,500	384.90	33,678,750	
コスモエネルギーホールディングス	1,700	1,607.00	2,731,900	
横浜ゴム	3,300	1,533.00	5,058,900	
TOYO TIRE	3,300	1,767.00	5,831,100	
ブリヂストン	15,400	3,465.00	53,361,000	
住友ゴム工業	5,100	1,002.00	5,110,200	
藤倉コンポジット	800	352.00	281,600	
オカモト	500	4,220.00	2,110,000	
フコク	200	686.00	137,200	
ニッタ	700	2,378.00	1,664,600	
住友理工	1,200	562.00	674,400	
三ツ星ベルト	800	1,719.00	1,375,200	
バンドー化学	1,100	601.00	661,100	
日東紡績	800	4,430.00	3,544,000	
AGC	5,400	3,160.00	17,064,000	
日本板硝子	2,600	399.00	1,037,400	
石塚硝子	100	1,932.00	193,200	
日本山村硝子	200	891.00	178,200	
日本電気硝子	2,300	1,994.00	4,586,200	
オハラ	200	1,308.00	261,600	
住友大阪セメント	1,000	3,480.00	3,480,000	
太平洋セメント	3,800	2,784.00	10,579,200	
日本ヒューム	600	795.00	477,000	
日本コンクリート工業	1,700	321.00	545,700	
三谷セキサン	200	5,730.00	1,146,000	
アジアパイルホールディングス	1,000	487.00	487,000	
東海カーボン	5,800	1,219.00	7,070,200	
日本カーボン	200	3,835.00	767,000	
東洋炭素	300	1,805.00	541,500	
ノリタケカンパニーリミテド	200	3,250.00	650,000	
TOTO	4,100	4,900.00	20,090,000	
日本碍子	7,100	1,517.00	10,770,700	
日本特殊陶業	4,600	1,932.00	8,887,200	

ダントーホールディングス	900	770.00	693,000
MARUWA	200	9,670.00	1,934,000
品川リフラクトリーズ	100	2,441.00	244,100
黒崎播磨	100	3,035.00	303,500
ヨータイ	700	824.00	576,800
イソライト工業	200	503.00	100,600
東京窯業	900	340.00	306,000
ニッカトー	200	723.00	144,600
フジインコーポレーテッド	600	3,740.00	2,244,000
クニミネ工業	200	1,028.00	205,600
エーアンドエーマテリアル	100	1,087.00	108,700
ニチアス	1,600	2,467.00	3,947,200
ニチハ	800	3,200.00	2,560,000
日本製鉄	25,800	1,109.00	28,612,200
神戸製鋼所	10,600	431.00	4,568,600
中山製鋼所	1,000	359.00	359,000
合同製鐵	200	2,029.00	405,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	15,600	789.00	12,308,400
東京製鐵	2,700	737.00	1,989,900
共英製鋼	700	1,351.00	945,700
大和工業	1,300	2,608.00	3,390,400
東京鐵鋼	200	1,790.00	358,000
大阪製鐵	200	1,109.00	221,800
淀川製鋼所	800	1,947.00	1,557,600
丸一鋼管	1,800	2,659.00	4,786,200
モリ工業	100	2,581.00	258,100
大同特殊鋼	900	3,460.00	3,114,000
日本高周波鋼業	100	363.00	36,300
日本冶金工業	600	1,607.00	964,200
山陽特殊製鋼	500	1,044.00	522,000
愛知製鋼	200	2,673.00	534,600
日立金属	6,300	1,631.00	10,275,300
日本金属	100	650.00	65,000
大平洋金属	300	1,650.00	495,000
新日本電工	3,700	233.00	862,100
栗本鐵工所	200	1,909.00	381,800
虹技	100	1,356.00	135,600
三菱製鋼	500	577.00	288,500
日亜鋼業	1,000	300.00	300,000
日本精線	100	3,390.00	339,000
エンビプロ・ホールディングス	200	563.00	112,600
シンニッタン	1,300	224.00	291,200

新家工業	100	1,145.00	114,500
大紀アルミニウム工業所	1,100	564.00	620,400
日本軽金属ホールディングス	1,460	1,698.00	2,479,080
三井金属鉱業	1,600	2,554.00	4,086,400
東邦亜鉛	200	2,021.00	404,200
三菱マテリアル	3,900	2,044.00	7,971,600
住友金属鉱山	7,300	3,328.00	24,294,400
D O W Aホールディングス	1,500	3,145.00	4,717,500
古河機械金属	1,000	1,188.00	1,188,000
エス・サイエンス	1,800	47.00	84,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	938.00	562,800
東邦チタニウム	1,200	695.00	834,000
U A C J	900	1,708.00	1,537,200
C Kサンエツ	100	3,745.00	374,500
古河電気工業	1,700	2,558.00	4,348,600
住友電気工業	21,400	1,223.00	26,172,200
フジクラ	7,000	301.00	2,107,000
昭和電線ホールディングス	700	1,217.00	851,900
東京特殊電線	100	2,450.00	245,000
タツタ電線	1,200	613.00	735,600
カナレ電気	100	1,772.00	177,200
平河ヒューテック	200	1,058.00	211,600
リョービ	700	1,197.00	837,900
アーレスティ	900	342.00	307,800
アサヒホールディングス	1,000	3,515.00	3,515,000
稲葉製作所	300	1,368.00	410,400
宮地エンジニアリンググループ	100	1,701.00	170,100
トーカロ	1,600	1,142.00	1,827,200
アルファC o	100	1,020.00	102,000
S U M C O	7,400	1,542.00	11,410,800
川田テクノロジーズ	100	4,710.00	471,000
R S Technologies	200	3,530.00	706,000
信和	200	709.00	141,800
東洋製罐グループホールディングス	3,800	1,036.00	3,936,800
ホッカンホールディングス	300	1,441.00	432,300
コロナ	200	1,037.00	207,400
横河ブリッジホールディングス	1,000	1,985.00	1,985,000
駒井ハルテック	100	1,574.00	157,400
高田機工	100	2,524.00	252,400
三和ホールディングス	5,500	1,169.00	6,429,500
文化シャッター	1,600	848.00	1,356,800
三協立山	700	980.00	686,000

アルインコ	500	961.00	480,500
東洋シャッター	100	772.00	77,200
L I X I Lグループ	8,400	2,201.00	18,488,400
日本フィルコン	300	595.00	178,500
ノーリツ	1,100	1,527.00	1,679,700
長府製作所	600	2,160.00	1,296,000
リンナイ	1,100	10,270.00	11,297,000
ダイニチ工業	200	755.00	151,000
日東精工	800	485.00	388,000
三洋工業	100	1,998.00	199,800
岡部	1,200	822.00	986,400
ジーテクト	700	1,260.00	882,000
東プレ	1,000	1,183.00	1,183,000
高周波熱錬	1,200	531.00	637,200
東京製網	500	552.00	276,000
サンコール	300	461.00	138,300
モリテック スチール	700	315.00	220,500
パイオラックス	800	1,590.00	1,272,000
エイチワン	600	606.00	363,600
日本発條	6,300	712.00	4,485,600
中央発條	100	2,940.00	294,000
アドバネクス	100	1,408.00	140,800
立川ブラインド工業	200	1,309.00	261,800
三益半導体工業	500	2,346.00	1,173,000
日本ドライケミカル	100	1,488.00	148,800
日本製鋼所	1,700	2,041.00	3,469,700
三浦工業	2,400	5,200.00	12,480,000
タクマ	1,800	1,698.00	3,056,400
ツガミ	1,300	1,275.00	1,657,500
オークマ	700	5,190.00	3,633,000
芝浦機械	700	2,195.00	1,536,500
アマダ	7,100	1,020.00	7,242,000
アイダエンジニアリング	1,500	760.00	1,140,000
滝澤鉄工所	100	1,026.00	102,600
F U J I	2,400	2,142.00	5,140,800
牧野フライス製作所	700	3,800.00	2,660,000
オーエスジー	2,700	1,806.00	4,876,200
ダイジェット工業	100	1,462.00	146,200
旭ダイヤモンド工業	1,500	505.00	757,500
D M G 森精機	3,500	1,508.00	5,278,000
ソディック	1,400	754.00	1,055,600
ディスコ	800	27,900.00	22,320,000

日東工器	300	2,090.00	627,000
日進工具	200	2,235.00	447,000
パンチ工業	800	405.00	324,000
富士ダイス	200	654.00	130,800
豊和工業	200	842.00	168,400
OKK	200	389.00	77,800
石川製作所	100	1,760.00	176,000
東洋機械金属	700	424.00	296,800
津田駒工業	100	893.00	89,300
エンシュウ	100	991.00	99,100
島精機製作所	900	1,710.00	1,539,000
オプトラン	700	2,221.00	1,554,700
NCホールディングス	100	670.00	67,000
イワキポンプ	300	900.00	270,000
フリュー	600	1,287.00	772,200
ヤマシンフィルタ	1,300	1,048.00	1,362,400
日阪製作所	900	903.00	812,700
やまびこ	1,000	1,291.00	1,291,000
平田機工	200	6,530.00	1,306,000
ペガサスミシン製造	800	301.00	240,800
マルマエ	300	1,041.00	312,300
タツモ	200	1,522.00	304,400
ナプテスコ	3,300	4,070.00	13,431,000
三井海洋開発	700	1,643.00	1,150,100
レオン自動機	600	1,127.00	676,200
S M C	1,800	58,310.00	104,958,000
ホソカワミクロン	100	5,230.00	523,000
ユニオンツール	200	3,155.00	631,000
オイレス工業	700	1,505.00	1,053,500
日精エー・エス・ビー機械	200	4,260.00	852,000
サトーホールディングス	800	2,272.00	1,817,600
技研製作所	600	4,085.00	2,451,000
日本エアテック	300	1,490.00	447,000
カワタ	100	928.00	92,800
日精樹脂工業	600	908.00	544,800
オカダアイヨン	100	1,113.00	111,300
ワイエイシイホールディングス	200	683.00	136,600
小松製作所	26,200	2,456.50	64,360,300
住友重機械工業	3,300	2,500.00	8,250,000
日立建機	2,300	3,785.00	8,705,500
日工	1,000	709.00	709,000
巴工業	200	2,178.00	435,600

井関農機	600	1,411.00	846,600
TOWA	700	1,209.00	846,300
丸山製作所	100	1,335.00	133,500
北川鉄工所	200	1,427.00	285,400
ローツェ	200	5,290.00	1,058,000
タカキタ	100	729.00	72,900
クボタ	30,800	1,956.50	60,260,200
荏原実業	100	3,260.00	326,000
三菱化工機	200	1,868.00	373,600
月島機械	1,000	1,294.00	1,294,000
帝国電機製作所	600	1,104.00	662,400
東京機械製作所	200	286.00	57,200
新東工業	1,400	725.00	1,015,000
澁谷工業	600	3,620.00	2,172,000
アイチ コーポレーション	1,100	915.00	1,006,500
小森コーポレーション	1,400	754.00	1,055,600
鶴見製作所	600	1,884.00	1,130,400
住友精密工業	100	2,169.00	216,900
日本ギア工業	200	305.00	61,000
酒井重工業	100	2,439.00	243,900
荏原製作所	2,400	2,987.00	7,168,800
石井鐵工所	100	2,724.00	272,400
西島製作所	600	804.00	482,400
北越工業	600	1,081.00	648,600
ダイキン工業	7,400	18,665.00	138,121,000
オルガノ	200	5,610.00	1,122,000
トーヨーカネツ	200	2,299.00	459,800
栗田工業	3,100	3,375.00	10,462,500
椿本チエイン	800	2,475.00	1,980,000
大同工業	200	622.00	124,400
木村化工機	800	423.00	338,400
アネスト岩田	900	873.00	785,700
ダイフク	3,000	10,990.00	32,970,000
サムコ	100	2,671.00	267,100
加藤製作所	200	1,111.00	222,200
油研工業	100	1,515.00	151,500
タダノ	2,600	933.00	2,425,800
フジテック	2,200	2,417.00	5,317,400
C K D	1,600	1,776.00	2,841,600
キトー	500	1,227.00	613,500
平和	1,600	1,764.00	2,822,400
理想科学工業	600	1,390.00	834,000

SANKYO	1,400	2,729.00	3,820,600
日本金銭機械	800	571.00	456,800
マースグループホールディングス	300	1,664.00	499,200
フクシマガリレイ	500	3,815.00	1,907,500
オーイズミ	200	415.00	83,000
ダイコク電機	200	1,005.00	201,000
竹内製作所	900	2,383.00	2,144,700
アマノ	1,500	2,585.00	3,877,500
JUKI	1,000	461.00	461,000
蛇の目マシン工業	800	583.00	466,400
マックス	900	1,545.00	1,390,500
グローリー	1,500	2,365.00	3,547,500
新晃工業	600	1,488.00	892,800
大和冷機工業	1,000	955.00	955,000
セガサミーホールディングス	5,700	1,274.00	7,261,800
日本ピストンリング	200	1,010.00	202,000
リケン	200	2,721.00	544,200
T P R	800	1,345.00	1,076,000
ツバキ・ナカシマ	1,200	858.00	1,029,600
ホシザキ	1,800	8,980.00	16,164,000
大豊工業	500	585.00	292,500
日本精工	10,800	855.00	9,234,000
NTN	12,900	210.00	2,709,000
ジェイテクト	5,600	895.00	5,012,000
不二越	600	3,825.00	2,295,000
日本トムソン	1,800	378.00	680,400
THK	3,500	2,706.00	9,471,000
ユーシン精機	500	717.00	358,500
前澤給装工業	200	2,250.00	450,000
イーグル工業	700	815.00	570,500
前澤工業	300	500.00	150,000
日本ピラー工業	700	1,575.00	1,102,500
キッツ	2,300	591.00	1,359,300
マキタ	7,500	5,070.00	38,025,000
日立造船	4,500	435.00	1,957,500
三菱重工業	9,700	2,343.50	22,731,950
I H I	4,100	1,444.00	5,920,400
スター精密	900	1,437.00	1,293,300
日清紡ホールディングス	3,600	724.00	2,606,400
イビデン	3,500	3,720.00	13,020,000
コニカミノルタ	12,800	296.00	3,788,800
ブラザー工業	7,200	1,723.00	12,405,600

ミネベアミツミ	10,800	2,021.00	21,826,800
日立製作所	27,900	3,677.00	102,588,300
三菱電機	58,100	1,444.00	83,896,400
富士電機	3,500	3,320.00	11,620,000
東洋電機製造	100	1,141.00	114,100
安川電機	6,300	4,245.00	26,743,500
シンフォニアテクノロジー	700	1,180.00	826,000
明電舎	1,000	1,617.00	1,617,000
オリジン	100	1,430.00	143,000
山洋電気	400	4,905.00	1,962,000
デンヨー	600	2,430.00	1,458,000
東芝テック	800	4,450.00	3,560,000
芝浦メカトロニクス	100	3,165.00	316,500
マブチモーター	1,600	4,190.00	6,704,000
日本電産	14,000	10,180.00	142,520,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	361.00	72,200
トレックス・セミコンダクター	200	1,299.00	259,800
東光高岳	200	1,068.00	213,600
ダブル・スコープ	1,100	788.00	866,800
宮越ホールディングス	100	729.00	72,900
ダイヘン	700	4,135.00	2,894,500
ヤーマン	1,100	1,445.00	1,589,500
JVCケンウッド	4,600	149.00	685,400
ミマキエンジニアリング	800	460.00	368,000
I - P E X	200	2,128.00	425,600
日新電機	1,400	1,120.00	1,568,000
大崎電気工業	1,200	632.00	758,400
オムロン	5,200	8,130.00	42,276,000
日東工業	800	2,097.00	1,677,600
I D E C	800	1,897.00	1,517,600
正興電機製作所	100	1,139.00	113,900
不二電機工業	100	1,324.00	132,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,900	1,884.00	3,579,600
メルコホールディングス	200	2,448.00	489,600
テクノメディカ	100	1,767.00	176,700
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	100	687.00	68,700
日本電気	7,100	6,010.00	42,671,000
富士通	5,600	14,215.00	79,604,000
沖電気工業	2,400	1,156.00	2,774,400
岩崎通信機	200	851.00	170,200
電気興業	200	2,630.00	526,000
サンケン電気	700	2,848.00	1,993,600

ナカヨ	100	1,502.00	150,200
アイホン	200	1,513.00	302,600
ルネサスエレクトロニクス	25,000	828.00	20,700,000
セイコーエプソン	7,300	1,195.00	8,723,500
ワコム	3,900	674.00	2,628,600
アルバック	1,000	4,060.00	4,060,000
アクセル	200	920.00	184,000
E I Z O	500	3,820.00	1,910,000
ジャパンディスプレイ	16,200	52.00	842,400
日本信号	1,500	1,014.00	1,521,000
京三製作所	1,400	464.00	649,600
能美防災	800	2,423.00	1,938,400
ホーチキ	500	1,258.00	629,000
星和電機	200	633.00	126,600
エレコム	700	4,890.00	3,423,000
パナソニック	66,500	912.10	60,654,650
シャープ	6,700	1,325.00	8,877,500
アンリツ	3,800	2,495.00	9,481,000
富士通ゼネラル	1,600	2,947.00	4,715,200
ソニー	36,400	7,832.00	285,084,800
T D K	2,800	12,050.00	33,740,000
帝国通信工業	200	1,184.00	236,800
タムラ製作所	1,800	547.00	984,600
アルプスアルパイン	5,100	1,537.00	7,838,700
池上通信機	100	860.00	86,000
日本電波工業	800	373.00	298,400
鈴木	200	691.00	138,200
日本トリム	100	3,710.00	371,000
ローランド ディー . ジー .	200	1,344.00	268,800
フォスター電機	600	1,257.00	754,200
S M K	100	2,722.00	272,200
ヨコオ	300	2,681.00	804,300
ティアック	200	128.00	25,600
ホシデン	1,600	947.00	1,515,200
ヒロセ電機	900	14,720.00	13,248,000
日本航空電子工業	1,400	1,573.00	2,202,200
T O A	600	806.00	483,600
マクセルホールディングス	1,300	1,072.00	1,393,600
古野電気	700	1,102.00	771,400
ユニデンホールディングス	100	1,918.00	191,800
スミダコーポレーション	500	789.00	394,500
アイコム	200	2,729.00	545,800

リオン	200	2,457.00	491,400
本多通信工業	800	530.00	424,000
船井電機	800	462.00	369,600
横河電機	5,400	1,710.00	9,234,000
新電元工業	200	2,033.00	406,600
アズビル	3,800	4,265.00	16,207,000
東亜ディーケーケー	200	864.00	172,800
日本光電工業	2,400	3,500.00	8,400,000
チノー	200	1,370.00	274,000
共和電業	800	439.00	351,200
日本電子材料	200	1,969.00	393,800
堀場製作所	1,100	5,550.00	6,105,000
アドバンテスト	4,300	5,490.00	23,607,000
小野測器	200	545.00	109,000
エスペック	600	1,818.00	1,090,800
キーエンス	5,300	49,530.00	262,509,000
日置電機	200	3,805.00	761,000
シスメックス	4,100	10,360.00	42,476,000
日本マイクロニクス	900	1,129.00	1,016,100
メガチップス	600	2,942.00	1,765,200
O B A R A G R O U P	300	3,625.00	1,087,500
澤藤電機	100	1,862.00	186,200
原田工業	200	918.00	183,600
コーセル	800	1,077.00	861,600
イリソ電子工業	600	4,230.00	2,538,000
オブテックスグループ	900	1,649.00	1,484,100
千代田インテグレ	200	1,661.00	332,200
アイ・オー・データ機器	100	1,041.00	104,100
レーザーテック	2,500	9,450.00	23,625,000
スタンレー電気	4,100	3,125.00	12,812,500
岩崎電気	200	1,423.00	284,600
ウシオ電機	3,200	1,361.00	4,355,200
岡谷電機産業	700	376.00	263,200
ヘリオス テクノ ホールディング	800	343.00	274,400
エノモト	100	1,117.00	111,700
日本セラミック	600	2,680.00	1,608,000
遠藤照明	200	667.00	133,400
古河電池	500	1,113.00	556,500
双信電機	200	463.00	92,600
山一電機	500	1,342.00	671,000
図研	300	2,760.00	828,000
日本電子	1,100	3,730.00	4,103,000

カシオ計算機	5,100	1,665.00	8,491,500
ファナック	5,500	20,660.00	113,630,000
日本シイエムケイ	1,400	473.00	662,200
エンプラス	200	2,285.00	457,000
大真空	200	2,141.00	428,200
ローム	2,400	8,520.00	20,448,000
浜松ホトニクス	4,100	5,380.00	22,058,000
三井ハイテック	700	2,014.00	1,409,800
新光電気工業	1,900	1,978.00	3,758,200
京セラ	8,200	6,050.00	49,610,000
太陽誘電	2,600	3,505.00	9,113,000
村田製作所	17,100	6,921.00	118,349,100
双葉電子工業	900	917.00	825,300
北陸電気工業	200	969.00	193,800
ニチコン	1,900	814.00	1,546,600
日本ケミコン	500	1,384.00	692,000
K O A	800	1,148.00	918,400
市光工業	1,000	483.00	483,000
小糸製作所	3,400	5,330.00	18,122,000
ミツバ	1,200	394.00	472,800
S C R E E Nホールディングス	900	6,370.00	5,733,000
キャノン電子	600	1,459.00	875,400
キャノン	29,000	1,731.00	50,199,000
リコー	14,800	711.00	10,522,800
象印マホービン	1,700	1,861.00	3,163,700
M U T O Hホールディングス	100	1,544.00	154,400
東京エレクトロン	3,700	28,580.00	105,746,000
トヨタ紡織	1,700	1,564.00	2,658,800
芦森工業	100	888.00	88,800
ユニプレス	1,100	886.00	974,600
豊田自動織機	4,700	6,970.00	32,759,000
モリタホールディングス	1,000	2,029.00	2,029,000
三櫻工業	700	584.00	408,800
デンソー	12,800	4,886.00	62,540,800
東海理化電機製作所	1,600	1,628.00	2,604,800
三井E & Sホールディングス	2,100	397.00	833,700
川崎重工業	4,600	1,430.00	6,578,000
名村造船所	2,300	163.00	374,900
サノヤスホールディングス	1,300	167.00	217,100
日本車輛製造	200	2,771.00	554,200
三菱ロジスネクスト	800	1,010.00	808,000
近畿車輛	100	1,359.00	135,900

日産自動車	68,600	385.00	26,411,000
いすゞ自動車	17,000	996.20	16,935,400
トヨタ自動車	64,800	7,034.00	455,803,200
日野自動車	7,300	788.00	5,752,400
三菱自動車工業	21,600	236.00	5,097,600
エフテック	300	521.00	156,300
レシップホールディングス	100	591.00	59,100
G M B	100	656.00	65,600
ファルテック	100	604.00	60,400
武蔵精密工業	1,400	1,199.00	1,678,600
日産車体	1,000	960.00	960,000
新明和工業	1,600	885.00	1,416,000
極東開発工業	1,000	1,385.00	1,385,000
日信工業	1,100	2,250.00	2,475,000
トピー工業	600	1,122.00	673,200
ティラド	200	1,319.00	263,800
曙ブレーキ工業	3,300	156.00	514,800
タチエス	900	1,044.00	939,600
N O K	3,200	1,149.00	3,676,800
フタバ産業	1,600	564.00	902,400
K Y B	700	2,314.00	1,619,800
大同メタル工業	1,200	540.00	648,000
プレス工業	2,900	302.00	875,800
ミクニ	900	280.00	252,000
太平洋工業	1,100	1,015.00	1,116,500
ケーヒン	1,400	2,595.00	3,633,000
河西工業	1,000	386.00	386,000
アイシン精機	4,800	3,495.00	16,776,000
マツダ	17,200	620.00	10,664,000
今仙電機製作所	600	667.00	400,200
本田技研工業	45,800	2,601.00	119,125,800
スズキ	11,500	4,795.00	55,142,500
S U B A R U	18,000	2,121.50	38,187,000
安永	200	1,261.00	252,200
ヤマハ発動機	8,200	1,621.00	13,292,200
ショーワ	1,400	2,298.00	3,217,200
T B K	900	473.00	425,700
エクセディ	800	1,379.00	1,103,200
豊田合成	1,800	2,554.00	4,597,200
愛三工業	1,100	510.00	561,000
盟和産業	100	930.00	93,000
日本プラスト	700	436.00	305,200

ヨロズ	600	1,052.00	631,200
エフ・シー・シー	900	2,046.00	1,841,400
シマノ	2,200	21,530.00	47,366,000
テイ・エス テック	1,500	3,010.00	4,515,000
ジャムコ	200	689.00	137,800
テルモ	16,400	4,179.00	68,535,600
クリエートメディック	100	1,050.00	105,000
日機装	1,800	1,089.00	1,960,200
日本エム・ディ・エム	300	2,080.00	624,000
島津製作所	7,100	3,185.00	22,613,500
JMS	600	922.00	553,200
クボテック	100	330.00	33,000
長野計器	500	865.00	432,500
ブイ・テクノロジー	400	4,725.00	1,890,000
東京計器	300	927.00	278,100
愛知時計電機	100	4,435.00	443,500
インターアクション	200	1,935.00	387,000
オーバル	1,000	238.00	238,000
東京精密	1,000	3,585.00	3,585,000
マニー	2,300	2,822.00	6,490,600
ニコン	8,900	709.00	6,310,100
トプコン	3,000	1,041.00	3,123,000
オリンパス	32,100	2,230.50	71,599,050
理研計器	600	2,847.00	1,708,200
タムロン	500	1,600.00	800,000
HOYA	11,500	12,160.00	139,840,000
シード	200	700.00	140,000
ノーリツ鋼機	300	1,705.00	511,500
エー・アンド・デイ	600	666.00	399,600
朝日インテック	6,600	3,490.00	23,034,000
シチズン時計	6,800	288.00	1,958,400
リズム	100	656.00	65,600
大研医器	300	539.00	161,700
メニコン	800	7,300.00	5,840,000
松風	200	1,386.00	277,200
セイコーホールディングス	800	1,418.00	1,134,400
ニプロ	4,000	1,202.00	4,808,000
中本パックス	100	1,615.00	161,500
スノーピーク	200	1,831.00	366,200
パラマウントベッドホールディングス	700	4,290.00	3,003,000
トランザクション	200	1,175.00	235,000
粧美堂	100	380.00	38,000

ニホンフラッシュ	600	1,391.00	834,600
前田工織	700	2,760.00	1,932,000
永大産業	900	319.00	287,100
アートネイチャー	600	640.00	384,000
バンダイナムコホールディングス	6,000	7,829.00	46,974,000
アイフィスジャパン	100	772.00	77,200
共立印刷	1,500	136.00	204,000
SHOEI	600	3,235.00	1,941,000
フランスベッドホールディングス	1,000	866.00	866,000
パイロットコーポレーション	900	3,050.00	2,745,000
萩原工業	300	1,623.00	486,900
トッパン・フォームズ	1,300	1,006.00	1,307,800
フジシールインターナショナル	1,400	2,113.00	2,958,200
タカラトミー	2,500	972.00	2,430,000
廣済堂	300	677.00	203,100
エステールホールディングス	100	630.00	63,000
タカノ	300	610.00	183,000
プロネクサス	600	1,189.00	713,400
ホクシン	300	120.00	36,000
ウッドワン	200	1,308.00	261,600
大建工業	300	1,865.00	559,500
凸版印刷	8,100	1,459.00	11,817,900
大日本印刷	7,500	2,106.00	15,795,000
共同印刷	200	2,604.00	520,800
NISSHA	1,100	1,350.00	1,485,000
光村印刷	100	1,755.00	175,500
TAKARA & COMPANY	200	2,132.00	426,400
アシックス	5,000	1,502.00	7,510,000
ツツミ	200	2,262.00	452,400
小松ウオール工業	200	1,802.00	360,400
ヤマハ	3,400	5,100.00	17,340,000
河合楽器製作所	200	2,649.00	529,800
クリナップ	600	511.00	306,600
ピジョン	3,800	5,020.00	19,076,000
オリバー	100	2,859.00	285,900
兼松サステック	100	1,597.00	159,700
キングジム	600	894.00	536,400
リンテック	1,400	2,467.00	3,453,800
イトーキ	1,300	363.00	471,900
任天堂	3,600	58,330.00	209,988,000
三菱鉛筆	900	1,315.00	1,183,500
タカラスタンダード	1,100	1,429.00	1,571,900

コクヨ	2,700	1,339.00	3,615,300
ナカバヤシ	800	648.00	518,400
グローブライド	200	3,115.00	623,000
オカムラ	1,900	750.00	1,425,000
美津濃	600	1,890.00	1,134,000
東京電力ホールディングス	46,600	293.00	13,653,800
中部電力	17,700	1,296.00	22,939,200
関西電力	21,900	1,022.00	22,381,800
中国電力	8,400	1,331.00	11,180,400
北陸電力	5,400	763.00	4,120,200
東北電力	14,600	1,001.00	14,614,600
四国電力	5,200	808.00	4,201,600
九州電力	12,100	971.00	11,749,100
北海道電力	5,500	461.00	2,535,500
沖縄電力	1,000	1,632.00	1,632,000
電源開発	4,700	1,578.00	7,416,600
エフオン	200	693.00	138,600
イーレックス	800	1,166.00	932,800
レノバ	900	1,250.00	1,125,000
東京瓦斯	11,200	2,394.50	26,818,400
大阪瓦斯	11,400	2,036.00	23,210,400
東邦瓦斯	2,900	5,210.00	15,109,000
北海道瓦斯	300	1,573.00	471,900
広島ガス	1,300	388.00	504,400
西部瓦斯	700	2,675.00	1,872,500
静岡ガス	1,600	933.00	1,492,800
メタウォーター	400	2,264.00	905,600
SBSホールディングス	600	2,305.00	1,383,000
東武鉄道	6,000	3,265.00	19,590,000
相鉄ホールディングス	1,800	2,836.00	5,104,800
東急	14,700	1,374.00	20,197,800
京浜急行電鉄	7,500	1,658.00	12,435,000
小田急電鉄	8,800	2,686.00	23,636,800
京王電鉄	3,100	6,570.00	20,367,000
京成電鉄	4,100	3,005.00	12,320,500
富士急行	800	4,180.00	3,344,000
新京成電鉄	100	2,331.00	233,100
東日本旅客鉄道	10,300	6,450.00	66,435,000
西日本旅客鉄道	5,100	5,193.00	26,484,300
東海旅客鉄道	4,800	15,240.00	73,152,000
西武ホールディングス	7,600	1,175.00	8,930,000
鴻池運輸	900	1,185.00	1,066,500

西日本鉄道	1,600	3,055.00	4,888,000
ハマキョウレックス	500	3,200.00	1,600,000
サカイ引越センター	400	5,130.00	2,052,000
近鉄グループホールディングス	5,500	4,575.00	25,162,500
阪急阪神ホールディングス	7,400	3,455.00	25,567,000
南海電気鉄道	2,600	2,332.00	6,063,200
京阪ホールディングス	2,400	4,375.00	10,500,000
神戸電鉄	100	3,605.00	360,500
名古屋鉄道	4,600	2,900.00	13,340,000
山陽電気鉄道	300	2,126.00	637,800
日本通運	1,800	6,140.00	11,052,000
ヤマトホールディングス	9,700	2,763.00	26,801,100
山九	1,600	4,225.00	6,760,000
丸運	300	258.00	77,400
丸全昭和運輸	500	3,395.00	1,697,500
センコーグループホールディングス	3,100	989.00	3,065,900
トナミホールディングス	100	6,480.00	648,000
ニッコンホールディングス	1,900	2,306.00	4,381,400
福山通運	700	4,945.00	3,461,500
セイノーホールディングス	4,100	1,470.00	6,027,000
エスライン	100	1,031.00	103,100
神奈川中央交通	100	4,140.00	414,000
日立物流	1,000	3,425.00	3,425,000
丸和運輸機関	700	4,245.00	2,971,500
C & F ロジホールディングス	700	1,772.00	1,240,400
九州旅客鉄道	4,900	2,260.00	11,074,000
S Gホールディングス	5,800	5,560.00	32,248,000
日本郵船	4,700	1,925.00	9,047,500
商船三井	3,500	2,262.00	7,917,000
川崎汽船	1,700	1,329.00	2,259,300
N S ユナイテッド海運	200	1,505.00	301,000
明治海運	800	432.00	345,600
飯野海運	2,500	380.00	950,000
共栄タンカー	100	771.00	77,100
乾汽船	200	936.00	187,200
日本航空	9,800	2,006.50	19,663,700
A N A ホールディングス	10,000	2,438.50	24,385,000
パスコ	100	1,468.00	146,800
トランコム	100	7,920.00	792,000
日新	600	1,609.00	965,400
三菱倉庫	1,700	2,985.00	5,074,500
三井倉庫ホールディングス	700	1,891.00	1,323,700

住友倉庫	2,100	1,355.00	2,845,500
澁澤倉庫	300	2,369.00	710,700
東陽倉庫	1,100	354.00	389,400
日本トランスシティ	1,500	585.00	877,500
ケイヒン	100	1,406.00	140,600
中央倉庫	400	1,250.00	500,000
川西倉庫	100	1,114.00	111,400
安田倉庫	500	934.00	467,000
ファイブホールディングス	100	1,154.00	115,400
東洋埠頭	100	1,508.00	150,800
宇徳	700	501.00	350,700
上組	3,100	2,040.00	6,324,000
サンリツ	100	636.00	63,600
キムラユニティー	100	1,087.00	108,700
キューソー流通システム	100	1,597.00	159,700
近鉄エクスプレス	1,100	2,235.00	2,458,500
東海運	200	305.00	61,000
エーアイティー	300	1,103.00	330,900
内外トランスライン	100	1,284.00	128,400
日本コンセプト	100	1,488.00	148,800
N E C ネットズエスアイ	1,600	2,019.00	3,230,400
クロスキャット	100	1,403.00	140,300
システナ	2,100	1,812.00	3,805,200
デジタルアーツ	300	8,450.00	2,535,000
日鉄ソリューションズ	800	3,230.00	2,584,000
キューブシステム	200	1,415.00	283,000
エイジア	100	2,525.00	252,500
コア	200	1,408.00	281,600
ラクーンホールディングス	200	2,203.00	440,600
ソリトンシステムズ	200	2,021.00	404,200
ソフトクリエイトホールディングス	200	3,255.00	651,000
T I S	5,700	2,251.00	12,830,700
J N S ホールディングス	100	745.00	74,500
電算システム	200	3,675.00	735,000
グリー	3,300	529.00	1,745,700
コーエーテクモホールディングス	1,100	5,210.00	5,731,000
三菱総合研究所	200	4,385.00	877,000
ボルテージ	100	599.00	59,900
電算	100	2,436.00	243,600
A G S	200	950.00	190,000
ファインデックス	600	1,381.00	828,600
ブレインパッド	100	4,365.00	436,500

K L a b	1,000	966.00	966,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	700	1,002.00	701,400
イーブックイニシアティブジャパン	100	3,225.00	322,500
ネクソン	14,500	2,643.00	38,323,500
アイスタイル	1,700	390.00	663,000
エムアップホールディングス	100	2,987.00	298,700
エイチーム	300	854.00	256,200
エニゲモ	600	1,552.00	931,200
テクノスジャパン	500	904.00	452,000
e n i s h	200	641.00	128,200
コロプラ	1,800	934.00	1,681,200
オルトプラス	200	509.00	101,800
ブロードリーフ	2,600	551.00	1,432,600
クロス・マーケティンググループ	200	411.00	82,200
デジタルハーツホールディングス	200	1,107.00	221,400
システム情報	500	1,358.00	679,000
メディアドゥ	100	7,880.00	788,000
じげん	1,600	350.00	560,000
ブイキューブ	200	1,938.00	387,600
エンカレッジ・テクノロジー	100	881.00	88,100
サイバーリンクス	100	3,385.00	338,500
ディー・エル・イー	500	423.00	211,500
フィックスターズ	600	1,116.00	669,600
C A R T A H O L D I N G S	200	1,309.00	261,800
オブティム	200	3,240.00	648,000
セレス	100	2,100.00	210,000
S H I F T	200	16,070.00	3,214,000
ティーガイア	600	1,935.00	1,161,000
セック	100	3,130.00	313,000
日本アジアグループ	800	309.00	247,200
テクマトリックス	800	2,425.00	1,940,000
プロシップ	100	1,537.00	153,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,400	2,230.00	3,122,000
G M O ペイメントゲートウェイ	1,200	11,950.00	14,340,000
ザッパラス	200	468.00	93,600
システムリサーチ	100	1,900.00	190,000
インターネットイニシアティブ	800	5,070.00	4,056,000
さくらインターネット	800	801.00	640,800
ヴィンクス	100	1,249.00	124,900
G M O グローバルサイン・ホールディングス	100	10,840.00	1,084,000
S R A ホールディングス	200	2,402.00	480,400
システムインテグレータ	100	715.00	71,500

朝日ネット	300	1,031.00	309,300
e B A S E	700	1,315.00	920,500
アバント	600	1,109.00	665,400
アドソル日進	100	2,669.00	266,900
フリービット	200	990.00	198,000
コムチュア	700	2,974.00	2,081,800
サイバーコム	100	1,861.00	186,100
アステリア	200	860.00	172,000
アイル	200	1,501.00	300,200
マークラインズ	200	2,393.00	478,600
メディカル・データ・ビジョン	700	2,533.00	1,773,100
g u m i	900	993.00	893,700
ショーケース	100	943.00	94,300
モバイルファクトリー	100	1,262.00	126,200
テラスカイ	200	5,350.00	1,070,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,362.00	136,200
P C Iホールディングス	100	1,229.00	122,900
パイプドHD	100	1,726.00	172,600
アイビーシー	100	1,117.00	111,700
ネオジャパン	100	2,225.00	222,500
P R T I M E S	100	2,805.00	280,500
ランドコンピュータ	100	1,148.00	114,800
ダブルスタンダード	100	5,020.00	502,000
オープンドア	200	1,489.00	297,800
マイネット	100	1,371.00	137,100
アカツキ	200	4,975.00	995,000
U b i c o mホールディングス	100	2,936.00	293,600
L I N E	1,400	5,390.00	7,546,000
カナミックネットワーク	600	833.00	499,800
ノムラシステムコーポレーション	200	442.00	88,400
チェンジ	400	8,820.00	3,528,000
シンクロ・フード	100	357.00	35,700
オークネット	200	1,628.00	325,600
セグエグループ	100	1,499.00	149,900
エイトレッド	100	2,995.00	299,500
A O I T Y O H o l d i n g s	800	441.00	352,800
マクロミル	1,000	782.00	782,000
ビーグリー	100	2,135.00	213,500
オロ	100	3,615.00	361,500
テモナ	100	1,622.00	162,200
ニーズウェル	100	918.00	91,800
サインポスト	100	1,312.00	131,200

ソルクシーズ	200	1,176.00	235,200
フェイス	100	1,015.00	101,500
プロトコーポレーション	600	1,304.00	782,400
ハイマックス	200	1,210.00	242,000
野村総合研究所	8,100	3,230.00	26,163,000
サイバネットシステム	300	909.00	272,700
C Eホールディングス	200	631.00	126,200
日本システム技術	100	1,988.00	198,800
インテージホールディングス	900	1,016.00	914,400
東邦システムサイエンス	100	964.00	96,400
ソースネクスト	2,600	324.00	842,400
インフォコム	700	4,220.00	2,954,000
HEROZ	100	3,505.00	350,500
ラクスル	500	4,580.00	2,290,000
F I G	800	278.00	222,400
システムサポート	100	1,705.00	170,500
イーソル	200	1,288.00	257,600
アルテリア・ネットワークス	700	1,864.00	1,304,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	100	1,333.00	133,300
トビラシステムズ	100	2,005.00	200,500
フォーカスシステムズ	200	1,000.00	200,000
クレスコ	200	1,319.00	263,800
フジ・メディア・ホールディングス	5,600	1,057.00	5,919,200
オービック	2,000	18,580.00	37,160,000
ジャストシステム	900	7,080.00	6,372,000
T D C ソフト	600	1,029.00	617,400
Zホールディングス	78,500	760.00	59,660,000
トレンドマイクロ	3,100	6,360.00	19,716,000
I Dホールディングス	100	1,420.00	142,000
日本オラクル	1,100	10,940.00	12,034,000
アルファシステムズ	100	3,570.00	357,000
フューチャー	700	2,199.00	1,539,300
C A C Holdings	300	1,423.00	426,900
S Bテクノロジー	100	3,715.00	371,500
トーセ	100	925.00	92,500
オービックビジネスコンサルタント	600	5,880.00	3,528,000
伊藤忠テクノソリューションズ	2,600	3,880.00	10,088,000
アイティフォー	700	897.00	627,900
東計電算	100	4,705.00	470,500
エックスネット	100	1,051.00	105,100
大塚商会	3,100	5,380.00	16,678,000
サイボウズ	700	3,230.00	2,261,000

電通国際情報サービス	400	6,610.00	2,644,000
A C C E S S	600	876.00	525,600
デジタルガレージ	1,000	3,740.00	3,740,000
E Mシステムズ	800	870.00	696,000
ウェザーニューズ	100	5,800.00	580,000
C I J	300	918.00	275,400
ビジネスエンジニアリング	100	3,605.00	360,500
日本エンタープライズ	800	271.00	216,800
WOWOW	200	2,833.00	566,600
スカラ	300	968.00	290,400
インテリジェント ウェイブ	200	797.00	159,400
I M A G I C A G R O U P	800	396.00	316,800
ネットワンシステムズ	2,200	4,910.00	10,802,000
システムソフト	2,100	102.00	214,200
アルゴグラフィックス	600	3,315.00	1,989,000
マーベラス	1,000	816.00	816,000
エイベックス	900	1,178.00	1,060,200
日本ユニシス	1,700	3,455.00	5,873,500
兼松エレクトロニクス	200	4,380.00	876,000
都築電気	100	1,650.00	165,000
T B Sホールディングス	3,400	1,844.00	6,269,600
日本テレビホールディングス	4,800	1,180.00	5,664,000
朝日放送グループホールディングス	600	714.00	428,400
テレビ朝日ホールディングス	1,600	1,682.00	2,691,200
スカパー J S A Tホールディングス	3,700	460.00	1,702,000
テレビ東京ホールディングス	500	2,363.00	1,181,500
日本BS放送	100	1,105.00	110,500
ビジョン	700	944.00	660,800
スマートバリュー	100	1,151.00	115,100
U S E N - N E X T H O L D I N G S	100	1,349.00	134,900
ワイヤレスゲート	200	764.00	152,800
コネクシオ	200	1,177.00	235,400
日本通信	4,200	230.00	966,000
クロップス	100	799.00	79,900
日本電信電話	76,100	2,311.00	175,867,100
K D D I	41,600	2,726.00	113,401,600
ソフトバンク	51,700	1,201.50	62,117,550
光通信	600	25,010.00	15,006,000
N T T ドコモ	40,800	3,876.00	158,140,800
エムティーアイ	800	937.00	749,600
G M Oインターネット	2,100	2,947.00	6,188,700
ファイバーゲート	100	2,034.00	203,400

アйдママーケティングコミュニケーション	100	438.00	43,800
KADOKAWA	1,500	2,945.00	4,417,500
学研ホールディングス	700	1,560.00	1,092,000
ゼンリン	1,000	1,199.00	1,199,000
昭文社ホールディングス	200	497.00	99,400
インプレスホールディングス	1,100	174.00	191,400
アイネット	200	1,559.00	311,800
松竹	400	15,490.00	6,196,000
東宝	3,300	4,480.00	14,784,000
東映	200	17,320.00	3,464,000
エヌ・ティ・ティ・データ	15,300	1,333.00	20,394,900
ピー・シー・エー	100	4,765.00	476,500
ビジネスブレイン太田昭和	200	1,594.00	318,800
D T S	1,400	2,238.00	3,133,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,400	6,720.00	16,128,000
シーイーシー	600	1,599.00	959,400
カプコン	2,600	6,080.00	15,808,000
アイ・エス・ピー	100	2,894.00	289,400
ジャステック	300	1,488.00	446,400
S C S K	1,400	5,830.00	8,162,000
日本システムウエア	100	2,105.00	210,500
アイネス	600	1,584.00	950,400
T K C	500	6,720.00	3,360,000
富士ソフト	700	5,520.00	3,864,000
N S D	1,800	2,030.00	3,654,000
コナミホールディングス	2,200	4,560.00	10,032,000
福井コンピュータホールディングス	200	3,085.00	617,000
J B C Cホールディングス	300	1,660.00	498,000
ミロク情報サービス	600	2,305.00	1,383,000
ソフトバンクグループ	45,200	7,085.00	320,242,000
高千穂交易	100	995.00	99,500
カワニシホールディングス	100	1,412.00	141,200
伊藤忠食品	100	5,520.00	552,000
エレマテック	600	950.00	570,000
J A L U X	100	1,592.00	159,200
あらた	500	5,010.00	2,505,000
トーメンデバイス	100	4,170.00	417,000
東京エレクトロン デバイス	200	3,270.00	654,000
フィールズ	700	340.00	238,000
双日	31,900	243.00	7,751,700
アルフレッサ ホールディングス	6,400	2,322.00	14,860,800
横浜冷凍	1,500	899.00	1,348,500

神栄	100	640.00	64,000
ラサ商事	200	906.00	181,200
アルコニックス	600	1,553.00	931,800
神戸物産	1,900	5,880.00	11,172,000
ハイパー	100	581.00	58,100
あい ホールディングス	800	1,959.00	1,567,200
ディーブイエックス	100	1,019.00	101,900
ダイワボウホールディングス	500	6,660.00	3,330,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,400	1,942.00	2,718,800
ラクト・ジャパン	200	3,785.00	757,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	1,089.00	1,089,000
八洲電機	500	962.00	481,000
メディアスホールディングス	200	930.00	186,000
レスターホールディングス	700	2,198.00	1,538,600
ジューテックホールディングス	100	1,060.00	106,000
大光	200	712.00	142,400
O C H Iホールディングス	100	1,890.00	189,000
T O K A Iホールディングス	3,000	1,056.00	3,168,000
黒谷	100	532.00	53,200
C o m i n i x	100	741.00	74,100
三洋貿易	600	1,020.00	612,000
ビューティガレージ	100	3,025.00	302,500
ウイン・パートナーズ	500	1,054.00	527,000
ミタチ産業	100	619.00	61,900
シップヘルスケアホールディングス	900	5,290.00	4,761,000
明治電機工業	100	1,403.00	140,300
デリカフーズホールディングス	100	636.00	63,600
スターティアホールディングス	100	758.00	75,800
コメダホールディングス	1,300	1,938.00	2,519,400
アセンテック	100	2,238.00	223,800
富士興産	100	766.00	76,600
協栄産業	100	1,451.00	145,100
小野建	600	1,156.00	693,600
南陽	100	1,723.00	172,300
佐島電機	300	851.00	255,300
エコートレーディング	100	675.00	67,500
伯東	300	1,143.00	342,900
コンドーテック	500	1,080.00	540,000
中山福	200	489.00	97,800
ナガイレーベン	800	2,685.00	2,148,000
三菱食品	700	2,825.00	1,977,500
松田産業	500	1,494.00	747,000

第一興商	800	3,665.00	2,932,000
メディバルホールディングス	6,300	2,094.00	13,192,200
S P K	200	1,333.00	266,600
萩原電気ホールディングス	200	2,255.00	451,000
アズワン	400	15,490.00	6,196,000
スズデン	100	1,238.00	123,800
尾家産業	100	1,650.00	165,000
シモジマ	200	1,431.00	286,200
ドウシシャ	600	2,061.00	1,236,600
小津産業	100	1,888.00	188,800
高速	200	1,585.00	317,000
たけびし	100	1,590.00	159,000
リックス	100	1,690.00	169,000
丸文	800	526.00	420,800
ハピネット	500	1,469.00	734,500
橋本総業ホールディングス	100	2,640.00	264,000
日本ライフライン	1,700	1,404.00	2,386,800
タカショー	300	675.00	202,500
マルカ	100	2,270.00	227,000
I D O M	1,500	679.00	1,018,500
進和	300	2,144.00	643,200
エスケイジャパン	100	345.00	34,500
ダイトロン	200	1,508.00	301,600
シークス	700	1,283.00	898,100
田中商事	100	706.00	70,600
オーハシテクニカ	200	1,496.00	299,200
白銅	100	1,346.00	134,600
伊藤忠商事	40,000	2,684.00	107,360,000
丸紅	59,600	613.70	36,576,520
高島	100	1,907.00	190,700
長瀬産業	3,200	1,451.00	4,643,200
蝶理	300	1,678.00	503,400
豊田通商	6,500	3,100.00	20,150,000
三共生興	1,100	451.00	496,100
兼松	2,200	1,308.00	2,877,600
ツカモトコーポレーション	100	1,289.00	128,900
三井物産	49,600	1,847.00	91,611,200
日本紙パルプ商事	400	3,760.00	1,504,000
カメイ	700	1,084.00	758,800
東都水産	100	3,555.00	355,500
O U Gホールディングス	100	2,885.00	288,500
スターゼン	200	4,030.00	806,000

山善	2,300	1,100.00	2,530,000	
椿本興業	100	3,780.00	378,000	
住友商事	36,100	1,274.00	45,991,400	
内田洋行	200	5,690.00	1,138,000	
三菱商事	37,500	2,564.00	96,150,000	
第一実業	200	3,750.00	750,000	
キヤノンマーケティングジャパン	1,500	2,066.00	3,099,000	
西華産業	200	1,465.00	293,000	
佐藤商事	500	1,044.00	522,000	
菱洋エレクトロ	600	3,020.00	1,812,000	
東京産業	800	570.00	456,000	
ユアサ商事	600	3,365.00	2,019,000	
神鋼商事	100	1,880.00	188,000	
トルク	200	315.00	63,000	
阪和興業	1,000	2,158.00	2,158,000	
正栄食品工業	500	4,145.00	2,072,500	
カナデン	500	1,487.00	743,500	
菱電商事	500	1,551.00	775,500	
フルサト工業	200	1,485.00	297,000	
岩谷産業	1,400	4,055.00	5,677,000	
ナイス	200	1,297.00	259,400	
昭光通商	100	631.00	63,100	
ニチモウ	100	1,985.00	198,500	
極東貿易	100	1,519.00	151,900	
イワキ	700	524.00	366,800	
三愛石油	1,400	1,050.00	1,470,000	
稲畑産業	1,300	1,331.00	1,730,300	
G S Iクレオス	100	1,782.00	178,200	
明和産業	800	430.00	344,000	
クワザワホールディングス	100	563.00	56,300	
ヤマエ久野	500	1,192.00	596,000	
ワキタ	1,300	1,054.00	1,370,200	
東邦ホールディングス	1,800	2,239.00	4,030,200	
サンゲツ	1,600	1,583.00	2,532,800	
ミツウロコグループホールディングス	800	1,302.00	1,041,600	
シナネンホールディングス	200	3,145.00	629,000	
伊藤忠エネクス	1,300	971.00	1,262,300	
サンリオ	1,600	1,913.00	3,060,800	
サンワテクノス	300	875.00	262,500	
リョーサン	700	2,078.00	1,454,600	
新光商事	1,100	869.00	955,900	
トーホー	200	1,955.00	391,000	

三信電気	200	2,005.00	401,000
東陽テクニカ	600	1,002.00	601,200
モスフードサービス	800	2,881.00	2,304,800
加賀電子	600	2,210.00	1,326,000
ソーダニッカ	800	582.00	465,600
立花エレテック	500	1,820.00	910,000
フォーバル	200	999.00	199,800
PALTA C	900	5,480.00	4,932,000
三谷産業	900	386.00	347,400
太平洋興発	100	658.00	65,800
西本Wismettacホールディングス	100	1,951.00	195,100
国際紙パルプ商事	1,800	298.00	536,400
ヤマタネ	200	1,360.00	272,000
日鉄物産	500	3,085.00	1,542,500
泉州電業	100	3,265.00	326,500
トラスコ中山	1,400	2,654.00	3,715,600
オートボックスセブン	2,200	1,450.00	3,190,000
モリト	500	725.00	362,500
加藤産業	800	3,680.00	2,944,000
北恵	100	1,150.00	115,000
イノテック	200	1,028.00	205,600
イエローハット	1,000	1,786.00	1,786,000
J Kホールディングス	800	851.00	680,800
日伝	600	2,323.00	1,393,800
北沢産業	700	290.00	203,000
杉本商事	200	1,870.00	374,000
因幡電機産業	1,600	2,640.00	4,224,000
東テク	200	2,392.00	478,400
ミスミグループ本社	7,200	3,055.00	21,996,000
アルテック	800	300.00	240,000
タキヒヨー	100	1,862.00	186,200
蔵王産業	100	1,456.00	145,600
スズケン	2,400	4,025.00	9,660,000
ジェコス	300	944.00	283,200
グローセル	800	420.00	336,000
ローソン	1,500	5,040.00	7,560,000
サンエー	600	4,595.00	2,757,000
カワチ薬品	500	2,817.00	1,408,500
エービーシー・マート	900	5,470.00	4,923,000
ハードオフコーポレーション	100	684.00	68,400
アスクル	600	4,605.00	2,763,000
ゲオホールディングス	1,000	1,648.00	1,648,000

アダストリア	800	1,538.00	1,230,400
ジーフット	200	485.00	97,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	444.00	44,400
くら寿司	300	6,330.00	1,899,000
キャンドウ	200	2,138.00	427,600
パルグループホールディングス	600	1,138.00	682,800
エディオン	2,600	1,092.00	2,839,200
サーラコーポレーション	1,200	593.00	711,600
ワッツ	200	913.00	182,600
ハローズ	200	3,985.00	797,000
フジオフードグループ本社	600	1,462.00	877,200
あみやき亭	100	3,020.00	302,000
ひらまつ	1,400	211.00	295,400
大黒天物産	100	5,700.00	570,000
ハニーズホールディングス	600	993.00	595,800
ファーマライズホールディングス	100	804.00	80,400
アルペン	500	2,097.00	1,048,500
ハブ	100	647.00	64,700
クオールホールディングス	800	1,202.00	961,600
ジーンズホールディングス	300	7,890.00	2,367,000
ビックカメラ	3,400	1,191.00	4,049,400
D C Mホールディングス	3,200	1,473.00	4,713,600
ペッパーフードサービス	400	338.00	135,200
Monotaro	4,100	5,400.00	22,140,000
東京一番フーズ	100	585.00	58,500
D Dホールディングス	100	790.00	79,000
きちりホールディングス	100	662.00	66,200
アークランドサービスホールディングス	500	2,088.00	1,044,000
J . フロント リテイリング	6,800	812.00	5,521,600
ドトール・日レスホールディングス	800	1,669.00	1,335,200
マツモトキヨシホールディングス	2,400	4,100.00	9,840,000
ブロンコビリー	200	2,389.00	477,800
Z O Z O	4,000	3,065.00	12,260,000
トレジャー・ファクトリー	100	804.00	80,400
物語コーポレーション	100	11,130.00	1,113,000
ココカラファイン	600	7,080.00	4,248,000
三越伊勢丹ホールディングス	10,000	598.00	5,980,000
H a m e e	100	2,331.00	233,100
ウエルシアホールディングス	3,400	4,335.00	14,739,000
クリエイトSDホールディングス	900	3,600.00	3,240,000
丸善C H Iホールディングス	900	388.00	349,200
ミサワ	100	746.00	74,600

ティーライフ	100	1,273.00	127,300
エー・ピーホールディングス	100	419.00	41,900
チムニー	100	1,353.00	135,300
シュッピン	300	871.00	261,300
オイシックス・ラ・大地	600	3,210.00	1,926,000
ネクステージ	900	1,475.00	1,327,500
ジョイフル本田	1,600	1,652.00	2,643,200
鳥貴族	100	1,604.00	160,400
キリン堂ホールディングス	200	3,490.00	698,000
ホットランド	500	1,230.00	615,000
すかいらーくホールディングス	6,500	1,541.00	10,016,500
SFPホールディングス	200	1,408.00	281,600
綿半ホールディングス	200	1,565.00	313,000
ヨシックス	100	1,855.00	185,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,600	1,194.00	1,910,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	200	765.00	153,000
B E E N O S	200	1,912.00	382,400
あさひ	500	1,884.00	942,000
日本調剤	200	1,820.00	364,000
コスモス薬品	500	17,630.00	8,815,000
トーエル	200	855.00	171,000
オンリー	100	528.00	52,800
セブン&アイ・ホールディングス	22,300	3,386.00	75,507,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,100	656.00	2,033,600
ツルハホールディングス	1,300	15,050.00	19,565,000
サンマルクホールディングス	500	1,637.00	818,500
フェリシモ	100	1,525.00	152,500
トリドールホールディングス	1,400	1,430.00	2,002,000
T O K Y O B A S E	700	404.00	282,800
ウイルプラスホールディングス	100	626.00	62,600
J Mホールディングス	500	2,676.00	1,338,000
サツドラホールディングス	100	2,037.00	203,700
アレンザホールディングス	200	1,718.00	343,600
串カツ田中ホールディングス	100	1,764.00	176,400
パロックジャパンリミテッド	300	630.00	189,000
クスリのアオキホールディングス	500	8,440.00	4,220,000
力の源ホールディングス	200	640.00	128,000
スシローグローバルホールディングス	3,200	2,941.00	9,411,200
メディカルシステムネットワーク	1,000	463.00	463,000
はるやまホールディングス	200	732.00	146,400
ノジマ	1,000	2,927.00	2,927,000

カップ・クリエイト	800	1,552.00	1,241,600
ライトオン	700	590.00	413,000
ジーンズメイト	100	217.00	21,700
良品計画	7,600	1,793.00	13,626,800
三城ホールディングス	800	288.00	230,400
アドヴァン	800	1,371.00	1,096,800
アルビス	200	2,627.00	525,400
コナカ	900	284.00	255,600
ハウス オブ ローゼ	100	1,653.00	165,300
G - 7ホールディングス	200	2,606.00	521,200
イオン北海道	700	890.00	623,000
コジマ	1,100	586.00	644,600
ヒマラヤ	100	884.00	88,400
コーナン商事	800	3,910.00	3,128,000
エコス	100	2,162.00	216,200
ワタミ	700	1,032.00	722,400
マルシェ	100	594.00	59,400
パン・パシフィック・インターナショナルホ	12,500	2,426.00	30,325,000
西松屋チェーン	1,300	1,503.00	1,953,900
ゼンショーホールディングス	2,700	2,545.00	6,871,500
幸楽苑ホールディングス	300	1,814.00	544,200
ハークスレイ	100	975.00	97,500
サイゼリヤ	900	2,117.00	1,905,300
V Tホールディングス	2,300	414.00	952,200
魚力	100	1,707.00	170,700
ポブラ	100	437.00	43,700
フジ・コーポレーション	100	2,610.00	261,000
ユナイテッドアローズ	600	1,542.00	925,200
ハイデイ日高	800	1,779.00	1,423,200
京都きもの友禅	300	232.00	69,600
コロワイド	1,800	1,683.00	3,029,400
ピーシーデポコーポレーション	900	700.00	630,000
壱番屋	500	5,520.00	2,760,000
トップカルチャー	100	389.00	38,900
P L A N T	100	875.00	87,500
スギホールディングス	1,100	7,390.00	8,129,000
薬王堂ホールディングス	200	2,607.00	521,400
ヴィア・ホールディングス	900	308.00	277,200
スクロール	1,000	887.00	887,000
ヨンドシーホールディングス	600	1,760.00	1,056,000
ファミリーマート	4,600	2,320.00	10,672,000
木曽路	700	2,601.00	1,820,700

S R S ホールディングス	700	900.00	630,000
千趣会	1,300	390.00	507,000
タカキュー	300	152.00	45,600
リテールパートナーズ	800	1,725.00	1,380,000
ケーヨー	1,200	827.00	992,400
上新電機	700	2,513.00	1,759,100
日本瓦斯	900	5,300.00	4,770,000
ロイヤルホールディングス	1,000	1,892.00	1,892,000
いなげや	700	1,935.00	1,354,500
島忠	1,000	4,190.00	4,190,000
チヨダ	600	992.00	595,200
ライフコーポレーション	500	4,400.00	2,200,000
リンガーハット	700	2,451.00	1,715,700
MrMaxHD	1,000	790.00	790,000
テンアライド	800	394.00	315,200
AOKIホールディングス	1,000	527.00	527,000
オークワ	900	1,442.00	1,297,800
コメリ	900	3,090.00	2,781,000
青山商事	1,100	559.00	614,900
しまむら	700	10,460.00	7,322,000
はせがわ	200	309.00	61,800
高島屋	4,200	876.00	3,679,200
松屋	1,200	816.00	979,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,700	744.00	2,008,800
近鉄百貨店	200	3,300.00	660,000
丸井グループ	5,400	2,097.00	11,323,800
アクシアル リテイリング	600	4,685.00	2,811,000
井筒屋	200	179.00	35,800
イオン	22,000	2,840.00	62,480,000
イズミ	1,100	3,740.00	4,114,000
平和堂	1,100	2,342.00	2,576,200
フジ	700	2,029.00	1,420,300
ヤオコー	700	7,670.00	5,369,000
ゼビオホールディングス	700	744.00	520,800
ケーズホールディングス	5,600	1,396.00	7,817,600
Olympicグループ	200	1,207.00	241,400
日産東京販売ホールディングス	1,000	262.00	262,000
シルバーライフ	100	2,003.00	200,300
Genky DrugStores	200	3,825.00	765,000
ナルミヤ・インターナショナル	100	706.00	70,600
ブックオフグループホールディングス	200	888.00	177,600
アインホールディングス	700	7,470.00	5,229,000

元気寿司	100	2,469.00	246,900
ヤマダホールディングス	17,400	511.00	8,891,400
アークランドサカモト	900	2,171.00	1,953,900
ニトリホールディングス	2,500	21,670.00	54,175,000
グルメ杵屋	500	977.00	488,500
愛眼	900	229.00	206,100
ケーユーホールディングス	200	874.00	174,800
吉野家ホールディングス	1,900	2,024.00	3,845,600
松屋フーズホールディングス	200	3,680.00	736,000
サガミホールディングス	700	1,276.00	893,200
関西スーパーマーケット	500	1,318.00	659,000
王将フードサービス	500	6,120.00	3,060,000
プレナス	700	1,814.00	1,269,800
ミニストップ	500	1,467.00	733,500
アークス	1,100	2,578.00	2,835,800
パローホールディングス	1,300	2,780.00	3,614,000
ベルク	200	7,350.00	1,470,000
大庄	200	1,270.00	254,000
ファーストリテイリング	800	67,290.00	53,832,000
サンドラッグ	2,200	4,045.00	8,899,000
サックスパー ホールディングス	600	568.00	340,800
ヤマザワ	100	1,824.00	182,400
やまや	100	2,195.00	219,500
ベルーナ	1,300	953.00	1,238,900
島根銀行	100	683.00	68,300
じもとホールディングス	480	1,018.00	488,640
めぶきフィナンシャルグループ	29,800	238.00	7,092,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	800	1,151.00	920,800
九州フィナンシャルグループ	12,300	504.00	6,199,200
ゆうちょ銀行	16,300	821.00	13,382,300
富山第一銀行	1,800	303.00	545,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	33,000	382.00	12,606,000
西日本フィナンシャルホールディングス	3,800	737.00	2,800,600
関西みらいフィナンシャルグループ	3,200	445.00	1,424,000
三十三フィナンシャルグループ	600	1,377.00	826,200
第四北越フィナンシャルグループ	900	2,237.00	2,013,300
ひろぎんホールディングス	8,400	609.00	5,115,600
新生銀行	4,200	1,339.00	5,623,800
あおぞら銀行	3,400	1,787.00	6,075,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	391,400	434.30	169,985,020
りそなホールディングス	62,700	366.70	22,992,090
三井住友トラスト・ホールディングス	10,800	2,877.50	31,077,000

三井住友フィナンシャルグループ	39,700	3,013.00	119,616,100
千葉銀行	19,300	596.00	11,502,800
群馬銀行	11,100	357.00	3,962,700
武蔵野銀行	900	1,582.00	1,423,800
千葉興業銀行	1,900	259.00	492,100
筑波銀行	2,700	203.00	548,100
七十七銀行	1,900	1,613.00	3,064,700
青森銀行	500	2,448.00	1,224,000
秋田銀行	300	1,551.00	465,300
山形銀行	700	1,350.00	945,000
岩手銀行	300	2,507.00	752,100
東邦銀行	4,800	237.00	1,137,600
東北銀行	200	1,147.00	229,400
みちのく銀行	300	1,361.00	408,300
ふくおかフィナンシャルグループ	4,900	1,812.00	8,878,800
静岡銀行	14,000	730.00	10,220,000
十六銀行	700	1,992.00	1,394,400
スルガ銀行	5,800	380.00	2,204,000
八十二銀行	13,900	423.00	5,879,700
山梨中央銀行	700	852.00	596,400
大垣共立銀行	1,100	2,370.00	2,607,000
福井銀行	600	1,851.00	1,110,600
北國銀行	600	3,085.00	1,851,000
清水銀行	200	1,859.00	371,800
富山銀行	100	3,140.00	314,000
滋賀銀行	1,100	2,462.00	2,708,200
南都銀行	900	2,004.00	1,803,600
百五銀行	5,100	333.00	1,698,300
京都銀行	2,100	5,130.00	10,773,000
紀陽銀行	2,100	1,602.00	3,364,200
ほくほくフィナンシャルグループ	3,900	1,059.00	4,130,100
山陰合同銀行	3,400	562.00	1,910,800
中国銀行	4,900	995.00	4,875,500
鳥取銀行	100	1,202.00	120,200
伊予銀行	8,200	708.00	5,805,600
百十四銀行	700	1,838.00	1,286,600
四国銀行	1,000	753.00	753,000
阿波銀行	900	2,616.00	2,354,400
大分銀行	300	2,498.00	749,400
宮崎銀行	300	2,424.00	727,200
佐賀銀行	200	1,325.00	265,000
沖縄銀行	600	3,080.00	1,848,000

琉球銀行	1,400	918.00	1,285,200
セブン銀行	19,200	260.00	4,992,000
みずほフィナンシャルグループ	77,760	1,345.50	104,626,080
高知銀行	100	787.00	78,700
山口フィナンシャルグループ	7,200	703.00	5,061,600
長野銀行	100	1,413.00	141,300
名古屋銀行	500	2,694.00	1,347,000
北洋銀行	8,700	235.00	2,044,500
愛知銀行	100	3,070.00	307,000
中京銀行	200	2,098.00	419,600
大光銀行	100	1,404.00	140,400
愛媛銀行	800	1,191.00	952,800
トマト銀行	100	1,072.00	107,200
京葉銀行	2,400	493.00	1,183,200
栃木銀行	3,100	186.00	576,600
北日本銀行	100	1,972.00	197,200
東和銀行	1,100	725.00	797,500
福島銀行	1,200	248.00	297,600
大東銀行	200	637.00	127,400
トモニホールディングス	4,200	341.00	1,432,200
フィデアホールディングス	6,000	115.00	690,000
池田泉州ホールディングス	6,400	175.00	1,120,000
F P G	1,600	564.00	902,400
マーキュリアインベストメント	200	668.00	133,600
S B Iホールディングス	6,400	2,670.00	17,088,000
日本アジア投資	1,000	230.00	230,000
ジャフコ グループ	900	4,495.00	4,045,500
大和証券グループ本社	46,100	455.00	20,975,500
野村ホールディングス	101,300	500.10	50,660,130
岡三証券グループ	4,800	355.00	1,704,000
丸三証券	1,600	465.00	744,000
東洋証券	2,500	117.00	292,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,600	285.00	1,881,000
光世証券	100	679.00	67,900
水戸証券	2,200	210.00	462,000
いちよし証券	1,200	487.00	584,400
松井証券	3,200	934.00	2,988,800
マネックスグループ	4,000	279.00	1,116,000
極東証券	1,100	631.00	694,100
岩井コスモホールディングス	600	1,308.00	784,800
藍澤証券	1,100	702.00	772,200
マネーパートナーズグループ	1,000	211.00	211,000

スパークス・グループ	2,900	257.00	745,300
小林洋行	100	270.00	27,000
かんぽ生命保険	2,100	1,737.00	3,647,700
S O M P Oホールディングス	10,800	3,823.00	41,288,400
アニコム ホールディングス	2,000	1,152.00	2,304,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	14,900	2,885.50	42,993,950
第一生命ホールディングス	32,600	1,588.00	51,768,800
東京海上ホールディングス	20,300	4,817.00	97,785,100
T & Dホールディングス	17,400	1,099.00	19,122,600
アドバンスクリエイト	100	2,179.00	217,900
全国保証	1,600	4,325.00	6,920,000
ジェイリース	100	651.00	65,100
イントラスト	100	912.00	91,200
日本モーゲージサービス	200	1,154.00	230,800
C a s a	100	1,256.00	125,600
アルヒ	900	1,953.00	1,757,700
プレミアグループ	200	2,134.00	426,800
クレディセゾン	4,000	1,194.00	4,776,000
芙蓉総合リース	600	6,570.00	3,942,000
みずほリース	900	2,759.00	2,483,100
東京センチュリー	1,100	5,960.00	6,556,000
日本証券金融	2,400	515.00	1,236,000
アイフル	8,500	280.00	2,380,000
リコーリース	500	2,850.00	1,425,000
イオンフィナンシャルサービス	3,500	1,095.00	3,832,500
アコム	11,400	463.00	5,278,200
ジャックス	700	1,767.00	1,236,900
オリエントコーポレーション	15,000	121.00	1,815,000
日立キャピタル	1,400	2,469.00	3,456,600
アプラスフィナンシャル	2,000	77.00	154,000
オリックス	35,800	1,383.50	49,529,300
三菱U F Jリース	14,600	492.00	7,183,200
九州リースサービス	200	636.00	127,200
日本取引所グループ	16,500	2,802.00	46,233,000
イー・ギャランティ	700	2,318.00	1,622,600
アサックス	200	747.00	149,400
N E Cキャピタルソリューション	200	1,886.00	377,200
いちご	7,200	334.00	2,404,800
日本駐車場開発	5,700	133.00	758,100
スター・マイカ・ホールディングス	200	1,575.00	315,000
A Dワークスグループ	1,400	160.00	224,000
ヒューリック	12,200	1,037.00	12,651,400

三栄建築設計	200	1,700.00	340,000
野村不動産ホールディングス	3,400	2,054.00	6,983,600
三重交通グループホールディングス	1,200	477.00	572,400
サムティ	800	1,659.00	1,327,200
ディア・ライフ	1,100	427.00	469,700
コーセーアールイー	100	583.00	58,300
日本商業開発	300	1,763.00	528,900
プレサンスコーポレーション	900	1,457.00	1,311,300
THEグローバル社	400	234.00	93,600
ハウスコム	100	1,305.00	130,500
日本管理センター	300	1,338.00	401,400
サンセイランディック	100	774.00	77,400
エストラスト	100	742.00	74,200
フージャースホールディングス	1,300	704.00	915,200
オープンハウス	1,800	3,840.00	6,912,000
東急不動産ホールディングス	15,400	492.00	7,576,800
飯田グループホールディングス	4,800	2,095.00	10,056,000
イーランド	100	804.00	80,400
ムゲンエステート	300	512.00	153,600
ビーロッド	200	770.00	154,000
ファーストブラザーズ	100	946.00	94,600
ハウストゥ	200	1,335.00	267,000
シーアールイー	100	1,391.00	139,100
プロパティエージェント	100	1,388.00	138,800
ケイアイスター不動産	100	2,824.00	282,400
アグレ都市デザイン	100	689.00	68,900
グッドコムアセット	100	3,545.00	354,500
ジェイ・エス・ビー	100	3,120.00	312,000
テンポイノベーション	100	799.00	79,900
グローバル・リンク・マネジメント	100	779.00	77,900
パーク24	3,100	1,773.00	5,496,300
パラカ	100	1,649.00	164,900
三井不動産	28,100	1,914.00	53,783,400
三菱地所	40,000	1,661.50	66,460,000
平和不動産	1,000	3,095.00	3,095,000
東京建物	5,900	1,280.00	7,552,000
ダイビル	1,500	1,288.00	1,932,000
京阪神ビルディング	900	1,833.00	1,649,700
住友不動産	12,900	3,083.00	39,770,700
テーオーシー	1,200	687.00	824,400
東京楽天地	100	4,400.00	440,000
レオパレス21	7,200	173.00	1,245,600

スターツコーポレーション	800	2,472.00	1,977,600
フジ住宅	600	541.00	324,600
空港施設	800	475.00	380,000
明和地所	200	505.00	101,000
ゴールドクレスト	500	1,382.00	691,000
エスリード	200	1,413.00	282,600
日神グループホールディングス	1,100	427.00	469,700
日本エスコン	1,100	932.00	1,025,200
タカラレーベン	2,500	317.00	792,500
A V A N T I A	200	830.00	166,000
イオンモール	3,000	1,636.00	4,908,000
毎日コムネット	100	759.00	75,900
ファースト住建	200	1,134.00	226,800
ランド	20,700	10.00	207,000
カチタス	1,500	3,120.00	4,680,000
トーセイ	800	1,109.00	887,200
穴吹興産	100	1,590.00	159,000
サンフロンティア不動産	800	915.00	732,000
エフ・ジェー・ネクスト	600	936.00	561,600
インテリックス	100	520.00	52,000
ランドビジネス	100	346.00	34,600
サンネクスタグループ	100	1,039.00	103,900
グランディハウス	600	384.00	230,400
日本空港ビルデング	1,800	4,750.00	8,550,000
明豊ファシリティワークス	200	650.00	130,000
日本工営	300	2,848.00	854,400
L I F U L L	1,800	430.00	774,000
ミクシィ	1,000	3,080.00	3,080,000
ジェイエイシーリクルートメント	300	1,342.00	402,600
日本M&Aセンター	4,200	6,410.00	26,922,000
メンバーズ	100	1,894.00	189,400
中広	100	498.00	49,800
UTグループ	900	3,635.00	3,271,500
アイティメディア	200	2,783.00	556,600
タケエイ	600	1,013.00	607,800
E・Jホールディングス	100	2,550.00	255,000
ビーネックスグループ	700	1,258.00	880,600
コシダカホールディングス	1,400	436.00	610,400
アルトナー	100	940.00	94,000
パソナグループ	600	1,600.00	960,000
C D S	100	1,372.00	137,200
リンクアンドモチベーション	1,300	429.00	557,700

G C A	700	670.00	469,000
エス・エム・エス	1,700	3,245.00	5,516,500
サニーサイドアップグループ	100	709.00	70,900
パーソルホールディングス	5,600	1,714.00	9,598,400
リニカル	200	839.00	167,800
クックパッド	1,800	382.00	687,600
エスクリ	100	361.00	36,100
アイ・ケイ・ケイ	200	628.00	125,600
学情	100	1,163.00	116,300
スタジオアリス	200	1,668.00	333,600
シミックホールディングス	200	1,345.00	269,000
エプロ	100	1,011.00	101,100
N J S	100	1,913.00	191,300
総合警備保障	2,300	5,100.00	11,730,000
カカクコム	4,100	3,030.00	12,423,000
アイロムグループ	200	2,012.00	402,400
セントケア・ホールディング	300	771.00	231,300
サイネックス	100	848.00	84,800
ルネサンス	200	946.00	189,200
ディップ	800	2,322.00	1,857,600
デジタルホールディングス	300	1,456.00	436,800
新日本科学	600	708.00	424,800
ツクイホールディングス	1,300	560.00	728,000
キャリアデザインセンター	100	1,069.00	106,900
ベネフィット・ワン	1,900	2,791.00	5,302,900
エムスリー	12,200	6,690.00	81,618,000
ツカダ・グローバルホールディング	600	279.00	167,400
プラス	100	472.00	47,200
アウトソーシング	3,200	1,110.00	3,552,000
ウェルネット	600	596.00	357,600
ワールドホールディングス	100	2,184.00	218,400
ディー・エヌ・エー	2,400	1,987.00	4,768,800
博報堂D Yホールディングス	7,600	1,464.00	11,126,400
ぐるなび	1,100	841.00	925,100
タカミヤ	800	571.00	456,800
ジャパンベストレスキューシステム	500	1,132.00	566,000
ファンコミュニケーションズ	1,700	491.00	834,700
ライク	100	2,008.00	200,800
ビジネス・ブレークスルー	200	380.00	76,000
エスプール	1,400	775.00	1,085,000
W D Bホールディングス	200	3,040.00	608,000
手間いらず	100	5,990.00	599,000

ティア	200	408.00	81,600
バリューコマース	300	3,535.00	1,060,500
インフォマート	5,800	988.00	5,730,400
J Pホールディングス	2,100	308.00	646,800
エコナックホールディングス	1,900	98.00	186,200
E P Sホールディングス	700	1,020.00	714,000
レグス	100	1,157.00	115,700
プレステージ・インターナショナル	2,100	916.00	1,923,600
アミューズ	200	2,541.00	508,200
ドリームインキュベータ	100	1,506.00	150,600
クイック	200	1,215.00	243,000
T A C	200	228.00	45,600
ケネディクス	4,900	562.00	2,753,800
電通グループ	6,300	3,035.00	19,120,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	658.00	65,800
ぴあ	100	3,370.00	337,000
イオンファンタジー	200	1,957.00	391,400
シーティーエス	600	940.00	564,000
ネクシィーズグループ	100	1,109.00	110,900
H . U . グループホールディングス	1,600	2,891.00	4,625,600
アルプス技研	600	2,035.00	1,221,000
サニックス	1,100	255.00	280,500
ダイオーズ	100	973.00	97,300
日本空調サービス	600	740.00	444,000
オリエンタルランド	5,900	15,080.00	88,972,000
ダスキン	1,400	2,903.00	4,064,200
明光ネットワークジャパン	700	730.00	511,000
ファルコホールディングス	200	1,491.00	298,200
秀英予備校	100	458.00	45,800
田谷	100	558.00	55,800
ラウンドワン	1,500	895.00	1,342,500
リゾートトラスト	2,500	1,699.00	4,247,500
ビー・エム・エル	700	3,265.00	2,285,500
ワタベウェディング	100	321.00	32,100
りらいあコミュニケーションズ	900	1,264.00	1,137,600
リソー教育	2,400	296.00	710,400
早稲田アカデミー	200	977.00	195,400
ユー・エス・エス	6,300	1,959.00	12,341,700
東京個別指導学院	100	569.00	56,900
サイバーエージェント	3,400	6,470.00	21,998,000
楽天	26,000	1,215.00	31,590,000
クリーク・アンド・リバー社	200	1,482.00	296,400

テー・オー・ダブリュー	1,000	318.00	318,000
山田コンサルティンググループ	300	1,181.00	354,300
セントラルスポーツ	200	2,369.00	473,800
フルキャストホールディングス	600	1,811.00	1,086,600
エン・ジャパン	900	2,752.00	2,476,800
リソルホールディングス	100	3,885.00	388,500
テクノプロ・ホールディングス	1,100	7,160.00	7,876,000
アトラ	100	281.00	28,100
インターワークス	100	346.00	34,600
アイ・アールジャパンホールディングス	200	12,470.00	2,494,000
Keeper 技研	400	1,432.00	572,800
ファーストロジック	100	771.00	77,100
三機サービス	100	1,150.00	115,000
Gunosy	200	956.00	191,200
デザインワン・ジャパン	100	280.00	28,000
イー・ガーディアン	200	3,445.00	689,000
リブセンス	300	288.00	86,400
ジャパンマテリアル	1,700	1,429.00	2,429,300
ベクトル	700	1,135.00	794,500
ウチヤマホールディングス	200	318.00	63,600
チャーム・ケア・コーポレーション	500	1,152.00	576,000
キャリアリンク	100	1,795.00	179,500
I B J	500	1,011.00	505,500
アサンテ	200	1,597.00	319,400
N・フィールド	300	719.00	215,700
バリューHR	200	1,789.00	357,800
M&Aキャピタルパートナーズ	500	5,220.00	2,610,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	200	2,422.00	484,400
E R Iホールディングス	100	690.00	69,000
アビスト	100	2,900.00	290,000
シグマクシス	300	1,694.00	508,200
ウィルグループ	300	863.00	258,900
エスクロー・エージェント・ジャパン	900	368.00	331,200
リクルートホールディングス	39,800	4,309.00	171,498,200
エラン	300	2,512.00	753,600
土木管理総合試験所	200	392.00	78,400
ネットマーケティング	100	665.00	66,500
日本郵政	45,600	740.00	33,744,000
ベルシステム24ホールディングス	900	1,675.00	1,507,500
鎌倉新書	500	965.00	482,500
S M N	100	1,020.00	102,000
L I T A L I C O	200	2,963.00	592,600

グローバルキッズCOMPANY	100	839.00	83,900
エアトリ	200	1,612.00	322,400
アトラエ	100	2,898.00	289,800
ストライク	200	6,560.00	1,312,000
ソラスト	1,500	1,385.00	2,077,500
セラク	100	1,903.00	190,300
インソース	200	3,300.00	660,000
ベйкаレント・コンサルティング	300	14,830.00	4,449,000
Orchestra Holdings	100	2,236.00	223,600
アイモバイル	100	1,405.00	140,500
キャリアインデックス	100	630.00	63,000
MS - Japan	100	830.00	83,000
船場	100	964.00	96,400
グレイステクノロジー	200	5,900.00	1,180,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	600	3,750.00	2,250,000
フルテック	100	1,434.00	143,400
グリーンズ	100	532.00	53,200
ツナググループ・ホールディングス	100	447.00	44,700
GameWith	100	592.00	59,200
ソウルドアウト	100	1,550.00	155,000
MS&Consulting	100	715.00	71,500
ミダック	100	2,905.00	290,500
日総工産	300	811.00	243,300
キュービーネットホールディングス	200	1,721.00	344,200
RPAホールディングス	500	818.00	409,000
スプリックス	100	825.00	82,500
マネジメントソリューションズ	200	1,600.00	320,000
プロレド・パートナーズ	100	5,480.00	548,000
カーブスホールディングス	1,500	726.00	1,089,000
フォーラムエンジニアリング	200	848.00	169,600
アドバンテッジリスクマネジメント	200	746.00	149,200
リログループ	3,100	2,655.00	8,230,500
東祥	200	1,330.00	266,000
エイチ・アイ・エス	900	1,721.00	1,548,900
ラックランド	100	2,342.00	234,200
共立メンテナンス	900	4,090.00	3,681,000
イチネンホールディングス	600	1,257.00	754,200
建設技術研究所	300	1,967.00	590,100
スペース	300	800.00	240,000
長大	100	1,314.00	131,400
燦ホールディングス	200	1,257.00	251,400
スバル興業	100	7,850.00	785,000

東京テアトル	100	1,327.00	132,700
タナベ経営	100	1,405.00	140,500
ナガワ	100	8,240.00	824,000
よみうりランド	100	4,130.00	413,000
東京都競馬	400	5,420.00	2,168,000
常磐興産	100	1,488.00	148,800
カナモト	900	2,401.00	2,160,900
東京ドーム	2,300	806.00	1,853,800
西尾レントオール	600	2,251.00	1,350,600
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	2,500	28.00	70,000
トランス・コスモス	600	2,746.00	1,647,600
乃村工藝社	2,400	782.00	1,876,800
藤田観光	200	1,644.00	328,800
KNT - CTホールディングス	200	1,137.00	227,400
日本管財	600	2,009.00	1,205,400
トーカイ	600	2,205.00	1,323,000
白洋舎	100	2,626.00	262,600
セコム	5,900	9,430.00	55,637,000
セントラル警備保障	400	3,690.00	1,476,000
丹青社	1,000	718.00	718,000
メイテック	700	5,360.00	3,752,000
応用地質	700	1,260.00	882,000
船井総研ホールディングス	1,100	2,479.00	2,726,900
進学会ホールディングス	100	475.00	47,500
オオバ	300	824.00	247,200
いであ	100	1,928.00	192,800
学究社	100	1,086.00	108,600
ベネッセホールディングス	1,800	2,679.00	4,822,200
イオンディライト	700	2,882.00	2,017,400
ナック	200	1,016.00	203,200
ダイセキ	900	2,754.00	2,478,600
ステップ	100	1,587.00	158,700
合 計	6,190,540		13,473,695,290

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年10月30日現在

資産総額	13,186,041,732円
負債総額	124,454,898円
純資産総額（ - ）	13,061,586,834円
発行済口数	8,256,120口
1口当たり純資産額（ / ）	1,582.05円
（100口当たり純資産額）	（158,205円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者に対する特典

ありません。

ハ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ニ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ホ 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2020年10月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

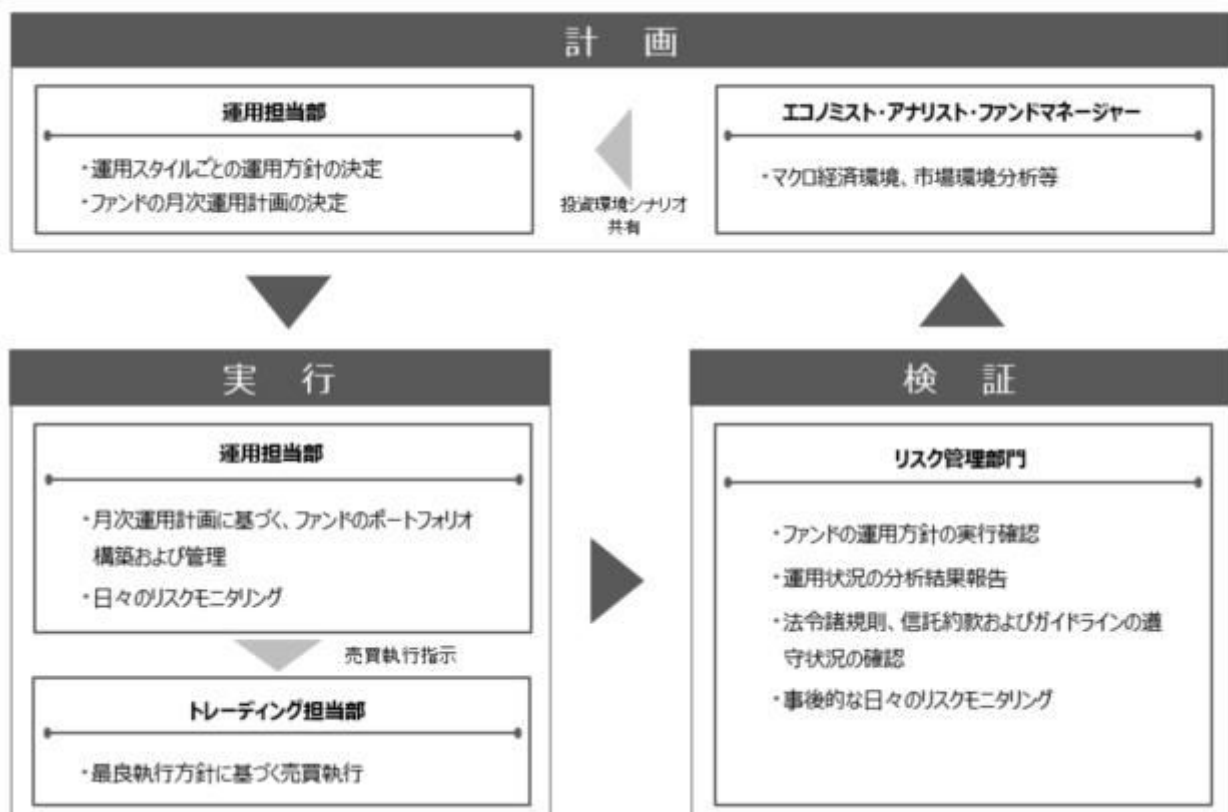
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年10月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	755	7,665,066
単位型株式投資信託	121	562,065
追加型公社債投資信託	1	28,300
単位型公社債投資信託	181	468,572
合計	1,058	8,724,005

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第35期（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第36期中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785

未収投資助言報酬		285,668	299,826
未収収益		44,150	37,702
その他の流動資産		31,771	40,119
流動資産合計		22,771,504	45,664,712
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		173,517	101,609
器具備品		751,471	783,224
土地		-	710
リース資産		-	968
建設仮勘定		-	66,498
有形固定資産合計		924,988	953,010
無形固定資産			
ソフトウェア		479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定		183,528	508,733
のれん		-	34,397,824
顧客関連資産		-	17,785,166
電話加入権		44	12,739
商標権		60	54
無形固定資産合計		663,501	53,613,651
投資その他の資産			
投資有価証券		10,829,628	19,436,480
関係会社株式		10,252,067	11,246,398
長期差入保証金		2,004,451	2,523,637
長期前払費用		97,107	113,852
会員権		7,819	90,479
繰延税金資産		1,426,381	-
貸倒引当金		-	20,750
投資その他の資産合計		24,617,457	33,390,098
固定資産合計		26,205,946	87,956,760
資産合計		48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

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

その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (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	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691

一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022
事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

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

法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

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

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

ては個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

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

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

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

3 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

建物	- 千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	- 千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	102,695千円

2 合併関連費用

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

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

3 本社移転費用

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

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

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

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

2019年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
2020年6月29日開催の第35回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

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

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369

子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

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

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度（2020年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839

(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
728,127	7,247	14,605

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位:千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842
確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位:千円)

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1
その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計

外部顧客への 営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269
----------------	------------	-----------	-----------	---------	------------

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

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

2.取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

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

1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

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

1. 企業結合の概要

(1)被取得企業の名称及び事業の内容

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

(2)企業結合を行った主な理由

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

(3)企業結合日

2019年4月1日

(4)企業結合の法的形式

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

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

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

2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1) 合併比率

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

(2) 合併比率の算定方法

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

(3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1) 発生したのれんの金額

37,043,811千円

(2) 発生原因

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

(3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	30,600,006
顧客分別金信託	300,033
前払費用	491,960
未収委託者報酬	8,462,795
未収運用受託報酬	2,637,333
未収投資助言報酬	403,508
未収収益	39,908
その他	127,104
流動資産合計	43,062,650
固定資産	
有形固定資産	1 2,622,154

無形固定資産		
のれん		33,074,831
顧客関連資産		16,728,528
その他		1,741,538
無形固定資産合計		51,544,898
投資その他の資産		
投資有価証券		21,128,629
関係会社株式		11,246,398
その他		2,228,340
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		34,582,618
固定資産合計		88,749,672
資産合計		131,812,323
負債の部		
流動負債		
リース債務		266
顧客からの預り金		2,366
その他の預り金		118,688
未払金		3,919,626
未払費用		4,532,572
未払法人税等		330,248
前受収益		28,358
賞与引当金		1,343,147
その他	2	25,119
流動負債合計		10,300,393
固定負債		
繰延税金負債		3,126,317
退職給付引当金		5,442,936
賞与引当金		7,383
その他		150,104
固定負債合計		8,726,742
負債合計		19,027,135
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		17,495,141
利益剰余金合計		19,316,346
株主資本合計		111,872,330
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		912,856
評価・換算差額等合計		912,856
純資産合計		112,785,187
負債純資産合計		131,812,323

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			23,512,538
運用受託報酬			4,131,413
投資助言報酬			637,750
その他の営業収益			115,543
営業収益計			28,397,245
営業費用			18,361,605
一般管理費	1		11,009,285
営業損失()			973,645
営業外収益	2		130,819
営業外費用	3		22,619
経常損失()			865,445
特別損失	4		179,016
税引前中間純損失()			1,044,462
法人税、住民税及び事業税			223,963
法人税等調整額			110,573
法人税等合計			113,390
中間純損失()			1,157,852

(3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当中間期変動額								
剰余金の配当								711,271
中間純損失()								1,157,852
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)								
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,869,124
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	17,495,141

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

当中間期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
中間純損失（ ）	1,157,852	1,157,852			1,157,852
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			535,001	535,001	535,001
当中間期変動額合計	1,869,124	1,869,124	535,001	535,001	1,334,122
当中間期末残高	19,316,346	111,872,330	912,856	912,856	112,785,187

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

其他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 2～50年

器具備品 3～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(追加情報)

当社は「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準第31号 2019年7月4日)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	991,194千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額109,041千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	288,293千円
無形固定資産	1,209,507千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	4,544千円
受取配当金	5,845千円
投資有価証券償還益	9,936千円
投資有価証券売却益	59,364千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	1千円
投資有価証券売却損	21,377千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	51,972千円
本社移転費用	127,044千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日
----------------------	------	---------	-------	----------------	----------------

(リース取引関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,192,635千円
1年超	4,091,860千円
合 計	5,284,495千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第36期中間会計期間(2020年9月30日)

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	30,600,006	30,600,006	-
(2)顧客分別金信託	300,033	300,033	-
(3)未収委託者報酬	8,462,795	8,462,795	-
(4)未収運用受託報酬	2,637,333	2,637,333	-
(5)未収投資助言報酬	403,508	403,508	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	21,083,260	21,083,260	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,006,627	2,006,627	-
資産計	65,493,564	65,493,564	-
(1)顧客からの預り金	2,366	2,366	-
(2)未払金			
未払手数料	3,761,585	3,761,585	-
負債計	3,763,951	3,763,951	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

 その他有価証券

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

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(7)投資その他の資産

 長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。
子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしていません。

また時価をもって中間貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、時価の算定に関する会計基準の適用指針第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載していません。

（有価証券関係）

第36期中間会計期間（2020年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載していません。

2. その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,043,944	14,414,570	1,629,373
小計	16,043,944	14,414,570	1,629,373
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,039,315	5,294,354	255,038
小計	5,039,315	5,294,354	255,038
合計	21,083,260	19,708,925	1,374,335

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 45,369千円）については、市場価格がないことから、記載していません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っていませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	23,512,538	4,131,413	637,750	115,543	28,397,245

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,329円93銭
1株当たり中間純損失()	34円18銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純損失については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

- 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
- 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

(追加情報)

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

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

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当た り配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

- (5)投資有価証券

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

- (6)長期差入保証金

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

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位：千円)

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

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 45,071千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自平成30年4月1日 至平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

(3) 退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

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

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

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	3,987,525	未払 手数料 料	573,578
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,969,101	未払 手数料 料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	4,328,153	未払 手数料 料	540,879
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,465,685	未払 手数料 料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

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

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円(2020年9月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2020年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	
J P モルガン証券株式会社	73,272百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	
B N P パリバ証券株式会社	102,025百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
三菱U F J モルガン・スタンレー証券株式会社	40,500百万円	
モルガン・スタンレーM U F G 証券株式会社	62,149百万円	

資本金の額は、2020年9月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当ありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 7月 2日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 7月 2日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年11月10日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMDAM トピックス上場投信の2020年4月9日から2020年10月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMDAM トピックス上場投信の2020年10月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月20日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間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中間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中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。