

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年10月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンド

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2019年10月22日から2020年 4月22日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情が

あるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

(1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ

ないファンドをいう。

- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

< ファンドの特色 >

東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

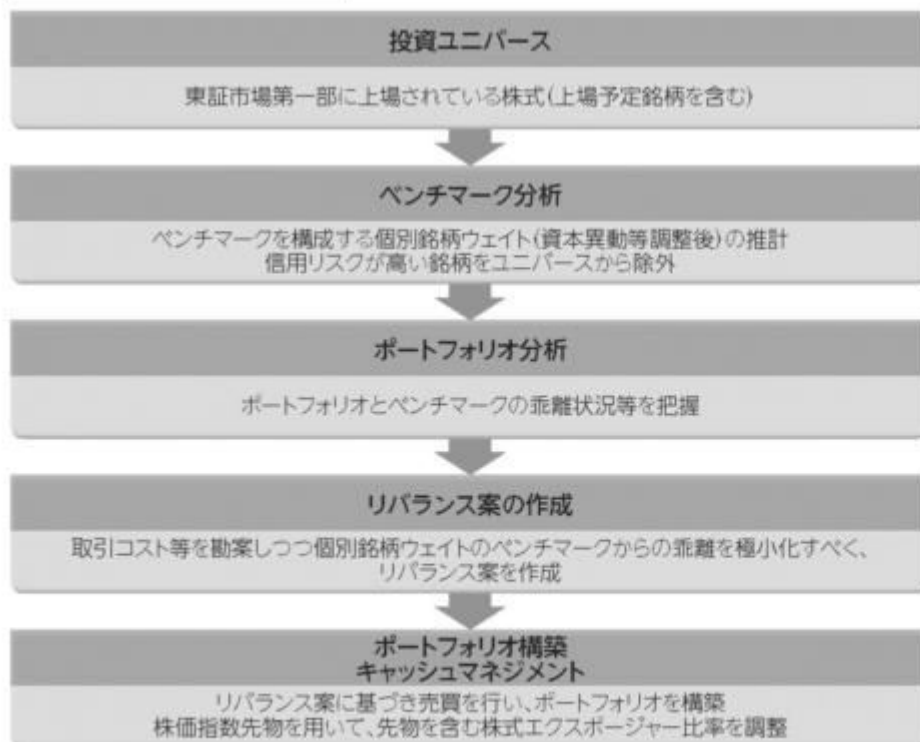
TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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

TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
 - 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
 - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

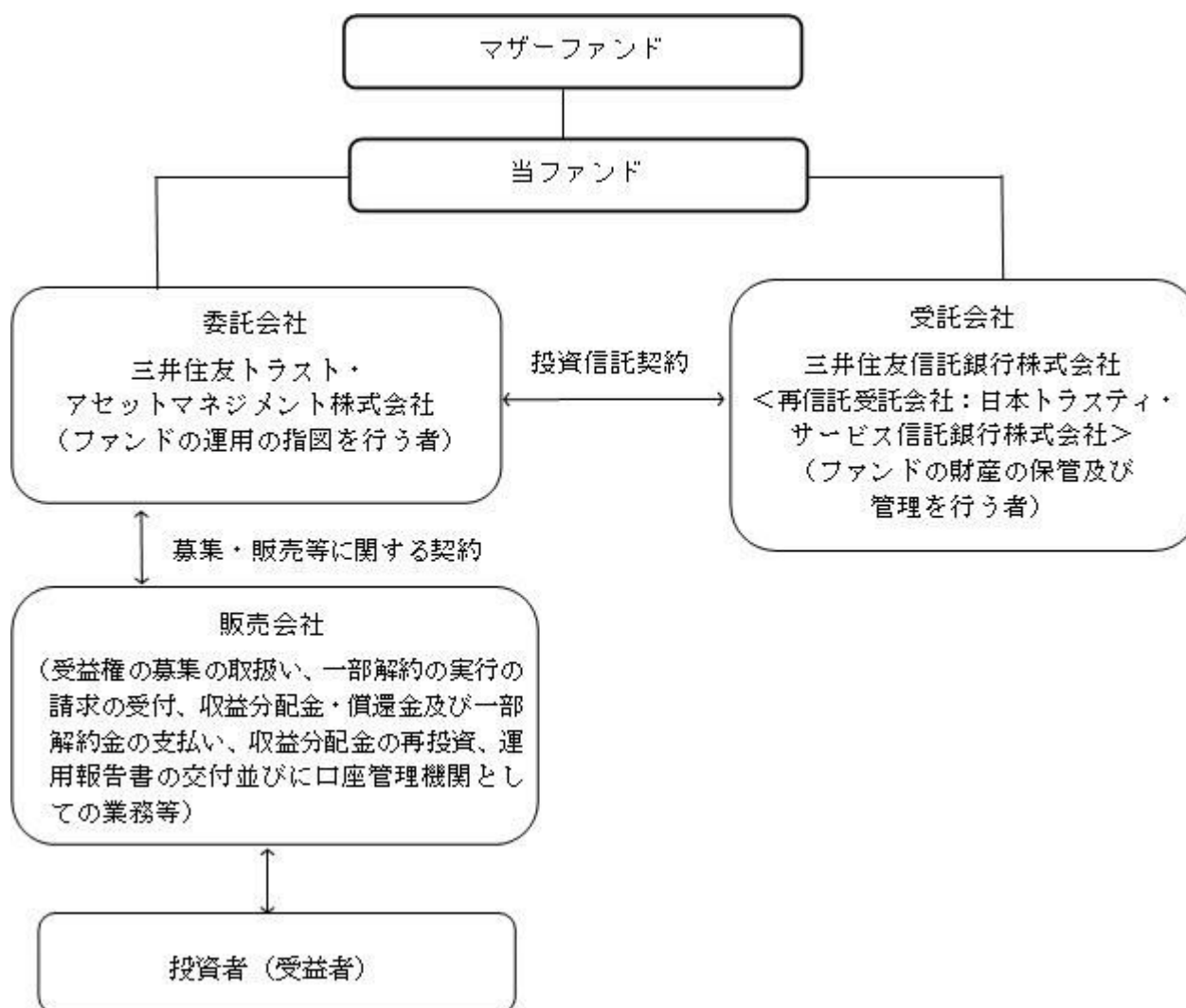
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2002年1月25日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年4月1日	当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継 当ファンドの名称を中央三井DC日本株式インデックスファンドからDC日本株式インデックスファンドに変更 当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2019年 8月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

当ファンドは、主としてわが国の株式に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．株式への実質投資は、東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- D．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき等、並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- E．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- F．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」の

受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1. から11. までの証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

B. 金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引（「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

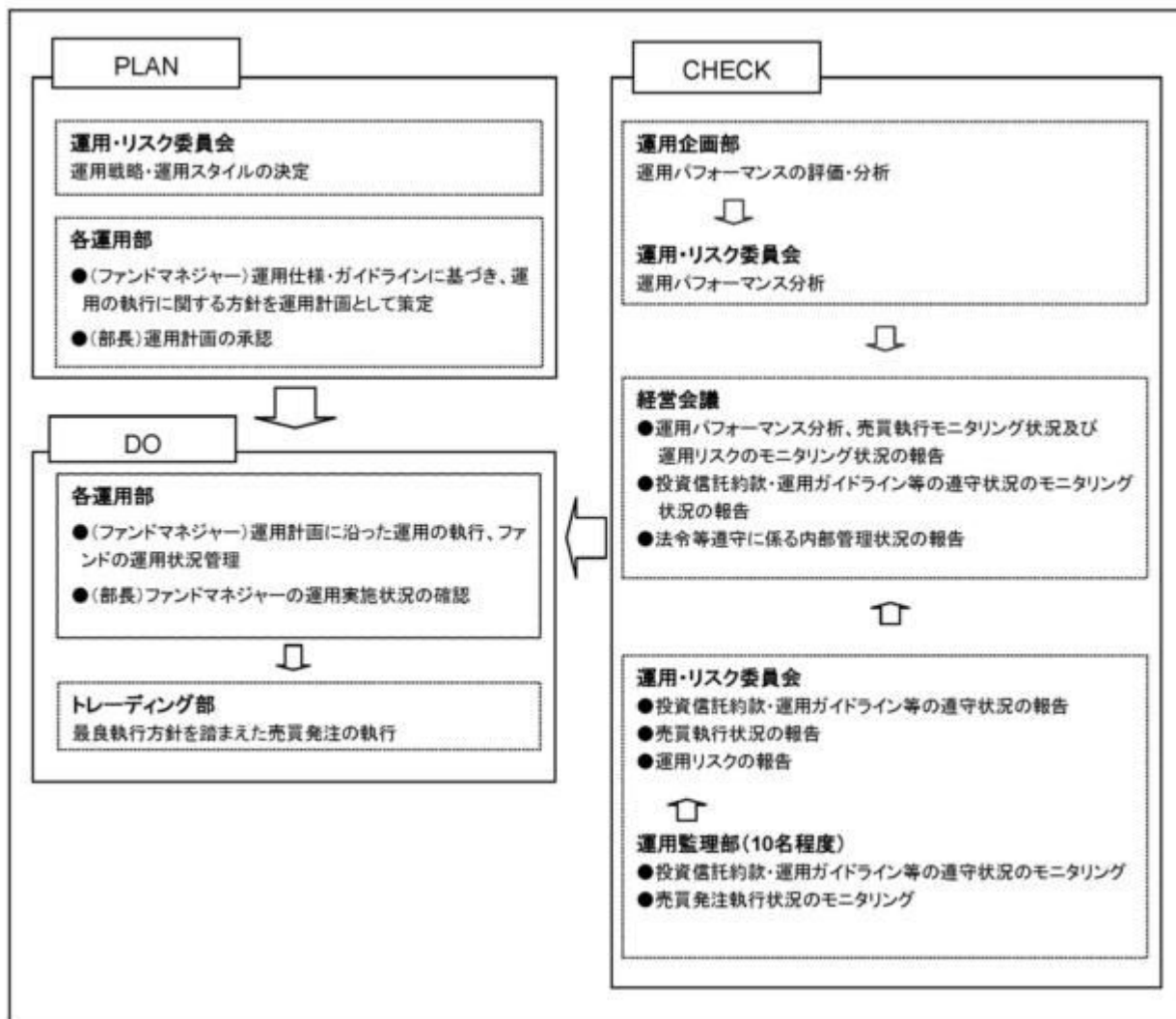
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は1月22日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- ・ 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- ・ 収益分配に充てず信託財産に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といい

ます。)への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H. 投資する株式等の範囲

イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ. 上記イ.の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

I. 信用取引の指図範囲

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

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

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

J. 先物取引等の運用指図

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

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

K. スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L. 金利先渡取引の運用指図

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

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

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

するものとします。

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

二．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

Q．再投資の指図

委託会社は、上記P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

R．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を

目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- ス．受託会社による資金の立替え
 - イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
 - ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
 - ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- ト．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ウ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

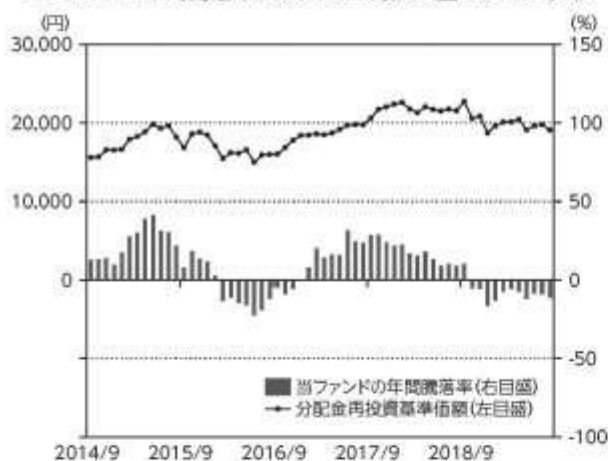
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

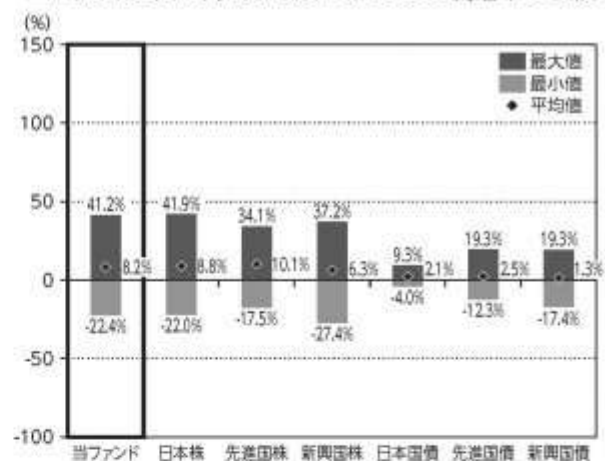
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2014年9月～2019年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式総額を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の規則財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜 0.55%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.242% (税抜 0.22%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.286% (税抜 0.26%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.077% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、投資信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
 組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
 財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
 上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2019年 8月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2019年8月30日現在の状況について記載してあります。

【D C日本株式インデックスファンド】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	541,494,861	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		266,990	0.05
合計(純資産総額)		541,761,851	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	335,270,176	1.6401	549,876,616	1.6151	541,494,861	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期計算期間末	(2010年 1月22日)	231,943,332	231,943,332	10,219	10,219
第9期計算期間末	(2011年 1月24日)	257,033,176	257,033,176	10,107	10,107
第10期計算期間末	(2012年 1月23日)	243,195,561	243,195,561	8,481	8,481
第11期計算期間末	(2013年 1月22日)	312,815,977	312,815,977	10,284	10,284
第12期計算期間末	(2014年 1月22日)	450,716,817	450,716,817	15,048	15,048
第13期計算期間末	(2015年 1月22日)	469,174,845	469,174,845	16,330	16,330
第14期計算期間末	(2016年 1月22日)	458,945,200	458,945,200	16,379	16,379
第15期計算期間末	(2017年 1月23日)	516,320,280	516,320,280	18,348	18,348
第16期計算期間末	(2018年 1月22日)	671,479,746	671,479,746	23,282	23,282
第17期計算期間末	(2019年 1月22日)	555,028,301	555,028,301	19,471	19,471
	2018年 8月末日	642,692,511		21,538	
	9月末日	671,779,129		22,726	
	10月末日	606,221,008		20,580	
	11月末日	611,619,279		20,843	
	12月末日	540,360,674		18,700	
	2019年 1月末日	558,322,915		19,609	
	2月末日	572,392,819		20,109	
	3月末日	577,425,775		20,117	

4月末日	579,701,872		20,442
5月末日	546,802,549		19,102
6月末日	561,910,513		19,615
7月末日	566,302,478		19,784
8月末日	541,761,851		19,107

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第8期計算期間	2009年 1月23日～2010年 1月22日	0
第9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	0
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	0
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	0
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	0
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第8期計算期間	2009年 1月23日～2010年 1月22日	20.0
第9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	1.1
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	16.1
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	21.3
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	46.3
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.5
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.3
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	26.9
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	16.4
第18期中間計算期間	2019年 1月23日～2019年 7月22日	1.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第8期計算期間	2009年 1月23日～2010年 1月22日	67,618,005	45,647,733	226,966,584
第9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	69,510,842	42,163,700	254,313,726
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	68,803,835	36,354,693	286,762,868
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	75,246,735	57,833,743	304,175,860
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	86,542,453	91,200,205	299,518,108
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	68,722,554	80,938,767	287,301,895
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	65,174,696	72,268,642	280,207,949
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	50,222,504	49,029,004	281,401,449
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	42,547,977	35,534,313	288,415,113
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	57,375,711	60,736,637	285,054,187
第18期中間計算期間	2019年 1月23日～2019年 7月22日	14,574,254	14,289,080	285,339,361

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	211,870,208,455	98.86
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,448,646,805	1.14
合計（純資産総額）		214,318,855,260	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
株価指数先物取引	買建	日本	2,340,500,000	1.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,090,500	6,780.53	7,394,172,474	6,960.00	7,589,880,000	3.54
日本	株式	ソニー	電気機器	656,800	5,355.63	3,517,582,528	6,042.00	3,968,385,600	1.85
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	761,900	3,958.29	3,015,827,824	4,824.00	3,675,405,600	1.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,644,100	575.04	3,820,686,680	510.40	3,391,148,640	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	656,800	4,562.00	2,996,325,885	5,096.00	3,347,052,800	1.56
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	854,300	4,461.85	3,811,764,909	3,590.00	3,066,937,000	1.43
日本	株式	キーエンス	電気機器	48,000	54,132.57	2,598,363,533	62,900.00	3,019,200,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	680,200	3,923.43	2,668,719,822	3,484.00	2,369,816,800	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	56,000	33,863.92	1,896,379,662	40,290.00	2,256,240,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	787,200	2,701.91	2,126,947,536	2,835.00	2,231,712,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	669,900	2,876.09	1,926,694,650	3,219.00	2,156,408,100	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	825,500	3,223.95	2,661,371,242	2,523.50	2,083,149,250	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,115,000	176.23	2,311,300,785	154.70	2,028,890,500	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	280,000	3,826.17	1,071,327,670	7,018.00	1,965,040,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	345,100	5,326.53	1,838,188,117	5,472.00	1,888,387,200	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,600	23,375.15	2,047,663,971	21,015.00	1,840,914,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	168,900	8,573.97	1,448,144,022	10,715.00	1,809,763,500	0.84
日本	株式	花王	化学	234,300	7,624.55	1,786,434,265	7,674.00	1,798,018,200	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	174,000	10,062.75	1,750,918,638	10,115.00	1,760,010,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	133,600	11,843.55	1,582,299,153	13,155.00	1,757,508,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	676,300	3,117.29	2,108,226,141	2,585.00	1,748,235,500	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	93,000	18,222.80	1,694,720,535	18,455.00	1,716,315,000	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,500	11,150.62	1,232,143,793	15,470.00	1,709,435,000	0.80
日本	株式	HOYA	精密機器	197,000	6,334.47	1,247,891,286	8,649.00	1,703,853,000	0.80
日本	株式	資生堂	化学	194,400	6,300.89	1,224,894,300	8,690.00	1,689,336,000	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	117,800	12,480.30	1,470,179,788	13,855.00	1,632,119,000	0.76
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	608,100	2,577.29	1,567,250,169	2,682.00	1,630,924,200	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	440,600	3,463.07	1,525,830,730	3,629.00	1,598,937,400	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	404,000	4,768.66	1,926,539,468	3,757.00	1,517,828,000	0.71
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,018,200	1,365.53	1,390,386,114	1,490.50	1,517,627,100	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11

鉱業	0.27	
建設業	2.81	
食料品	4.03	
繊維製品	0.63	
パルプ・紙	0.25	
化学	7.17	
医薬品	5.65	
石油・石炭製品	0.53	
ゴム製品	0.76	
ガラス・土石製品	0.78	
鉄鋼	0.77	
非鉄金属	0.70	
金属製品	0.54	
機械	4.83	
電気機器	13.55	
輸送用機器	7.68	
精密機器	2.16	
その他製品	2.22	
電気・ガス業	1.70	
陸運業	4.75	
海運業	0.15	
空運業	0.55	
倉庫・運輸関連業	0.19	
情報・通信業	8.97	
卸売業	4.83	
小売業	4.74	
銀行業	5.65	
証券、商品先物取引業	0.76	
保険業	2.26	
その他金融業	1.11	
不動産業	2.53	
サービス業	5.21	
	小計	98.86
合計		98.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	155円		2,370,616,500	2,340,500,000	1.09

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年1月25日
作成基準日：2019年8月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額 19,107円

純資産総額 5.42億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2015年1月	0円
2016年1月	0円
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
設定後 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.5%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.9%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.7%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.4%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.1%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.1%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.0%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※2019年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

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

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年 1月25日設定）

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

（4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年 1月23日から翌年 1月22日までとすることを原則とします。

ただし、第 1 計算期間は2002年 1月25日から2003年 1月22日までとします。

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社

の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2018年1月23日から2019年1月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2018年 1月22日現在)	第17期 (2019年 1月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	68,525
コール・ローン	2,095,054	2,002,495
親投資信託受益証券	671,144,389	554,749,015
未収入金	2,390,864	29,661
流動資産合計	675,630,307	556,849,696
資産合計	675,630,307	556,849,696
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,338,269	-
未払受託者報酬	230,661	231,817
未払委託者報酬	1,581,628	1,589,552
未払利息	3	5
その他未払費用	-	21
流動負債合計	4,150,561	1,821,395
負債合計	4,150,561	1,821,395
純資産の部		
元本等		
元本	288,415,113	285,054,187
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	383,064,633	269,974,114
(分配準備積立金)	250,650,975	213,348,026
元本等合計	671,479,746	555,028,301
純資産合計	671,479,746	555,028,301
負債純資産合計	675,630,307	556,849,696

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	2017年 1月24日 至 2018年 1月22日	自	2018年 1月23日 至 2019年 1月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		144,326,109		106,875,046
営業収益合計		144,326,109		106,875,046
営業費用				
支払利息		620		1,000
受託者報酬		433,044		470,647
委託者報酬		2,969,383		3,227,184
その他費用		-		66
営業費用合計		3,403,047		3,698,897
営業利益又は営業損失（ ）		140,923,062		110,573,943
経常利益又は経常損失（ ）		140,923,062		110,573,943
当期純利益又は当期純損失（ ）		140,923,062		110,573,943
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		6,014,257		10,625,300
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		234,918,831		383,064,633
剰余金増加額又は欠損金減少額		43,054,266		66,331,732
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		43,054,266		66,331,732
剰余金減少額又は欠損金増加額		29,817,269		79,473,608
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		29,817,269		79,473,608
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		383,064,633		269,974,114

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2018年 1月22日現在)	第17期 (2019年 1月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	288,415,113口	285,054,187口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3282円 (23,282円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9471円 (19,471円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2017年 1月24日 至 2018年 1月22日			第17期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,388,329円	費用控除後の配当等収益額	A	9,509,866円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	123,520,476円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	307,186,733円	収益調整金額	C	347,858,286円
分配準備積立金額	D	115,742,170円	分配準備積立金額	D	203,838,160円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	557,837,708円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	561,206,312円
当ファンドの期末残存口数	F	288,415,113口	当ファンドの期末残存口数	F	285,054,187口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,341円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,687円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第17期 (2019年 1月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2017年 1月24日 至 2018年 1月22日	自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	281,401,449円	288,415,113円
期中追加設定元本額	42,547,977円	57,375,711円
期中一部解約元本額	35,534,313円	60,736,637円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 (2018年 1月22日現在)	第17期 (2019年 1月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	139,661,098	96,183,461
合計	139,661,098	96,183,461

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	338,261,595	554,749,015	
合計		338,261,595	554,749,015	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	66,526,468
コール・ローン	1,944,083,755
株式	216,130,363,030
派生商品評価勘定	68,616,600
未収配当金	337,267,998
差入委託証拠金	50,680,000
流動資産合計	218,597,537,851
資産合計	218,597,537,851
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,618,160
前受金	30,014,100
未払解約金	248,738,330
未払利息	5,413
その他未払費用	108,015
流動負債合計	317,484,018
負債合計	317,484,018
純資産の部	
元本等	
元本	133,094,892,670
剰余金	
剰余金又は欠損金()	85,185,161,163
元本等合計	218,280,053,833
純資産合計	218,280,053,833
負債純資産合計	218,597,537,851

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,094,892,670口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.6400円 (1万口当たり純資産額) (16,400円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年 1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年 1月22日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 1月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	129,763,328,727円
期中追加設定元本額	15,240,674,659円
期中一部解約元本額	11,909,110,716円
期末元本額	133,094,892,670円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	773,278,833円
D C 日本株式インデックスファンド	338,261,595円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,289,882,348円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,174,196,021円
D C バランスファンド 3 0	2,276,064,046円
D C バランスファンド 5 0	3,321,338,562円
D C バランスファンド 7 0	1,695,738,061円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	613,089,728円
日本株式インデックス e	1,880,097,514円
インデックスコレクション（国内株式）	11,166,973,318円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	6,524,502,726円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	1,644,303,430円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,299,715,491円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,359,303,722円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,322,875,511円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,841,837,590円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	171,982,023円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,561,787,527円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	147,094,758円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	814,631,727円

区分	2019年 1月22日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	8,749,806円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	917,276,870円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,524,724,642円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	705,925,116円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,725,861,605円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	976,092,492円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	187,819,449円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,918,410,022円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	51,982,843円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	241,759,453円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,789,637,661円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	92,707,335円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	91,712,598円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	38,474,350円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	1,365,680,269円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	973,149,943円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	32,542,134円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	506,165,628円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	7,295,140,373円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	133,541,298円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	72,613,859円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	13,324,947円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	210,656,768円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	3,988,678円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2019年 1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		42,670,708,458
合計		42,670,708,458

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	2,129,350,900	-	2,159,365,000	30,014,100
合計		2,129,350,900	-	2,159,365,000	30,014,100

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,300	2,853.00	12,267,900	
日本水産	133,400	670.00	89,378,000	
マルハニチロ	19,300	3,805.00	73,436,500	
カネコ種苗	3,700	1,270.00	4,699,000	
サカタのタネ	16,200	3,545.00	57,429,000	
ホクト	11,200	1,986.00	22,243,200	
ホクリヨウ	1,700	609.00	1,035,300	
住石ホールディングス	27,600	100.00	2,760,000	
日鉄鉱業	3,100	4,610.00	14,291,000	
三井松島ホールディングス	5,600	1,432.00	8,019,200	
国際石油開発帝石	535,200	1,028.00	550,185,600	
石油資源開発	19,200	2,105.00	40,416,000	
K & O エナジーグループ	6,500	1,441.00	9,366,500	
ヒノキヤグループ	2,700	2,003.00	5,408,100	
ショーボンドホールディングス	10,400	7,670.00	79,768,000	
ミライト・ホールディングス	37,500	1,575.00	59,062,500	
タマホーム	8,300	1,206.00	10,009,800	
サンヨーホームズ	1,900	825.00	1,567,500	
日本アクア	3,000	408.00	1,224,000	
ファーストコーポレーション	3,600	751.00	2,703,600	
ベステラ	2,500	1,481.00	3,702,500	
T A T E R U	15,200	322.00	4,894,400	
スペースバリューホールディングス	16,300	946.00	15,419,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	667.00	1,667,500	
第一カッター興業	1,400	1,790.00	2,506,000	
安藤・間	86,000	729.00	62,694,000	

東急建設	39,600	1,005.00	39,798,000	
コムシスホールディングス	47,300	2,841.00	134,379,300	
ミサワホーム	10,900	767.00	8,360,300	
ピーアールホールディングス	10,500	341.00	3,580,500	
高松コンストラクショングループ	8,500	2,817.00	23,944,500	
東建コーポレーション	4,200	6,610.00	27,762,000	
ソネック	1,300	701.00	911,300	
ヤマウラ	5,500	978.00	5,379,000	
大成建設	109,700	5,130.00	562,761,000	
大林組	330,600	1,038.00	343,162,800	
清水建設	337,200	943.00	317,979,600	
飛鳥建設	9,800	1,466.00	14,366,800	
長谷工コーポレーション	138,000	1,227.00	169,326,000	
松井建設	12,500	771.00	9,637,500	
銭高組	1,300	5,330.00	6,929,000	
鹿島建設	258,300	1,542.00	398,298,600	
不動テトラ	8,400	1,699.00	14,271,600	
大末建設	4,300	927.00	3,986,100	
鉄建建設	6,900	2,608.00	17,995,200	
西松建設	23,900	2,498.00	59,702,200	
三井住友建設	74,400	694.00	51,633,600	
大豊建設	7,600	3,495.00	26,562,000	
前田建設工業	79,000	1,071.00	84,609,000	
佐田建設	8,200	401.00	3,288,200	
ナカノフドー建設	9,100	493.00	4,486,300	
奥村組	18,300	3,400.00	62,220,000	
東鉄工業	13,200	2,979.00	39,322,800	
イチケン	2,200	2,010.00	4,422,000	
富士ピー・エス	3,300	426.00	1,405,800	
浅沼組	4,100	3,020.00	12,382,000	
戸田建設	128,600	694.00	89,248,400	
熊谷組	15,900	3,360.00	53,424,000	
青木あすなろ建設	5,800	994.00	5,765,200	
北野建設	2,400	3,200.00	7,680,000	
植木組	1,600	2,244.00	3,590,400	
矢作建設工業	15,000	708.00	10,620,000	
ピーエス三菱	12,100	571.00	6,909,100	
日本ハウスホールディングス	20,500	428.00	8,774,000	
大東建託	39,200	15,180.00	595,056,000	
新日本建設	13,600	1,085.00	14,756,000	
N I P P O	29,100	2,089.00	60,789,900	
東亜道路工業	2,100	3,035.00	6,373,500	

前田道路	34,500	2,163.00	74,623,500
日本道路	3,000	6,230.00	18,690,000
東亜建設工業	8,400	1,419.00	11,919,600
若築建設	5,400	1,523.00	8,224,200
東洋建設	40,300	397.00	15,999,100
五洋建設	130,900	641.00	83,906,900
世紀東急工業	16,000	625.00	10,000,000
福田組	3,700	4,075.00	15,077,500
住友林業	78,300	1,456.00	114,004,800
日本基礎技術	10,800	343.00	3,704,400
巴コーポレーション	14,600	356.00	5,197,600
大和ハウス工業	304,900	3,579.00	1,091,237,100
ライト工業	21,200	1,406.00	29,807,200
積水ハウス	337,400	1,654.50	558,228,300
日特建設	9,100	655.00	5,960,500
北陸電気工事	5,200	929.00	4,830,800
ユアテック	17,600	892.00	15,699,200
四電工	1,700	2,619.00	4,452,300
中電工	14,200	2,341.00	33,242,200
関電工	50,100	1,053.00	52,755,300
きんでん	73,200	1,806.00	132,199,200
東京エネシス	11,400	998.00	11,377,200
トーエネック	3,100	3,075.00	9,532,500
住友電設	7,600	1,827.00	13,885,200
日本電設工業	18,800	2,363.00	44,424,400
協和エクシオ	43,100	2,661.00	114,689,100
新日本空調	9,500	1,732.00	16,454,000
九電工	21,700	3,850.00	83,545,000
三機工業	25,300	1,151.00	29,120,300
日揮	95,100	1,655.00	157,390,500
中外炉工業	3,300	2,058.00	6,791,400
ヤマト	10,500	483.00	5,071,500
太平電業	7,400	2,464.00	18,233,600
高砂熱学工業	28,000	1,792.00	50,176,000
三晃金属工業	1,500	2,825.00	4,237,500
朝日工業社	2,400	3,110.00	7,464,000
明星工業	19,900	737.00	14,666,300
大気社	15,100	3,000.00	45,300,000
ダイダン	7,600	2,544.00	19,334,400
日比谷総合設備	10,500	1,784.00	18,732,000
東芝プラントシステム	24,100	2,056.00	49,549,600
OSJBホールディングス	48,600	300.00	14,580,000

東洋エンジニアリング	12,200	708.00	8,637,600
新興プランテック	19,800	1,209.00	23,938,200
日本製粉	32,700	1,865.00	60,985,500
日清製粉グループ本社	111,400	2,259.00	251,652,600
日東富士製粉	700	5,520.00	3,864,000
昭和産業	9,100	2,975.00	27,072,500
鳥越製粉	8,500	807.00	6,859,500
中部飼料	12,000	1,206.00	14,472,000
フィード・ワン	66,200	178.00	11,783,600
東洋精糖	1,500	1,029.00	1,543,500
日本甜菜製糖	5,500	1,785.00	9,817,500
三井製糖	7,800	2,967.00	23,142,600
塩水港精糖	10,200	221.00	2,254,200
日新製糖	4,700	2,098.00	9,860,600
森永製菓	24,800	4,650.00	115,320,000
中村屋	2,600	4,220.00	10,972,000
江崎グリコ	29,600	5,390.00	159,544,000
名糖産業	4,600	1,268.00	5,832,800
井村屋グループ	4,200	2,551.00	10,714,200
不二家	5,500	2,310.00	12,705,000
山崎製パン	80,600	2,165.00	174,499,000
第一屋製パン	1,600	1,048.00	1,676,800
モロゾフ	1,700	5,070.00	8,619,000
亀田製菓	6,100	4,885.00	29,798,500
寿スピリッツ	10,400	4,285.00	44,564,000
カルビー	44,900	3,490.00	156,701,000
森永乳業	19,800	3,200.00	63,360,000
六甲バター	7,200	2,045.00	14,724,000
ヤクルト本社	73,000	7,440.00	543,120,000
明治ホールディングス	69,900	8,600.00	601,140,000
雪印メグミルク	23,700	2,917.00	69,132,900
プリマハム	13,900	2,073.00	28,814,700
日本ハム	42,600	4,580.00	195,108,000
林兼産業	3,100	584.00	1,810,400
丸大食品	10,500	1,850.00	19,425,000
S Foods	8,900	3,715.00	33,063,500
伊藤ハム米久ホールディングス	63,500	701.00	44,513,500
サッポロホールディングス	36,000	2,533.00	91,188,000
アサヒグループホールディングス	206,500	4,446.00	918,099,000
キリンホールディングス	446,000	2,529.50	1,128,157,000
宝ホールディングス	73,800	1,396.00	103,024,800
オエノンホールディングス	28,000	354.00	9,912,000

養命酒製造	3,000	2,068.00	6,204,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	75,500	3,325.00	251,037,500	
サントリー食品インターナショナル	66,000	4,895.00	323,070,000	
ダイドーグループホールディングス	5,600	5,470.00	30,632,000	
伊藤園	32,700	4,905.00	160,393,500	
キーコーヒー	9,700	2,039.00	19,778,300	
ユニカフェ	2,900	1,033.00	2,995,700	
ジャパンフーズ	1,400	1,213.00	1,698,200	
日清オイリオグループ	12,700	3,230.00	41,021,000	
不二製油グループ本社	24,000	3,560.00	85,440,000	
かどや製油	1,100	5,420.00	5,962,000	
J - オイルミルズ	5,100	3,890.00	19,839,000	
キッコーマン	65,000	5,920.00	384,800,000	
味の素	217,700	1,913.00	416,460,100	
キューピー	54,900	2,524.00	138,567,600	
ハウス食品グループ本社	37,600	3,965.00	149,084,000	
カゴメ	39,500	2,960.00	116,920,000	
焼津水産化学工業	4,700	1,047.00	4,920,900	
アリアケジャパン	9,000	6,830.00	61,470,000	
ピエトロ	1,300	1,645.00	2,138,500	
エバラ食品工業	2,300	2,135.00	4,910,500	
ニチレイ	51,200	3,010.00	154,112,000	
東洋水産	50,700	3,935.00	199,504,500	
イトアンド	3,300	1,589.00	5,243,700	
大冷	1,100	1,709.00	1,879,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,600	472.00	1,227,200	
日清食品ホールディングス	41,900	6,850.00	287,015,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,517.00	13,340,100	
一正蒲鉾	3,700	1,103.00	4,081,100	
フジッコ	10,700	2,398.00	25,658,600	
ロック・フィールド	10,600	1,591.00	16,864,600	
日本たばこ産業	569,300	2,759.50	1,570,983,350	
ケンコーマヨネーズ	5,400	2,036.00	10,994,400	
わらべや日洋ホールディングス	6,500	1,888.00	12,272,000	
なとり	5,400	1,649.00	8,904,600	
イフジ産業	1,700	656.00	1,115,200	
ピククルスコーポレーション	2,300	2,133.00	4,905,900	
北の達人コーポレーション	38,700	418.00	16,176,600	
ユーグレナ	41,800	617.00	25,790,600	
ミヨシ油脂	3,700	1,090.00	4,033,000	
理研ビタミン	4,700	3,500.00	16,450,000	
片倉工業	11,900	1,185.00	14,101,500	

グンゼ	6,900	4,720.00	32,568,000	
東洋紡	40,800	1,590.00	64,872,000	
ユニチカ	28,300	500.00	14,150,000	
富士紡ホールディングス	5,000	2,608.00	13,040,000	
倉敷紡績	9,200	2,432.00	22,374,400	
シキボウ	4,900	1,039.00	5,091,100	
日本毛織	31,800	814.00	25,885,200	
トーア紡コーポレーション	3,900	467.00	1,821,300	
ダイドーリミテッド	11,300	350.00	3,955,000	
帝国繊維	10,800	2,253.00	24,332,400	
帝人	78,500	1,842.00	144,597,000	
東レ	746,500	803.50	599,812,750	
サカイオーベックス	2,300	1,928.00	4,434,400	
住江織物	2,600	2,591.00	6,736,600	
日本フェルト	5,400	448.00	2,419,200	
イチカワ	1,400	1,375.00	1,925,000	
日東製網	1,100	1,290.00	1,419,000	
アツギ	7,800	960.00	7,488,000	
ダイニック	3,800	751.00	2,853,800	
セーレン	23,700	1,731.00	41,024,700	
ソトー	3,800	977.00	3,712,600	
東海染工	1,300	978.00	1,271,400	
小松マテーレ	15,900	773.00	12,290,700	
ワコールホールディングス	28,000	2,877.00	80,556,000	
ホギメディカル	12,000	3,620.00	43,440,000	
レナウン	26,700	102.00	2,723,400	
クラウディアホールディングス	2,400	474.00	1,137,600	
T S Iホールディングス	35,600	747.00	26,593,200	
マツオカコーポレーション	3,100	2,760.00	8,556,000	
ワールド	9,700	1,575.00	15,277,500	
三陽商会	5,700	1,793.00	10,220,100	
ナイガイ	3,500	516.00	1,806,000	
オンワードホールディングス	57,900	639.00	36,998,100	
ルックホールディングス	3,500	1,099.00	3,846,500	
ゴールドウイン	8,700	10,520.00	91,524,000	
デサント	23,500	1,850.00	43,475,000	
キング	5,000	499.00	2,495,000	
ヤマトインターナショナル	6,300	417.00	2,627,100	
特種東海製紙	6,100	4,040.00	24,644,000	
王子ホールディングス	433,200	616.00	266,851,200	
日本製紙	46,100	2,162.00	99,668,200	
三菱製紙	15,700	583.00	9,153,100	

北越コーポレーション	63,800	577.00	36,812,600
中越パルプ工業	4,000	1,363.00	5,452,000
巴川製紙所	3,100	1,074.00	3,329,400
大王製紙	46,900	1,367.00	64,112,300
阿波製紙	2,400	462.00	1,108,800
レンゴー	99,200	924.00	91,660,800
トーモク	5,900	1,659.00	9,788,100
ザ・パック	7,300	3,015.00	22,009,500
クラレ	162,400	1,704.00	276,729,600
旭化成	684,500	1,150.00	787,175,000
共和レザー	5,900	780.00	4,602,000
昭和電工	63,900	3,545.00	226,525,500
住友化学	757,400	575.00	435,505,000
住友精化	4,700	4,325.00	20,327,500
日産化学	59,100	5,880.00	347,508,000
ラサ工業	3,300	1,343.00	4,431,900
クレハ	8,900	6,570.00	58,473,000
多木化学	2,800	5,090.00	14,252,000
テイカ	7,800	1,768.00	13,790,400
石原産業	18,500	1,139.00	21,071,500
片倉コープアグリ	2,700	1,171.00	3,161,700
日東エフシー	5,900	734.00	4,330,600
日本曹達	15,200	2,911.00	44,247,200
東ソー	148,700	1,493.00	222,009,100
トクヤマ	27,700	2,586.00	71,632,200
セントラル硝子	21,000	2,273.00	47,733,000
東亜合成	60,400	1,221.00	73,748,400
大阪ソーダ	10,300	2,457.00	25,307,100
関東電化工業	22,800	845.00	19,266,000
デンカ	37,800	3,405.00	128,709,000
信越化学工業	169,600	8,532.00	1,447,027,200
日本カーバイド工業	3,200	1,666.00	5,331,200
堺化学工業	6,400	2,214.00	14,169,600
第一稀元素化学工業	7,700	877.00	6,752,900
エア・ウォーター	78,800	1,784.00	140,579,200
大陽日酸	79,300	1,771.00	140,440,300
日本化学工業	3,200	2,279.00	7,292,800
東邦アセチレン	1,400	1,388.00	1,943,200
日本パーカライズिंग	52,600	1,284.00	67,538,400
高圧ガス工業	15,300	758.00	11,597,400
チタン工業	1,200	2,440.00	2,928,000
四国化成工業	16,200	1,091.00	17,674,200

戸田工業	2,000	2,274.00	4,548,000
ステラ ケミファ	5,600	2,832.00	15,859,200
保土谷化学工業	3,200	2,067.00	6,614,400
日本触媒	16,200	7,370.00	119,394,000
大日精化工業	7,900	2,811.00	22,206,900
カネカ	25,600	4,240.00	108,544,000
三菱瓦斯化学	99,000	1,730.00	171,270,000
三井化学	87,300	2,653.00	231,606,900
J S R	96,600	1,708.00	164,992,800
東京応化工業	16,500	3,045.00	50,242,500
大阪有機化学工業	8,900	1,166.00	10,377,400
三菱ケミカルホールディングス	643,200	909.40	584,926,080
K Hネオケム	14,700	2,498.00	36,720,600
ダイセル	149,400	1,114.00	166,431,600
住友ベークライト	16,600	3,920.00	65,072,000
積水化学工業	210,300	1,582.00	332,694,600
日本ゼオン	86,800	1,071.00	92,962,800
アイカ工業	28,900	3,735.00	107,941,500
宇部興産	48,600	2,368.00	115,084,800
積水樹脂	15,900	1,945.00	30,925,500
タキロンシーアイ	20,800	583.00	12,126,400
旭有機材	6,500	1,537.00	9,990,500
日立化成	44,500	1,718.00	76,451,000
ニチバン	5,100	2,038.00	10,393,800
リケンテクノス	26,200	442.00	11,580,400
大倉工業	4,800	1,771.00	8,500,800
積水化成品工業	14,300	945.00	13,513,500
群栄化学工業	2,500	2,827.00	7,067,500
タイガースポリマー	5,000	610.00	3,050,000
ミライアル	2,700	1,082.00	2,921,400
ダイキアクシス	3,400	925.00	3,145,000
ダイキョーニシカワ	20,300	1,149.00	23,324,700
竹本容器	3,400	1,573.00	5,348,200
森六ホールディングス	5,200	2,586.00	13,447,200
日本化薬	61,200	1,389.00	85,006,800
カーリットホールディングス	10,100	763.00	7,706,300
日本精化	7,500	1,094.00	8,205,000
扶桑化学工業	9,800	2,081.00	20,393,800
トリケミカル研究所	2,200	4,330.00	9,526,000
A D E K A	47,400	1,756.00	83,234,400
日油	37,100	3,480.00	129,108,000
ハリマ化成グループ	7,800	948.00	7,394,400

花王	238,500	7,601.00	1,812,838,500
第一工業製薬	3,600	2,615.00	9,414,000
石原ケミカル	2,400	1,620.00	3,888,000
日華化学	3,200	968.00	3,097,600
ニイタカ	1,500	1,447.00	2,170,500
三洋化成工業	6,500	5,060.00	32,890,000
有機合成薬品工業	7,300	209.00	1,525,700
大日本塗料	10,900	1,002.00	10,921,800
日本ペイントホールディングス	79,400	3,535.00	280,679,000
関西ペイント	108,100	1,851.00	200,093,100
神東塗料	7,500	169.00	1,267,500
中国塗料	31,600	933.00	29,482,800
日本特殊塗料	7,200	1,315.00	9,468,000
藤倉化成	13,000	579.00	7,527,000
太陽ホールディングス	7,900	3,305.00	26,109,500
D I C	43,500	3,475.00	151,162,500
サカタインクス	21,000	1,201.00	25,221,000
東洋インキＳＣホールディングス	20,300	2,517.00	51,095,100
T & K T O K A	7,300	991.00	7,234,300
富士フィルムホールディングス	204,100	4,562.00	931,104,200
資生堂	195,200	6,240.00	1,218,048,000
ライオン	136,900	2,162.00	295,977,800
高砂香料工業	6,800	3,525.00	23,970,000
マンダム	22,100	2,907.00	64,244,700
ミルボン	12,100	4,550.00	55,055,000
ファンケル	43,700	2,308.00	100,859,600
コーセー	16,600	15,040.00	249,664,000
コタ	4,600	1,401.00	6,444,600
シーボン	1,200	2,661.00	3,193,200
ポーラ・オルビスホールディングス	41,900	2,948.00	123,521,200
ノエビアホールディングス	6,300	4,515.00	28,444,500
アジュバンコスメジャパン	2,200	932.00	2,050,400
エステー	6,900	1,803.00	12,440,700
アグロ カネショウ	3,900	2,072.00	8,080,800
コニシ	17,400	1,637.00	28,483,800
長谷川香料	11,700	1,580.00	18,486,000
星光P M C	6,400	787.00	5,036,800
小林製薬	27,500	6,980.00	191,950,000
荒川化学工業	8,800	1,338.00	11,774,400
メック	6,600	1,082.00	7,141,200
日本高純度化学	2,700	2,261.00	6,104,700
タカラバイオ	25,700	2,551.00	65,560,700

J C U	12,800	1,501.00	19,212,800
新田ゼラチン	6,000	678.00	4,068,000
O A Tアグリオ	1,300	1,973.00	2,564,900
デクセリアルズ	25,300	826.00	20,897,800
アース製薬	7,400	5,160.00	38,184,000
北興化学工業	9,700	546.00	5,296,200
大成ラミック	3,200	2,912.00	9,318,400
クミアイ化学工業	40,600	675.00	27,405,000
日本農薬	23,500	497.00	11,679,500
アキレス	7,200	2,022.00	14,558,400
有沢製作所	15,500	782.00	12,121,000
日東電工	74,200	5,792.00	429,766,400
レック	10,500	1,581.00	16,600,500
三光合成	7,300	352.00	2,569,600
きもと	16,200	186.00	3,013,200
藤森工業	8,800	2,912.00	25,625,600
前澤化成工業	6,500	1,046.00	6,799,000
ウェーブロックホールディングス	2,000	740.00	1,480,000
J S P	5,800	2,226.00	12,910,800
エフピコ	8,100	6,320.00	51,192,000
天馬	6,800	1,745.00	11,866,000
信越ポリマー	17,600	702.00	12,355,200
東リ	24,000	256.00	6,144,000
ニフコ	39,400	2,614.00	102,991,600
バルカー	8,000	2,266.00	18,128,000
ユニ・チャーム	208,300	3,371.00	702,179,300
協和発酵キリン	123,100	2,124.00	261,464,400
武田薬品工業	387,800	4,449.00	1,725,322,200
アステラス製薬	905,800	1,558.50	1,411,689,300
大日本住友製薬	72,800	3,755.00	273,364,000
塩野義製薬	128,500	6,553.00	842,060,500
田辺三菱製薬	102,700	1,615.00	165,860,500
わかもと製薬	11,200	286.00	3,203,200
あすか製薬	12,100	1,148.00	13,890,800
日本新薬	25,700	6,540.00	168,078,000
バイオフェルミン製薬	1,700	2,470.00	4,199,000
中外製薬	102,400	6,560.00	671,744,000
科研製薬	17,700	5,290.00	93,633,000
エーザイ	117,600	8,774.00	1,031,822,400
ロート製薬	50,400	2,904.00	146,361,600
小野薬品工業	232,000	2,398.50	556,452,000
久光製薬	29,000	5,550.00	160,950,000

持田製薬	7,400	9,770.00	72,298,000
参天製薬	186,300	1,523.00	283,734,900
扶桑薬品工業	3,500	2,761.00	9,663,500
日本ケミファ	1,300	3,280.00	4,264,000
ツムラ	30,400	3,150.00	95,760,000
日医工	25,200	1,678.00	42,285,600
キッセイ薬品工業	17,400	2,877.00	50,059,800
生化学工業	19,100	1,284.00	24,524,400
栄研化学	17,300	2,370.00	41,001,000
日水製薬	4,000	1,170.00	4,680,000
鳥居薬品	5,300	2,476.00	13,122,800
JCRファーマ	6,900	5,970.00	41,193,000
東和薬品	4,700	7,970.00	37,459,000
富士製薬工業	6,700	1,790.00	11,993,000
沢井製薬	20,200	5,720.00	115,544,000
ゼリア新薬工業	19,400	1,953.00	37,888,200
第一三共	281,100	3,756.00	1,055,811,600
キョーリン製薬ホールディングス	21,700	2,297.00	49,844,900
大幸薬品	4,300	1,812.00	7,791,600
ダイト	5,700	2,945.00	16,786,500
大塚ホールディングス	187,200	4,503.00	842,961,600
大正製薬ホールディングス	22,000	11,500.00	253,000,000
ペプチドリーム	45,200	4,340.00	196,168,000
日本コークス工業	80,900	95.00	7,685,500
昭和シェル石油	90,900	1,645.00	149,530,500
ニチレキ	12,600	985.00	12,411,000
ユシロ化学工業	5,000	1,189.00	5,945,000
ビーピー・カストロール	3,400	1,275.00	4,335,000
富士石油	23,100	306.00	7,068,600
MORESCO	3,500	1,552.00	5,432,000
出光興産	76,100	3,870.00	294,507,000
JXTGホールディングス	1,652,400	587.60	970,950,240
コスモエネルギーホールディングス	28,400	2,433.00	69,097,200
横浜ゴム	56,900	2,260.00	128,594,000
TOYO TIRE	50,400	1,463.00	73,735,200
ブリヂストン	302,000	4,269.00	1,289,238,000
住友ゴム工業	88,300	1,430.00	126,269,000
藤倉ゴム工業	8,400	451.00	3,788,400
オカモト	6,800	5,660.00	38,488,000
フコク	4,200	891.00	3,742,200
ニッタ	11,100	3,505.00	38,905,500
住友理工	19,000	1,042.00	19,798,000

三ツ星ベルト	12,900	2,077.00	26,793,300
バンドー化学	18,700	1,091.00	20,401,700
日東紡績	14,600	1,839.00	26,849,400
A G C	97,100	3,580.00	347,618,000
日本板硝子	44,700	949.00	42,420,300
石塚硝子	1,400	2,021.00	2,829,400
日本山村硝子	4,000	1,561.00	6,244,000
日本電気硝子	42,500	2,947.00	125,247,500
オハラ	3,800	1,673.00	6,357,400
住友大阪セメント	19,800	4,815.00	95,337,000
太平洋セメント	62,100	3,580.00	222,318,000
日本ヒューム	9,900	798.00	7,900,200
日本コンクリート工業	20,700	255.00	5,278,500
三谷セキサン	4,600	2,690.00	12,374,000
アジアパイルホールディングス	14,000	593.00	8,302,000
東海カーボン	89,200	1,448.00	129,161,600
日本カーボン	4,700	4,220.00	19,834,000
東洋炭素	5,800	2,204.00	12,783,200
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	5,130.00	30,267,000
T O T O	75,600	4,110.00	310,716,000
日本碍子	119,900	1,624.00	194,717,600
日本特殊陶業	82,800	2,162.00	179,013,600
M A R U W A	3,400	6,050.00	20,570,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,800.00	9,880,000
黒崎播磨	2,000	6,600.00	13,200,000
ヨータイ	8,400	637.00	5,350,800
イソライト工業	4,900	517.00	2,533,300
東京窯業	12,100	382.00	4,622,200
ニッカトー	4,400	911.00	4,008,400
フジミインコーポレーテッド	8,800	2,200.00	19,360,000
クニミネ工業	3,300	829.00	2,735,700
エーアンドエーマテリアル	1,800	987.00	1,776,600
ニチアス	26,900	1,924.00	51,755,600
ニチハ	13,700	2,657.00	36,400,900
新日鐵住金	451,400	1,985.50	896,254,700
神戸製鋼所	177,800	849.00	150,952,200
中山製鋼所	13,100	504.00	6,602,400
合同製鐵	4,600	1,727.00	7,944,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	262,400	1,887.50	495,280,000
東京製鐵	52,000	920.00	47,840,000
共英製鋼	11,000	1,770.00	19,470,000
大和工業	20,600	2,676.00	55,125,600

東京鐵鋼	3,900	1,174.00	4,578,600
大阪製鐵	6,300	1,866.00	11,755,800
淀川製鋼所	13,100	2,197.00	28,780,700
丸一鋼管	34,400	3,395.00	116,788,000
モリ工業	2,900	2,290.00	6,641,000
大同特殊鋼	15,900	4,505.00	71,629,500
日本高周波鋼業	3,500	541.00	1,893,500
日本冶金工業	80,400	253.00	20,341,200
山陽特殊製鋼	12,200	2,287.00	27,901,400
愛知製鋼	5,500	3,535.00	19,442,500
日立金属	104,700	1,189.00	124,488,300
日本金属	2,200	1,137.00	2,501,400
大平洋金属	6,600	2,762.00	18,229,200
新日本電工	58,200	219.00	12,745,800
栗本鐵工所	4,800	1,404.00	6,739,200
虹技	1,400	1,345.00	1,883,000
日本鑄鉄管	1,000	984.00	984,000
三菱製鋼	7,200	1,698.00	12,225,600
日亜鋼業	13,600	288.00	3,916,800
日本精線	1,400	3,540.00	4,956,000
エンビプロ・ホールディングス	2,000	505.00	1,010,000
シンニッタン	14,700	327.00	4,806,900
新家工業	2,200	1,564.00	3,440,800
大紀アルミニウム工業所	15,700	578.00	9,074,600
日本輕金属ホールディングス	265,200	225.00	59,670,000
三井金属鋳業	26,300	2,475.00	65,092,500
東邦亜鉛	5,400	3,350.00	18,090,000
三菱マテリアル	64,200	3,125.00	200,625,000
住友金属鋳山	133,100	3,166.00	421,394,600
D O W Aホールディングス	22,700	3,395.00	77,066,500
古河機械金属	16,100	1,304.00	20,994,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,300	1,658.00	18,735,400
東邦チタニウム	17,500	967.00	16,922,500
U A C J	14,800	2,323.00	34,380,400
C Kサンエツ	1,800	2,468.00	4,442,400
古河電気工業	28,100	3,115.00	87,531,500
住友電気工業	363,300	1,524.50	553,850,850
フジクラ	117,500	455.00	53,462,500
昭和電線ホールディングス	11,300	618.00	6,983,400
東京特殊電線	1,300	1,951.00	2,536,300
タツタ電線	19,500	499.00	9,730,500
カナレ電気	1,600	1,783.00	2,852,800

平河ヒューテック	4,000	1,106.00	4,424,000
リョービ	12,000	2,669.00	32,028,000
アーレスティ	12,100	648.00	7,840,800
アサヒホールディングス	18,300	2,336.00	42,748,800
稲葉製作所	5,500	1,288.00	7,084,000
宮地エンジニアリンググループ	2,900	1,942.00	5,631,800
トーカロ	25,100	905.00	22,715,500
アルファC o	3,300	1,265.00	4,174,500
SUMCO	107,400	1,270.00	136,398,000
川田テクノロジーズ	2,200	6,920.00	15,224,000
RS Technologies	2,000	2,398.00	4,796,000
東洋製罐グループホールディングス	61,900	2,599.00	160,878,100
ホッカンホールディングス	4,800	1,717.00	8,241,600
コロナ	5,200	1,071.00	5,569,200
横河ブリッジホールディングス	18,100	1,740.00	31,494,000
駒井ハルテック	1,800	1,881.00	3,385,800
高田機工	900	2,710.00	2,439,000
三和ホールディングス	100,400	1,149.00	115,359,600
文化シャッター	28,700	722.00	20,721,400
三協立山	13,500	1,388.00	18,738,000
アルインコ	7,500	955.00	7,162,500
東洋シャッター	2,300	628.00	1,444,400
LIXILグループ	143,400	1,480.00	212,232,000
日本フィルコン	7,200	553.00	3,981,600
ノーリツ	21,700	1,558.00	33,808,600
長府製作所	9,900	2,121.00	20,997,900
リンナイ	17,300	7,110.00	123,003,000
ダイニチ工業	5,100	646.00	3,294,600
日東精工	13,500	497.00	6,709,500
三洋工業	1,300	1,924.00	2,501,200
岡部	19,700	897.00	17,670,900
ジーテクト	10,700	1,545.00	16,531,500
東プレ	18,100	2,369.00	42,878,900
高周波熱錬	18,700	869.00	16,250,300
東京製綱	5,800	1,001.00	5,805,800
サンコール	5,300	610.00	3,233,000
モリテック スチール	7,300	418.00	3,051,400
パイオラックス	15,600	2,260.00	35,256,000
エイチワン	9,300	1,069.00	9,941,700
日本発條	96,800	1,000.00	96,800,000
中央発條	1,200	3,160.00	3,792,000
アドバネクス	1,200	1,616.00	1,939,200

立川ブラインド工業	4,200	1,029.00	4,321,800
三益半導体工業	7,600	1,257.00	9,553,200
日本ドライケミカル	2,600	1,134.00	2,948,400
日本製鋼所	29,600	1,917.00	56,743,200
三浦工業	42,100	2,598.00	109,375,800
タクマ	35,600	1,394.00	49,626,400
ツガミ	22,100	668.00	14,762,800
オークマ	12,400	5,440.00	67,456,000
東芝機械	11,100	2,165.00	24,031,500
アマダホールディングス	150,100	1,072.00	160,907,200
アイダエンジニアリング	27,200	769.00	20,916,800
滝澤鉄工所	2,900	1,458.00	4,228,200
F U J I	29,100	1,370.00	39,867,000
牧野フライス製作所	11,400	4,185.00	47,709,000
オーエスジー	48,000	2,091.00	100,368,000
ダイジェット工業	1,200	1,833.00	2,199,600
旭ダイヤモンド工業	25,800	671.00	17,311,800
D M G 森精機	61,600	1,394.00	85,870,400
ソディック	21,200	806.00	17,087,200
ディスコ	13,200	14,260.00	188,232,000
日東工器	5,200	2,124.00	11,044,800
日進工具	2,900	2,358.00	6,838,200
パンチ工業	6,500	515.00	3,347,500
富士ダイス	4,100	633.00	2,595,300
豊和工業	5,500	778.00	4,279,000
O K K	4,100	811.00	3,325,100
東洋機械金属	6,700	583.00	3,906,100
島精機製作所	13,500	3,525.00	47,587,500
オプトラン	9,500	1,707.00	16,216,500
N C ホールディングス	3,000	542.00	1,626,000
フリュー	7,600	1,011.00	7,683,600
ヤマシンフィルタ	16,900	676.00	11,424,400
日阪製作所	12,000	821.00	9,852,000
やまびこ	18,800	1,090.00	20,492,000
平田機工	4,600	6,010.00	27,646,000
ペガサスミシン製造	8,900	719.00	6,399,100
マルマエ	2,700	680.00	1,836,000
タツモ	2,900	721.00	2,090,900
ナブテスコ	53,500	2,699.00	144,396,500
三井海洋開発	10,300	2,464.00	25,379,200
レオン自動機	9,500	1,348.00	12,806,000
S M C	28,800	35,190.00	1,013,472,000

新川	7,000	362.00	2,534,000
ホソカワミクロン	3,400	4,155.00	14,127,000
ユニオンツール	4,200	3,005.00	12,621,000
オイレス工業	13,600	1,843.00	25,064,800
日精エー・エス・ビー機械	2,800	3,660.00	10,248,000
サトーホールディングス	11,700	2,651.00	31,016,700
技研製作所	6,700	3,245.00	21,741,500
日本エアーテック	3,000	595.00	1,785,000
カワタ	1,900	1,391.00	2,642,900
日精樹脂工業	8,200	944.00	7,740,800
オカダアイヨン	3,200	1,505.00	4,816,000
ワイエイシイホールディングス	3,700	639.00	2,364,300
小松製作所	444,900	2,731.50	1,215,244,350
住友重機械工業	56,300	3,700.00	208,310,000
日立建機	39,400	2,726.00	107,404,400
日工	2,800	2,314.00	6,479,200
巴工業	4,200	2,467.00	10,361,400
井関農機	9,900	1,612.00	15,958,800
TOWA	8,100	655.00	5,305,500
丸山製作所	2,200	1,322.00	2,908,400
北川鉄工所	4,400	2,271.00	9,992,400
ローツェ	4,200	1,572.00	6,602,400
タカキタ	3,300	660.00	2,178,000
クボタ	527,100	1,715.00	903,976,500
荏原実業	2,900	2,202.00	6,385,800
三菱化工機	3,400	1,499.00	5,096,600
月島機械	19,600	1,382.00	27,087,200
帝国電機製作所	6,700	1,185.00	7,939,500
新東工業	23,500	935.00	21,972,500
澁谷工業	8,600	3,635.00	31,261,000
アイチ コーポレーション	17,300	596.00	10,310,800
小森コーポレーション	26,800	1,173.00	31,436,400
鶴見製作所	7,700	1,947.00	14,991,900
住友精密工業	1,600	3,250.00	5,200,000
酒井重工業	1,900	2,334.00	4,434,600
荏原製作所	43,600	2,834.00	123,562,400
石井鐵工所	1,600	1,833.00	2,932,800
西島製作所	10,000	941.00	9,410,000
北越工業	9,900	1,085.00	10,741,500
ダイキン工業	134,100	11,780.00	1,579,698,000
オルガノ	3,600	2,537.00	9,133,200
トーヨーカネツ	3,700	2,411.00	8,920,700

栗田工業	53,200	2,703.00	143,799,600	
椿本チエイン	12,900	4,000.00	51,600,000	
大同工業	4,800	936.00	4,492,800	
木村化工機	8,400	363.00	3,049,200	
アネスト岩田	15,300	953.00	14,580,900	
ダイフク	54,100	5,210.00	281,861,000	
サムコ	2,600	942.00	2,449,200	
加藤製作所	5,100	2,724.00	13,892,400	
油研工業	1,700	1,931.00	3,282,700	
タダノ	47,600	1,194.00	56,834,400	
フジテック	35,700	1,200.00	42,840,000	
C K D	27,300	1,003.00	27,381,900	
キトー	7,400	1,608.00	11,899,200	
平和	27,400	2,269.00	62,170,600	
理想科学工業	8,700	1,668.00	14,511,600	
S A N K Y O	24,600	4,190.00	103,074,000	
日本金銭機械	10,900	985.00	10,736,500	
マースグループホールディングス	6,100	2,214.00	13,505,400	
福島工業	6,100	3,765.00	22,966,500	
オーイズミ	4,000	373.00	1,492,000	
ダイコク電機	4,400	1,554.00	6,837,600	
竹内製作所	16,400	1,890.00	30,996,000	
アマノ	28,100	2,247.00	63,140,700	
J U K I	13,700	1,184.00	16,220,800	
サンデンホールディングス	11,700	824.00	9,640,800	
蛇の目マシン工業	8,600	499.00	4,291,400	
マックス	15,100	1,407.00	21,245,700	
グローリー	27,200	2,705.00	73,576,000	
新晃工業	9,100	1,454.00	13,231,400	
大和冷機工業	14,200	1,150.00	16,330,000	
セガサミーホールディングス	97,400	1,574.00	153,307,600	
日本ピストンリング	3,500	1,773.00	6,205,500	
リケン	4,500	4,890.00	22,005,000	
T P R	13,200	2,309.00	30,478,800	
ツバキ・ナカシマ	14,800	1,770.00	26,196,000	
ホシザキ	27,800	8,160.00	226,848,000	
大豊工業	7,800	996.00	7,768,800	
日本精工	201,800	1,035.00	208,863,000	
N T N	211,100	349.00	73,673,900	
ジェイテクト	94,200	1,381.00	130,090,200	
不二越	9,100	4,165.00	37,901,500	
日本トムソン	29,100	523.00	15,219,300	

THK	61,200	2,378.00	145,533,600
ユーシン精機	7,400	920.00	6,808,000
前澤給装工業	3,700	1,857.00	6,870,900
イーグル工業	12,100	1,292.00	15,633,200
前澤工業	6,900	357.00	2,463,300
日本ピラー工業	9,900	1,335.00	13,216,500
キッツ	39,800	899.00	35,780,200
マキタ	119,600	4,025.00	481,390,000
日立造船	78,400	365.00	28,616,000
三菱重工業	164,700	4,209.00	693,222,300
IHI	75,500	3,275.00	247,262,500
スター精密	16,900	1,574.00	26,600,600
日清紡ホールディングス	54,900	924.00	50,727,600
イビデン	60,300	1,534.00	92,500,200
コニカミノルタ	214,900	1,041.00	223,710,900
ブラザー工業	128,100	1,768.00	226,480,800
ミネベアミツミ	182,500	1,638.00	298,935,000
日立製作所	442,400	3,450.00	1,526,280,000
三菱電機	982,600	1,339.50	1,316,192,700
富士電機	63,800	3,235.00	206,393,000
東洋電機製造	4,000	1,320.00	5,280,000
安川電機	114,000	2,936.00	334,704,000
シンフォニアテクノロジー	13,900	1,336.00	18,570,400
明電舎	19,600	1,428.00	27,988,800
オリジン電気	2,800	1,737.00	4,863,600
山洋電気	4,800	3,985.00	19,128,000
デンヨー	9,300	1,406.00	13,075,800
東芝テック	12,400	2,599.00	32,227,600
芝浦メカトロニクス	1,800	3,505.00	6,309,000
マブチモーター	27,300	3,510.00	95,823,000
日本電産	118,200	12,420.00	1,468,044,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,300	1,734.00	9,190,200
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,185.00	4,029,000
東光高岳	5,000	1,402.00	7,010,000
ダブル・スコープ	14,600	1,188.00	17,344,800
ダイヘン	10,900	2,359.00	25,713,100
ヤーマン	14,400	1,342.00	19,324,800
JVCケンウッド	76,100	247.00	18,796,700
ミマキエンジニアリング	8,900	777.00	6,915,300
第一精工	4,200	1,180.00	4,956,000
日新電機	23,400	872.00	20,404,800
大崎電気工業	19,900	715.00	14,228,500

オムロン	104,500	4,275.00	446,737,500
日東工業	15,900	1,947.00	30,957,300
I D E C	13,300	2,013.00	26,772,900
不二電機工業	1,300	1,315.00	1,709,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,400	2,335.00	82,659,000
サクサホールディングス	2,600	1,829.00	4,755,400
メルコホールディングス	4,100	3,490.00	14,309,000
テクノメディカ	2,100	2,083.00	4,374,300
日本電気	127,200	3,580.00	455,376,000
富士通	94,700	7,083.00	670,760,100
沖電気工業	42,800	1,385.00	59,278,000
岩崎通信機	4,500	790.00	3,555,000
電気興業	5,300	2,417.00	12,810,100
サンケン電気	11,600	2,185.00	25,346,000
ナカヨ	2,100	1,406.00	2,952,600
アイホン	5,600	1,651.00	9,245,600
ルネサスエレクトロニクス	102,300	583.00	59,640,900
セイコーエプソン	122,100	1,644.00	200,732,400
ワコム	71,700	457.00	32,766,900
アルバック	22,700	3,300.00	74,910,000
アクセル	4,500	497.00	2,236,500
E I Z O	9,100	4,045.00	36,809,500
日本信号	25,300	929.00	23,503,700
京三製作所	21,800	433.00	9,439,400
能美防災	13,100	1,837.00	24,064,700
ホーチキ	6,500	1,104.00	7,176,000
星和電機	4,500	390.00	1,755,000
エレコム	9,100	2,879.00	26,198,900
パナソニック	1,122,600	1,064.50	1,195,007,700
シャープ	97,400	1,187.00	115,613,800
アンリツ	63,400	1,580.00	100,172,000
富士通ゼネラル	30,200	1,483.00	44,786,600
ソニー	658,800	5,352.00	3,525,897,600
T D K	51,400	7,660.00	393,724,000
帝国通信工業	4,600	1,171.00	5,386,600
タムラ製作所	38,400	567.00	21,772,800
アルプスアルパイン	102,300	2,169.00	221,888,700
池上通信機	3,000	1,201.00	3,603,000
日本電波工業	8,400	399.00	3,351,600
鈴木	5,100	618.00	3,151,800
日本トリム	1,900	5,860.00	11,134,000
ローランド ディー . ジー .	5,000	2,072.00	10,360,000

フォスター電機	11,700	1,389.00	16,251,300
クラリオン	9,900	2,489.00	24,641,100
S M K	2,800	2,238.00	6,266,400
ヨコオ	7,200	1,348.00	9,705,600
ホシデン	29,300	772.00	22,619,600
ヒロセ電機	14,100	11,360.00	160,176,000
日本航空電子工業	22,700	1,355.00	30,758,500
T O A	10,800	1,004.00	10,843,200
マクセルホールディングス	21,300	1,510.00	32,163,000
古野電気	12,900	920.00	11,868,000
ユニデンホールディングス	3,000	2,080.00	6,240,000
スミダコーポレーション	8,600	1,249.00	10,741,400
アイコム	5,600	2,159.00	12,090,400
リオン	4,700	1,691.00	7,947,700
本多通信工業	8,700	482.00	4,193,400
横河電機	98,500	1,954.00	192,469,000
新電元工業	3,500	3,950.00	13,825,000
アズビル	63,500	2,191.00	139,128,500
東亜ディーケーケー	5,000	738.00	3,690,000
日本光電工業	43,400	3,420.00	148,428,000
チノー	3,500	1,228.00	4,298,000
共和電業	10,800	364.00	3,931,200
日本電子材料	4,300	640.00	2,752,000
堀場製作所	19,500	5,040.00	98,280,000
アドバンテスト	67,100	2,183.00	146,479,300
小野測器	4,800	581.00	2,788,800
エスベック	8,800	1,973.00	17,362,400
キーエンス	48,200	53,760.00	2,591,232,000
日置電機	5,200	3,525.00	18,330,000
シスメックス	76,600	5,909.00	452,629,400
日本マイクロニクス	16,200	727.00	11,777,400
メガチップス	7,800	2,776.00	21,652,800
O B A R A G R O U P	5,800	3,650.00	21,170,000
澤藤電機	1,300	1,492.00	1,939,600
原田工業	3,300	839.00	2,768,700
コーセル	13,900	964.00	13,399,600
イリソ電子工業	9,100	4,345.00	39,539,500
オブテックスグループ	17,400	1,870.00	32,538,000
千代田インテグレ	4,300	1,977.00	8,501,100
アイ・オー・データ機器	4,200	1,139.00	4,783,800
レーザーテック	20,200	3,090.00	62,418,000
スタンレー電気	69,600	3,155.00	219,588,000

岩崎電気	3,900	1,352.00	5,272,800
ウシオ電機	59,800	1,222.00	73,075,600
岡谷電機産業	7,400	382.00	2,826,800
ハリオス テクノ ホールディング	9,500	654.00	6,213,000
エノモト	2,300	808.00	1,858,400
日本セラミック	10,100	2,468.00	24,926,800
遠藤照明	5,200	715.00	3,718,000
古河電池	7,100	690.00	4,899,000
双信電機	5,400	362.00	1,954,800
山一電機	7,300	1,177.00	8,592,100
図研	6,600	1,490.00	9,834,000
日本電子	19,500	1,844.00	35,958,000
カシオ計算機	87,100	1,374.00	119,675,400
ファナック	93,400	18,185.00	1,698,479,000
日本シイエムケイ	24,500	652.00	15,974,000
エンプラス	4,500	3,060.00	13,770,000
大真空	3,800	957.00	3,636,600
ローム	47,500	7,000.00	332,500,000
浜松ホトニクス	70,500	3,665.00	258,382,500
三井ハイテック	11,100	861.00	9,557,100
新光電気工業	33,400	713.00	23,814,200
京セラ	149,800	5,962.00	893,107,600
太陽誘電	43,800	1,581.00	69,247,800
村田製作所	103,100	14,050.00	1,448,555,000
ユーシン	14,800	982.00	14,533,600
双葉電子工業	16,200	1,678.00	27,183,600
北陸電気工業	3,900	995.00	3,880,500
ニチコン	31,300	893.00	27,950,900
日本ケミコン	7,000	2,036.00	14,252,000
K O A	15,000	1,339.00	20,085,000
市光工業	14,800	600.00	8,880,000
小糸製作所	58,900	5,920.00	348,688,000
ミツバ	18,500	685.00	12,672,500
S C R E E Nホールディングス	17,100	5,110.00	87,381,000
キャノン電子	9,100	1,906.00	17,344,600
キャノン	528,900	3,070.00	1,623,723,000
リコー	295,600	1,113.00	329,002,800
象印マホービン	18,500	1,132.00	20,942,000
M U T O Hホールディングス	1,400	1,925.00	2,695,000
東京エレクトロン	65,500	14,260.00	934,030,000
トヨタ紡織	34,400	1,739.00	59,821,600
芦森工業	2,000	1,431.00	2,862,000

ユニプレス	19,000	2,012.00	38,228,000
豊田自動織機	79,500	5,430.00	431,685,000
モリタホールディングス	17,200	1,876.00	32,267,200
三櫻工業	12,600	605.00	7,623,000
デンソー	216,300	5,032.00	1,088,421,600
東海理化電機製作所	25,900	1,971.00	51,048,900
三井E & Sホールディングス	34,000	1,181.00	40,154,000
川崎重工業	76,400	2,607.00	199,174,800
名村造船所	29,500	461.00	13,599,500
日本車輛製造	3,500	2,337.00	8,179,500
三菱ロジスネクスト	11,700	1,083.00	12,671,100
近畿車輛	1,400	1,937.00	2,711,800
日産自動車	1,158,600	913.80	1,058,728,680
いすゞ自動車	310,500	1,592.00	494,316,000
トヨタ自動車	1,094,800	6,784.00	7,427,123,200
日野自動車	122,700	1,112.00	136,442,400
三菱自動車工業	363,600	663.00	241,066,800
エフテック	6,700	985.00	6,599,500
レシップホールディングス	3,400	702.00	2,386,800
G M B	1,900	951.00	1,806,900
ファルテック	1,700	776.00	1,319,200
武蔵精密工業	23,900	1,592.00	38,048,800
日産車体	19,200	1,000.00	19,200,000
新明和工業	45,800	1,478.00	67,692,400
極東開発工業	19,600	1,531.00	30,007,600
日信工業	18,000	1,491.00	26,838,000
トピー工業	8,100	2,393.00	19,383,300
ティラド	3,600	2,342.00	8,431,200
曙ブレーキ工業	53,900	214.00	11,534,600
タチエス	16,700	1,537.00	25,667,900
N O K	52,800	1,633.00	86,222,400
フタバ産業	27,400	590.00	16,166,000
K Y B	9,600	2,864.00	27,494,400
大同メタル工業	16,000	800.00	12,800,000
プレス工業	48,800	581.00	28,352,800
ミクニ	12,600	538.00	6,778,800
太平洋工業	20,600	1,519.00	31,291,400
ケーヒン	22,600	1,962.00	44,341,200
河西工業	12,100	863.00	10,442,300
アイシン精機	80,900	4,315.00	349,083,500
マツダ	308,300	1,204.50	371,347,350
今仙電機製作所	9,200	1,018.00	9,365,600

本田技研工業	828,700	3,239.00	2,684,159,300
スズキ	179,700	5,847.00	1,050,705,900
S U B A R U	305,000	2,557.50	780,037,500
安永	4,700	1,509.00	7,092,300
ヤマハ発動機	138,700	2,314.00	320,951,800
ショーワ	23,200	1,403.00	32,549,600
T B K	11,400	413.00	4,708,200
エクセディ	13,400	2,705.00	36,247,000
豊田合成	31,700	2,388.00	75,699,600
愛三工業	15,100	752.00	11,355,200
盟和産業	1,500	1,058.00	1,587,000
日本プラスト	7,500	761.00	5,707,500
ヨロズ	9,200	1,513.00	13,919,600
エフ・シー・シー	17,700	2,723.00	48,197,100
シマノ	39,600	15,400.00	609,840,000
テイ・エス テック	22,800	3,180.00	72,504,000
ジャムコ	4,900	2,549.00	12,490,100
テルモ	139,000	6,210.00	863,190,000
クリエートメディック	3,200	995.00	3,184,000
日機装	31,700	988.00	31,319,600
島津製作所	126,400	2,373.00	299,947,200
J M S	9,100	582.00	5,296,200
長野計器	7,500	797.00	5,977,500
ブイ・テクノロジー	2,300	14,130.00	32,499,000
東京計器	6,100	928.00	5,660,800
愛知時計電機	1,300	3,840.00	4,992,000
インターアクション	5,100	1,972.00	10,057,200
オーバル	9,300	234.00	2,176,200
東京精密	17,800	2,871.00	51,103,800
マニー	12,000	4,910.00	58,920,000
ニコン	171,200	1,695.00	290,184,000
トプコン	52,800	1,530.00	80,784,000
オリンパス	146,300	4,540.00	664,202,000
理研計器	8,700	2,016.00	17,539,200
タムロン	8,700	1,705.00	14,833,500
H O Y A	197,800	6,276.00	1,241,392,800
シード	4,100	1,372.00	5,625,200
ノーリツ鋼機	7,700	1,641.00	12,635,700
エー・アンド・デイ	8,700	651.00	5,663,700
朝日インテック	35,500	4,750.00	168,625,000
シチズン時計	107,500	563.00	60,522,500
リズム時計工業	3,200	1,823.00	5,833,600

大研医器	7,500	617.00	4,627,500
メニコン	13,500	2,851.00	38,488,500
シンシア	1,400	489.00	684,600
松風	4,700	1,102.00	5,179,400
セイコーホールディングス	15,200	2,338.00	35,537,600
ニプロ	68,000	1,437.00	97,716,000
中本パックス	2,700	1,688.00	4,557,600
スノーピーク	3,600	1,200.00	4,320,000
パラマウントベッドホールディングス	11,300	4,630.00	52,319,000
トランザクション	5,200	716.00	3,723,200
S H O - B I	2,700	349.00	942,300
ニホンフラッシュ	4,100	1,658.00	6,797,800
前田工織	10,800	2,424.00	26,179,200
永大産業	12,500	430.00	5,375,000
アートネイチャー	10,500	625.00	6,562,500
バンダイナムコホールディングス	101,600	4,730.00	480,568,000
アイフィスジャパン	2,100	586.00	1,230,600
共立印刷	15,700	202.00	3,171,400
S H O E I	4,700	3,765.00	17,695,500
フランスベッドホールディングス	13,900	909.00	12,635,100
パイロットコーポレーション	17,100	5,270.00	90,117,000
萩原工業	5,500	1,538.00	8,459,000
トッパン・フォームズ	21,000	918.00	19,278,000
フジシールインターナショナル	22,000	3,840.00	84,480,000
タカラトミー	41,100	1,103.00	45,333,300
廣濟堂	8,800	609.00	5,359,200
エステールホールディングス	2,500	654.00	1,635,000
アーク	36,000	84.00	3,024,000
タカノ	3,700	819.00	3,030,300
プロネクサス	8,200	1,010.00	8,282,000
ホクシン	5,800	149.00	864,200
ウッドワン	3,200	1,140.00	3,648,000
大建工業	7,400	1,879.00	13,904,600
凸版印刷	138,700	1,782.00	247,163,400
大日本印刷	138,500	2,523.00	349,435,500
図書印刷	9,000	921.00	8,289,000
共同印刷	3,000	2,373.00	7,119,000
N I S S H A	20,200	1,376.00	27,795,200
光村印刷	800	2,090.00	1,672,000
宝印刷	5,000	1,589.00	7,945,000
アシックス	97,500	1,564.00	152,490,000
ツツミ	3,000	1,898.00	5,694,000

小松ウオール工業	2,900	1,927.00	5,588,300
ヤマハ	58,400	4,570.00	266,888,000
河合楽器製作所	3,000	3,025.00	9,075,000
クリナップ	8,800	620.00	5,456,000
ピジョン	59,400	4,220.00	250,668,000
兼松サステック	600	1,569.00	941,400
キングジム	8,000	823.00	6,584,000
リンテック	23,400	2,380.00	55,692,000
イトーキ	18,100	590.00	10,679,000
任天堂	60,500	33,700.00	2,038,850,000
三菱鉛筆	16,200	2,282.00	36,968,400
タカラスタANDARD	20,300	1,669.00	33,880,700
コクヨ	47,100	1,648.00	77,620,800
ナカバヤシ	9,300	545.00	5,068,500
グローブライド	4,800	2,627.00	12,609,600
オカムラ	34,300	1,428.00	48,980,400
美津濃	9,700	2,539.00	24,628,300
東京電力ホールディングス	784,200	730.00	572,466,000
中部電力	300,600	1,767.00	531,160,200
関西電力	400,800	1,709.00	684,967,200
中国電力	135,800	1,513.00	205,465,400
北陸電力	96,200	1,010.00	97,162,000
東北電力	230,100	1,537.00	353,663,700
四国電力	88,500	1,410.00	124,785,000
九州電力	202,500	1,376.00	278,640,000
北海道電力	91,900	771.00	70,854,900
沖縄電力	18,200	2,170.00	39,494,000
電源開発	78,200	2,754.00	215,362,800
エフオン	5,800	842.00	4,883,600
イーレックス	17,000	624.00	10,608,000
レノバ	10,300	1,086.00	11,185,800
東京瓦斯	192,700	2,958.00	570,006,600
大阪瓦斯	190,600	2,205.00	420,273,000
東邦瓦斯	48,700	5,010.00	243,987,000
北海道瓦斯	5,300	1,525.00	8,082,500
広島ガス	19,600	341.00	6,683,600
西部瓦斯	11,100	2,630.00	29,193,000
静岡ガス	30,200	911.00	27,512,200
メタウォーター	4,700	2,991.00	14,057,700
SBSホールディングス	9,700	1,571.00	15,238,700
東武鉄道	103,600	3,105.00	321,678,000
相鉄ホールディングス	33,700	3,375.00	113,737,500

東京急行電鉄	266,800	1,886.00	503,184,800
京浜急行電鉄	134,600	1,864.00	250,894,400
小田急電鉄	157,400	2,524.00	397,277,600
京王電鉄	54,900	6,390.00	350,811,000
京成電鉄	73,600	3,510.00	258,336,000
富士急行	13,400	3,355.00	44,957,000
新京成電鉄	2,500	2,111.00	5,277,500
東日本旅客鉄道	174,700	10,055.00	1,756,608,500
西日本旅客鉄道	88,100	8,007.00	705,416,700
東海旅客鉄道	88,000	23,410.00	2,060,080,000
西武ホールディングス	125,200	1,947.00	243,764,400
鴻池運輸	15,600	1,635.00	25,506,000
西日本鉄道	27,200	2,819.00	76,676,800
ハマキョウレックス	7,500	3,645.00	27,337,500
サカイ引越センター	5,200	5,720.00	29,744,000
近鉄グループホールディングス	93,000	4,910.00	456,630,000
阪急阪神ホールディングス	124,100	3,915.00	485,851,500
南海電気鉄道	41,500	3,000.00	124,500,000
京阪ホールディングス	41,400	4,555.00	188,577,000
神戸電鉄	2,400	3,915.00	9,396,000
名古屋鉄道	74,500	2,898.00	215,901,000
山陽電気鉄道	7,200	2,143.00	15,429,600
日本通運	36,500	6,460.00	235,790,000
ヤマトホールディングス	163,100	3,012.00	491,257,200
山九	25,900	5,260.00	136,234,000
丸運	5,100	289.00	1,473,900
丸全昭和運輸	7,500	2,678.00	20,085,000
センコーグループホールディングス	51,300	873.00	44,784,900
トナミホールディングス	2,200	5,730.00	12,606,000
ニッコンホールディングス	35,400	2,770.00	98,058,000
日本石油輸送	1,100	2,867.00	3,153,700
福山通運	11,900	4,425.00	52,657,500
セイノーホールディングス	69,700	1,521.00	106,013,700
エスライン	2,700	1,052.00	2,840,400
神奈川中央交通	2,300	3,700.00	8,510,000
日立物流	20,500	3,120.00	63,960,000
丸和運輸機関	4,900	3,505.00	17,174,500
C & F ロジホールディングス	9,400	1,205.00	11,327,000
九州旅客鉄道	78,100	3,735.00	291,703,500
S Gホールディングス	87,900	3,000.00	263,700,000
日本郵船	78,100	1,824.00	142,454,400
商船三井	55,400	2,645.00	146,533,000

川崎汽船	29,000	1,499.00	43,471,000
N S ユナイテッド海運	5,300	2,970.00	15,741,000
飯野海運	45,400	396.00	17,978,400
共栄タンカー	1,100	1,534.00	1,687,400
乾汽船	8,400	738.00	6,199,200
日本航空	170,300	3,968.00	675,750,400
A N A ホールディングス	170,100	3,995.00	679,549,500
パスコ	1,800	763.00	1,373,400
トランコム	2,600	5,780.00	15,028,000
日新	8,000	1,841.00	14,728,000
三菱倉庫	32,200	2,793.00	89,934,600
三井倉庫ホールディングス	11,400	1,861.00	21,215,400
住友倉庫	35,000	1,396.00	48,860,000
澁澤倉庫	5,000	1,554.00	7,770,000
東陽倉庫	16,400	282.00	4,624,800
日本トランスシティ	20,000	448.00	8,960,000
ケイヒン	1,700	1,273.00	2,164,100
中央倉庫	5,500	999.00	5,494,500
川西倉庫	1,800	1,237.00	2,226,600
安田倉庫	7,400	815.00	6,031,000
東洋埠頭	2,800	1,493.00	4,180,400
宇徳	7,600	523.00	3,974,800
上組	57,400	2,345.00	134,603,000
サンリツ	2,100	664.00	1,394,400
キムラユニティー	2,400	1,010.00	2,424,000
キューソー流通システム	2,300	2,068.00	4,756,400
近鉄エクスプレス	17,600	1,581.00	27,825,600
東海運	5,100	298.00	1,519,800
エーアイティー	5,900	1,016.00	5,994,400
内外トランスライン	2,900	1,361.00	3,946,900
日本コンセプト	2,500	979.00	2,447,500
N E C ネットズエスアイ	10,700	2,382.00	25,487,400
システナ	34,500	1,259.00	43,435,500
デジタルアーツ	5,200	6,250.00	32,500,000
新日鉄住金ソリューションズ	14,500	2,734.00	39,643,000
キューブシステム	5,200	627.00	3,260,400
エイジア	2,000	1,127.00	2,254,000
コア	4,100	1,172.00	4,805,200
ソリトンシステムズ	5,400	780.00	4,212,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,200	1,353.00	5,682,600
T I S	32,200	4,795.00	154,399,000
ネオス	2,700	1,162.00	3,137,400

電算システム	3,700	2,319.00	8,580,300
グリー	52,100	481.00	25,060,100
コーエーテクモホールディングス	19,800	1,842.00	36,471,600
三菱総合研究所	3,800	3,215.00	12,217,000
電算	1,100	2,186.00	2,404,600
A G S	5,500	667.00	3,668,500
ファインデックス	8,100	564.00	4,568,400
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,481.00	3,258,200
ブレインパッド	2,100	6,090.00	12,789,000
K L a b	17,200	947.00	16,288,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	13,000	883.00	11,479,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,656.00	2,649,600
ネクソン	245,600	1,555.00	381,908,000
アイスタイル	24,800	838.00	20,782,400
エムアップ	3,300	1,680.00	5,544,000
エイチーム	6,000	1,649.00	9,894,000
テクノスジャパン	8,100	771.00	6,245,100
コロプラ	27,700	771.00	21,356,700
ブロードリーフ	48,100	570.00	27,417,000
クロス・マーケティンググループ	3,000	345.00	1,035,000
デジタルハーツホールディングス	4,400	1,434.00	6,309,600
メディアドゥホールディングス	3,000	2,345.00	7,035,000
じげん	10,200	554.00	5,650,800
サイバーリンクス	1,600	925.00	1,480,000
フィックスターズ	9,400	1,312.00	12,332,800
C A R T A H O L D I N G S	5,100	1,061.00	5,411,100
オブティム	2,100	4,425.00	9,292,500
セレス	3,100	1,450.00	4,495,000
ベリサーブ	1,000	4,680.00	4,680,000
ティーガイア	9,700	2,100.00	20,370,000
セック	1,600	3,600.00	5,760,000
日本アジアグループ	9,800	349.00	3,420,200
豆蔵ホールディングス	6,500	1,042.00	6,773,000
テクマトリックス	6,900	1,822.00	12,571,800
プロシップ	1,400	2,641.00	3,697,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	233,100	242.00	56,410,200
G M O ペイメントゲートウェイ	15,900	5,300.00	84,270,000
ザッパラス	4,900	362.00	1,773,800
システムリサーチ	1,300	2,706.00	3,517,800
インターネットイニシアティブ	15,700	2,550.00	40,035,000
さくらインターネット	11,500	456.00	5,244,000
ヴィンクス	3,300	1,277.00	4,214,100

GMOクラウド	2,200	3,090.00	6,798,000
SRAホールディングス	5,200	2,485.00	12,922,000
Minorisソリューションズ	1,900	1,677.00	3,186,300
朝日ネット	7,900	503.00	3,973,700
eBASE	2,900	1,814.00	5,260,600
アバント	2,600	1,168.00	3,036,800
アドソル日進	3,400	1,591.00	5,409,400
フリービット	6,500	801.00	5,206,500
コムチュア	5,500	2,784.00	15,312,000
サイバーコム	1,800	2,189.00	3,940,200
アステリア	4,900	782.00	3,831,800
マークラインズ	3,400	1,350.00	4,590,000
メディカル・データ・ビジョン	8,500	979.00	8,321,500
ショーケース・ティービー	2,200	666.00	1,465,200
モバイルファクトリー	2,700	1,258.00	3,396,600
テラスカイ	600	3,590.00	2,154,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,331.00	5,723,300
PCIホールディングス	1,700	2,330.00	3,961,000
パイプドHD	1,600	953.00	1,524,800
アイビーシー	1,700	1,001.00	1,701,700
ネオジャパン	2,000	844.00	1,688,000
PR TIMES	700	2,480.00	1,736,000
ランドコンピュータ	1,200	1,011.00	1,213,200
ダブルスタンダード	700	3,705.00	2,593,500
オープンドア	4,800	2,931.00	14,068,800
マイネット	3,100	1,766.00	5,474,600
アカツキ	3,400	6,480.00	22,032,000
ベネフィットジャパン	800	760.00	608,000
Ubicomホールディングス	1,800	1,178.00	2,120,400
LINE	29,400	3,905.00	114,807,000
カナミックネットワーク	1,500	1,811.00	2,716,500
ノムラシステムコーポレーション	900	747.00	672,300
チェンジ	1,300	4,275.00	5,557,500
シンクロ・フード	4,200	593.00	2,490,600
オークネット	5,100	906.00	4,620,600
AOI TYO Holdings	10,700	799.00	8,549,300
マクロミル	12,300	1,574.00	19,360,200
ビーグリー	2,000	819.00	1,638,000
オロ	1,000	4,300.00	4,300,000
ソルクシーズ	4,200	624.00	2,620,800
フェイス	3,900	850.00	3,315,000
ハイマックス	1,200	1,786.00	2,143,200

野村総合研究所	61,300	4,620.00	283,206,000
サイバネットシステム	7,900	577.00	4,558,300
C Eホールディングス	2,700	702.00	1,895,400
日本システム技術	1,600	1,485.00	2,376,000
インテージホールディングス	12,500	916.00	11,450,000
東邦システムサイエンス	3,000	909.00	2,727,000
ソースネクスト	37,600	581.00	21,845,600
インフォコム	4,000	4,165.00	16,660,000
F I G	8,700	305.00	2,653,500
フォーカスシステムズ	6,400	1,016.00	6,502,400
クレスコ	3,000	2,996.00	8,988,000
フジ・メディア・ホールディングス	100,100	1,591.00	159,259,100
オービック	33,400	8,980.00	299,932,000
ジャストシステム	13,800	2,218.00	30,608,400
T D C ソフト	8,400	794.00	6,669,600
ヤフー	629,100	289.00	181,809,900
トレンドマイクロ	51,400	6,290.00	323,306,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,357.00	3,799,600
日本オラクル	15,600	7,750.00	120,900,000
アルファシステムズ	3,100	2,557.00	7,926,700
フューチャー	13,200	1,498.00	19,773,600
C A C H o l d i n g s	7,200	940.00	6,768,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,200	1,778.00	7,467,600
トーセ	2,700	818.00	2,208,600
オービックビジネスコンサルタント	9,900	4,225.00	41,827,500
伊藤忠テクノソリューションズ	44,000	2,248.00	98,912,000
アイティフォー	11,900	731.00	8,698,900
東計電算	1,500	3,005.00	4,507,500
エクスネット	1,900	832.00	1,580,800
大塚商会	52,200	3,370.00	175,914,000
サイボウズ	11,200	660.00	7,392,000
ソフトブレーン	7,600	447.00	3,397,200
電通国際情報サービス	6,000	2,956.00	17,736,000
デジタルガレージ	18,800	2,530.00	47,564,000
E Mシステムズ	8,000	1,121.00	8,968,000
ウェザーニューズ	3,300	2,959.00	9,764,700
C I J	7,500	749.00	5,617,500
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,865.00	1,865,000
日本エンタープライズ	10,300	181.00	1,864,300
WOWOW	4,700	3,010.00	14,147,000
スカラ	7,700	703.00	5,413,100
I M A G I C A G R O U P	8,100	502.00	4,066,200

ネットワンシステムズ	34,200	2,098.00	71,751,600
システムソフト	23,600	101.00	2,383,600
アルゴグラフィックス	4,100	3,950.00	16,195,000
マーベラス	14,900	867.00	12,918,300
エイベックス	16,600	1,466.00	24,335,600
日本ユニシス	30,200	2,596.00	78,399,200
兼松エレクトロニクス	5,300	3,230.00	17,119,000
東京放送ホールディングス	64,000	1,835.00	117,440,000
日本テレビホールディングス	88,600	1,722.00	152,569,200
朝日放送グループホールディングス	9,500	720.00	6,840,000
テレビ朝日ホールディングス	26,600	2,076.00	55,221,600
スカパーJ S A Tホールディングス	73,900	480.00	35,472,000
テレビ東京ホールディングス	8,000	2,332.00	18,656,000
日本BS放送	3,300	1,085.00	3,580,500
ビジョン	3,000	3,940.00	11,820,000
ワイヤレスゲート	4,400	525.00	2,310,000
コネクシオ	6,800	1,433.00	9,744,400
クロップス	1,900	669.00	1,271,100
日本電信電話	659,400	4,548.00	2,998,951,200
K D D I	849,600	2,701.00	2,294,769,600
光通信	11,400	17,270.00	196,878,000
N T T ドコモ	692,200	2,579.50	1,785,529,900
エムティーアイ	11,400	590.00	6,726,000
G M O インターネット	35,200	1,381.00	48,611,200
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	491.00	1,129,300
カドカワ	28,200	1,175.00	33,135,000
学研ホールディングス	3,300	4,065.00	13,414,500
ゼンリン	19,300	2,468.00	47,632,400
昭文社	4,600	496.00	2,281,600
インプレスホールディングス	7,700	144.00	1,108,800
アイネット	5,600	1,348.00	7,548,800
松竹	6,400	10,780.00	68,992,000
東宝	63,400	4,140.00	262,476,000
東映	4,100	13,230.00	54,243,000
エヌ・ティ・ティ・データ	256,800	1,271.00	326,392,800
ピー・シー・エー	1,300	1,953.00	2,538,900
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,868.00	3,175,600
D T S	10,800	3,680.00	39,744,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,900	3,385.00	151,986,500
シーイーシー	10,400	1,886.00	19,614,400
カブコン	41,400	2,175.00	90,045,000
アイ・エス・ビー	1,900	1,829.00	3,475,100

ジャステック	5,600	934.00	5,230,400
S C S K	25,500	4,355.00	111,052,500
日本システムウエア	3,200	1,829.00	5,852,800
アイネス	12,300	1,161.00	14,280,300
T K C	8,200	3,965.00	32,513,000
富士ソフト	14,400	4,290.00	61,776,000
N S D	15,900	2,216.00	35,234,400
コナミホールディングス	39,400	5,030.00	198,182,000
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,584.00	5,068,800
J B C Cホールディングス	7,700	1,529.00	11,773,300
ミロク情報サービス	9,600	2,357.00	22,627,200
ソフトバンクグループ	402,900	7,839.00	3,158,333,100
ハウスイ	800	864.00	691,200
高千穂交易	3,600	951.00	3,423,600
伊藤忠食品	2,400	4,745.00	11,388,000
エレマテック	4,400	1,885.00	8,294,000
J A L U X	2,700	2,496.00	6,739,200
あらた	5,400	4,380.00	23,652,000
トーメンデバイス	1,500	2,315.00	3,472,500
東京エレクトロン デバイス	3,400	1,803.00	6,130,200
フィールズ	8,500	774.00	6,579,000
双日	534,400	408.00	218,035,200
アルフレッサ ホールディングス	107,500	3,080.00	331,100,000
横浜冷凍	25,300	952.00	24,085,600
神栄	1,300	922.00	1,198,600
ラサ商事	5,000	841.00	4,205,000
ラクーンホールディングス	5,600	662.00	3,707,200
アルコニックス	10,300	1,086.00	11,185,800
神戸物産	14,600	3,390.00	49,494,000
あい ホールディングス	15,500	1,966.00	30,473,000
ディーブイエックス	3,700	1,146.00	4,240,200
ダイワボウホールディングス	8,800	5,240.00	46,112,000
マクニカ・富士エレホールディングス	26,800	1,471.00	39,422,800
ラクト・ジャパン	2,100	7,110.00	14,931,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,200	1,149.00	20,911,800
八洲電機	7,300	756.00	5,518,800
メディアスホールディングス	5,200	713.00	3,707,600
U K Cホールディングス	6,100	1,963.00	11,974,300
ジュテックホールディングス	2,200	993.00	2,184,600
大光	2,400	534.00	1,281,600
O C H Iホールディングス	2,700	1,138.00	3,072,600
T O K A Iホールディングス	51,100	889.00	45,427,900

黒谷	1,600	440.00	704,000
C o m i n i x	1,700	809.00	1,375,300
三洋貿易	4,900	1,798.00	8,810,200
ビューティガレージ	1,300	1,458.00	1,895,400
ウイン・パートナーズ	6,100	1,030.00	6,283,000
ミタチ産業	2,400	717.00	1,720,800
シップヘルスケアホールディングス	20,200	4,245.00	85,749,000
明治電機工業	3,000	1,688.00	5,064,000
デリカフーズホールディングス	1,700	1,359.00	2,310,300
スターティアホールディングス	1,800	591.00	1,063,800
コメダホールディングス	22,300	2,067.00	46,094,100
富士興産	3,600	623.00	2,242,800
協栄産業	1,200	1,523.00	1,827,600
小野建	8,600	1,626.00	13,983,600
佐島電機	7,000	872.00	6,104,000
エコートレーディング	2,200	598.00	1,315,600
伯東	6,500	1,161.00	7,546,500
コンドーテック	7,300	956.00	6,978,800
中山福	5,400	533.00	2,878,200
ナガイレーベン	14,000	2,432.00	34,048,000
三菱食品	10,600	2,939.00	31,153,400
松田産業	7,100	1,428.00	10,138,800
第一興商	14,400	5,360.00	77,184,000
メディバルホールディングス	104,400	2,428.00	253,483,200
S P K	2,100	2,276.00	4,779,600
萩原電気ホールディングス	3,600	2,804.00	10,094,400
アズワン	6,900	7,300.00	50,370,000
スズデン	3,300	1,370.00	4,521,000
尾家産業	3,000	1,237.00	3,711,000
シモジマ	5,800	1,069.00	6,200,200
ドウシシャ	9,100	1,724.00	15,688,400
小津産業	2,100	1,897.00	3,983,700
高速	5,600	1,096.00	6,137,600
たけびし	3,300	1,405.00	4,636,500
リックス	2,100	1,478.00	3,103,800
丸文	8,300	715.00	5,934,500
ハピネット	8,100	1,562.00	12,652,200
橋本総業ホールディングス	1,700	1,434.00	2,437,800
日本ライフライン	30,300	1,585.00	48,025,500
タカショー	4,600	427.00	1,964,200
エクセル	3,400	2,121.00	7,211,400
マルカキカイ	3,100	2,177.00	6,748,700

I D O M	32,600	392.00	12,779,200
日本エム・ディ・エム	5,500	1,036.00	5,698,000
進和	5,600	2,223.00	12,448,800
エスケイジャパン	2,300	731.00	1,681,300
ダイترون	4,300	1,266.00	5,443,800
シークス	12,300	1,445.00	17,773,500
田中商事	3,100	557.00	1,726,700
オーハシテクニカ	5,500	1,229.00	6,759,500
白銅	3,000	1,623.00	4,869,000
伊藤忠商事	676,800	1,985.00	1,343,448,000
丸紅	954,200	816.00	778,627,200
高島	1,500	1,829.00	2,743,500
長瀬産業	54,400	1,562.00	84,972,800
蝶理	6,200	1,674.00	10,378,800
豊田通商	108,000	3,440.00	371,520,000
三共生興	16,100	403.00	6,488,300
兼松	38,700	1,298.00	50,232,600
ツカモトコーポレーション	1,700	1,057.00	1,796,900
三井物産	797,100	1,779.50	1,418,439,450
日本紙パルプ商事	5,500	4,030.00	22,165,000
日立ハイテクノロジーズ	29,400	3,805.00	111,867,000
カメイ	12,600	1,226.00	15,447,600
東都水産	1,300	2,242.00	2,914,600
O U Gホールディングス	1,500	2,471.00	3,706,500
スターゼン	3,600	3,995.00	14,382,000
山善	37,800	1,087.00	41,088,600
椿本興業	2,200	3,220.00	7,084,000
住友商事	572,300	1,673.00	957,457,900
内田洋行	4,500	2,463.00	11,083,500
三菱商事	679,000	3,126.00	2,122,554,000
第一実業	4,400	3,465.00	15,246,000
キャノンマーケティングジャパン	27,700	1,993.00	55,206,100
西華産業	5,500	1,501.00	8,255,500
佐藤商事	8,700	917.00	7,977,900
菱洋エレクトロ	9,800	1,570.00	15,386,000
東京産業	9,300	517.00	4,808,100
ユアサ商事	9,900	3,190.00	31,581,000
神鋼商事	2,200	2,491.00	5,480,200
小林産業	5,600	272.00	1,523,200
阪和興業	16,800	2,999.00	50,383,200
正栄食品工業	5,100	2,594.00	13,229,400
カナデン	9,300	1,224.00	11,383,200

菱電商事	7,700	1,420.00	10,934,000
フルサト工業	5,200	1,579.00	8,210,800
岩谷産業	21,500	3,720.00	79,980,000
すてきナイスグループ	4,000	890.00	3,560,000
昭光通商	3,300	627.00	2,069,100
ニチモウ	1,500	1,736.00	2,604,000
極東貿易	2,900	1,600.00	4,640,000
イワキ	11,200	424.00	4,748,800
三愛石油	26,000	1,008.00	26,208,000
稲畑産業	23,300	1,481.00	34,507,300
G S Iクレオス	2,500	1,267.00	3,167,500
明和産業	8,600	401.00	3,448,600
ワキタ	20,600	1,137.00	23,422,200
東邦ホールディングス	28,700	2,725.00	78,207,500
サンゲツ	29,200	2,084.00	60,852,800
ミツウロコグループホールディングス	14,100	787.00	11,096,700
シナネンホールディングス	4,000	2,302.00	9,208,000
伊藤忠エネクス	21,400	1,002.00	21,442,800
サンリオ	29,900	2,274.00	67,992,600
サンワテクノス	5,700	1,000.00	5,700,000
リョーサン	10,700	2,983.00	31,918,100
新光商事	9,100	1,733.00	15,770,300
トーホー	4,300	2,069.00	8,896,700
三信電気	8,000	1,783.00	14,264,000
東陽テクニカ	11,200	816.00	9,139,200
モスフードサービス	12,700	2,807.00	35,648,900
加賀電子	9,600	2,040.00	19,584,000
ソーダニッカ	9,800	530.00	5,194,000
立花エレテック	7,200	1,580.00	11,376,000
フォーバル	4,100	831.00	3,407,100
P A L T A C	17,400	4,965.00	86,391,000
三谷産業	10,900	287.00	3,128,300
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,200	4,440.00	9,768,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,104.00	883,200
国際紙パルプ商事	16,600	280.00	4,648,000
ヤマタネ	4,900	1,636.00	8,016,400
丸紅建材リース	900	1,831.00	1,647,900
日鉄住金物産	6,900	4,685.00	32,326,500
泉州電業	3,200	2,678.00	8,569,600
トラスコ中山	20,100	2,905.00	58,390,500
オートバックスセブン	38,500	1,862.00	71,687,000
モリト	6,900	777.00	5,361,300

加藤産業	15,100	3,230.00	48,773,000
北恵	1,800	946.00	1,702,800
イノテック	6,500	984.00	6,396,000
イエローハット	9,100	2,616.00	23,805,600
J Kホールディングス	8,400	557.00	4,678,800
日伝	8,000	1,622.00	12,976,000
北沢産業	7,100	261.00	1,853,100
杉本商事	5,100	1,771.00	9,032,100
因幡電機産業	13,700	4,195.00	57,471,500
バイテックホールディングス	4,300	1,944.00	8,359,200
東テク	3,100	2,152.00	6,671,200
ミスミグループ本社	121,100	2,540.00	307,594,000
アルテック	6,800	217.00	1,475,600
タキヒヨー	2,900	1,840.00	5,336,000
蔵王産業	1,500	1,327.00	1,990,500
スズケン	44,100	5,800.00	255,780,000
ジェコス	6,500	1,034.00	6,721,000
ルネサスイーストン	8,600	419.00	3,603,400
ローソン	24,500	6,760.00	165,620,000
サンエー	7,300	4,400.00	32,120,000
カワチ薬品	7,500	1,949.00	14,617,500
エービーシー・マート	15,100	6,170.00	93,167,000
ハードオフコーポレーション	3,800	831.00	3,157,800
アスクル	8,500	2,345.00	19,932,500
ゲオホールディングス	14,800	1,629.00	24,109,200
アダストリア	13,400	2,130.00	28,542,000
ジーフット	5,700	662.00	3,773,400
くらコーポレーション	5,700	5,370.00	30,609,000
キャンドゥ	4,500	1,583.00	7,123,500
パルグループホールディングス	5,000	3,120.00	15,600,000
エディオン	41,000	1,118.00	45,838,000
サーラコーポレーション	19,700	587.00	11,563,900
ワッツ	3,200	728.00	2,329,600
ハローズ	3,700	2,136.00	7,903,200
あみやき亭	2,100	3,580.00	7,518,000
ひらまつ	19,000	351.00	6,669,000
大黒天物産	2,300	4,100.00	9,430,000
ハニーズホールディングス	9,200	908.00	8,353,600
ファーマライズホールディングス	2,200	582.00	1,280,400
アルペン	7,300	1,721.00	12,563,300
ハブ	3,100	886.00	2,746,600
クオールホールディングス	14,300	1,775.00	25,382,500

ジーンズ	6,600	5,500.00	36,300,000
ビックカメラ	51,700	1,305.00	67,468,500
D C Mホールディングス	52,200	1,121.00	58,516,200
ペッパーフードサービス	7,600	2,765.00	21,014,000
MonotaRO	61,200	2,456.00	150,307,200
東京一番フーズ	2,400	586.00	1,406,400
DDホールディングス	2,100	2,165.00	4,546,500
きちりホールディングス	2,600	690.00	1,794,000
アークランドサービスホールディングス	7,100	2,053.00	14,576,300
J.フロント リテイリング	123,800	1,259.00	155,864,200
ドトール・日レスホールディングス	17,000	2,120.00	36,040,000
マツモトキヨシホールディングス	40,000	3,390.00	135,600,000
ブロンコピリー	5,100	2,540.00	12,954,000
Z O Z O	104,600	2,121.00	221,856,600
トレジャー・ファクトリー	2,800	802.00	2,245,600
物語コーポレーション	2,800	9,320.00	26,096,000
ココカラファイン	10,900	5,260.00	57,334,000
三越伊勢丹ホールディングス	181,000	1,180.00	213,580,000
H a m e e	2,400	912.00	2,188,800
ウエルシアホールディングス	25,600	4,115.00	105,344,000
クリエイイトSDホールディングス	14,300	2,686.00	38,409,800
丸善C H Iホールディングス	10,800	329.00	3,553,200
ティーライフ	1,300	937.00	1,218,100
エー・ピーカンパニー	1,900	479.00	910,100
チムニー	3,000	2,518.00	7,554,000
シュッピン	6,500	690.00	4,485,000
ネクステージ	14,900	1,273.00	18,967,700
ジョイフル本田	28,400	1,419.00	40,299,600
鳥貴族	3,100	1,886.00	5,846,600
キリン堂ホールディングス	3,800	1,392.00	5,289,600
ホットランド	5,000	1,285.00	6,425,000
すかいらーくホールディングス	90,200	1,848.00	166,689,600
綿半ホールディングス	3,500	2,131.00	7,458,500
ヨシックス	1,600	2,880.00	4,608,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,200	1,211.00	34,150,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	677.00	2,640,300
B E E N O S	2,200	1,340.00	2,948,000
あさひ	8,000	1,387.00	11,096,000
日本調剤	3,400	3,505.00	11,917,000
コスモス薬品	4,900	19,890.00	97,461,000
トーエル	4,600	734.00	3,376,400
オンリー	1,700	953.00	1,620,100

セブン&アイ・ホールディングス	405,600	4,804.00	1,948,502,400	
薬王堂	4,200	2,633.00	11,058,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	26,000	1,251.00	32,526,000	
ツルハホールディングス	21,000	9,680.00	203,280,000	
サンマルクホールディングス	7,700	2,504.00	19,280,800	
フェリシモ	2,100	1,117.00	2,345,700	
トリドールホールディングス	12,000	1,956.00	23,472,000	
TOKYO BASE	8,400	678.00	5,695,200	
ウイルプラスホールディングス	900	798.00	718,200	
ジャパンミート	3,600	1,703.00	6,130,800	
サツドラホールディングス	1,600	1,898.00	3,036,800	
デファクトスタンダード	700	508.00	355,600	
ダイユー・リックホールディングス	5,100	992.00	5,059,200	
パロックジャパンリミテッド	7,900	913.00	7,212,700	
クスリのアオキホールディングス	7,700	6,910.00	53,207,000	
力の源ホールディングス	2,700	811.00	2,189,700	
スシローグローバルホールディングス	10,600	5,660.00	59,996,000	
LIXILビバ	8,200	1,596.00	13,087,200	
メディカルシステムネットワーク	10,200	438.00	4,467,600	
はるやまホールディングス	4,500	849.00	3,820,500	
ノジマ	17,200	2,185.00	37,582,000	
カッパ・クリエイト	13,600	1,396.00	18,985,600	
ライトオン	8,000	848.00	6,784,000	
良品計画	13,700	24,170.00	331,129,000	
三城ホールディングス	11,800	422.00	4,979,600	
アドヴァン	14,800	916.00	13,556,800	
アルビス	3,700	2,417.00	8,942,900	
コナカ	12,200	453.00	5,526,600	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,850.00	2,220,000	
G-7ホールディングス	2,900	2,153.00	6,243,700	
イオン北海道	9,800	798.00	7,820,400	
コジマ	14,000	518.00	7,252,000	
ヒマラヤ	3,000	933.00	2,799,000	
コーナン商事	12,700	2,686.00	34,112,200	
エコス	3,500	1,684.00	5,894,000	
ワタミ	12,800	1,402.00	17,945,600	
マルシェ	2,600	774.00	2,012,400	
ドンキホーテホールディングス	62,700	6,210.00	389,367,000	
西松屋チェーン	21,300	909.00	19,361,700	
ゼンショーホールディングス	45,700	2,544.00	116,260,800	
幸楽苑ホールディングス	6,100	2,522.00	15,384,200	
ハークスレイ	2,000	1,112.00	2,224,000	

サイゼリヤ	16,000	2,046.00	32,736,000
V Tホールディングス	32,900	426.00	14,015,400
魚力	2,600	1,416.00	3,681,600
ポブラ	2,400	600.00	1,440,000
フジ・コーポレーション	1,900	2,069.00	3,931,100
ユナイテッドアローズ	11,100	3,610.00	40,071,000
ハイデイ日高	12,700	2,177.00	27,647,900
京都きもの友禅	6,000	432.00	2,592,000
コロワイド	32,200	2,388.00	76,893,600
ピーシーデポコーポレーション	12,500	455.00	5,687,500
壱番屋	6,800	4,625.00	31,450,000
P L A N T	2,200	1,002.00	2,204,400
スギホールディングス	21,300	4,555.00	97,021,500
ヴィア・ホールディングス	11,500	673.00	7,739,500
スクロール	14,600	414.00	6,044,400
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,163.00	23,360,400
ユニー・ファミリーマートホールディングス	27,100	13,070.00	354,197,000
木曽路	11,900	2,514.00	29,916,600
S R Sホールディングス	11,500	979.00	11,258,500
タカキュー	7,500	187.00	1,402,500
ケーヨー	18,000	541.00	9,738,000
上新電機	11,400	2,427.00	27,667,800
日本瓦斯	15,700	4,040.00	63,428,000
ロイヤルホールディングス	16,900	2,666.00	45,055,400
いなげや	10,800	1,359.00	14,677,200
島忠	21,900	3,155.00	69,094,500
チヨダ	10,200	1,850.00	18,870,000
ライフコーポレーション	7,400	2,456.00	18,174,400
リンガーハット	12,000	2,359.00	28,308,000
M r M a x H D	13,100	502.00	6,576,200
テンアライド	8,600	391.00	3,362,600
A O K Iホールディングス	19,400	1,310.00	25,414,000
オークワ	13,800	1,040.00	14,352,000
コメリ	15,000	2,491.00	37,365,000
青山商事	16,900	2,705.00	45,714,500
しまむら	11,300	8,930.00	100,909,000
はせがわ	5,100	403.00	2,055,300
高島屋	75,900	1,497.00	113,622,300
松屋	19,500	996.00	19,422,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,700	1,577.00	78,376,900
近鉄百貨店	3,700	3,470.00	12,839,000
パルコ	9,100	1,059.00	9,636,900

丸井グループ	81,900	2,248.00	184,111,200
アクシアル リテイリング	8,000	3,600.00	28,800,000
イオン	372,300	2,203.50	820,363,050
イズミ	19,700	5,550.00	109,335,000
平和堂	19,700	2,584.00	50,904,800
フジ	11,700	1,902.00	22,253,400
ヤオコー	11,000	5,780.00	63,580,000
ゼビオホールディングス	11,700	1,300.00	15,210,000
ケーズホールディングス	100,600	1,075.00	108,145,000
Olympicグループ	5,600	697.00	3,903,200
日産東京販売ホールディングス	13,900	318.00	4,420,200
Genky DrugStores	3,800	2,847.00	10,818,600
総合メディカルホールディングス	8,500	2,084.00	17,714,000
ブックオフグループホールディングス	4,900	758.00	3,714,200
アインホールディングス	13,000	8,180.00	106,340,000
元気寿司	2,700	4,520.00	12,204,000
ヤマダ電機	294,900	537.00	158,361,300
アークランドサカモト	16,500	1,349.00	22,258,500
ニトリホールディングス	41,900	13,930.00	583,667,000
グルメ杵屋	6,800	1,163.00	7,908,400
愛眼	7,400	294.00	2,175,600
ケーユーホールディングス	5,000	809.00	4,045,000
吉野家ホールディングス	33,800	1,734.00	58,609,200
松屋フーズホールディングス	4,700	3,660.00	17,202,000
サガミホールディングス	13,000	1,346.00	17,498,000
関西スーパーマーケット	7,200	1,020.00	7,344,000
王将フードサービス	7,100	7,160.00	50,836,000
プレナス	10,900	1,902.00	20,731,800
ミニストップ	7,200	2,006.00	14,443,200
アークス	18,200	2,511.00	45,700,200
バローホールディングス	20,900	2,600.00	54,340,000
ベルク	4,800	4,975.00	23,880,000
大庄	5,100	1,567.00	7,991,700
ファーストリテイリング	12,900	51,060.00	658,674,000
サンドラッグ	36,400	3,400.00	123,760,000
サクスパー ホールディングス	8,200	1,049.00	8,601,800
ヤマザワ	2,000	1,784.00	3,568,000
やまや	1,700	2,194.00	3,729,800
ベルーナ	23,800	1,021.00	24,299,800
島根銀行	2,900	704.00	2,041,600
じもとホールディングス	63,800	128.00	8,166,400
めぶきフィナンシャルグループ	505,600	309.00	156,230,400

東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	1,636.00	22,086,000
九州フィナンシャルグループ	160,500	434.00	69,657,000
ゆうちょ銀行	275,000	1,257.00	345,675,000
富山第一銀行	24,700	397.00	9,805,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	618,600	452.00	279,607,200
西日本フィナンシャルホールディングス	62,700	980.00	61,446,000
関西みらいフィナンシャルグループ	46,300	866.00	40,095,800
三十三フィナンシャルグループ	8,800	1,702.00	14,977,600
第四北越フィナンシャルグループ	17,000	3,215.00	54,655,000
新生銀行	71,100	1,421.00	101,033,100
あおぞら銀行	54,100	3,365.00	182,046,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,748,000	577.10	3,894,270,800
りそなホールディングス	1,063,300	549.20	583,964,360
三井住友トラスト・ホールディングス	190,400	4,190.00	797,776,000
三井住友フィナンシャルグループ	682,900	3,928.00	2,682,431,200
千葉銀行	344,200	657.00	226,139,400
群馬銀行	195,200	482.00	94,086,400
武蔵野銀行	14,700	2,567.00	37,734,900
千葉興業銀行	28,300	360.00	10,188,000
筑波銀行	40,300	233.00	9,389,900
七十七銀行	30,700	1,978.00	60,724,600
青森銀行	7,700	2,881.00	22,183,700
秋田銀行	6,500	2,214.00	14,391,000
山形銀行	11,200	2,108.00	23,609,600
岩手銀行	6,900	3,490.00	24,081,000
東邦銀行	86,600	327.00	28,318,200
東北銀行	4,800	1,118.00	5,366,400
みちのく銀行	6,100	1,734.00	10,577,400
ふくおかフィナンシャルグループ	78,900	2,433.00	191,963,700
静岡銀行	244,600	894.00	218,672,400
十六銀行	13,300	2,409.00	32,039,700
八十二銀行	176,800	470.00	83,096,000
山梨中央銀行	12,500	1,359.00	16,987,500
大垣共立銀行	15,600	2,295.00	35,802,000
福井銀行	8,700	1,661.00	14,450,700
北國銀行	10,500	3,565.00	37,432,500
清水銀行	4,300	1,635.00	7,030,500
富山銀行	2,100	3,240.00	6,804,000
滋賀銀行	19,700	2,617.00	51,554,900
南都銀行	11,600	2,261.00	26,227,600
百五銀行	88,800	404.00	35,875,200
京都銀行	34,800	4,680.00	162,864,000

紀陽銀行	34,700	1,590.00	55,173,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	65,000	1,286.00	83,590,000	
広島銀行	144,100	637.00	91,791,700	
山陰合同銀行	58,300	781.00	45,532,300	
中国銀行	63,200	987.00	62,378,400	
鳥取銀行	3,700	1,440.00	5,328,000	
伊予銀行	129,500	613.00	79,383,500	
百十四銀行	10,500	2,639.00	27,709,500	
四国銀行	14,400	1,109.00	15,969,600	
阿波銀行	15,700	2,941.00	46,173,700	
大分銀行	6,100	3,500.00	21,350,000	
宮崎銀行	6,700	2,839.00	19,021,300	
佐賀銀行	6,100	1,806.00	11,016,600	
十八銀行	6,200	2,689.00	16,671,800	
沖縄銀行	9,100	3,200.00	29,120,000	
琉球銀行	22,900	1,148.00	26,289,200	
セブン銀行	329,200	328.00	107,977,600	
みずほフィナンシャルグループ	13,166,400	176.90	2,329,136,160	
高知銀行	3,400	798.00	2,713,200	
山口フィナンシャルグループ	121,500	1,112.00	135,108,000	
長野銀行	3,500	1,673.00	5,855,500	
名古屋銀行	8,000	3,370.00	26,960,000	
北洋銀行	148,200	297.00	44,015,400	
愛知銀行	3,700	3,775.00	13,967,500	
中京銀行	4,300	2,128.00	9,150,400	
大光銀行	3,600	1,754.00	6,314,400	
愛媛銀行	14,100	1,066.00	15,030,600	
トマト銀行	4,200	1,107.00	4,649,400	
京葉銀行	43,700	722.00	31,551,400	
栃木銀行	52,700	249.00	13,122,300	
北日本銀行	3,300	2,264.00	7,471,200	
東和銀行	17,000	748.00	12,716,000	
福島銀行	8,000	401.00	3,208,000	
大東銀行	4,500	620.00	2,790,000	
トモニホールディングス	76,500	415.00	31,747,500	
フィデアホールディングス	94,100	135.00	12,703,500	
池田泉州ホールディングス	104,900	308.00	32,309,200	
F P G	30,500	1,167.00	35,593,500	
マーキュリアインベストメント	3,700	700.00	2,590,000	
S B Iホールディングス	115,500	2,290.00	264,495,000	
ジャフコ	15,900	3,720.00	59,148,000	
大和証券グループ本社	777,700	586.20	455,887,740	

野村ホールディングス	1,778,400	454.80	808,816,320
岡三証券グループ	82,800	526.00	43,552,800
丸三証券	28,900	826.00	23,871,400
東洋証券	34,400	174.00	5,985,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	115,800	501.00	58,015,800
光世証券	2,400	757.00	1,816,800
水戸証券	27,700	265.00	7,340,500
いちよし証券	20,500	864.00	17,712,000
松井証券	47,500	1,199.00	56,952,500
だいこう証券ビジネス	4,000	408.00	1,632,000
マネックスグループ	90,800	392.00	35,593,600
カブドットコム証券	72,600	381.00	27,660,600
極東証券	13,100	1,203.00	15,759,300
岩井コスモホールディングス	10,000	1,289.00	12,890,000
藍澤証券	18,300	665.00	12,169,500
マネーパートナーズグループ	11,300	295.00	3,333,500
かんぽ生命保険	36,600	2,502.00	91,573,200
S O M P Oホールディングス	170,800	4,057.00	692,935,600
アニコム ホールディングス	7,700	3,500.00	26,950,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	253,300	3,269.00	828,037,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	79,600	2,093.00	166,602,800
第一生命ホールディングス	548,200	1,735.50	951,401,100
東京海上ホールディングス	351,200	5,322.00	1,869,086,400
T & Dホールディングス	299,700	1,356.00	406,393,200
アドバンスクリエイト	2,200	1,728.00	3,801,600
全国保証	27,300	3,790.00	103,467,000
ジェイリース	1,900	349.00	663,100
イントラスト	2,600	370.00	962,000
日本モーゲージサービス	1,300	1,034.00	1,344,200
C a s a	3,100	1,212.00	3,757,200
アルヒ	8,800	2,459.00	21,639,200
クレディセゾン	67,900	1,396.00	94,788,400
芙蓉総合リース	11,100	5,600.00	62,160,000
興銀リース	18,200	2,508.00	45,645,600
東京センチュリー	19,500	4,950.00	96,525,000
日本証券金融	42,700	612.00	26,132,400
アイフル	147,800	268.00	39,610,400
リコーリース	7,600	3,320.00	25,232,000
イオンフィナンシャルサービス	61,900	2,134.00	132,094,600
アコム	194,800	384.00	74,803,200
ジャックス	10,700	1,867.00	19,976,900
オリエントコーポレーション	262,100	130.00	34,073,000

日立キャピタル	22,800	2,422.00	55,221,600
アプラスフィナンシャル	44,600	85.00	3,791,000
オリックス	646,400	1,698.00	1,097,587,200
三菱UFJリース	218,600	556.00	121,541,600
九州リースサービス	4,600	704.00	3,238,400
日本取引所グループ	261,700	1,992.00	521,306,400
イー・ギャランティ	8,800	1,050.00	9,240,000
アサックス	3,900	552.00	2,152,800
NECキャピタルソリューション	3,800	1,629.00	6,190,200
いちご	123,500	355.00	43,842,500
日本駐車場開発	117,600	144.00	16,934,400
ヒューリック	202,300	987.00	199,670,100
三栄建築設計	3,900	1,722.00	6,715,800
スター・マイカ	4,400	1,586.00	6,978,400
野村不動産ホールディングス	64,600	2,084.00	134,626,400
三重交通グループホールディングス	19,800	603.00	11,939,400
サムティ	13,500	1,477.00	19,939,500
ディア・ライフ	12,300	451.00	5,547,300
コーセーアールイー	2,900	898.00	2,604,200
エー・ディー・ワークス	123,300	38.00	4,685,400
日本商業開発	6,100	1,517.00	9,253,700
プレサンスコーポレーション	15,400	1,463.00	22,530,200
ユニゾホールディングス	14,700	2,064.00	30,340,800
THEグローバル社	4,600	554.00	2,548,400
日本管理センター	6,300	836.00	5,266,800
サンセイランディック	2,600	803.00	2,087,800
エストラスト	1,300	765.00	994,500
フージャースホールディングス	20,700	689.00	14,262,300
オープンハウス	15,800	4,345.00	68,651,000
東急不動産ホールディングス	260,800	577.00	150,481,600
飯田グループホールディングス	80,900	1,953.00	157,997,700
イーランド	1,500	677.00	1,015,500
ムゲンエステート	6,700	569.00	3,812,300
ファーストブラザーズ	2,700	1,049.00	2,832,300
ハウズドゥ	3,500	1,255.00	4,392,500
シーアールイー	3,200	944.00	3,020,800
ケイアイスター不動産	2,600	1,725.00	4,485,000
グッドコムアセット	1,700	1,458.00	2,478,600
ジェイ・エス・ビー	400	3,600.00	1,440,000
テンポイノベーション	800	1,533.00	1,226,400
パーク24	56,600	2,696.00	152,593,600
バラカ	2,500	1,683.00	4,207,500

三井不動産	514,100	2,629.00	1,351,568,900
三菱地所	678,900	1,901.50	1,290,928,350
平和不動産	18,400	1,903.00	35,015,200
東京建物	106,000	1,289.00	136,634,000
ダイビル	28,600	1,082.00	30,945,200
京阪神ビルディング	17,400	930.00	16,182,000
住友不動産	217,800	4,196.00	913,888,800
テオオーシー	22,300	778.00	17,349,400
東京楽天地	1,400	4,680.00	6,552,000
レオパレス21	119,500	507.00	60,586,500
スターツコーポレーション	13,200	2,396.00	31,627,200
フジ住宅	12,500	826.00	10,325,000
空港施設	11,100	529.00	5,871,900
明和地所	5,300	592.00	3,137,600
ゴールドクレスト	7,700	1,603.00	12,343,100
日本エスリード	3,700	1,484.00	5,490,800
日神不動産	14,200	448.00	6,361,600
日本エスコン	17,600	820.00	14,432,000
タカラレーベン	45,700	333.00	15,218,100
サンヨーハウジング名古屋	5,400	915.00	4,941,000
イオンモール	48,600	1,761.00	85,584,600
毎日コムネット	1,800	741.00	1,333,800
ファースト住建	3,600	1,191.00	4,287,600
カチタス	10,800	2,888.00	31,190,400
トーセイ	13,400	967.00	12,957,800
穴吹興産	1,100	2,855.00	3,140,500
サンフロンティア不動産	13,500	1,145.00	15,457,500
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	909.00	7,817,400
インテリックス	2,800	663.00	1,856,400
ランドビジネス	4,800	794.00	3,811,200
グランディハウス	8,400	418.00	3,511,200
日本空港ビルデング	30,900	3,925.00	121,282,500
日本工営	6,400	2,582.00	16,524,800
LIFULL	32,800	740.00	24,272,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,600	2,071.00	15,739,600
日本M&Aセンター	70,000	2,608.00	182,560,000
メンバーズ	3,200	1,080.00	3,456,000
中広	1,100	627.00	689,700
タケエイ	9,600	665.00	6,384,000
E・Jホールディングス	1,200	1,008.00	1,209,600
トラスト・テック	4,600	3,200.00	14,720,000
コシダカホールディングス	25,200	1,390.00	35,028,000

アルトナー	1,800	684.00	1,231,200
パソナグループ	9,000	1,319.00	11,871,000
C D S	2,300	1,141.00	2,624,300
リンクアンドモチベーション	17,400	873.00	15,190,200
G C A	9,400	723.00	6,796,200
エス・エム・エス	34,500	1,716.00	59,202,000
パーソルホールディングス	93,900	1,874.00	175,968,600
リニカル	5,400	1,462.00	7,894,800
クックパッド	29,100	293.00	8,526,300
エスクリ	2,700	599.00	1,617,300
アイ・ケイ・ケイ	4,600	767.00	3,528,200
学情	3,800	1,262.00	4,795,600
スタジオアリス	4,800	2,452.00	11,769,600
シミックホールディングス	5,300	1,604.00	8,501,200
N J S	2,100	1,550.00	3,255,000
総合警備保障	37,400	4,995.00	186,813,000
カカクコム	70,700	1,838.00	129,946,600
アイロムグループ	3,500	1,629.00	5,701,500
セントケア・ホールディング	5,100	545.00	2,779,500
サイネックス	1,700	683.00	1,161,100
ルネサンス	5,300	2,006.00	10,631,800
ディップ	15,200	1,902.00	28,910,400
オプトホールディング	5,700	1,450.00	8,265,000
ツクイ	22,200	797.00	17,693,400
キャリアデザインセンター	2,400	1,143.00	2,743,200
ベネフィット・ワン	13,000	3,465.00	45,045,000
エムスリー	197,700	1,530.00	302,481,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	608.00	3,587,200
ブラス	800	571.00	456,800
アウトソーシング	49,600	1,184.00	58,726,400
ウェルネット	9,600	978.00	9,388,800
ワールドホールディングス	2,600	2,562.00	6,661,200
ディー・エヌ・エー	50,700	1,924.00	97,546,800
博報堂D Yホールディングス	130,600	1,602.00	209,221,200
ぐるなび	13,500	708.00	9,558,000
エスアールジータカミヤ	9,600	676.00	6,489,600
ジャパンベストレスキューシステム	7,400	1,263.00	9,346,200
ファンコミュニケーションズ	26,000	540.00	14,040,000
ライク	3,700	1,174.00	4,343,800
ビジネス・ブレークスルー	4,100	321.00	1,316,100
W D Bホールディングス	4,300	2,441.00	10,496,300
ティア	4,800	603.00	2,894,400

C D G	900	1,387.00	1,248,300
バリューコマース	6,400	1,371.00	8,774,400
インフォマート	51,500	1,117.00	57,525,500
J Pホールディングス	26,500	281.00	7,446,500
エコナックホールディングス	17,300	111.00	1,920,300
E P Sホールディングス	14,200	1,683.00	23,898,600
レグス	2,400	924.00	2,217,600
プレステージ・インターナショナル	17,600	1,214.00	21,366,400
アミューズ	5,700	2,418.00	13,782,600
ドリームインキュベータ	2,800	1,575.00	4,410,000
クイック	5,800	1,376.00	7,980,800
T A C	5,300	223.00	1,181,900
ケネディクス	88,000	536.00	47,168,000
電通	114,400	5,140.00	588,016,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,838.00	6,616,800
ぴあ	2,700	3,865.00	10,435,500
イオンファンタジー	3,000	2,667.00	8,001,000
シーティーエス	10,800	753.00	8,132,400
ネクシィーズグループ	2,800	1,917.00	5,367,600
みらかホールディングス	26,300	2,647.00	69,616,100
アルプス技研	8,300	1,766.00	14,657,800
ダイオーズ	2,200	1,270.00	2,794,000
日本空調サービス	10,500	638.00	6,699,000
オリエンタルランド	110,900	11,070.00	1,227,663,000
ダスキン	25,300	2,494.00	63,098,200
明光ネットワークジャパン	12,000	993.00	11,916,000
ファルコホールディングス	5,100	1,534.00	7,823,400
ラウンドワン	29,200	1,114.00	32,528,800
リゾートトラスト	39,800	1,642.00	65,351,600
ビー・エム・エル	12,100	2,982.00	36,082,200
ワタベウェディング	1,600	646.00	1,033,600
りらいあコミュニケーションズ	17,100	946.00	16,176,600
リソー教育	47,900	447.00	21,411,300
早稲田アカデミー	1,400	1,884.00	2,637,600
ユー・エス・エス	114,700	1,871.00	214,603,700
東京個別指導学院	3,300	1,341.00	4,425,300
サイバーエージェント	57,900	4,175.00	241,732,500
楽天	437,700	830.00	363,291,000
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,189.00	6,539,500
テー・オー・ダブリュー	8,900	739.00	6,577,100
セントラルスポーツ	3,500	3,385.00	11,847,500
フルキャストホールディングス	9,500	1,795.00	17,052,500

エン・ジャパン	10,300	3,660.00	37,698,000
リソルホールディングス	1,000	4,005.00	4,005,000
テクノプロ・ホールディングス	17,700	5,400.00	95,580,000
アトラ	2,000	437.00	874,000
インターワークス	1,900	713.00	1,354,700
アイ・アールジャパンホールディングス	3,000	1,203.00	3,609,000
K e e P e r 技研	3,000	969.00	2,907,000
ファーストロジック	1,900	633.00	1,202,700
三機サービス	1,400	1,444.00	2,021,600
G u n o s y	5,800	2,663.00	15,445,400
デザインワン・ジャパン	2,100	315.00	661,500
イー・ガーディアン	4,400	2,093.00	9,209,200
リブセンス	5,300	280.00	1,484,000
ジャパンマテリアル	25,800	1,133.00	29,231,400
ベクトル	11,500	1,362.00	15,663,000
ウチヤマホールディングス	4,700	429.00	2,016,300
ライクキッズネクスト	2,000	793.00	1,586,000
キャリアリンク	3,600	338.00	1,216,800
I B J	6,300	875.00	5,512,500
アサンテ	3,700	2,058.00	7,614,600
N・フィールド	6,000	919.00	5,514,000
バリューHR	2,000	1,743.00	3,486,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,400	4,200.00	10,080,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,282.00	4,871,600
E R Iホールディングス	2,700	757.00	2,043,900
アビスト	1,500	3,375.00	5,062,500
シグマクシス	4,500	810.00	3,645,000
ウィルグループ	6,100	923.00	5,630,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,900	257.00	3,315,300
日本ビューホテル	3,000	1,110.00	3,330,000
リクルートホールディングス	672,500	2,855.50	1,920,323,750
エラン	6,400	1,383.00	8,851,200
土木管理総合試験所	4,100	503.00	2,062,300
日本郵政	769,500	1,352.00	1,040,364,000
ベルシステム24ホールディングス	15,800	1,466.00	23,162,800
鎌倉新書	6,900	1,302.00	8,983,800
一蔵	1,100	578.00	635,800
L I T A L I C O	2,100	1,959.00	4,113,900
グローバルグループ	1,200	930.00	1,116,000
エボラブルアジア	2,700	1,956.00	5,281,200
アトラエ	1,800	2,164.00	3,895,200
ストライク	2,300	1,872.00	4,305,600

ソラスト	22,900	1,074.00	24,594,600
セラク	2,200	556.00	1,223,200
インソース	3,100	1,850.00	5,735,000
アイモバイル	2,300	781.00	1,796,300
キャリアインデックス	3,200	1,257.00	4,022,400
MS - J a p a n	3,800	1,325.00	5,035,000
船場	1,600	839.00	1,342,400
グレイステクノロジー	2,500	1,931.00	4,827,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,600	1,605.00	8,988,000
フルテック	1,100	1,145.00	1,259,500
グリーンズ	2,000	1,330.00	2,660,000
ツナグ・ソリューションズ	1,000	627.00	627,000
日総工産	2,300	1,942.00	4,466,600
キュービーネットホールディングス	4,800	1,851.00	8,884,800
スプリックス	2,600	2,143.00	5,571,800
アドバンテッジリスクマネジメント	3,700	906.00	3,352,200
リログループ	51,400	2,773.00	142,532,200
東祥	5,900	3,270.00	19,293,000
エイチ・アイ・エス	16,700	4,085.00	68,219,500
ラックランド	1,800	2,004.00	3,607,200
共立メンテナンス	14,400	4,920.00	70,848,000
イチネンホールディングス	9,900	1,204.00	11,919,600
建設技術研究所	6,400	1,472.00	9,420,800
スペース	6,200	1,222.00	7,576,400
長大	3,800	709.00	2,694,200
燦ホールディングス	2,100	2,366.00	4,968,600
スバル興業	700	5,630.00	3,941,000
東京テアトル	3,700	1,233.00	4,562,100
タナベ経営	1,800	1,288.00	2,318,400
ナガワ	2,600	5,600.00	14,560,000
よみうりランド	2,100	3,875.00	8,137,500
東京都競馬	6,200	2,885.00	17,887,000
カナモト	14,100	2,978.00	41,989,800
東京ドーム	35,200	929.00	32,700,800
西尾レントオール	9,600	3,415.00	32,784,000
トランス・コスモス	10,500	2,244.00	23,562,000
乃村工藝社	22,000	2,798.00	61,556,000
藤田観光	3,800	2,796.00	10,624,800
KNT - CTホールディングス	4,900	1,359.00	6,659,100
日本管財	10,100	1,920.00	19,392,000
トーカイ	9,100	2,766.00	25,170,600
白洋舎	1,100	2,817.00	3,098,700

セコム	99,600	9,235.00	919,806,000	
セントラル警備保障	4,500	4,650.00	20,925,000	
丹青社	17,800	1,119.00	19,918,200	
メイテック	11,900	4,700.00	55,930,000	
応用地質	10,200	1,177.00	12,005,400	
船井総研ホールディングス	19,600	1,695.00	33,222,000	
進学会ホールディングス	4,300	582.00	2,502,600	
オオバ	7,300	610.00	4,453,000	
いであ	1,900	983.00	1,867,700	
学究社	3,100	1,396.00	4,327,600	
ベネッセホールディングス	34,400	2,819.00	96,973,600	
イオンディライト	11,600	4,030.00	46,748,000	
ナック	5,900	1,058.00	6,242,200	
ニチイ学館	13,500	1,019.00	13,756,500	
ダイセキ	15,800	2,366.00	37,382,800	
ステップ	3,400	1,231.00	4,185,400	
合 計	111,780,600		216,130,363,030	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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18期中間計算期間(2019年1月23日から2019年7月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2019年 1月22日現在)	第18期中間計算期間 (2019年 7月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	68,525	-
コール・ローン	2,002,495	1,917,744
親投資信託受益証券	554,749,015	561,061,898
未収入金	29,661	925,628
流動資産合計	556,849,696	563,905,270
資産合計	556,849,696	563,905,270
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	891,580
未払受託者報酬	231,817	212,522
未払委託者報酬	1,589,552	1,457,234
未払利息	5	3
その他未払費用	21	-
流動負債合計	1,821,395	2,561,339
負債合計	1,821,395	2,561,339
純資産の部		
元本等		
元本	285,054,187	285,339,361
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	269,974,114	276,004,570
(分配準備積立金)	213,348,026	202,975,124
元本等合計	555,028,301	561,343,931
純資産合計	555,028,301	561,343,931
負債純資産合計	556,849,696	563,905,270

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 2018年 1月23日 至 2018年 7月22日	第18期中間計算期間 自 2019年 1月23日 至 2019年 7月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	45,159,637	7,322,035
営業収益合計	45,159,637	7,322,035
営業費用		
支払利息	496	369
受託者報酬	238,830	212,522
委託者報酬	1,637,632	1,457,234
その他費用	30	-
営業費用合計	1,876,988	1,670,125
営業利益又は営業損失（ ）	47,036,625	5,651,910
経常利益又は経常損失（ ）	47,036,625	5,651,910
中間純利益又は中間純損失（ ）	47,036,625	5,651,910
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,584,951	472,395
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	383,064,633	269,974,114
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,010,210	14,347,776
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,010,210	14,347,776
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,361,462	13,496,835
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,361,462	13,496,835
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	349,261,707	276,004,570

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2019年 1月22日現在)	第18期中間計算期間 (2019年 7月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	285,054,187口	285,339,361口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9471円 (19,471円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9673円 (19,673円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第18期中間計算期間 (2019年 7月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第18期中間計算期間 (2019年 7月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日	第18期中間計算期間 自 2019年 1月23日 至 2019年 7月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	288,415,113円	285,054,187円
期中追加設定元本額	57,375,711円	14,574,254円
期中一部解約元本額	60,736,637円	14,289,080円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2019年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,949,222,615
株式	217,558,526,710

	2019年 7月22日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	20,108,730
未収入金	1,041,880
未収配当金	324,987,994
差入委託証拠金	53,795,960
流動資産合計	219,907,683,889
資産合計	219,907,683,889
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,705,500
前受金	9,410,250
未払解約金	185,318,261
未払利息	4,055
その他未払費用	518
流動負債合計	205,438,584
負債合計	205,438,584
純資産の部	
元本等	
元本	132,199,995,077
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	87,502,250,228
元本等合計	219,702,245,305
純資産合計	219,702,245,305
負債純資産合計	219,907,683,889

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 7月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2019年 7月22日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,199,995,077口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.6619円 (1万口当たり純資産額) (16,619円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 7月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月23日
期首元本額	133,094,892,670円
期中追加設定元本額	5,031,721,621円
期中一部解約元本額	5,926,619,214円
期末元本額	132,199,995,077円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	763,328,102円
DC日本株式インデックスファンド	337,602,683円
DC日本株式インデックスファンドL	53,974,725,460円
DC日本株式インデックスファンドA	1,157,254,665円
DCバランスファンド30	2,270,914,370円
DCバランスファンド50	3,344,504,174円
DCバランスファンド70	1,739,866,090円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	623,891,864円
日本株式インデックスe	1,833,548,119円
インデックスコレクション（国内株式）	11,331,537,092円
インデックスコレクション（バランス株式30）	7,097,143,213円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,062,037,652円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,556,563,360円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,418,119,429円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,291,855,269円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,677,779,272円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	128,578,664円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,269,129,323円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	135,583,395円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	731,852,346円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,591,192円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	880,417,586円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,384,563,556円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	649,866,881円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,020,039,551円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	904,518,818円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	161,625,610円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,819,573,975円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	49,277,886円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	219,959,037円

区分	2019年 7月22日現在
バランスファンドV A (適格機関投資家専用)	2,775,759,281円
V Aバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	87,874,358円
V Aバランス50-50 (適格機関投資家専用)	87,640,685円
V Aファンド25 (適格機関投資家専用)	1,254,626,989円
バランスファンドV A 2 (適格機関投資家専用)	972,521,351円
バランスV A 20L (適格機関投資家専用)	21,782,124円
バランスV A 25L (適格機関投資家専用)	465,977,741円
バランスファンドV A 3 (適格機関投資家専用)	7,290,425,933円
世界バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	129,311,036円
国内バランスV A 30 (適格機関投資家専用)	65,186,884円
国内バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	11,933,163円
V Aバランス20-80 (適格機関投資家専用)	190,678,951円
私募日本株式インデックスファンドA L (適格機関投資家専用)	6,027,947円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 7月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,056,079,750	-	2,065,490,000	9,410,250
合計		2,056,079,750	-	2,065,490,000	9,410,250

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

(2019年 8月30日現在)

資産総額	542,138,421円
負債総額	376,570円
純資産総額（ - ）	541,761,851円
発行済口数	283,540,473口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9107円
（1万口当たり純資産額）	（19,107円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2019年 8月30日現在)

資産総額	215,352,740,021円
負債総額	1,033,884,761円
純資産総額（ - ）	214,318,855,260円
発行済口数	132,699,524,487口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6151円
（1万口当たり純資産額）	（16,151円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2019年 8月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2019年10月21日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	517	12,293,215
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	88	343,157
単位型公社債投資信託	7	58,802
合計	612	12,695,174

3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,973,152	23,830,484
有価証券	-	2,268,127
前払費用	157,614	197,843
未収委託者報酬	5,373,307	6,351,590
未収運用受託報酬	-	5,525,778
未収収益	896	212,722
その他	8,946	2,261,900
流動資産合計	29,513,917	40,648,447
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 36,782	1 282,407
器具備品	1 79,655	1 564,981
その他	1 1,912	1 14,462
有形固定資産合計	118,350	861,851
無形固定資産		
ソフトウェア	210,679	1,487,265
その他	4,377	7,256
無形固定資産合計	215,056	1,494,522
投資その他の資産		
投資有価証券	42,802	11,334,053
関係会社株式	-	4,663,000
長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	22,767,534	28,501,567
利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411
負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851
旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240
営業利益	5,516,262	8,554,888

(単位:千円)

前事業年度

当事業年度

（自 2017年4月1日
至 2018年3月31日）（自 2018年4月1日
至 2019年3月31日）

営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本	
	利益剰余金	
	その他利益剰余金	

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				30,000
当期純利益				3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317		1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	-	1,317	3,744,907
当期末残高	182	-	182	25,592,216

当事業年度（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	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本	
	利益剰余金	

	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

ております。

4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

6．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7．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。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

(有形固定資産の減価償却方法の変更)

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016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）を採用していましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

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ており、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ております。

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」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。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、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。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、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。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、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017年6月30日

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

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

2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日
----------------------	------	--------	-----------	--------	------------	------------

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

2019年6月27日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
(2) 未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額 （*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-

(7) デリバティブ取引 (*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

(5) 未払金、及び(6) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位:千円)

区分	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2018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
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度(2019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
現金及び預金	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

２．その他有価証券

前事業年度（2018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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

当事業年度（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
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405,802	3,432,259	973,543
小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2018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
62,968	499	2,224

当事業年度（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
1,538,203	46,789	34,437

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
	スイスフラン	1,110	-	5	5
	香港ドル	560	-	4	4
	ユーロ	2,492	-	0	0
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
--------------	------------------	---------	--------------	------------------------	------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建				
	ユーロ		6,313	-	86
	合計		8,643,951	-	82,081

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	"
有価証券評価差額	-	"	173,602	"
繰延ヘッジ損益	-	"	58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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

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

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

（1）取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

（2）実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」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」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,945,175千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	4,809,206	その他未払金	424,421

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	-	-

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2018年3月31日）

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

当事業年度（2019年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日	当事業年度 (自 2018年4月1日

	至 2018年3月31日)	至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の見取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2019年10月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2019年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2019年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 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トラスト・アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019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。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年3月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドの2018年1月23日から2019年1月22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。

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、DC日本株式インデックスファンドの2019年1月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年9月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドの2019年1月23日から2019年7月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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。

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中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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。また、中間監査には、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中間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、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。

中間監査意見

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、DC日本株式インデックスファンドの2019年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年1月23日から2019年7月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。