

## 【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9月10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A
【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A

### （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 9月11日から2020年 3月10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 : <http://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。)における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

## 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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。  
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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 >

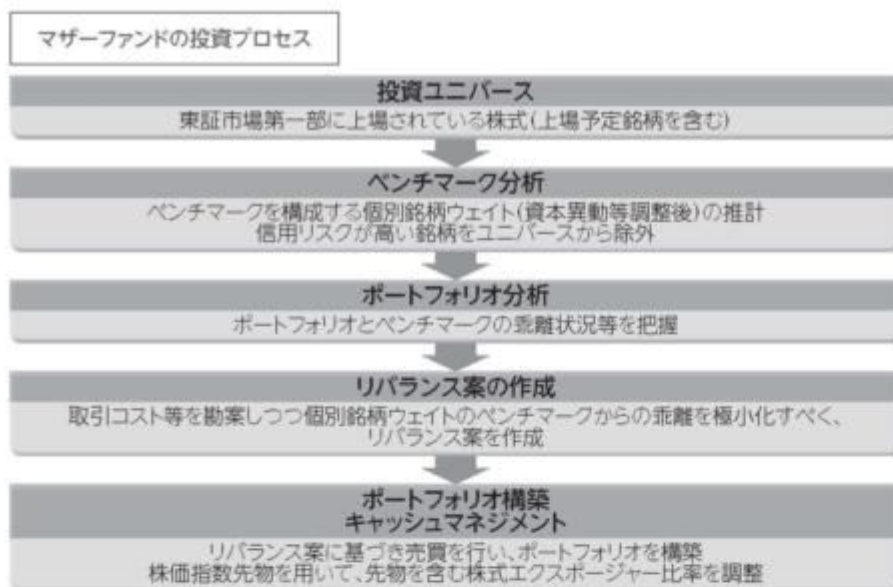
## 東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>(注)</sup>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。

#### (注) 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。



※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。

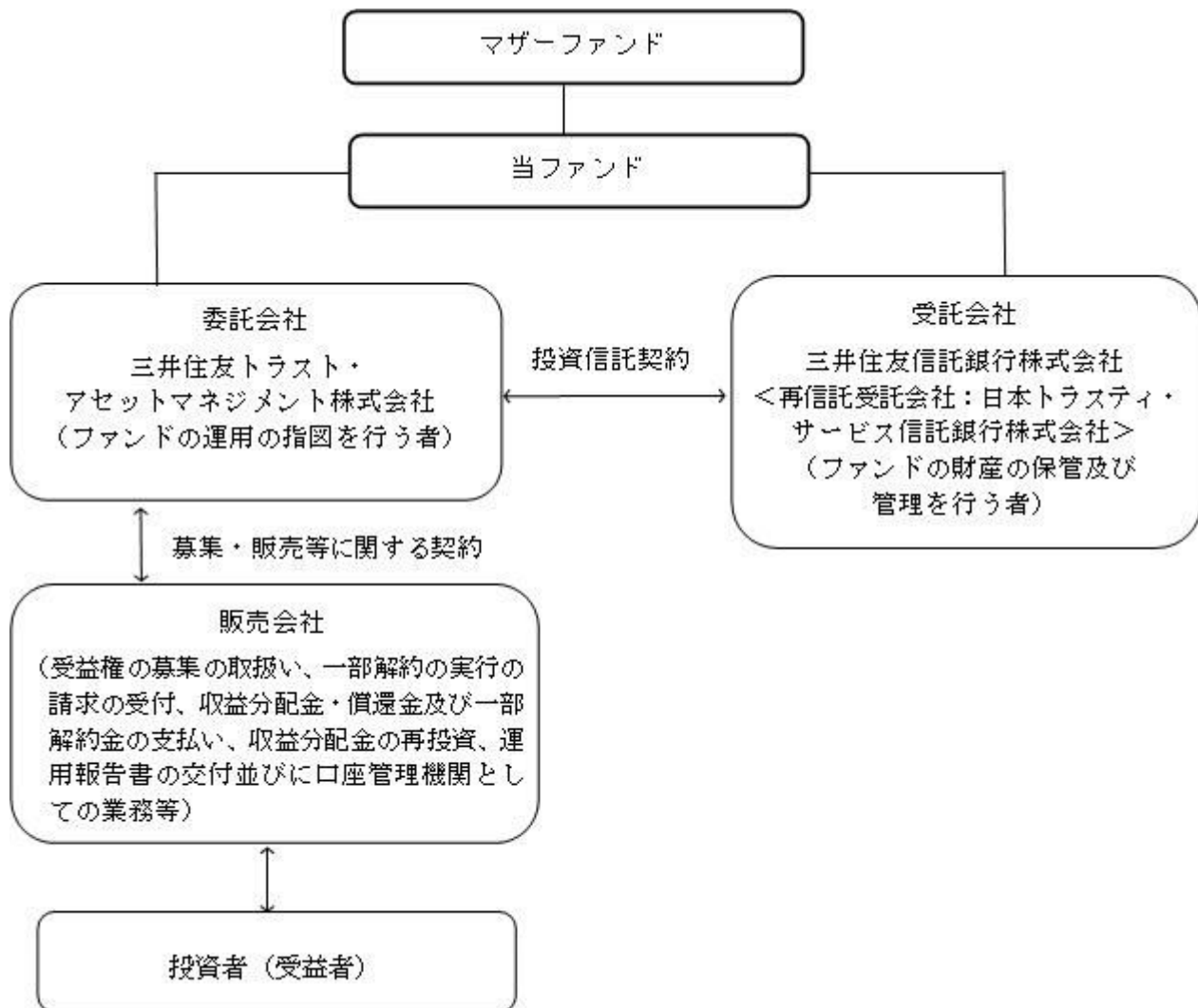
## (2) 【ファンドの沿革】

2002年12月11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AからDC日本株式インデックスファンドA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 6月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

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

## ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

当ファンドは、主としてわが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、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、T O P I X（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（信託財産に属する他の投資信託受益証券（振替受益権を含みます。）の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合）は、原則として信託財産総額の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。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - A．有価証券
  - B．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、後記（5）投資制限<約款に定める投資制限>J．、K．及びL．に定めるものに限りません。）
  - C．金銭債権（上記A．、B．及び下記D．に掲げるものに該当するものを除きます。）

D．約束手形（上記A．に掲げるものに該当するものを除きます。）

## 2．次に掲げる特定資産以外の資産

A．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会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社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。

A．株券又は新株引受権証券

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

E．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。）

F．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。）

G．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。）

H．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券

I．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。）

J．コマーシャル・ペーパー

K．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

L．外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記A．からK．までの証券又は証券の性質を有するもの

M．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。）

N．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。）

O．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。）

P．オプションを表示する証券又は証券（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。）

Q．預託証券（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。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証券

S．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。）

T．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。）

U．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

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記A．の証券又は証券並びに上記L．及び上記Q．の証券又は証券のうち上記A．の証券又は証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記B．から上記F．までの証券並びに上記L．及び上記Q．の証券又は証券のうち上記B．から上記F．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M．の証券及び上記N．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2．運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

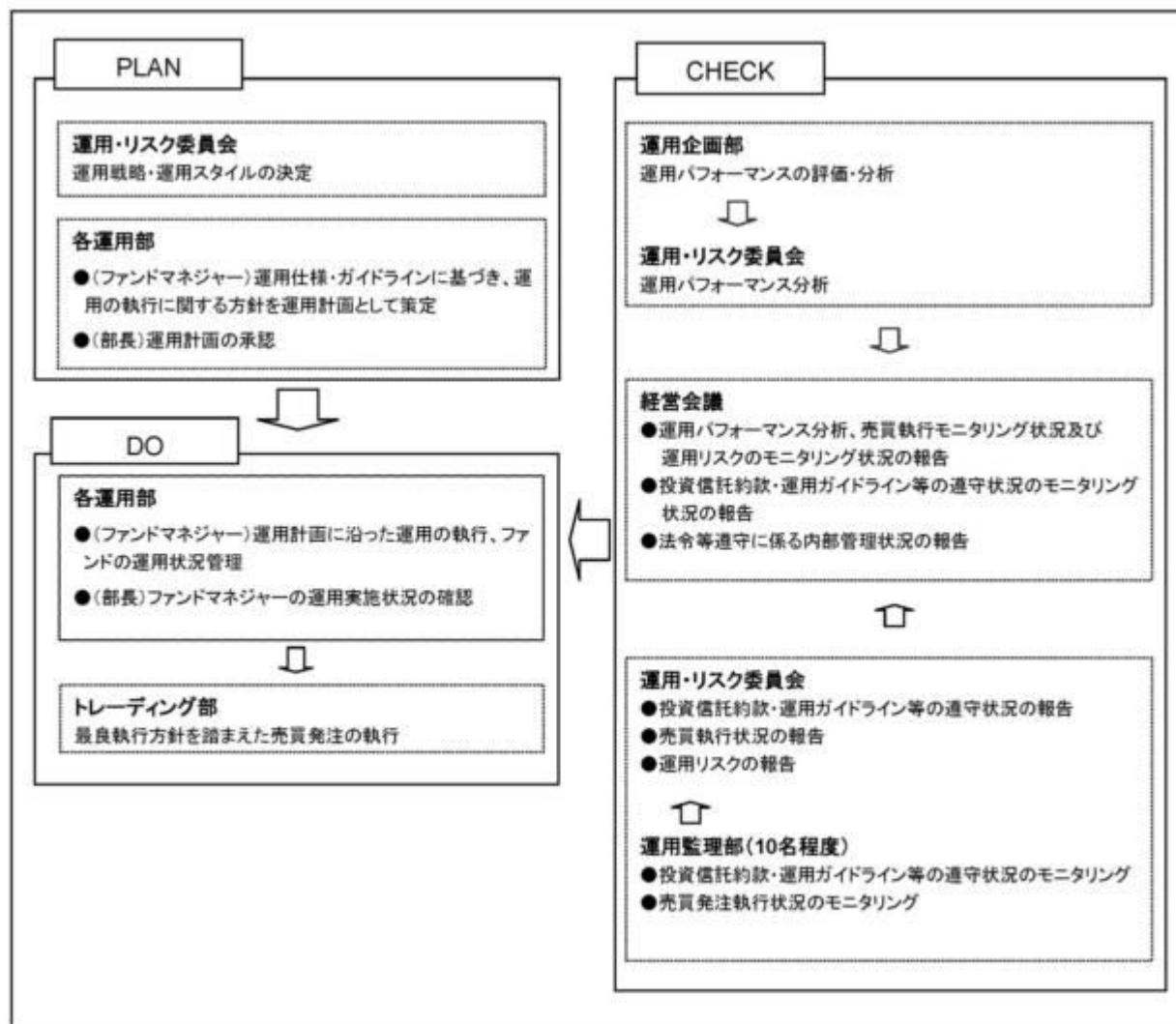
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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12月10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．信用取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、委託会社はすみやかに、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。

ニ．上記ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、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。

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

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

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、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、委託会社はすみやかに、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、有価証券の貸付にあたり、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、信託財産において有していない公社債又は、下記ロ．の規定により借入れた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、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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、委託会社はすみやかに、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。

#### 〇．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あたり、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、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

#### Ｑ．再投資の指図

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

#### Ｒ．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券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。

#### Ｓ．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替え金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

T. 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。

U. 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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有

価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

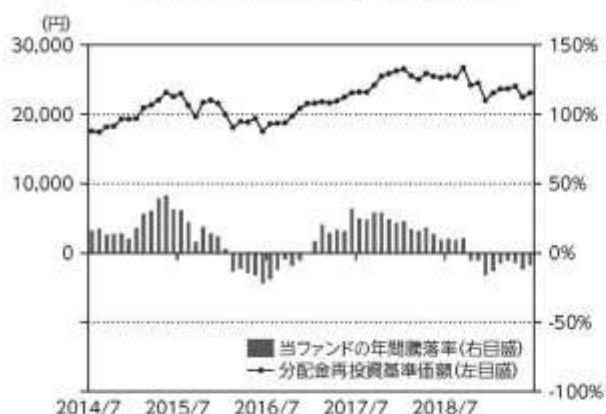
確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

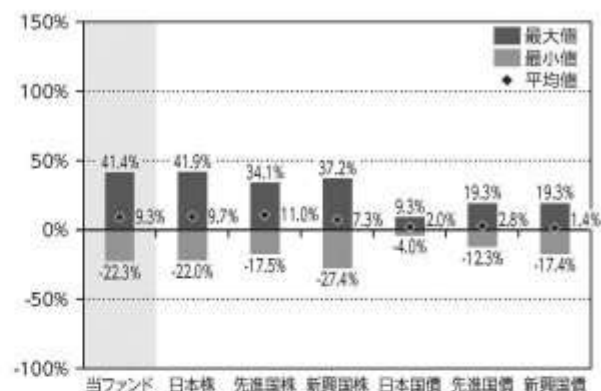
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*2014年7月～2019年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの指数

日本株・・・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

先進国株・・・ MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※2</sup>

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)<sup>※3</sup>

日本国債・・・ NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

先進国債・・・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>※5</sup>

新興国債・・・ JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(円ベース)<sup>※6</sup>

(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あります。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2 MSCIロクサイ・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。

※3 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。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、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。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 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せん。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.4212%（\*）（税抜 0.39%）（ ）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 0.2376% (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 0.1296% (税抜 0.12%)	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 0.054% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

\*消費税率が10%になった場合は、0.429%となります。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 0.132% (税抜 0.12%)	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 0.055% (税抜 0.05%)	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 6月28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6月28日現在の状況について記載してあります。

#### 【DC日本株式インデックスファンドA】

##### （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	1,925,799,841	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		964,659	0.05
合計(純資産総額)		1,926,764,500	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(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	1,162,641,778	1.6702	1,941,844,298	1.6564	1,925,799,841	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第7期計算期間末	(2009年12月10日)	1,204,086,539	1,204,086,539	10,971	10,971
第8期計算期間末	(2010年12月10日)	1,201,314,433	1,201,314,433	11,341	11,341
第9期計算期間末	(2011年12月12日)	1,089,966,022	1,089,966,022	9,711	9,711
第10期計算期間末	(2012年12月10日)	1,172,924,685	1,172,924,685	10,460	10,460
第11期計算期間末	(2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末	(2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末	(2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末	(2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末	(2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176

第16期計算期間末	(2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
	2018年 6月末日	2,150,208,232		25,255	
	7月末日	2,163,166,018		25,573	
	8月末日	2,157,896,299		25,311	
	9月末日	2,266,725,663		26,710	
	10月末日	2,026,600,021		24,192	
	11月末日	2,076,339,142		24,505	
	12月末日	1,865,371,086		21,989	
	2019年 1月末日	1,951,244,572		23,062	
	2月末日	1,983,040,656		23,653	
	3月末日	1,992,012,833		23,666	
	4月末日	2,015,577,710		24,051	
	5月末日	1,879,633,702		22,478	
	6月末日	1,926,764,500		23,085	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	0
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	0
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	0
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	0
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	0
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	6.3
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	3.4
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	14.4
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	7.7
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5

第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期中間計算期間	2018年12月11日～2019年6月10日	1.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	217,735,038	121,325,019	1,097,544,565
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	219,646,942	257,914,603	1,059,276,904
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	222,832,492	159,705,810	1,122,403,586
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	232,065,601	233,152,933	1,121,316,254
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期中間計算期間	2018年12月11日～2019年6月10日	61,092,833	74,365,590	832,297,922

(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	216,722,708,610	98.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,299,621,100	1.50
合計(純資産総額)		220,022,329,710	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	3,272,610,000	1.49

(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	1,085,900	6,779.54	7,361,910,712	6,688.00	7,262,499,200	3.30
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	799,200	3,950.45	3,157,204,140	5,165.00	4,127,868,000	1.88
日本	株式	ソニー	電気機器	653,900	5,351.55	3,499,381,750	5,648.00	3,693,227,200	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,616,100	575.47	3,807,406,525	512.00	3,387,443,200	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	654,000	4,557.93	2,980,889,010	5,017.00	3,281,118,000	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	850,700	4,467.22	3,800,266,276	3,823.00	3,252,226,100	1.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	47,800	54,054.00	2,583,781,364	66,130.00	3,161,014,000	1.44
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	677,400	3,925.29	2,658,994,607	3,806.00	2,578,184,400	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	667,100	2,872.15	1,916,015,865	3,594.00	2,397,557,400	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	822,100	3,227.81	2,653,586,243	2,785.00	2,289,548,500	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	55,800	33,818.64	1,887,080,360	39,490.00	2,203,542,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	783,900	2,701.24	2,117,506,570	2,743.50	2,150,629,650	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,059,900	176.38	2,303,508,746	156.10	2,038,650,390	0.93
日本	株式	花王	化学	236,600	7,621.71	1,803,297,817	8,210.00	1,942,486,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	673,500	3,119.96	2,101,297,640	2,840.00	1,912,740,000	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,300	23,388.90	2,041,851,112	21,580.00	1,883,934,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	133,000	11,828.55	1,573,198,100	14,065.00	1,870,645,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	343,700	5,325.44	1,830,355,507	5,399.00	1,855,636,300	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	92,600	18,214.54	1,686,666,655	19,930.00	1,845,518,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	173,300	10,062.01	1,743,747,150	10,080.00	1,746,864,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	438,700	3,460.35	1,518,057,274	3,949.00	1,732,426,300	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	117,300	12,466.17	1,462,282,798	14,725.00	1,727,242,500	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	168,200	8,560.10	1,439,810,412	10,035.00	1,687,887,000	0.77
日本	株式	キャノン	電気機器	524,600	3,071.72	1,611,427,375	3,146.00	1,650,391,600	0.75
日本	株式	HOYA	精密機器	196,200	6,319.27	1,239,842,175	8,254.00	1,619,434,800	0.74
日本	株式	資生堂	化学	193,600	6,286.21	1,217,011,828	8,121.00	1,572,225,600	0.71
日本	株式	第一三共	医薬品	278,900	3,806.97	1,061,765,492	5,635.00	1,571,601,500	0.71
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	605,500	2,577.05	1,560,404,392	2,512.50	1,521,318,750	0.69
日本	株式	村田製作所	電気機器	306,800	4,684.48	1,437,199,011	4,840.00	1,484,912,000	0.67
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	402,300	4,776.16	1,921,449,690	3,648.00	1,467,590,400	0.67

(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。

#### □.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	2.76
		食料品	4.05
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.29
		医薬品	5.41
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.77
		ガラス・土石製品	0.85
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.55
		機械	5.10
		電気機器	13.39
		輸送用機器	7.72
		精密機器	2.10
		その他製品	2.13
		電気・ガス業	1.64
		陸運業	4.65
		海運業	0.16
		空運業	0.54
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	8.77
		卸売業	4.88
		小売業	4.48
		銀行業	5.77
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.25
		その他金融業	1.11
不動産業	2.39		
サービス業	5.20		
	小計	98.50	
合計		98.50	

(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	T O P I X 先物	買建	211	円	3,227,684,250	3,272,610,000	1.49

(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

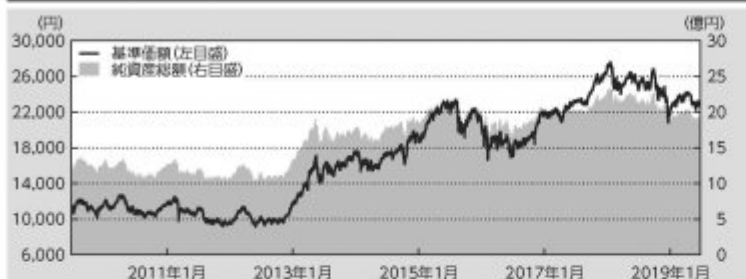
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2002年12月11日

作成基準日：2019年6月28日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	23,085円
純資産総額	19.27億円

※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。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2014年12月	2015年12月	2016年12月	2017年12月	2018年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

### 主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.9%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.7%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.5%
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	1.2%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	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：http://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なります。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、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（http://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：<http://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（<http://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： <http://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12月11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12月11日から翌年12月10日までとすることを原則とします。

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

#### （5）【その他】

##### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### （1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

##### （2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に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、持分に依り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16期計算期間(2017年12月12日から2018年12月10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A】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2017年12月11日現在)	第16期 (2018年12月10日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	6,068,824	5,374,048
親投資信託受益証券	2,208,061,471	1,974,354,131
未収入金	2,484,508	3,337,244
流動資産合計	2,216,614,803	1,983,065,423
<b>資産合計</b>	2,216,614,803	1,983,065,423
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	3,115,228	3,251,708
未払受託者報酬	556,337	570,880
未払委託者報酬	3,783,049	3,881,892
未払利息	9	15
その他未払費用	-	65
流動負債合計	7,454,623	7,704,560
<b>負債合計</b>	7,454,623	7,704,560
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	843,966,902	845,570,679
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,365,193,278	1,129,790,184
(分配準備積立金)	657,754,032	584,105,376
元本等合計	2,209,160,180	1,975,360,863
<b>純資産合計</b>	2,209,160,180	1,975,360,863
<b>負債純資産合計</b>	2,216,614,803	1,983,065,423

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第15期		第16期	
	自	2016年12月13日 至 2017年12月11日	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日
営業収益				
受取利息		2		-
有価証券売買等損益		393,874,843		229,626,981
営業収益合計		393,874,845		229,626,981
営業費用				
支払利息		2,756		3,295
受託者報酬		1,094,508		1,166,144
委託者報酬		7,442,601		7,929,594
その他費用		13		181
営業費用合計		8,539,878		9,099,214
営業利益又は営業損失( )		385,334,967		238,726,195
経常利益又は経常損失( )		385,334,967		238,726,195
当期純利益又は当期純損失( )		385,334,967		238,726,195
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( )		35,175,935		11,561,683
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,112,279,190		1,365,193,278
剰余金増加額又は欠損金減少額		260,803,259		245,142,688
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		260,803,259		245,142,688
剰余金減少額又は欠損金増加額		358,048,203		253,381,270
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		358,048,203		253,381,270
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,365,193,278		1,129,790,184

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2017年12月12日から2018年12月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2017年12月11日現在)	第16期 (2018年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	843,966,902口	845,570,679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) 2.6176円 (26,176円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3361円 (23,361円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2016年12月13日 至 2017年12月11日			第16期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10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	39,230,451円	費用控除後の配当等収益額	A	36,839,864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	310,928,581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	1,054,412,586円	収益調整金額	C	1,169,330,674円
分配準備積立金額	D	307,595,000円	分配準備積立金額	D	547,265,512円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,712,166,618円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,753,436,050円
当ファンドの期末残存口数	F	843,966,902口	当ファンドの期末残存口数	F	845,570,679口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,287円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,736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16期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第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16期 (2018年12月10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15期	第16期
	自 2016年12月13日 至 2017年12月11日	自 2017年12月12日 至 2018年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	949,060,361円	843,966,902円
期中追加設定元本額	199,865,073円	159,092,319円
期中一部解約元本額	304,958,532円	157,488,542円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第15期 (2017年12月11日現在)	第16期 (2018年12月10日現在)
	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	367,744,765	216,985,345
合計	367,744,765	216,985,345

## （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	1,180,551,382	1,974,354,131	
合計		1,180,551,382	1,974,354,131	

(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

	2018年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,295,109,954
株式	213,793,923,570
未収配当金	123,032,877
前払金	53,790,000
差入委託証拠金	24,122,000
流動資産合計	217,289,978,401
資産合計	217,289,978,401
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,790,540
未払金	787,296,340
未払解約金	168,267,537
未払利息	9,312
その他未払費用	41,600
流動負債合計	1,009,405,329
負債合計	1,009,405,329
純資産の部	
元本等	
元本	129,324,616,612
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	86,955,956,460

	2018年12月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	216,280,573,072
純資産合計	216,280,573,072
負債純資産合計	217,289,978,401

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年12月10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）

	2018年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	129,324,616,612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 1.6724円 (1万口当たり純資産額) (16,724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

	2018年12月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2018年12月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



	2018年12月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2018年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	130,824,852,131円
期中追加設定元本額	11,642,592,873円
期中一部解約元本額	13,142,828,392円
期末元本額	129,324,616,612円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	783,357,123円
D C 日本株式インデックスファンド	344,614,893円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,184,176,899円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,180,551,382円
D C バランスファンド 3 0	2,041,374,937円
D C バランスファンド 5 0	3,039,020,945円
D C バランスファンド 7 0	1,604,407,074円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	617,784,003円
日本株式インデックス e	1,879,172,042円
インデックスコレクション（国内株式）	11,087,259,239円

区分	2018年12月10日現在
インデックスコレクション(バランス株式30)	5,531,057,941円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,510,745,501円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,232,372,092円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,242,029,106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)	2,346,892,931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)	1,885,352,142円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	161,972,179円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	1,484,195,690円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	136,520,689円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	771,786,800円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	10,965,342円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	863,946,912円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,348,438,202円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	636,479,504円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	10,870,527,327円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	921,851,172円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	177,521,259円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,793,634,788円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	46,835,751円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	213,951,831円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,789,637,661円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	85,439,171円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	84,898,622円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	38,798,135円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,244,583,111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)	27,486,202円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	434,276,494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)	133,300,302円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	65,409,621円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	11,336,216円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	187,485,872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)	4,879,193円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2018年12月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	38,496,503,400
合計	38,496,503,400

(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

(2018年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,436,570,000	-	2,382,780,000	53,790,000
合計		2,436,570,000	-	2,382,780,000	53,790,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,200	3,105.00	13,041,000	
日本水産	129,000	666.00	85,914,000	
マルハニチロ	18,600	3,905.00	72,633,000	
カネコ種苗	3,600	1,378.00	4,960,800	
サカタのタネ	15,700	3,855.00	60,523,500	
ホクト	10,800	2,014.00	21,751,200	
ホクリヨウ	1,700	701.00	1,191,700	
住石ホールディングス	27,600	108.00	2,980,800	
日鉄鉱業	3,000	4,920.00	14,760,000	
三井松島ホールディングス	5,400	1,549.00	8,364,600	
国際石油開発帝石	517,700	1,193.50	617,874,950	
石油資源開発	18,500	2,412.00	44,622,000	
K&Oエナジーグループ	6,300	1,567.00	9,872,100	
ヒノキヤグループ	2,700	2,093.00	5,651,100	
ショーボンドホールディングス	10,000	8,520.00	85,200,000	
ミライト・ホールディングス	33,000	1,537.00	50,721,000	
タマホーム	8,000	1,074.00	8,592,000	

サンヨーホームズ	1,900	835.00	1,586,500
日本アクア	3,000	385.00	1,155,000
ファーストコーポレーション	3,500	933.00	3,265,500
ベストテラ	2,500	1,608.00	4,020,000
TATERU	15,200	368.00	5,593,600
スペースバリューホールディングス	15,700	1,025.00	16,092,500
ダイセキ環境ソリューション	2,500	793.00	1,982,500
第一カッター興業	1,400	1,965.00	2,751,000
安藤・間	83,200	681.00	56,659,200
東急建設	38,300	1,018.00	38,989,400
コムシスホールディングス	45,800	2,656.00	121,644,800
ミサワホーム	10,800	814.00	8,791,200
ピーアールホールディングス	10,500	387.00	4,063,500
高松コンストラクショングループ	8,200	2,680.00	21,976,000
東建コーポレーション	4,000	7,390.00	29,560,000
ソネック	1,300	754.00	980,200
ヤマウラ	5,500	956.00	5,258,000
大成建設	106,100	4,835.00	512,993,500
大林組	319,700	1,070.00	342,079,000
清水建設	326,200	889.00	289,991,800
飛鳥建設	9,500	1,482.00	14,079,000
長谷工コーポレーション	133,500	1,290.00	172,215,000
松井建設	12,300	786.00	9,667,800
銭高組	1,300	5,220.00	6,786,000
鹿島建設	249,900	1,475.00	368,602,500
不動テトラ	8,300	1,812.00	15,039,600
大末建設	4,200	1,139.00	4,783,800
鉄建建設	6,600	2,748.00	18,136,800
西松建設	23,200	2,447.00	56,770,400
三井住友建設	74,400	647.00	48,136,800
大豊建設	7,300	3,595.00	26,243,500
前田建設工業	76,400	1,103.00	84,269,200
佐田建設	8,000	407.00	3,256,000
ナカノフドー建設	8,900	560.00	4,984,000
奥村組	17,700	3,525.00	62,392,500
東鉄工業	12,800	3,130.00	40,064,000
イチケン	2,200	2,002.00	4,404,400
富士ピー・エス	3,300	445.00	1,468,500
浅沼組	3,900	3,120.00	12,168,000
戸田建設	124,400	686.00	85,338,400
熊谷組	15,300	3,415.00	52,249,500
青木あすなろ建設	5,700	998.00	5,688,600

北野建設	2,300	3,995.00	9,188,500
植木組	1,500	2,384.00	3,576,000
矢作建設工業	14,500	725.00	10,512,500
ピーエス三菱	11,900	669.00	7,961,100
日本ハウスホールディングス	20,200	477.00	9,635,400
大東建託	38,000	15,070.00	572,660,000
新日本建設	13,100	1,062.00	13,912,200
N I P P O	28,200	1,938.00	54,651,600
東亜道路工業	2,000	3,090.00	6,180,000
前田道路	33,300	2,123.00	70,695,900
日本道路	2,900	6,060.00	17,574,000
東亜建設工業	8,400	1,444.00	12,129,600
若築建設	5,400	1,642.00	8,866,800
東洋建設	39,000	404.00	15,756,000
五洋建設	126,600	675.00	85,455,000
世紀東急工業	15,500	641.00	9,935,500
福田組	3,500	4,655.00	16,292,500
住友林業	75,800	1,497.00	113,472,600
日本基礎技術	10,800	324.00	3,499,200
巴コーポレーション	14,300	399.00	5,705,700
大和ハウス工業	295,000	3,417.00	1,008,015,000
ライト工業	20,500	1,491.00	30,565,500
積水ハウス	326,300	1,638.00	534,479,400
日特建設	9,100	676.00	6,151,600
北陸電気工事	5,200	966.00	5,023,200
ユアテック	17,000	889.00	15,113,000
四電工	1,600	2,632.00	4,211,200
中電工	13,700	2,347.00	32,153,900
関電工	48,400	1,105.00	53,482,000
きんでん	70,800	1,858.00	131,546,400
東京エネシス	11,000	953.00	10,483,000
トーエネック	3,000	3,165.00	9,495,000
住友電設	7,400	1,823.00	13,490,200
日本電設工業	18,200	2,320.00	42,224,000
協和エクシオ	41,700	2,588.00	107,919,600
新日本空調	9,200	1,921.00	17,673,200
九電工	21,000	4,015.00	84,315,000
三機工業	24,900	1,114.00	27,738,600
日揮	92,000	1,641.00	150,972,000
中外炉工業	3,200	2,240.00	7,168,000
ヤマト	10,300	569.00	5,860,700
太平電業	7,200	2,667.00	19,202,400

高砂熱学工業	27,100	1,892.00	51,273,200
三晃金属工業	1,500	2,856.00	4,284,000
朝日工業社	2,400	3,150.00	7,560,000
明星工業	19,300	787.00	15,189,100
大気社	14,700	2,950.00	43,365,000
ダイダン	7,300	2,604.00	19,009,200
日比谷総合設備	10,200	1,811.00	18,472,200
東芝プラントシステム	23,300	2,231.00	51,982,300
O S J Bホールディングス	47,000	321.00	15,087,000
東洋エンジニアリング	12,200	745.00	9,089,000
新興プランテック	19,100	1,159.00	22,136,900
日本製粉	31,600	1,885.00	59,566,000
日清製粉グループ本社	107,700	2,320.00	249,864,000
日東富士製粉	700	5,550.00	3,885,000
昭和産業	8,800	2,893.00	25,458,400
鳥越製粉	8,400	904.00	7,593,600
中部飼料	11,600	1,289.00	14,952,400
フィード・ワン	64,100	191.00	12,243,100
東洋精糖	1,400	1,134.00	1,587,600
日本甜菜製糖	5,400	1,878.00	10,141,200
三井製糖	7,500	2,967.00	22,252,500
塩水港精糖	10,200	240.00	2,448,000
日新製糖	4,500	2,260.00	10,170,000
森永製菓	24,000	4,795.00	115,080,000
中村屋	2,500	4,340.00	10,850,000
江崎グリコ	28,700	5,570.00	159,859,000
名糖産業	4,600	1,414.00	6,504,400
井村屋グループ	4,100	2,839.00	11,639,900
不二家	5,300	2,444.00	12,953,200
山崎製パン	78,000	2,354.00	183,612,000
第一屋製パン	1,600	1,129.00	1,806,400
モロゾフ	1,600	5,300.00	8,480,000
亀田製菓	5,900	5,320.00	31,388,000
寿スピリッツ	10,100	4,560.00	46,056,000
カルビー	43,500	3,560.00	154,860,000
森永乳業	19,100	3,190.00	60,929,000
六甲バター	7,000	2,279.00	15,953,000
ヤクルト本社	70,600	8,340.00	588,804,000
明治ホールディングス	67,600	8,720.00	589,472,000
雪印メグミルク	23,000	2,999.00	68,977,000
プリマハム	13,400	2,026.00	27,148,400
日本ハム	41,200	4,065.00	167,478,000

林兼産業	3,100	636.00	1,971,600	
丸大食品	10,200	1,906.00	19,441,200	
S Foods	8,600	4,410.00	37,926,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	61,400	705.00	43,287,000	
サッポロホールディングス	34,900	2,397.00	83,655,300	
アサヒグループホールディングス	199,700	4,373.00	873,288,100	
キリンホールディングス	431,400	2,427.00	1,047,007,800	
宝ホールディングス	71,400	1,381.00	98,603,400	
オエノンホールディングス	27,100	376.00	10,189,600	
養命酒製造	2,900	2,248.00	6,519,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	73,000	3,225.00	235,425,000	
サントリー食品インターナショナル	63,800	4,730.00	301,774,000	
ダイドーグループホールディングス	5,400	6,010.00	32,454,000	
伊藤園	31,600	5,010.00	158,316,000	
キーコーヒー	9,400	2,112.00	19,852,800	
ユニカフェ	2,900	1,195.00	3,465,500	
ジャパンフーズ	1,400	1,215.00	1,701,000	
日清オイリオグループ	12,300	3,375.00	41,512,500	
不二製油グループ本社	23,200	3,620.00	83,984,000	
かどや製油	1,000	5,670.00	5,670,000	
J - オイルミルズ	4,900	3,965.00	19,428,500	
キッコーマン	62,900	6,280.00	395,012,000	
味の素	210,600	1,881.00	396,138,600	
キューピー	53,100	2,657.00	141,086,700	
ハウス食品グループ本社	36,400	3,920.00	142,688,000	
カゴメ	38,200	3,095.00	118,229,000	
焼津水産化学工業	4,600	1,030.00	4,738,000	
アリアケジャパン	8,700	9,300.00	80,910,000	
ピエトロ	1,200	1,649.00	1,978,800	
エバラ食品工業	2,300	2,116.00	4,866,800	
ニチレイ	49,500	3,160.00	156,420,000	
東洋水産	49,100	4,010.00	196,891,000	
イトアンド	3,300	1,646.00	5,431,800	
大冷	1,100	1,810.00	1,991,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,600	605.00	1,573,000	
日清食品ホールディングス	40,500	7,120.00	288,360,000	
永谷園ホールディングス	5,100	2,684.00	13,688,400	
一正蒲鉾	3,700	1,033.00	3,822,100	
フジッコ	10,300	2,453.00	25,265,900	
ロック・フィールド	10,300	1,729.00	17,808,700	
日本たばこ産業	550,700	2,803.50	1,543,887,450	
ケンコーマヨネーズ	5,300	2,216.00	11,744,800	

わらべや日洋ホールディングス	6,200	1,926.00	11,941,200
なとり	5,300	1,788.00	9,476,400
イフジ産業	1,700	704.00	1,196,800
ピクルスコーポレーション	2,300	2,220.00	5,106,000
北の達人コーポレーション	37,500	451.00	16,912,500
ユーグレナ	39,500	665.00	26,267,500
ミヨシ油脂	3,600	1,208.00	4,348,800
理研ビタミン	4,500	3,635.00	16,357,500
片倉工業	11,500	1,173.00	13,489,500
ゲンゼ	6,800	4,260.00	28,968,000
東洋紡	39,500	1,558.00	61,541,000
ユニチカ	27,400	509.00	13,946,600
富士紡ホールディングス	4,900	2,854.00	13,984,600
倉敷紡績	8,900	2,820.00	25,098,000
シキボウ	4,900	1,117.00	5,473,300
日本毛織	30,700	885.00	27,169,500
トーア紡コーポレーション	3,900	534.00	2,082,600
ダイドーリミテッド	11,300	360.00	4,068,000
帝国繊維	10,500	2,284.00	23,982,000
帝人	76,000	1,873.00	142,348,000
東レ	722,000	827.00	597,094,000
サカイオーベックス	2,300	2,368.00	5,446,400
住江織物	2,500	2,615.00	6,537,500
日本フェルト	5,400	474.00	2,559,600
イチカワ	1,400	1,470.00	2,058,000
日東製網	1,100	1,435.00	1,578,500
アツギ	7,700	1,011.00	7,784,700
ダイニック	3,800	761.00	2,891,800
セーレン	22,900	1,768.00	40,487,200
ソトー	3,800	961.00	3,651,800
東海染工	1,300	1,095.00	1,423,500
小松マテーレ	15,400	843.00	12,982,200
ワコールホールディングス	27,100	2,943.00	79,755,300
ホギメディカル	11,600	3,185.00	36,946,000
レナウン	26,700	111.00	2,963,700
クラウドシアホールディングス	2,400	488.00	1,171,200
T S Iホールディングス	34,400	687.00	23,632,800
マツオカコーポレーション	3,000	3,345.00	10,035,000
ワールド	9,700	1,724.00	16,722,800
三陽商会	5,600	1,991.00	11,149,600
ナイガイ	3,500	541.00	1,893,500
オンワードホールディングス	57,400	619.00	35,530,600



ルックホールディングス	3,500	1,016.00	3,556,000	
ゴールドウイン	8,400	11,130.00	93,492,000	
デサント	22,700	2,025.00	45,967,500	
キング	5,000	502.00	2,510,000	
ヤマトインターナショナル	6,300	437.00	2,753,100	
特種東海製紙	5,900	4,350.00	25,665,000	
王子ホールディングス	418,900	629.00	263,488,100	
日本製紙	44,600	2,036.00	90,805,600	
三菱製紙	15,200	545.00	8,284,000	
北越コーポレーション	61,700	555.00	34,243,500	
中越パルプ工業	3,900	1,513.00	5,900,700	
巴川製紙所	3,100	1,049.00	3,251,900	
大王製紙	45,300	1,321.00	59,841,300	
阿波製紙	2,400	530.00	1,272,000	
レンゴー	96,000	893.00	85,728,000	
トモク	5,700	1,783.00	10,163,100	
ザ・パック	7,000	3,070.00	21,490,000	
クラレ	157,000	1,691.00	265,487,000	
旭化成	662,000	1,145.50	758,321,000	
共和レザー	5,800	825.00	4,785,000	
昭和電工	61,800	3,740.00	231,132,000	
住友化学	732,500	580.00	424,850,000	
住友精化	4,500	4,445.00	20,002,500	
日産化学	57,100	6,060.00	346,026,000	
ラサ工業	3,300	1,449.00	4,781,700	
クレハ	8,600	7,310.00	62,866,000	
多木化学	1,400	8,710.00	12,194,000	
テイカ	7,600	1,839.00	13,976,400	
石原産業	17,900	1,100.00	19,690,000	
片倉コープアグリ	2,700	1,160.00	3,132,000	
日東エフシー	5,900	765.00	4,513,500	
日本曹達	14,700	2,729.00	40,116,300	
東ソー	143,800	1,443.00	207,503,400	
トクヤマ	26,800	2,714.00	72,735,200	
セントラル硝子	20,300	2,432.00	49,369,600	
東亜合成	58,400	1,206.00	70,430,400	
大阪ソーダ	10,000	2,583.00	25,830,000	
関東電化工業	22,100	864.00	19,094,400	
デンカ	36,600	3,430.00	125,538,000	
信越化学工業	164,000	9,318.00	1,528,152,000	
日本カーバイド工業	3,100	1,891.00	5,862,100	
堺化学工業	6,200	2,570.00	15,934,000	

第一稀元素化学工業	7,600	972.00	7,387,200
エア・ウォーター	76,200	1,733.00	132,054,600
大陽日酸	76,700	1,870.00	143,429,000
日本化学工業	3,200	2,445.00	7,824,000
東邦アセチレン	1,400	1,402.00	1,962,800
日本パーカラライジング	50,900	1,305.00	66,424,500
高压ガス工業	14,800	831.00	12,298,800
チタン工業	1,200	2,341.00	2,809,200
四国化成工業	15,700	1,154.00	18,117,800
戸田工業	2,000	2,309.00	4,618,000
ステラ ケミファ	5,500	2,856.00	15,708,000
保土谷化学工業	3,200	2,242.00	7,174,400
日本触媒	15,600	7,190.00	112,164,000
大日精化工業	7,700	2,960.00	22,792,000
カネカ	24,800	4,050.00	100,440,000
三菱瓦斯化学	95,700	1,670.00	159,819,000
三井化学	84,500	2,636.00	222,742,000
J S R	93,400	1,712.00	159,900,800
東京応化工業	16,000	3,185.00	50,960,000
大阪有機化学工業	8,600	1,273.00	10,947,800
三菱ケミカルホールディングス	622,100	853.30	530,837,930
K Hネオケム	14,200	2,486.00	35,301,200
ダイセル	144,500	1,223.00	176,723,500
住友ベークライト	16,100	3,810.00	61,341,000
積水化学工業	203,400	1,768.00	359,611,200
日本ゼオン	83,900	1,048.00	87,927,200
アイカ工業	27,900	3,540.00	98,766,000
宇部興産	47,000	2,391.00	112,377,000
積水樹脂	15,400	1,984.00	30,553,600
タキロンシーアイ	20,000	609.00	12,180,000
旭有機材	6,400	1,622.00	10,380,800
日立化成	43,000	1,619.00	69,617,000
ニチバン	4,900	2,034.00	9,966,600
リケンテクノス	25,400	487.00	12,369,800
大倉工業	4,800	2,024.00	9,715,200
積水化成品工業	13,900	992.00	13,788,800
群栄化学工業	2,400	2,957.00	7,096,800
タイガースポリマー	5,000	669.00	3,345,000
ミライアル	2,700	1,060.00	2,862,000
ダイキアクシス	3,300	1,014.00	3,346,200
ダイキョーニシカワ	19,700	1,106.00	21,788,200
竹本容器	1,700	2,937.00	4,992,900

森六ホールディングス	5,000	2,808.00	14,040,000
日本化薬	59,200	1,407.00	83,294,400
カーリットホールディングス	10,000	814.00	8,140,000
日本精化	7,500	1,048.00	7,860,000
扶桑化学工業	9,400	2,170.00	20,398,000
トリケミカル研究所	2,100	4,785.00	10,048,500
A D E K A	45,900	1,661.00	76,239,900
日油	35,900	3,690.00	132,471,000
ハリマ化成グループ	7,700	1,060.00	8,162,000
花王	230,700	8,175.00	1,885,972,500
第一工業製薬	3,500	2,943.00	10,300,500
石原ケミカル	2,400	1,864.00	4,473,600
日華化学	3,200	1,171.00	3,747,200
ニイタカ	1,500	1,736.00	2,604,000
三洋化成工業	6,300	5,460.00	34,398,000
有機合成薬品工業	7,300	228.00	1,664,400
大日本塗料	10,500	1,064.00	11,172,000
日本ペイントホールディングス	76,800	3,740.00	287,232,000
関西ペイント	104,600	2,012.00	210,455,200
神東塗料	7,500	180.00	1,350,000
中国塗料	30,600	951.00	29,100,600
日本特殊塗料	7,000	1,537.00	10,759,000
藤倉化成	12,500	618.00	7,725,000
太陽ホールディングス	7,700	3,355.00	25,833,500
D I C	42,100	3,360.00	141,456,000
サカタインクス	20,300	1,235.00	25,070,500
東洋インキ S C ホールディングス	19,700	2,627.00	51,751,900
T & K T O K A	7,200	1,084.00	7,804,800
富士フイルムホールディングス	197,400	4,525.00	893,235,000
資生堂	188,800	7,034.00	1,328,019,200
ライオン	132,400	2,228.00	294,987,200
高砂香料工業	6,600	3,540.00	23,364,000
マンダム	21,400	3,110.00	66,554,000
ミルボン	11,700	4,875.00	57,037,500
ファンケル	42,300	2,824.00	119,455,200
コーセー	16,100	16,420.00	264,362,000
コタ	4,600	1,478.00	6,798,800
シーズ・ホールディングス	11,200	5,870.00	65,744,000
シーボン	1,200	2,714.00	3,256,800
ポーラ・オルビスホールディングス	40,600	2,984.00	121,150,400
ノエビアホールディングス	6,100	4,980.00	30,378,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	963.00	2,118,600

エステー	6,800	2,174.00	14,783,200
アグロ カネショウ	3,900	2,140.00	8,346,000
コニシ	16,800	1,637.00	27,501,600
長谷川香料	11,300	1,497.00	16,916,100
星光P M C	6,400	851.00	5,446,400
小林製薬	26,600	7,370.00	196,042,000
荒川化学工業	8,500	1,475.00	12,537,500
メック	6,500	1,200.00	7,800,000
日本高純度化学	2,600	2,332.00	6,063,200
タカラバイオ	24,900	2,726.00	67,877,400
J C U	12,300	1,650.00	20,295,000
新田ゼラチン	6,000	727.00	4,362,000
O A T アグリオ	1,300	2,170.00	2,821,000
デクセリアルズ	24,500	878.00	21,511,000
アース製薬	7,200	5,400.00	38,880,000
北興化学工業	9,700	494.00	4,791,800
大成ラミック	3,100	3,020.00	9,362,000
クミアイ化学工業	39,300	666.00	26,173,800
日本農薬	22,600	517.00	11,684,200
アキレス	6,900	2,113.00	14,579,700
有沢製作所	14,900	789.00	11,756,100
日東電工	71,800	5,689.00	408,470,200
レック	10,200	1,881.00	19,186,200
三光合成	7,300	368.00	2,686,400
きもと	16,200	202.00	3,272,400
藤森工業	8,500	3,165.00	26,902,500
前澤化成工業	6,500	1,089.00	7,078,500
ウェーブロックホールディングス	2,000	804.00	1,608,000
J S P	5,600	2,303.00	12,896,800
エフピコ	7,800	6,590.00	51,402,000
天馬	6,600	1,904.00	12,566,400
信越ポリマー	17,100	734.00	12,551,400
東リ	23,600	276.00	6,513,600
ニフコ	38,100	2,762.00	105,232,200
バルカー	7,700	2,499.00	19,242,300
ユニ・チャーム	201,500	3,525.00	710,287,500
協和発酵キリン	119,000	2,249.00	267,631,000
武田薬品工業	375,100	3,771.00	1,414,502,100
アステラス製薬	876,100	1,647.50	1,443,374,750
大日本住友製薬	70,400	3,755.00	264,352,000
塩野義製薬	124,300	6,920.00	860,156,000
田辺三菱製薬	99,400	1,645.00	163,513,000

わかもと製薬	11,200	285.00	3,192,000	
あすか製薬	11,700	1,168.00	13,665,600	
日本新薬	24,900	7,400.00	184,260,000	
ピオフェルミン製薬	1,600	2,730.00	4,368,000	
中外製薬	99,100	7,200.00	713,520,000	
科研製薬	17,100	5,330.00	91,143,000	
エーザイ	113,700	9,634.00	1,095,385,800	
ロート製薬	48,700	3,370.00	164,119,000	
小野薬品工業	224,400	2,615.50	586,918,200	
久光製薬	28,100	7,100.00	199,510,000	
持田製薬	7,200	10,300.00	74,160,000	
参天製薬	180,100	1,817.00	327,241,700	
扶桑薬品工業	3,300	2,680.00	8,844,000	
日本ケミファ	1,300	3,840.00	4,992,000	
ツムラ	29,400	3,420.00	100,548,000	
日医工	23,600	1,799.00	42,456,400	
キッセイ薬品工業	16,800	3,325.00	55,860,000	
生化学工業	18,400	1,428.00	26,275,200	
栄研化学	16,700	2,475.00	41,332,500	
日水製薬	4,000	1,201.00	4,804,000	
鳥居薬品	5,100	2,419.00	12,336,900	
JCRファーマ	6,700	5,350.00	35,845,000	
東和薬品	4,600	8,430.00	38,778,000	
富士製薬工業	6,500	1,845.00	11,992,500	
沢井製薬	19,500	6,120.00	119,340,000	
ゼリア新薬工業	18,800	2,009.00	37,769,200	
第一三共	271,900	4,164.00	1,132,191,600	
キョーリン製薬ホールディングス	24,300	2,656.00	64,540,800	
大幸薬品	4,200	1,860.00	7,812,000	
ダイト	5,500	3,280.00	18,040,000	
大塚ホールディングス	181,000	5,342.00	966,902,000	
大正製薬ホールディングス	21,300	12,830.00	273,279,000	
ペプチドリーム	43,700	4,815.00	210,415,500	
日本コークス工業	79,700	101.00	8,049,700	
昭和シェル石油	88,900	1,650.00	146,685,000	
ニチレキ	12,200	1,092.00	13,322,400	
ユシロ化学工業	4,900	1,299.00	6,365,100	
ビーピー・カストロール	3,400	1,481.00	5,035,400	
富士石油	23,100	320.00	7,392,000	
MORESCO	3,400	1,595.00	5,423,000	
出光興産	73,600	3,905.00	287,408,000	
JXTGホールディングス	1,617,500	645.70	1,044,419,750	

コスモエネルギーホールディングス	27,500	2,637.00	72,517,500
横浜ゴム	55,000	2,289.00	125,895,000
東洋ゴム工業	48,800	1,611.00	78,616,800
ブリヂストン	292,000	4,475.00	1,306,700,000
住友ゴム工業	85,400	1,439.00	122,890,600
藤倉ゴム工業	8,200	478.00	3,919,600
オカモト	6,600	5,950.00	39,270,000
フコク	4,200	927.00	3,893,400
ニッタ	10,700	3,645.00	39,001,500
住友理工	18,400	1,006.00	18,510,400
三ツ星ベルト	12,500	2,225.00	27,812,500
バンドー化学	18,100	1,194.00	21,611,400
日東紡績	14,200	1,961.00	27,846,200
A G C	95,800	3,665.00	351,107,000
日本板硝子	44,700	899.00	40,185,300
石塚硝子	1,400	2,069.00	2,896,600
日本山村硝子	4,000	1,695.00	6,780,000
日本電気硝子	41,100	2,895.00	118,984,500
オハラ	3,800	2,124.00	8,071,200
住友大阪セメント	19,200	4,705.00	90,336,000
太平洋セメント	60,000	3,565.00	213,900,000
日本ヒューム	9,600	900.00	8,640,000
日本コンクリート工業	20,400	281.00	5,732,400
三谷セキサン	4,400	2,800.00	12,320,000
アジアパイルホールディングス	13,500	645.00	8,707,500
東海カーボン	86,300	1,434.00	123,754,200
日本カーボン	4,500	4,620.00	20,790,000
東洋炭素	5,600	2,500.00	14,000,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,700	4,795.00	27,331,500
T O T O	73,100	3,855.00	281,800,500
日本碍子	116,000	1,593.00	184,788,000
日本特殊陶業	80,100	2,179.00	174,537,900
M A R U W A	3,300	6,320.00	20,856,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,995.00	9,987,500
黒崎播磨	1,900	6,740.00	12,806,000
ヨータイ	8,400	652.00	5,476,800
イソライト工業	4,900	485.00	2,376,500
東京窯業	12,100	420.00	5,082,000
ニッカトー	4,300	930.00	3,999,000
フジミインコーポレーテッド	8,500	2,177.00	18,504,500
クニミネ工業	3,200	956.00	3,059,200
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,022.00	1,839,600

ニチアス	26,000	2,026.00	52,676,000
ニチハ	13,200	2,871.00	37,897,200
新日鐵住金	420,500	1,962.50	825,231,250
神戸製鋼所	172,000	864.00	148,608,000
中山製鋼所	12,900	537.00	6,927,300
合同製鐵	4,600	1,787.00	8,220,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	253,800	1,898.50	481,839,300
日新製鋼	22,700	1,385.00	31,439,500
東京製鐵	50,300	940.00	47,282,000
共英製鋼	10,600	1,956.00	20,733,600
大和工業	20,000	2,728.00	54,560,000
東京鐵鋼	3,900	1,365.00	5,323,500
大阪製鐵	6,200	1,929.00	11,959,800
淀川製鋼所	12,700	2,366.00	30,048,200
丸一鋼管	33,300	3,420.00	113,886,000
モリ工業	2,800	2,487.00	6,963,600
大同特殊鋼	15,400	4,345.00	66,913,000
日本高周波鋼業	3,500	648.00	2,268,000
日本冶金工業	77,700	255.00	19,813,500
山陽特殊製鋼	11,800	2,538.00	29,948,400
愛知製鋼	5,300	3,845.00	20,378,500
日立金属	101,200	1,217.00	123,160,400
日本金属	2,200	1,271.00	2,796,200
大平洋金属	6,400	3,065.00	19,616,000
新日本電工	56,300	239.00	13,455,700
栗本鐵工所	4,700	1,502.00	7,059,400
虹技	1,400	1,545.00	2,163,000
日本鑄鉄管	1,000	1,256.00	1,256,000
三菱製鋼	7,000	1,834.00	12,838,000
日亜鋼業	13,600	320.00	4,352,000
日本精線	1,300	3,315.00	4,309,500
エンビプロ・ホールディングス	2,000	515.00	1,030,000
シンニッタン	14,500	396.00	5,742,000
新家工業	2,100	1,669.00	3,504,900
大紀アルミニウム工業所	15,700	603.00	9,467,100
日本軽金属ホールディングス	256,600	236.00	60,557,600
三井金属鉱業	25,400	2,423.00	61,544,200
東邦亜鉛	5,200	3,485.00	18,122,000
三菱マテリアル	62,100	3,155.00	195,925,500
住友金属鉱山	128,700	3,149.00	405,276,300
DOWAホールディングス	22,000	3,535.00	77,770,000
古河機械金属	15,600	1,278.00	19,936,800

大阪チタニウムテクノロジーズ	10,900	2,047.00	22,312,300
東邦チタニウム	16,900	1,254.00	21,192,600
U A C J	14,300	2,373.00	33,933,900
C Kサンエツ	1,800	2,774.00	4,993,200
古河電気工業	27,100	2,856.00	77,397,600
住友電気工業	351,400	1,510.50	530,789,700
フジクラ	113,700	452.00	51,392,400
昭和電線ホールディングス	10,900	637.00	6,943,300
東京特殊電線	1,300	1,944.00	2,527,200
タツタ電線	18,900	513.00	9,695,700
カナレ電気	1,600	1,936.00	3,097,600
平河ヒューテック	4,000	1,210.00	4,840,000
リョービ	11,600	2,807.00	32,561,200
アーレスティ	11,700	673.00	7,874,100
アサヒホールディングス	17,700	2,351.00	41,612,700
稲葉製作所	5,300	1,315.00	6,969,500
宮地エンジニアリンググループ	2,900	2,037.00	5,907,300
トーカロ	24,300	908.00	22,064,400
アルファC o	3,300	1,361.00	4,491,300
S U M C O	103,800	1,447.00	150,198,600
川田テクノロジーズ	2,100	8,410.00	17,661,000
R S Technologies	1,900	4,165.00	7,913,500
東洋製罐グループホールディングス	59,900	2,588.00	155,021,200
ホッカンホールディングス	4,800	1,733.00	8,318,400
コロナ	5,200	1,114.00	5,792,800
横河ブリッジホールディングス	17,500	1,837.00	32,147,500
駒井ハルテック	1,800	2,056.00	3,700,800
高田機工	900	2,727.00	2,454,300
三和ホールディングス	97,100	1,275.00	123,802,500
文化シャッター	27,700	744.00	20,608,800
三協立山	13,000	1,213.00	15,769,000
アルインコ	7,500	1,055.00	7,912,500
東洋シャッター	2,300	647.00	1,488,100
L I X I Lグループ	138,700	1,439.00	199,589,300
日本フィルコン	7,200	550.00	3,960,000
ノーリツ	21,000	1,545.00	32,445,000
長府製作所	9,600	2,294.00	22,022,400
リンナイ	16,800	7,300.00	122,640,000
ダイニチ工業	5,100	722.00	3,682,200
日東精工	13,000	658.00	8,554,000
三洋工業	1,300	2,001.00	2,601,300
岡部	19,100	958.00	18,297,800



ジーテクト	10,400	1,560.00	16,224,000
東プレ	17,500	2,240.00	39,200,000
高周波熱錬	18,100	955.00	17,285,500
東京製綱	5,800	1,076.00	6,240,800
サンコール	5,300	714.00	3,784,200
モリテック スチール	7,300	440.00	3,212,000
パイオラックス	15,100	2,464.00	37,206,400
エイチワン	9,200	1,007.00	9,264,400
日本発條	93,600	1,007.00	94,255,200
中央発條	1,100	3,405.00	3,745,500
アドバネクス	1,200	1,363.00	1,635,600
立川ブラインド工業	4,200	1,175.00	4,935,000
三益半導体工業	7,300	1,351.00	9,862,300
日本ドライケミカル	2,500	1,267.00	3,167,500
日本製鋼所	28,600	1,977.00	56,542,200
三浦工業	40,700	2,934.00	119,413,800
タクマ	34,400	1,486.00	51,118,400
ツガミ	21,400	738.00	15,793,200
オークマ	12,000	5,330.00	63,960,000
東芝機械	10,700	1,919.00	20,533,300
アマダホールディングス	145,200	1,051.00	152,605,200
アイダエンジニアリング	26,300	823.00	21,644,900
滝澤鉄工所	2,900	1,480.00	4,292,000
F U J I	28,100	1,380.00	38,778,000
牧野フライス製作所	11,100	4,175.00	46,342,500
オーエスジー	46,400	2,200.00	102,080,000
ダイジェット工業	1,200	1,802.00	2,162,400
旭ダイヤモンド工業	25,000	647.00	16,175,000
D M G 森精機	59,600	1,436.00	85,585,600
ソディック	20,500	756.00	15,498,000
ディスコ	12,700	14,240.00	180,848,000
日東工器	5,100	2,344.00	11,954,400
日進工具	2,800	2,448.00	6,854,400
パンチ工業	6,500	546.00	3,549,000
富士ダイス	4,100	697.00	2,857,700
豊和工業	5,500	800.00	4,400,000
O K K	4,100	847.00	3,472,700
東洋機械金属	6,700	565.00	3,785,500
島精機製作所	13,000	3,270.00	42,510,000
オプトラン	9,200	1,879.00	17,286,800
N C ホールディングス	3,000	531.00	1,593,000
フリーー	7,500	1,002.00	7,515,000

ヤマシンフィルタ	16,300	725.00	11,817,500
日阪製作所	11,600	915.00	10,614,000
やまびこ	18,200	1,160.00	21,112,000
平田機工	4,400	5,770.00	25,388,000
ペガサスミシン製造	8,800	753.00	6,626,400
タツモ	2,900	821.00	2,380,900
ナプテスコ	51,800	2,650.00	137,270,000
三井海洋開発	10,000	2,656.00	26,560,000
レオン自動機	9,200	1,631.00	15,005,200
S M C	27,800	34,720.00	965,216,000
新川	7,000	453.00	3,171,000
ホソカワミクロン	3,300	4,485.00	14,800,500
ユニオンツール	4,100	3,270.00	13,407,000
オイレス工業	13,200	1,925.00	25,410,000
日精エー・エス・ビー機械	2,700	3,815.00	10,300,500
サトーホールディングス	11,300	2,861.00	32,329,300
技研製作所	6,500	3,835.00	24,927,500
日本エアージェット	3,000	680.00	2,040,000
カワタ	1,900	1,585.00	3,011,500
日精樹脂工業	8,100	968.00	7,840,800
オカダアイヨン	3,200	1,642.00	5,254,400
ワイエイシイホールディングス	3,700	681.00	2,519,700
小松製作所	430,300	2,615.00	1,125,234,500
住友重機械工業	54,400	3,700.00	201,280,000
日立建機	38,200	2,706.00	103,369,200
日工	2,700	2,451.00	6,617,700
巴工業	4,000	2,308.00	9,232,000
井関農機	9,600	1,688.00	16,204,800
T O W A	8,100	687.00	5,564,700
丸山製作所	2,200	1,497.00	3,293,400
北川鉄工所	4,400	2,462.00	10,832,800
ローツェ	4,200	1,611.00	6,766,200
タカキタ	3,300	630.00	2,079,000
クボタ	509,800	1,802.50	918,914,500
荏原実業	2,900	1,978.00	5,736,200
三菱化工機	3,400	1,558.00	5,297,200
月島機械	19,000	1,266.00	24,054,000
帝国電機製作所	6,600	1,450.00	9,570,000
新東工業	22,800	887.00	20,223,600
澁谷工業	8,400	3,735.00	31,374,000
アイチ コーポレーション	16,700	640.00	10,688,000
小森コーポレーション	25,900	1,126.00	29,163,400

鶴見製作所	7,500	1,900.00	14,250,000
住友精密工業	1,600	3,345.00	5,352,000
酒井重工業	1,900	2,516.00	4,780,400
荏原製作所	42,200	2,797.00	118,033,400
石井鐵工所	1,600	1,844.00	2,950,400
西島製作所	9,900	1,033.00	10,226,700
北越工業	9,800	1,120.00	10,976,000
ダイキン工業	129,700	12,205.00	1,582,988,500
オルガノ	3,500	2,931.00	10,258,500
トーヨーカネツ	3,700	2,269.00	8,395,300
栗田工業	51,500	2,787.00	143,530,500
椿本チエイン	12,500	4,180.00	52,250,000
大同工業	4,700	964.00	4,530,800
木村化工機	8,400	400.00	3,360,000
アネスト岩田	14,800	1,064.00	15,747,200
ダイフク	52,300	5,600.00	292,880,000
サムコ	2,600	1,274.00	3,312,400
加藤製作所	4,900	2,876.00	14,092,400
油研工業	1,700	1,932.00	3,284,400
タダノ	46,000	1,116.00	51,336,000
フジテック	34,500	1,284.00	44,298,000
C K D	26,400	1,071.00	28,274,400
キトー	7,200	1,635.00	11,772,000
平和	26,500	2,387.00	63,255,500
理想科学工業	8,400	1,773.00	14,893,200
SANKYO	23,800	4,430.00	105,434,000
日本金銭機械	10,500	1,080.00	11,340,000
マースグループホールディングス	6,000	2,203.00	13,218,000
福島工業	5,900	3,965.00	23,393,500
オーイズミ	4,000	463.00	1,852,000
ダイコク電機	4,400	1,612.00	7,092,800
竹内製作所	15,900	1,926.00	30,623,400
アマノ	27,100	2,312.00	62,655,200
JUKI	13,200	1,320.00	17,424,000
サンデンホールディングス	11,600	788.00	9,140,800
蛇の目マシン工業	8,600	529.00	4,549,400
マックス	14,600	1,421.00	20,746,600
グローリー	26,300	2,686.00	70,641,800
新晃工業	8,800	1,622.00	14,273,600
大和冷機工業	13,700	1,145.00	15,686,500
セガサミーホールディングス	94,200	1,567.00	147,611,400
日本ピストンリング	3,500	1,962.00	6,867,000

リケン	4,400	5,130.00	22,572,000
T P R	12,800	2,433.00	31,142,400
ツバキ・ナカシマ	14,300	1,802.00	25,768,600
ホシザキ	27,800	8,990.00	249,922,000
大豊工業	7,700	1,031.00	7,938,700
日本精工	195,100	1,007.00	196,465,700
N T N	204,200	358.00	73,103,600
ジェイテクト	91,100	1,354.00	123,349,400
不二越	8,800	4,380.00	38,544,000
日本トムソン	28,200	560.00	15,792,000
T H K	59,200	2,400.00	142,080,000
ユーシン精機	7,400	1,081.00	7,999,400
前澤給装工業	3,700	1,951.00	7,218,700
イーグル工業	11,700	1,308.00	15,303,600
前澤工業	6,900	374.00	2,580,600
日本ピラー工業	9,600	1,443.00	13,852,800
キッツ	38,500	911.00	35,073,500
マキタ	115,600	4,200.00	485,520,000
日立造船	75,900	362.00	27,475,800
三菱重工業	159,300	4,229.00	673,679,700
I H I	73,100	3,410.00	249,271,000
スター精密	16,400	1,597.00	26,190,800
日清紡ホールディングス	53,100	953.00	50,604,300
イビデン	58,300	1,562.00	91,064,600
コニカミノルタ	207,900	1,036.00	215,384,400
ブラザー工業	123,900	1,700.00	210,630,000
ミネベアミツミ	176,500	1,601.00	282,576,500
日立製作所	427,900	3,254.00	1,392,386,600
三菱電機	950,400	1,343.50	1,276,862,400
富士電機	61,800	3,405.00	210,429,000
東洋電機製造	4,000	1,387.00	5,548,000
安川電機	110,200	3,180.00	350,436,000
シンフォニアテクノロジー	13,400	1,463.00	19,604,200
明電舎	19,000	1,543.00	29,317,000
オリジン電気	2,800	1,870.00	5,236,000
山洋電気	4,700	3,895.00	18,306,500
デンヨー	9,000	1,556.00	14,004,000
東芝テック	12,000	2,716.00	32,592,000
芝浦メカトロニクス	1,800	3,750.00	6,750,000
マブチモーター	26,400	3,640.00	96,096,000
日本電産	114,400	13,760.00	1,574,144,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,200	2,245.00	11,674,000

トレックス・セミコンダクター	3,400	1,399.00	4,756,600
東光高岳	5,000	1,537.00	7,685,000
ダブル・スコープ	14,100	1,214.00	17,117,400
ダイヘン	10,500	2,510.00	26,355,000
ヤーマン	13,900	1,700.00	23,630,000
JVCケンウッド	71,200	275.00	19,580,000
ミマキエンジニアリング	8,800	858.00	7,550,400
第一精工	4,200	1,212.00	5,090,400
日新電機	22,600	926.00	20,927,600
大崎電気工業	19,400	763.00	14,802,200
オムロン	101,100	4,455.00	450,400,500
日東工業	15,400	2,068.00	31,847,200
I D E C	12,900	2,224.00	28,689,600
不二電機工業	1,300	1,322.00	1,718,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,300	2,531.00	86,813,300
サクサホールディングス	2,600	1,878.00	4,882,800
メルコホールディングス	4,000	3,720.00	14,880,000
テクノメディカ	2,100	2,065.00	4,336,500
日本電気	123,000	3,565.00	438,495,000
富士通	91,700	6,930.00	635,481,000
沖電気工業	41,400	1,462.00	60,526,800
岩崎通信機	4,500	746.00	3,357,000
電気興業	5,100	2,646.00	13,494,600
サンケン電気	11,300	2,223.00	25,119,900
ナカヨ	2,100	1,484.00	3,116,400
アイホン	5,600	1,697.00	9,503,200
ルネサスエレクトロニクス	98,900	518.00	51,230,200
セイコーエプソン	118,100	1,627.00	192,148,700
ワコム	69,300	531.00	36,798,300
アルバック	21,900	3,540.00	77,526,000
アクセル	4,500	540.00	2,430,000
E I Z O	8,800	4,130.00	36,344,000
日本信号	24,600	938.00	23,074,800
京三製作所	21,000	441.00	9,261,000
能美防災	12,700	2,062.00	26,187,400
ホーチキ	6,200	1,226.00	7,601,200
星和電機	4,500	423.00	1,903,500
エレコム	8,700	2,935.00	25,534,500
パナソニック	1,085,800	1,086.00	1,179,178,800
シャープ	94,200	1,377.00	129,713,400
アンリツ	61,300	1,638.00	100,409,400
富士通ゼネラル	29,200	1,542.00	45,026,400

ソニー	637,000	5,694.00	3,627,078,000
T D K	49,700	7,920.00	393,624,000
帝国通信工業	4,400	1,203.00	5,293,200
タムラ製作所	37,200	584.00	21,724,800
アルプス電気	87,800	2,428.00	213,178,400
池上通信機	3,000	1,252.00	3,756,000
日本電波工業	8,400	455.00	3,822,000
鈴木	5,100	651.00	3,320,100
日本トリム	1,800	5,890.00	10,602,000
ローランド ディー・ジー・	5,000	2,310.00	11,550,000
フォスター電機	11,400	1,451.00	16,541,400
クラリオン	9,900	2,481.00	24,561,900
S M K	2,800	2,226.00	6,232,800
ヨコオ	7,000	1,452.00	10,164,000
ホシデン	28,300	813.00	23,007,900
ヒロセ電機	13,700	10,760.00	147,412,000
日本航空電子工業	22,000	1,298.00	28,556,000
T O A	10,500	1,133.00	11,896,500
マクセルホールディングス	20,600	1,511.00	31,126,600
古野電気	12,400	1,189.00	14,743,600
ユニデンホールディングス	2,900	2,279.00	6,609,100
アルパイン	16,700	1,660.00	27,722,000
スミダコーポレーション	8,300	1,360.00	11,288,000
アイコム	5,400	2,220.00	11,988,000
リオン	4,500	1,988.00	8,946,000
本多通信工業	8,500	550.00	4,675,000
横河電機	95,300	2,028.00	193,268,400
新電元工業	3,400	3,935.00	13,379,000
アズビル	61,500	2,234.00	137,391,000
東亜ディーケーケー	5,000	887.00	4,435,000
日本光電工業	42,000	3,570.00	149,940,000
チノー	3,500	1,406.00	4,921,000
共和電業	10,800	401.00	4,330,800
日本電子材料	4,300	673.00	2,893,900
堀場製作所	18,900	4,880.00	92,232,000
アドバンテスト	64,900	2,071.00	134,407,900
小野測器	4,800	666.00	3,196,800
エスベック	8,500	1,932.00	16,422,000
キーエンス	46,600	57,860.00	2,696,276,000
日置電機	5,000	4,030.00	20,150,000
シスメックス	74,100	5,607.00	415,478,700
日本マイクロニクス	15,700	814.00	12,779,800

メガチップス	7,600	2,645.00	20,102,000
O B A R A G R O U P	5,600	4,295.00	24,052,000
澤藤電機	1,300	1,790.00	2,327,000
原田工業	3,300	882.00	2,910,600
コーセル	13,400	1,075.00	14,405,000
イリソ電子工業	8,800	4,145.00	36,476,000
オブテックスグループ	16,800	2,040.00	34,272,000
千代田インテグレ	4,100	2,302.00	9,438,200
アイ・オー・データ機器	4,200	1,090.00	4,578,000
レーザーテック	19,500	3,245.00	63,277,500
スタンレー電気	67,400	3,100.00	208,940,000
岩崎電気	3,900	1,445.00	5,635,500
ウシオ電機	57,900	1,197.00	69,306,300
岡谷電機産業	7,400	407.00	3,011,800
ハリオス テクノ ホールディング	9,100	700.00	6,370,000
日本セラミック	9,700	2,623.00	25,443,100
遠藤照明	5,200	773.00	4,019,600
古河電池	7,100	762.00	5,410,200
双信電機	5,400	384.00	2,073,600
山一電機	7,100	1,249.00	8,867,900
図研	6,300	1,607.00	10,124,100
日本電子	18,900	1,868.00	35,305,200
カシオ計算機	84,300	1,497.00	126,197,100
ファナック	90,300	17,390.00	1,570,317,000
日本シイエムケイ	24,500	815.00	19,967,500
エンプラス	4,400	3,000.00	13,200,000
大真空	3,800	960.00	3,648,000
ローム	46,000	7,280.00	334,880,000
浜松ホトニクス	68,200	3,715.00	253,363,000
三井ハイテック	10,700	1,086.00	11,620,200
新光電気工業	32,200	753.00	24,246,600
京セラ	144,900	5,696.00	825,350,400
太陽誘電	42,400	1,930.00	81,832,000
村田製作所	99,700	16,045.00	1,599,686,500
ユーシン	14,800	983.00	14,548,400
双葉電子工業	15,700	1,635.00	25,669,500
北陸電気工業	3,800	991.00	3,765,800
ニチコン	30,200	789.00	23,827,800
日本ケミコン	6,700	1,990.00	13,333,000
K O A	14,500	1,363.00	19,763,500
市光工業	14,600	637.00	9,300,200
小糸製作所	57,000	5,720.00	326,040,000

ミツバ	17,900	669.00	11,975,100
S C R E E Nホールディングス	16,500	5,060.00	83,490,000
キヤノン電子	8,800	1,982.00	17,441,600
キヤノン	511,600	3,120.00	1,596,192,000
リコー	286,000	1,063.00	304,018,000
象印マホービン	17,900	1,089.00	19,493,100
M U T O Hホールディングス	1,400	2,160.00	3,024,000
東京エレクトロン	63,400	14,065.00	891,721,000
トヨタ紡織	33,300	1,697.00	56,510,100
芦森工業	2,000	1,558.00	3,116,000
ユニプレス	18,400	1,999.00	36,781,600
豊田自動織機	76,900	5,540.00	426,026,000
モリタホールディングス	16,600	1,991.00	33,050,600
三櫻工業	12,100	601.00	7,272,100
デンソー	210,800	5,093.00	1,073,604,400
東海理化電機製作所	25,100	1,945.00	48,819,500
三井E & Sホールディングス	34,000	1,164.00	39,576,000
川崎重工業	73,900	2,528.00	186,819,200
名村造船所	28,500	473.00	13,480,500
日本車輛製造	3,500	2,501.00	8,753,500
三菱ロジスネクスト	11,300	1,171.00	13,232,300
近畿車輛	1,400	2,102.00	2,942,800
日産自動車	1,120,600	945.00	1,058,967,000
いすゞ自動車	300,300	1,590.00	477,477,000
トヨタ自動車	1,058,800	6,820.00	7,221,016,000
日野自動車	118,700	1,101.00	130,688,700
三菱自動車工業	351,700	665.00	233,880,500
エフテック	6,700	972.00	6,512,400
レシップホールディングス	3,400	708.00	2,407,200
G M B	1,900	1,107.00	2,103,300
ファルテック	1,700	911.00	1,548,700
武蔵精密工業	22,400	1,662.00	37,228,800
日産車体	18,600	867.00	16,126,200
新明和工業	44,300	1,423.00	63,038,900
極東開発工業	18,900	1,578.00	29,824,200
日信工業	17,400	1,450.00	25,230,000
トピー工業	7,800	2,531.00	19,741,800
ティラド	3,500	2,427.00	8,494,500
曙ブレーキ工業	52,200	216.00	11,275,200
タチエス	16,200	1,483.00	24,024,600
N O K	51,100	1,634.00	83,497,400
フタバ産業	26,400	572.00	15,100,800



K Y B	9,600	2,685.00	25,776,000
大同メタル工業	15,500	852.00	13,206,000
プレス工業	47,200	579.00	27,328,800
ミクニ	12,100	534.00	6,461,400
太平洋工業	19,900	1,493.00	29,710,700
ケーヒン	21,900	1,841.00	40,317,900
河西工業	11,700	933.00	10,916,100
アイシン精機	78,300	4,185.00	327,685,500
マツダ	298,200	1,220.50	363,953,100
今仙電機製作所	8,900	1,031.00	9,175,900
本田技研工業	801,600	3,033.00	2,431,252,800
スズキ	173,800	5,420.00	941,996,000
S U B A R U	295,000	2,462.00	726,290,000
安永	4,600	1,672.00	7,691,200
ヤマハ発動機	134,200	2,249.00	301,815,800
ショーワ	22,500	1,405.00	31,612,500
T B K	11,400	423.00	4,822,200
エクセディ	12,900	2,715.00	35,023,500
豊田合成	30,700	2,213.00	67,939,100
愛三工業	15,000	786.00	11,790,000
盟和産業	1,500	1,050.00	1,575,000
日本プラスト	7,500	844.00	6,330,000
ヨロズ	8,900	1,419.00	12,629,100
エフ・シー・シー	17,100	2,621.00	44,819,100
シマノ	38,300	16,000.00	612,800,000
テイ・エス テック	22,100	3,225.00	71,272,500
ジャムコ	4,800	2,747.00	13,185,600
テルモ	134,400	6,105.00	820,512,000
クリエートメディック	3,200	1,115.00	3,568,000
日機装	30,700	1,005.00	30,853,500
島津製作所	122,300	2,389.00	292,174,700
J M S	8,700	571.00	4,967,700
長野計器	7,500	874.00	6,555,000
ブイ・テクノロジー	2,200	14,940.00	32,868,000
東京計器	6,100	1,029.00	6,276,900
愛知時計電機	1,300	3,865.00	5,024,500
インターアクション	5,000	2,053.00	10,265,000
オーバル	9,300	258.00	2,399,400
東京精密	17,200	3,015.00	51,858,000
マニー	11,600	5,000.00	58,000,000
ニコン	165,600	1,725.00	285,660,000
トプコン	51,000	1,670.00	85,170,000

オリンパス	141,500	3,120.00	441,480,000
理研計器	8,400	2,172.00	18,244,800
タムロン	8,400	1,742.00	14,632,800
H O Y A	191,300	6,739.00	1,289,170,700
シード	4,000	1,410.00	5,640,000
ノーリツ銅機	7,500	1,758.00	13,185,000
エー・アンド・デイ	8,700	733.00	6,377,100
朝日インテック	34,300	5,450.00	186,935,000
シチズン時計	104,000	582.00	60,528,000
リズム時計工業	3,200	2,000.00	6,400,000
大研医器	7,500	706.00	5,295,000
メニコン	13,000	2,813.00	36,569,000
シンシア	1,400	612.00	856,800
松風	4,700	1,166.00	5,480,200
セイコーホールディングス	14,700	2,375.00	34,912,500
ニプロ	65,800	1,430.00	94,094,000
中本パックス	2,700	1,754.00	4,735,800
スノーピーク	3,500	1,335.00	4,672,500
パラマウントベッドホールディングス	10,900	4,570.00	49,813,000
トランザクション	5,200	748.00	3,889,600
S H O - B I	2,700	395.00	1,066,500
ニホンフラッシュ	4,100	1,847.00	7,572,700
前田工織	10,500	2,693.00	28,276,500
永大産業	12,300	419.00	5,153,700
アートネイチャー	10,100	657.00	6,635,700
バンダイナムコホールディングス	98,200	4,670.00	458,594,000
アイフィスジャパン	2,100	671.00	1,409,100
共立印刷	15,700	229.00	3,595,300
S H O E I	4,600	4,145.00	19,067,000
フランスベッドホールディングス	13,400	935.00	12,529,000
パイロットコーポレーション	16,600	5,730.00	95,118,000
萩原工業	5,300	1,551.00	8,220,300
トッパン・フォームズ	20,400	984.00	20,073,600
フジシールインターナショナル	21,300	3,710.00	79,023,000
タカラトミー	39,800	1,337.00	53,212,600
廣濟堂	8,800	422.00	3,713,600
エステールホールディングス	2,500	675.00	1,687,500
アーケ	36,000	92.00	3,312,000
タカノ	3,700	854.00	3,159,800
プロネクサス	8,200	1,061.00	8,700,200
ホクシン	5,800	155.00	899,000
ウッドワン	3,200	1,104.00	3,532,800

大建工業	7,200	2,000.00	14,400,000	
凸版印刷	134,100	1,788.00	239,770,800	
大日本印刷	133,900	2,472.00	331,000,800	
図書印刷	8,900	773.00	6,879,700	
共同印刷	2,900	2,627.00	7,618,300	
N I S S H A	19,500	1,572.00	30,654,000	
光村印刷	800	2,161.00	1,728,800	
宝印刷	5,000	1,794.00	8,970,000	
アシックス	94,300	1,618.00	152,577,400	
ツツミ	3,000	1,996.00	5,988,000	
小松ウオール工業	2,900	1,990.00	5,771,000	
ヤマハ	56,500	4,840.00	273,460,000	
河合楽器製作所	2,900	3,475.00	10,077,500	
クリナップ	8,800	695.00	6,116,000	
ピジョン	57,400	4,550.00	261,170,000	
兼松サステック	600	1,662.00	997,200	
キングジム	7,900	881.00	6,959,900	
リンテック	22,600	2,378.00	53,742,800	
イトーキ	17,400	580.00	10,092,000	
任天堂	58,500	32,830.00	1,920,555,000	
三菱鉛筆	15,600	2,084.00	32,510,400	
タカラスタANDARD	19,600	1,700.00	33,320,000	
コクヨ	45,600	1,701.00	77,565,600	
ナカバヤシ	9,300	550.00	5,115,000	
グローブライド	4,600	2,661.00	12,240,600	
オカムラ	33,200	1,519.00	50,430,800	
美津濃	9,400	2,416.00	22,710,400	
東京電力ホールディングス	758,500	688.00	521,848,000	
中部電力	290,700	1,698.00	493,608,600	
関西電力	387,700	1,715.50	665,099,350	
中国電力	131,400	1,433.00	188,296,200	
北陸電力	93,100	1,023.00	95,241,300	
東北電力	222,500	1,488.00	331,080,000	
四国電力	85,600	1,383.00	118,384,800	
九州電力	195,800	1,343.00	262,959,400	
北海道電力	88,900	794.00	70,586,600	
沖縄電力	17,600	2,144.00	37,734,400	
電源開発	75,600	2,857.00	215,989,200	
エフオン	5,700	937.00	5,340,900	
イーレックス	16,500	671.00	11,071,500	
レノバ	9,900	974.00	9,642,600	
東京瓦斯	186,400	2,851.00	531,426,400	

大阪瓦斯	184,400	2,064.00	380,601,600	
東邦瓦斯	47,100	4,710.00	221,841,000	
北海道瓦斯	5,100	1,474.00	7,517,400	
広島ガス	19,600	351.00	6,879,600	
西部瓦斯	10,700	2,478.00	26,514,600	
静岡ガス	29,200	932.00	27,214,400	
メタウォーター	4,600	3,160.00	14,536,000	
SBSホールディングス	9,400	1,382.00	12,990,800	
東武鉄道	100,200	3,090.00	309,618,000	
相鉄ホールディングス	32,600	3,360.00	109,536,000	
東京急行電鉄	258,100	1,921.00	495,810,100	
京浜急行電鉄	130,200	1,743.00	226,938,600	
小田急電鉄	152,200	2,415.00	367,563,000	
京王電鉄	53,100	6,250.00	331,875,000	
京成電鉄	71,200	3,535.00	251,692,000	
富士急行	13,000	2,999.00	38,987,000	
新京成電鉄	2,400	2,121.00	5,090,400	
東日本旅客鉄道	169,000	10,230.00	1,728,870,000	
西日本旅客鉄道	85,200	7,717.00	657,488,400	
東海旅客鉄道	85,100	23,035.00	1,960,278,500	
西武ホールディングス	121,100	2,064.00	249,950,400	
鴻池運輸	15,100	1,712.00	25,851,200	
西日本鉄道	26,300	2,822.00	74,218,600	
ハマキョウレックス	7,300	3,785.00	27,630,500	
サカイ引越センター	5,000	5,780.00	28,900,000	
近鉄グループホールディングス	90,000	4,850.00	436,500,000	
阪急阪神ホールディングス	120,000	3,730.00	447,600,000	
南海電気鉄道	40,100	2,955.00	118,495,500	
京阪ホールディングス	40,100	4,730.00	189,673,000	
神戸電鉄	2,300	3,990.00	9,177,000	
名古屋鉄道	72,100	2,786.00	200,870,600	
山陽電気鉄道	6,900	2,272.00	15,676,800	
日本通運	35,300	6,590.00	232,627,000	
ヤマトホールディングス	157,700	2,948.00	464,899,600	
山九	25,000	5,270.00	131,750,000	
丸運	5,100	312.00	1,591,200	
丸全昭和運輸	7,300	3,020.00	22,046,000	
センコーグループホールディングス	49,600	869.00	43,102,400	
トナミホールディングス	2,200	5,850.00	12,870,000	
ニッコンホールディングス	34,200	2,735.00	93,537,000	
日本石油輸送	1,100	2,868.00	3,154,800	
福山通運	11,500	4,710.00	54,165,000	

セイノーホールディングス	67,400	1,588.00	107,031,200
エスライン	2,700	1,150.00	3,105,000
神奈川中央交通	2,200	3,730.00	8,206,000
日立物流	19,800	3,005.00	59,499,000
丸和運輸機関	4,700	3,070.00	14,429,000
C & F ロジホールディングス	9,100	1,226.00	11,156,600
九州旅客鉄道	75,500	3,595.00	271,422,500
S Gホールディングス	85,000	2,753.00	234,005,000
日本郵船	75,600	1,875.00	141,750,000
商船三井	53,600	2,547.00	136,519,200
川崎汽船	28,100	1,548.00	43,498,800
N S ユナイテッド海運	5,100	3,020.00	15,402,000
飯野海運	44,000	428.00	18,832,000
共栄タンカー	1,100	1,836.00	2,019,600
乾汽船	8,100	943.00	7,638,300
日本航空	164,700	3,865.00	636,565,500
A N Aホールディングス	164,500	3,889.00	639,740,500
パスコ	1,700	946.00	1,608,200
トランコム	2,500	6,240.00	15,600,000
日新	7,800	1,907.00	14,874,600
三菱倉庫	31,100	2,639.00	82,072,900
三井倉庫ホールディングス	11,000	1,932.00	21,252,000
住友倉庫	33,800	1,397.00	47,218,600
澁澤倉庫	4,900	1,568.00	7,683,200
東陽倉庫	16,100	290.00	4,669,000
日本トランスシティ	19,700	454.00	8,943,800
ケイヒン	1,700	1,364.00	2,318,800
中央倉庫	5,500	1,032.00	5,676,000
川西倉庫	1,800	1,528.00	2,750,400
安田倉庫	7,400	806.00	5,964,400
東洋埠頭	2,700	1,497.00	4,041,900
宇徳	7,600	509.00	3,868,400
上組	55,500	2,460.00	136,530,000
サンリツ	2,100	655.00	1,375,500
キムラユニティー	2,400	1,071.00	2,570,400
キューソー流通システム	2,200	2,383.00	5,242,600
近鉄エクスプレス	17,000	1,774.00	30,158,000
東海運	5,100	360.00	1,836,000
エーアイティー	5,800	971.00	5,631,800
内外トランスライン	2,800	1,552.00	4,345,600
日本コンセプト	2,500	1,116.00	2,790,000
N E C ネットズエスアイ	10,400	2,459.00	25,573,600

システナ	33,400	1,525.00	50,935,000
デジタルアーツ	5,000	6,850.00	34,250,000
新日鉄住金ソリューションズ	14,000	2,945.00	41,230,000
キューブシステム	5,200	717.00	3,728,400
エイジア	2,000	1,237.00	2,474,000
コア	4,100	1,314.00	5,387,400
ソリトンシステムズ	5,400	811.00	4,379,400
ソフトクリエイティブホールディングス	4,200	1,710.00	7,182,000
T I S	31,100	4,920.00	153,012,000
ネオス	2,700	1,219.00	3,291,300
電算システム	3,600	2,268.00	8,164,800
グリー	50,400	460.00	23,184,000
コーエーテクモホールディングス	19,200	1,853.00	35,577,600
三菱総合研究所	3,700	3,480.00	12,876,000
電算	1,100	2,152.00	2,367,200
A G S	5,500	743.00	4,086,500
ファインデックス	8,100	698.00	5,653,800
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,720.00	3,784,000
ブレインパッド	2,000	6,480.00	12,960,000
K L a b	16,600	1,100.00	18,260,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,300	2,134.00	13,444,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,809.00	2,894,400
ネクソン	237,500	1,391.00	330,362,500
アイスタイル	24,000	1,005.00	24,120,000
エムアップ	3,300	2,103.00	6,939,900
エイチーム	5,900	1,521.00	8,973,900
テクノスジャパン	8,000	903.00	7,224,000
コロプラ	26,800	821.00	22,002,800
ブロードリーフ	46,500	611.00	28,411,500
クロス・マーケティンググループ	3,000	388.00	1,164,000
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,648.00	7,086,400
メディアドゥホールディングス	2,900	2,643.00	7,664,700
じげん	10,200	577.00	5,885,400
サイバーリンクス	1,600	1,036.00	1,657,600
フィックスターズ	9,000	1,172.00	10,548,000
VOYAGE GROUP	5,100	1,127.00	5,747,700
オブティム	2,100	4,745.00	9,964,500
セレス	3,100	1,803.00	5,589,300
ベリサーブ	1,000	5,280.00	5,280,000
ティーガイア	9,400	2,230.00	20,962,000
セック	1,600	4,020.00	6,432,000
日本アジアグループ	9,800	344.00	3,371,200

豆蔵ホールディングス	6,500	1,080.00	7,020,000
テクマトリックス	6,700	1,868.00	12,515,600
プロシップ	1,400	2,452.00	3,432,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	225,500	230.00	51,865,000
GMOペイメントゲートウェイ	15,400	6,660.00	102,564,000
ザッパラス	4,900	391.00	1,915,900
システムリサーチ	1,300	3,255.00	4,231,500
インターネットイニシアティブ	15,200	2,618.00	39,793,600
さくらインターネット	11,300	542.00	6,124,600
ヴィンクス	3,200	1,650.00	5,280,000
GMOクラウド	2,100	3,790.00	7,959,000
SRAホールディングス	5,000	2,812.00	14,060,000
Minorityソリューションズ	1,900	1,700.00	3,230,000
朝日ネット	7,900	524.00	4,139,600
eBASE	2,900	1,705.00	4,944,500
アバント	2,600	1,182.00	3,073,200
アドソル日進	3,400	1,805.00	6,137,000
フリービット	6,400	993.00	6,355,200
コムチュア	5,300	3,220.00	17,066,000
サイバーコム	1,800	1,645.00	2,961,000
アステリア	4,900	811.00	3,973,900
マークライنز	3,300	1,394.00	4,600,200
メディカル・データ・ビジョン	8,400	985.00	8,274,000
ショーケース・ティービー	2,200	772.00	1,698,400
モバイルファクトリー	2,700	1,252.00	3,380,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,200	1,851.00	7,774,200
PCIホールディングス	1,700	2,525.00	4,292,500
パイプドHD	1,600	1,010.00	1,616,000
アイビーシー	1,600	1,186.00	1,897,600
ネオジャパン	2,000	792.00	1,584,000
PR TIMES	700	2,244.00	1,570,800
ランドコンピュータ	1,200	1,031.00	1,237,200
オープンドア	4,700	3,015.00	14,170,500
マイネット	3,100	2,028.00	6,286,800
アカツキ	3,300	5,560.00	18,348,000
ベネフィットジャパン	800	808.00	646,400
Ubicomホールディングス	1,800	1,065.00	1,917,000
LINE	28,400	3,630.00	103,092,000
カナミックネットワーク	1,500	1,862.00	2,793,000
ノムラシステムコーポレーション	900	976.00	878,400
チェンジ	600	6,710.00	4,026,000
シンクロ・フード	4,200	565.00	2,373,000

オークネット	5,100	1,089.00	5,553,900
A O I T Y O H o l d i n g s	10,300	949.00	9,774,700
マクロミル	11,900	1,660.00	19,754,000
ビーグリー	1,900	993.00	1,886,700
オロ	1,000	4,400.00	4,400,000
ソルクシーズ	4,200	727.00	3,053,400
フェイス	3,800	1,130.00	4,294,000
ハイマックス	1,200	1,754.00	2,104,800
野村総合研究所	59,300	4,745.00	281,378,500
サイバネットシステム	7,900	707.00	5,585,300
C E ホールディングス	2,700	700.00	1,890,000
日本システム技術	1,600	1,893.00	3,028,800
インテージホールディングス	12,100	987.00	11,942,700
東邦システムサイエンス	3,000	859.00	2,577,000
ソースネクスト	36,400	620.00	22,568,000
F I G	8,700	383.00	3,332,100
フォーカスシステムズ	6,400	1,054.00	6,745,600
クレスコ	2,900	3,600.00	10,440,000
フジ・メディア・ホールディングス	96,800	1,702.00	164,753,600
オービック	32,300	9,160.00	295,868,000
ジャストシステム	13,300	2,492.00	33,143,600
T D C ソフト	8,300	918.00	7,619,400
ヤフー	608,400	317.00	192,862,800
トレンドマイクロ	49,700	6,210.00	308,637,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,800	1,328.00	3,718,400
日本オラクル	15,100	7,090.00	107,059,000
アルファシステムズ	3,100	2,606.00	8,078,600
フューチャー	12,800	1,654.00	21,171,200
C A C H o l d i n g s	7,200	1,016.00	7,315,200
ソフトバンク・テクノロジー	4,000	1,851.00	7,404,000
トーセ	2,700	895.00	2,416,500
オービックビジネスコンサルタント	4,800	9,600.00	46,080,000
伊藤忠テクノソリューションズ	42,600	2,115.00	90,099,000
アイティフォー	11,500	797.00	9,165,500
東計電算	1,400	3,245.00	4,543,000
エクスネット	1,900	906.00	1,721,400
大塚商会	50,500	3,515.00	177,507,500
サイボウズ	11,200	658.00	7,369,600
ソフトブレーン	7,600	484.00	3,678,400
電通国際情報サービス	5,800	3,385.00	19,633,000
デジタルガレージ	18,200	2,762.00	50,268,400
E M システムズ	7,700	1,087.00	8,369,900



ウェザーニューズ	3,200	3,185.00	10,192,000
C I J	7,500	718.00	5,385,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	2,175.00	2,175,000
日本エンタープライズ	10,300	221.00	2,276,300
WOWOW	4,500	3,265.00	14,692,500
スカラ	7,700	792.00	6,098,400
I M A G I C A G R O U P	8,100	557.00	4,511,700
ネットワンシステムズ	33,100	2,221.00	73,515,100
システムソフト	23,600	106.00	2,501,600
アルゴグラフィックス	4,000	4,225.00	16,900,000
マーベラス	14,400	859.00	12,369,600
エイベックス	16,100	1,552.00	24,987,200
日本ユニシス	29,200	2,870.00	83,804,000
兼松エレクトロニクス	5,100	3,415.00	17,416,500
東京放送ホールディングス	61,900	1,924.00	119,095,600
日本テレビホールディングス	85,700	1,782.00	152,717,400
朝日放送グループホールディングス	9,500	754.00	7,163,000
テレビ朝日ホールディングス	25,700	2,178.00	55,974,600
スカパーJ S A Tホールディングス	71,500	522.00	37,323,000
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,575.00	19,827,500
日本BS放送	3,300	1,220.00	4,026,000
ビジョン	2,900	4,630.00	13,427,000
ワイヤレスゲート	4,400	497.00	2,186,800
コネクシオ	6,700	1,399.00	9,373,300
クロップス	1,900	700.00	1,330,000
日本電信電話	637,700	4,595.00	2,930,231,500
K D D I	821,700	2,619.50	2,152,443,150
光通信	11,000	18,020.00	198,220,000
N T T ドコモ	669,500	2,551.50	1,708,229,250
エムティーアイ	11,000	570.00	6,270,000
G M O インターネット	34,100	1,385.00	47,228,500
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	497.00	1,143,100
カドカワ	27,300	1,260.00	34,398,000
学研ホールディングス	3,200	4,355.00	13,936,000
ゼンリン	18,700	2,687.00	50,246,900
昭文社	4,600	523.00	2,405,800
インプレスホールディングス	7,700	159.00	1,224,300
アイネット	5,400	1,529.00	8,256,600
松竹	6,200	11,380.00	70,556,000
東宝	61,400	3,815.00	234,241,000
東映	3,900	13,530.00	52,767,000
エヌ・ティ・ティ・データ	248,400	1,292.00	320,932,800

ピー・シー・エー	1,300	2,095.00	2,723,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,956.00	3,325,200
D T S	10,500	3,880.00	40,740,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	43,400	3,310.00	143,654,000
シーイーシー	10,100	2,409.00	24,330,900
カプコン	40,000	2,106.00	84,240,000
アイ・エス・ビー	1,900	2,159.00	4,102,100
ジャステック	5,600	1,045.00	5,852,000
S C S K	24,600	4,110.00	101,106,000
日本システムウエア	3,200	2,164.00	6,924,800
アイネス	12,000	1,195.00	14,340,000
T K C	7,900	4,020.00	31,758,000
富士ソフト	14,000	4,655.00	65,170,000
N S D	15,400	2,328.00	35,851,200
コナミホールディングス	38,100	4,885.00	186,118,500
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,601.00	5,123,200
J B C Cホールディングス	7,400	1,691.00	12,513,400
ミロク情報サービス	9,300	2,504.00	23,287,200
ソフトバンクグループ	389,700	8,616.00	3,357,655,200
ハウスイ	800	927.00	741,600
高千穂交易	3,600	999.00	3,596,400
伊藤忠食品	2,300	5,030.00	11,569,000
エレマテック	4,400	2,016.00	8,870,400
J A L U X	2,600	2,713.00	7,053,800
あらた	5,200	4,920.00	25,584,000
トーメンデバイス	1,400	2,359.00	3,302,600
東京エレクトロン デバイス	3,400	1,793.00	6,096,200
フィールズ	8,200	934.00	7,658,800
双日	516,900	403.00	208,310,700
アルフレッサ ホールディングス	104,000	2,928.00	304,512,000
横浜冷凍	24,500	930.00	22,785,000
神栄	1,300	1,017.00	1,322,100
ラサ商事	5,000	934.00	4,670,000
ラクーンホールディングス	5,600	622.00	3,483,200
アルコニックス	9,900	1,198.00	11,860,200
神戸物産	14,100	3,190.00	44,979,000
あい ホールディングス	15,000	2,025.00	30,375,000
ディーブイエックス	3,700	1,214.00	4,491,800
ダイワボウホールディングス	8,500	5,420.00	46,070,000
マクニカ・富士エレホールディングス	26,000	1,590.00	41,340,000
ラクト・ジャパン	2,000	8,240.00	16,480,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,600	1,115.00	19,624,000

八洲電機	7,300	802.00	5,854,600
メディアスホールディングス	5,200	776.00	4,035,200
UKCホールディングス	6,000	2,346.00	14,076,000
ジュテックホールディングス	2,200	1,013.00	2,228,600
大光	2,400	639.00	1,533,600
OCHIホールディングス	2,700	1,225.00	3,307,500
TOKAIホールディングス	49,500	943.00	46,678,500
黒谷	1,600	480.00	768,000
Cominix	1,600	815.00	1,304,000
三洋貿易	4,700	1,862.00	8,751,400
ビューティガレージ	1,300	1,709.00	2,221,700
ウイン・パートナーズ	6,100	1,052.00	6,417,200
ミタチ産業	2,400	741.00	1,778,400
シップヘルスケアホールディングス	19,500	4,280.00	83,460,000
明治電機工業	2,900	1,882.00	5,457,800
デリカフーズホールディングス	1,700	1,421.00	2,415,700
スターティアホールディングス	1,800	713.00	1,283,400
コメダホールディングス	21,600	2,332.00	50,371,200
富士興産	3,600	622.00	2,239,200
協栄産業	1,100	1,727.00	1,899,700
小野建	8,300	1,592.00	13,213,600
佐島電機	6,900	955.00	6,589,500
エコトレーディング	2,200	629.00	1,383,800
伯東	6,400	1,275.00	8,160,000
コンドーテック	7,300	996.00	7,270,800
中山福	5,400	543.00	2,932,200
ナガイレーベン	13,500	2,632.00	35,532,000
三菱食品	10,300	2,965.00	30,539,500
松田産業	6,800	1,459.00	9,921,200
第一興商	13,900	5,100.00	70,890,000
メディバルホールディングス	101,000	2,505.00	253,005,000
SPK	2,000	2,360.00	4,720,000
萩原電気ホールディングス	3,500	2,950.00	10,325,000
アズワン	6,700	8,070.00	54,069,000
スズデン	3,300	1,267.00	4,181,100
尾家産業	3,000	1,298.00	3,894,000
シモジマ	5,700	1,070.00	6,099,000
ドウシヤ	8,800	1,986.00	17,476,800
小津産業	2,100	1,925.00	4,042,500
高速	5,600	1,074.00	6,014,400
たけびし	3,300	1,394.00	4,600,200
リックス	2,100	1,510.00	3,171,000

丸文	8,300	803.00	6,664,900
ハピネット	7,800	1,532.00	11,949,600
橋本総業ホールディングス	1,700	1,540.00	2,618,000
日本ライフライン	29,400	1,578.00	46,393,200
タカショー	4,600	469.00	2,157,400
エクセル	3,400	1,891.00	6,429,400
マルカキカイ	3,000	2,086.00	6,258,000
I D O M	31,600	428.00	13,524,800
日本エム・ディ・エム	5,500	1,239.00	6,814,500
進和	5,500	2,205.00	12,127,500
エスケイジャパン	2,300	811.00	1,865,300
ダイトロン	4,300	1,373.00	5,903,900
シークス	11,900	1,695.00	20,170,500
田中商事	3,100	611.00	1,894,100
オーハシテクニカ	5,300	1,361.00	7,213,300
白銅	3,000	1,660.00	4,980,000
伊藤忠商事	654,600	1,988.50	1,301,672,100
丸紅	922,800	807.50	745,161,000
高島	1,500	1,978.00	2,967,000
長瀬産業	52,600	1,608.00	84,580,800
蝶理	6,000	1,804.00	10,824,000
豊田通商	104,500	3,660.00	382,470,000
三共生興	15,900	429.00	6,821,100
兼松	37,400	1,361.00	50,901,400
ツカモトコーポレーション	1,700	1,160.00	1,972,000
三井物産	771,000	1,699.00	1,309,929,000
日本紙パルプ商事	5,300	4,320.00	22,896,000
日立ハイテクノロジーズ	28,400	3,725.00	105,790,000
カメイ	12,200	1,216.00	14,835,200
東都水産	1,300	1,926.00	2,503,800
O U G ホールディングス	1,500	2,577.00	3,865,500
スターゼン	3,500	4,085.00	14,297,500
山善	36,600	1,137.00	41,614,200
椿本興業	2,100	3,080.00	6,468,000
住友商事	553,500	1,658.50	917,979,750
内田洋行	4,300	2,612.00	11,231,600
三菱商事	656,700	3,034.00	1,992,427,800
第一実業	4,300	3,875.00	16,662,500
キャノンマーケティングジャパン	26,800	2,036.00	54,564,800
西華産業	5,300	1,530.00	8,109,000
佐藤商事	8,400	915.00	7,686,000
菱洋エレクトロ	9,500	1,668.00	15,846,000

東京産業	9,300	541.00	5,031,300
ユアサ商事	9,600	3,630.00	34,848,000
神鋼商事	2,100	2,673.00	5,613,300
小林産業	5,600	295.00	1,652,000
阪和興業	16,200	3,095.00	50,139,000
正栄食品工業	4,900	4,525.00	22,172,500
カナデン	9,000	1,300.00	11,700,000
菱電商事	7,400	1,560.00	11,544,000
フルサト工業	5,200	1,717.00	8,928,400
岩谷産業	20,800	3,805.00	79,144,000
すてきナイスグループ	4,000	1,066.00	4,264,000
昭光通商	3,300	735.00	2,425,500
ニチモウ	1,500	1,707.00	2,560,500
極東貿易	2,900	1,540.00	4,466,000
イワキ	11,200	485.00	5,432,000
三愛石油	25,100	1,211.00	30,396,100
稲畑産業	22,500	1,510.00	33,975,000
G S Iクレオス	2,500	1,391.00	3,477,500
明和産業	8,600	403.00	3,465,800
ワキタ	20,000	1,224.00	24,480,000
東邦ホールディングス	27,700	2,919.00	80,856,300
サンゲツ	28,300	2,141.00	60,590,300
ミツウロコグループホールディングス	13,600	658.00	8,948,800
シナネンホールディングス	3,900	2,520.00	9,828,000
伊藤忠エネクス	20,700	1,060.00	21,942,000
サンリオ	28,900	2,379.00	68,753,100
サンワテクノス	5,700	1,144.00	6,520,800
リョーサン	10,300	2,966.00	30,549,800
新光商事	8,800	1,704.00	14,995,200
トーホー	4,200	2,250.00	9,450,000
三信電気	7,800	1,792.00	13,977,600
東陽テクニカ	10,800	851.00	9,190,800
モスフードサービス	12,300	2,999.00	36,887,700
加賀電子	9,300	2,062.00	19,176,600
ソーダニッカ	9,600	586.00	5,625,600
立花エレテック	6,900	1,630.00	11,247,000
フォーバル	4,100	911.00	3,735,100
P A L T A C	16,900	5,740.00	97,006,000
三谷産業	10,900	298.00	3,248,200
西本Wismettacホールディングス	2,100	4,965.00	10,426,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,224.00	979,200
国際紙パルプ商事	16,300	296.00	4,824,800

ヤマタネ	4,700	1,748.00	8,215,600
丸紅建材リース	900	2,009.00	1,808,100
日鉄住金物産	6,700	4,815.00	32,260,500
泉州電業	3,100	2,613.00	8,100,300
トラスコ中山	19,500	3,090.00	60,255,000
オートバックスセブン	37,200	1,746.00	64,951,200
モリト	6,800	796.00	5,412,800
加藤産業	14,600	3,375.00	49,275,000
北恵	1,800	1,162.00	2,091,600
イノテック	6,500	1,013.00	6,584,500
イエローハット	8,800	2,793.00	24,578,400
J Kホールディングス	8,400	619.00	5,199,600
日伝	7,800	1,671.00	13,033,800
北沢産業	7,100	233.00	1,654,300
杉本商事	5,100	1,751.00	8,930,100
因幡電機産業	13,300	4,585.00	60,980,500
バイテックホールディングス	4,200	2,339.00	9,823,800
東テク	3,100	2,561.00	7,939,100
ミスミグループ本社	117,100	2,455.00	287,480,500
アルテック	6,800	252.00	1,713,600
タキヒヨー	2,800	1,907.00	5,339,600
蔵王産業	1,500	1,350.00	2,025,000
スズケン	42,700	6,060.00	258,762,000
ジェコス	6,500	1,108.00	7,202,000
ルネサスイーストン	8,600	425.00	3,655,000
ローソン	23,700	7,350.00	174,195,000
サンエー	7,100	4,695.00	33,334,500
カワチ薬品	7,300	2,024.00	14,775,200
エービーシー・マート	14,600	6,270.00	91,542,000
ハードオフコーポレーション	3,800	876.00	3,328,800
アスクル	8,200	2,949.00	24,181,800
ゲオホールディングス	14,300	1,767.00	25,268,100
アダストリア	13,000	2,025.00	26,325,000
ジーフット	5,700	744.00	4,240,800
くらコーポレーション	5,500	6,560.00	36,080,000
キャンドウ	4,500	1,678.00	7,551,000
パルグループホールディングス	4,800	2,884.00	13,843,200
エディオン	39,700	1,218.00	48,354,600
サーラコーポレーション	19,000	629.00	11,951,000
ワッツ	3,200	793.00	2,537,600
ハローズ	3,500	2,508.00	8,778,000
あみやき亭	2,000	3,905.00	7,810,000

ひらまつ	18,700	355.00	6,638,500
大黒天物産	2,300	4,415.00	10,154,500
ハニーズホールディングス	9,100	868.00	7,898,800
ファーマライズホールディングス	2,200	593.00	1,304,600
アルペン	7,200	1,872.00	13,478,400
ハブ	3,100	1,067.00	3,307,700
クオールホールディングス	13,800	1,979.00	27,310,200
ジーンズ	6,400	6,680.00	42,752,000
ビックカメラ	50,000	1,669.00	83,450,000
D C Mホールディングス	50,500	1,103.00	55,701,500
ペッパーフードサービス	7,400	3,955.00	29,267,000
Monotaro	59,100	3,150.00	186,165,000
東京一番フーズ	2,400	628.00	1,507,200
DDホールディングス	2,100	2,357.00	4,949,700
きちり	2,600	802.00	2,085,200
アークランドサービスホールディングス	6,900	2,429.00	16,760,100
J.フロント リテイリング	119,800	1,478.00	177,064,400
ドトール・日レスホールディングス	16,500	2,225.00	36,712,500
マツモトキヨシホールディングス	38,700	3,995.00	154,606,500
ブロンコビリー	4,900	3,005.00	14,724,500
Z O Z O	101,200	2,391.00	241,969,200
トレジャー・ファクトリー	2,800	737.00	2,063,600
物語コーポレーション	2,700	10,170.00	27,459,000
ココカラファイン	10,500	6,080.00	63,840,000
三越伊勢丹ホールディングス	175,100	1,279.00	223,952,900
Hamee	2,400	1,886.00	4,526,400
ウエルシアホールディングス	24,700	5,780.00	142,766,000
クリエイトSDホールディングス	13,800	3,025.00	41,745,000
丸善CHIホールディングス	10,800	348.00	3,758,400
ティーライフ	1,300	1,074.00	1,396,200
エー・ピーカンパニー	1,900	524.00	995,600
チムニー	2,900	2,733.00	7,925,700
シュッピン	6,400	1,011.00	6,470,400
ネクステージ	14,400	1,193.00	17,179,200
ジョイフル本田	27,400	1,593.00	43,648,200
鳥貴族	3,100	1,983.00	6,147,300
麒麟堂ホールディングス	3,700	1,582.00	5,853,400
ホットランド	4,900	1,402.00	6,869,800
すかいらーくホールディングス	87,200	1,949.00	169,952,800
綿半ホールディングス	3,500	2,570.00	8,995,000
ヨシックス	1,500	2,907.00	4,360,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,200	1,264.00	34,380,800

ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	769.00	2,999,100
B E E N O S	2,200	1,463.00	3,218,600
あさひ	7,800	1,451.00	11,317,800
日本調剤	3,300	3,490.00	11,517,000
コスモス薬品	4,700	21,620.00	101,614,000
トーエル	4,600	752.00	3,459,200
一六堂	2,500	512.00	1,280,000
オンリー	1,700	1,046.00	1,778,200
セブン&アイ・ホールディングス	392,300	4,867.00	1,909,324,100
薬王堂	4,100	3,140.00	12,874,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,200	1,284.00	32,356,800
ツルハホールディングス	20,300	10,990.00	223,097,000
サンマルクホールディングス	7,400	2,712.00	20,068,800
フェリシモ	2,100	1,194.00	2,507,400
トリドールホールディングス	11,600	2,147.00	24,905,200
T O K Y O B A S E	8,400	697.00	5,854,800
ウイルプラスホールディングス	900	933.00	839,700
ジャパンミート	3,600	2,044.00	7,358,400
サツドラホールディングス	1,600	1,899.00	3,038,400
デファクトスタンダード	700	571.00	399,700
ダイユー・リックホールディングス	5,100	1,095.00	5,584,500
パロックジャパンリミテッド	7,600	980.00	7,448,000
クスリのアオキホールディングス	7,400	8,090.00	59,866,000
力の源ホールディングス	2,700	861.00	2,324,700
スシローグローバルホールディングス	10,300	6,660.00	68,598,000
L I X I L ビバ	8,000	1,742.00	13,936,000
メディカルシステムネットワーク	10,000	427.00	4,270,000
はるやまホールディングス	4,500	867.00	3,901,500
ノジマ	16,700	2,357.00	39,361,900
カッパ・クリエイト	13,100	1,445.00	18,929,500
ライトオン	7,900	915.00	7,228,500
良品計画	13,300	29,290.00	389,557,000
三城ホールディングス	11,600	463.00	5,370,800
アドヴァン	14,400	1,012.00	14,572,800
アルビス	3,600	2,736.00	9,849,600
コナカ	12,000	481.00	5,772,000
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,877.00	2,252,400
G - 7ホールディングス	2,800	2,470.00	6,916,000
イオン北海道	9,500	801.00	7,609,500
コジマ	13,800	539.00	7,438,200
ヒマラヤ	3,000	970.00	2,910,000
コーナン商事	12,300	2,790.00	34,317,000



エコス	3,500	2,256.00	7,896,000
ワタミ	12,300	1,350.00	16,605,000
マルシェ	2,500	793.00	1,982,500
ドンキホーテホールディングス	60,500	6,980.00	422,290,000
西松屋チェーン	20,600	985.00	20,291,000
ゼンショーホールディングス	44,200	2,797.00	123,627,400
幸楽苑ホールディングス	5,900	2,263.00	13,351,700
ハークスレイ	2,000	1,061.00	2,122,000
サイゼリヤ	15,500	2,019.00	31,294,500
V Tホールディングス	31,800	453.00	14,405,400
魚力	2,600	1,445.00	3,757,000
ポブラ	2,400	610.00	1,464,000
フジ・コーポレーション	1,900	1,959.00	3,722,100
ユナイテッドアローズ	10,700	4,015.00	42,960,500
ハイデイ日高	12,300	2,273.00	27,957,900
京都きもの友禅	6,000	410.00	2,460,000
コロワイド	31,100	2,592.00	80,611,200
ピーシーデポコーポレーション	12,500	520.00	6,500,000
壱番屋	6,600	4,540.00	29,964,000
P L A N T	2,200	1,022.00	2,248,400
スギホールディングス	20,600	4,895.00	100,837,000
ヴィア・ホールディングス	11,500	702.00	8,073,000
スクロール	14,400	411.00	5,918,400
ヨンドシーホールディングス	10,400	2,362.00	24,564,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	26,200	16,570.00	434,134,000
木曽路	11,500	2,558.00	29,417,000
S R Sホールディングス	11,100	1,005.00	11,155,500
タカキュー	7,500	192.00	1,440,000
ケーヨー	17,300	548.00	9,480,400
上新電機	11,100	2,621.00	29,093,100
日本瓦斯	17,200	4,155.00	71,466,000
ロイヤルホールディングス	16,600	2,883.00	47,857,800
いなげや	10,500	1,513.00	15,886,500
島忠	21,200	2,985.00	63,282,000
チヨダ	9,900	1,928.00	19,087,200
ライフコーポレーション	7,100	2,545.00	18,069,500
リンガーハット	11,600	2,392.00	27,747,200
M r M a x H D	12,900	522.00	6,733,800
テンアライド	8,600	410.00	3,526,000
A O K Iホールディングス	18,800	1,353.00	25,436,400
オークワ	13,400	1,138.00	15,249,200
コメリ	14,500	2,634.00	38,193,000

青山商事	18,000	2,820.00	50,760,000
しまむら	10,900	9,330.00	101,697,000
はせがわ	5,100	449.00	2,289,900
高島屋	73,500	1,551.00	113,998,500
松屋	18,900	1,233.00	23,303,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,000	1,780.00	85,440,000
近鉄百貨店	3,600	3,655.00	13,158,000
パルコ	9,000	1,242.00	11,178,000
丸井グループ	79,200	2,292.00	181,526,400
アクシアル リテイリング	7,800	3,900.00	30,420,000
イオン	360,100	2,641.50	951,204,150
イズミ	19,000	5,880.00	111,720,000
平和堂	19,000	2,948.00	56,012,000
フジ	11,300	1,993.00	22,520,900
ヤオコー	10,600	6,320.00	66,992,000
ゼビオホールディングス	11,400	1,398.00	15,937,200
ケーズホールディングス	97,300	1,136.00	110,532,800
Olympicグループ	5,600	769.00	4,306,400
日産東京販売ホールディングス	13,900	323.00	4,489,700
Genky DrugStores	3,700	3,600.00	13,320,000
総合メディカルホールディングス	8,200	2,408.00	19,745,600
ブックオフグループホールディングス	4,800	790.00	3,792,000
アインホールディングス	12,600	8,320.00	104,832,000
元気寿司	2,600	4,770.00	12,402,000
ヤマダ電機	285,200	533.00	152,011,600
アークランドサカモト	15,900	1,404.00	22,323,600
ニトリホールディングス	40,500	14,490.00	586,845,000
グルメ杵屋	6,700	1,185.00	7,939,500
愛眼	7,400	312.00	2,308,800
ケーユーホールディングス	5,000	854.00	4,270,000
吉野家ホールディングス	32,700	1,903.00	62,228,100
松屋フーズホールディングス	4,500	3,760.00	16,920,000
サガミホールディングス	12,600	1,347.00	16,972,200
関西スーパーマーケット	7,100	1,021.00	7,249,100
王将フードサービス	6,900	7,570.00	52,233,000
プレナス	10,500	1,894.00	19,887,000
ミニストップ	7,000	2,030.00	14,210,000
アークス	17,600	2,644.00	46,534,400
バローホールディングス	20,200	2,756.00	55,671,200
ベルク	4,600	5,780.00	26,588,000
大庄	5,000	1,642.00	8,210,000
ファーストリテイリング	12,500	57,550.00	719,375,000

サンドラッグ	35,200	3,740.00	131,648,000
サクスパー ホールディングス	8,000	1,156.00	9,248,000
ヤマザワ	2,000	1,754.00	3,508,000
やまや	1,600	2,459.00	3,934,400
ペルーナ	23,000	1,073.00	24,679,000
島根銀行	2,900	820.00	2,378,000
じもとホールディングス	62,900	139.00	8,743,100
めぶきフィナンシャルグループ	489,200	322.00	157,522,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,000	1,826.00	23,738,000
九州フィナンシャルグループ	155,300	484.00	75,165,200
ゆうちょ銀行	266,100	1,261.00	335,552,100
富山第一銀行	24,100	413.00	9,953,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	598,400	475.00	284,240,000
西日本フィナンシャルホールディングス	60,700	1,100.00	66,770,000
関西みらいフィナンシャルグループ	44,900	818.00	36,728,200
三十三フィナンシャルグループ	8,500	1,883.00	16,005,500
第四北越フィナンシャルグループ	16,500	3,375.00	55,687,500
新生銀行	68,800	1,496.00	102,924,800
あおぞら銀行	52,300	3,565.00	186,449,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,526,600	596.50	3,893,116,900
りそなホールディングス	1,028,400	561.20	577,138,080
三井住友トラスト・ホールディングス	184,100	4,233.00	779,295,300
三井住友フィナンシャルグループ	660,500	3,962.00	2,616,901,000
千葉銀行	333,000	647.00	215,451,000
群馬銀行	188,900	487.00	91,994,300
武蔵野銀行	14,200	2,783.00	39,518,600
千葉興業銀行	27,400	414.00	11,343,600
筑波銀行	39,000	222.00	8,658,000
七十七銀行	29,800	2,090.00	62,282,000
青森銀行	7,500	2,933.00	21,997,500
秋田銀行	6,300	2,247.00	14,156,100
山形銀行	10,900	2,219.00	24,187,100
岩手銀行	6,700	3,915.00	26,230,500
東邦銀行	83,800	342.00	28,659,600
東北銀行	4,800	1,236.00	5,932,800
みちのく銀行	6,000	1,774.00	10,644,000
ふくおかフィナンシャルグループ	76,400	2,447.00	186,950,800
静岡銀行	236,700	942.00	222,971,400
十六銀行	12,900	2,515.00	32,443,500
八十二銀行	171,100	484.00	82,812,400
山梨中央銀行	12,100	1,543.00	18,670,300
大垣共立銀行	15,100	2,374.00	35,847,400

福井銀行	8,400	1,795.00	15,078,000
北國銀行	10,100	3,915.00	39,541,500
清水銀行	4,300	1,774.00	7,628,200
富山銀行	2,000	3,575.00	7,150,000
滋賀銀行	19,100	2,717.00	51,894,700
南都銀行	11,300	2,383.00	26,927,900
百五銀行	86,100	413.00	35,559,300
京都銀行	33,700	5,040.00	169,848,000
紀陽銀行	33,600	1,614.00	54,230,400
ほくほくフィナンシャルグループ	62,900	1,362.00	85,669,800
広島銀行	139,500	637.00	88,861,500
山陰合同銀行	56,500	837.00	47,290,500
中国銀行	61,200	1,010.00	61,812,000
鳥取銀行	3,700	1,504.00	5,564,800
伊予銀行	125,300	631.00	79,064,300
百十四銀行	10,200	2,692.00	27,458,400
四国銀行	14,000	1,339.00	18,746,000
阿波銀行	15,300	2,941.00	44,997,300
大分銀行	6,000	3,540.00	21,240,000
宮崎銀行	6,500	3,005.00	19,532,500
佐賀銀行	6,100	1,944.00	11,858,400
十八銀行	6,000	2,694.00	16,164,000
沖縄銀行	8,800	3,485.00	30,668,000
琉球銀行	22,200	1,177.00	26,129,400
セブン銀行	318,800	338.00	107,754,400
みずほフィナンシャルグループ	12,734,300	181.00	2,304,908,300
高知銀行	3,400	866.00	2,944,400
山口フィナンシャルグループ	117,600	1,136.00	133,593,600
長野銀行	3,500	1,673.00	5,855,500
名古屋銀行	7,800	3,495.00	27,261,000
北洋銀行	143,600	306.00	43,941,600
愛知銀行	3,600	4,195.00	15,102,000
中京銀行	4,200	2,285.00	9,597,000
大光銀行	3,600	1,992.00	7,171,200
愛媛銀行	13,700	1,104.00	15,124,800
トマト銀行	4,200	1,227.00	5,153,400
京葉銀行	42,400	737.00	31,248,800
栃木銀行	51,000	270.00	13,770,000
北日本銀行	3,200	2,322.00	7,430,400
東和銀行	16,500	837.00	13,810,500
福島銀行	8,000	495.00	3,960,000
大東銀行	4,500	765.00	3,442,500

トモニホールディングス	74,100	452.00	33,493,200
フィデアホールディングス	91,000	146.00	13,286,000
池田泉州ホールディングス	101,800	324.00	32,983,200
F P G	30,100	1,120.00	33,712,000
マーキュリアインベストメント	3,700	813.00	3,008,100
S B I ホールディングス	111,700	2,466.00	275,452,200
ジャフコ	15,400	3,910.00	60,214,000
大和証券グループ本社	752,200	601.80	452,673,960
野村ホールディングス	1,720,000	455.40	783,288,000
岡三証券グループ	80,100	522.00	41,812,200
丸三証券	28,000	853.00	23,884,000
東洋証券	33,900	192.00	6,508,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	112,000	519.00	58,128,000
光世証券	2,400	916.00	2,198,400
水戸証券	27,300	299.00	8,162,700
いちよし証券	19,800	903.00	17,879,400
松井証券	46,000	1,248.00	57,408,000
だいこう証券ビジネス	4,000	476.00	1,904,000
マネックスグループ	87,800	384.00	33,715,200
カブドットコム証券	70,300	397.00	27,909,100
極東証券	12,700	1,264.00	16,052,800
岩井コスモホールディングス	9,700	1,306.00	12,668,200
藍澤証券	17,700	746.00	13,204,200
マネーパートナーズグループ	11,300	310.00	3,503,000
かんぽ生命保険	35,400	2,673.00	94,624,200
S O M P O ホールディングス	183,800	4,136.00	760,196,800
アニコム ホールディングス	7,500	3,430.00	25,725,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	245,000	3,307.00	810,215,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	77,000	2,244.00	172,788,000
第一生命ホールディングス	530,200	1,868.00	990,413,600
東京海上ホールディングス	339,700	5,475.00	1,859,857,500
T & D ホールディングス	289,800	1,494.00	432,961,200
アドバンスクリエイト	2,200	2,003.00	4,406,600
全国保証	26,400	3,840.00	101,376,000
ジェイリース	1,900	464.00	881,600
イントラスト	2,600	390.00	1,014,000
日本モーゲージサービス	1,300	876.00	1,138,800
C a s a	3,100	1,159.00	3,592,900
アルヒ	8,500	1,952.00	16,592,000
クレディセゾン	65,600	1,368.00	89,740,800
芙蓉総合リース	10,700	5,880.00	62,916,000
興銀リース	17,600	2,606.00	45,865,600

東京センチュリー	18,900	4,975.00	94,027,500
日本証券金融	41,300	643.00	26,555,900
アイフル	143,000	304.00	43,472,000
リコーリース	7,400	3,440.00	25,456,000
イオンフィナンシャルサービス	59,900	2,099.00	125,730,100
アコム	188,400	402.00	75,736,800
ジャックス	10,300	1,908.00	19,652,400
オリエントコーポレーション	253,500	159.00	40,306,500
日立キャピタル	22,100	2,525.00	55,802,500
アプラスフィナンシャル	44,600	98.00	4,370,800
オリックス	625,200	1,739.50	1,087,535,400
三菱UFJリース	211,400	579.00	122,400,600
九州リースサービス	4,600	658.00	3,026,800
日本取引所グループ	253,200	1,893.00	479,307,600
イー・ギャランティ	8,700	1,041.00	9,056,700
アサックス	3,900	577.00	2,250,300
NECキャピタルソリューション	3,800	1,601.00	6,083,800
いちご	119,500	357.00	42,661,500
日本駐車場開発	113,900	153.00	17,426,700
ヒューリック	195,700	1,035.00	202,549,500
三栄建築設計	3,800	1,555.00	5,909,000
スター・マイカ	4,400	1,666.00	7,330,400
野村不動産ホールディングス	62,500	2,167.00	135,437,500
三重交通グループホールディングス	19,200	592.00	11,366,400
サムティ	13,000	1,328.00	17,264,000
ディア・ライフ	12,100	482.00	5,832,200
コーセーアールイー	2,900	872.00	2,528,800
エー・ディー・ワークス	123,300	38.00	4,685,400
日本商業開発	5,900	1,679.00	9,906,100
プレサンスコーポレーション	14,900	1,486.00	22,141,400
ユニゾホールディングス	14,200	2,189.00	31,083,800
THEグローバル社	4,600	575.00	2,645,000
日本管理センター	6,300	986.00	6,211,800
サンセイランディック	2,600	967.00	2,514,200
エストラスト	1,300	772.00	1,003,600
フージャースホールディングス	20,700	639.00	13,227,300
オープンハウス	15,300	4,030.00	61,659,000
東急不動産ホールディングス	252,300	603.00	152,136,900
飯田グループホールディングス	78,200	2,022.00	158,120,400
イーランド	1,500	715.00	1,072,500
ムゲンエステート	6,700	689.00	4,616,300
ファーストブラザーズ	2,700	1,205.00	3,253,500

ハウストゥ	3,400	1,194.00	4,059,600
シーアールイー	3,200	1,010.00	3,232,000
ケイアイスター不動産	2,600	1,702.00	4,425,200
グッドコムアセット	1,700	1,514.00	2,573,800
ジェイ・エス・ビー	300	4,405.00	1,321,500
テンポイノベーション	800	1,480.00	1,184,000
パーク24	54,800	2,981.00	163,358,800
パラカ	2,500	1,849.00	4,622,500
三井不動産	497,200	2,673.00	1,329,015,600
三菱地所	656,600	1,803.50	1,184,178,100
平和不動産	17,800	1,852.00	32,965,600
東京建物	102,500	1,261.00	129,252,500
ダイビル	27,700	1,199.00	33,212,300
京阪神ビルディング	16,900	827.00	13,976,300
住友不動産	210,700	4,189.00	882,622,300
大京	14,500	2,958.00	42,891,000
テーオーシー	21,600	790.00	17,064,000
東京楽天地	1,400	4,775.00	6,685,000
レオパレス21	118,400	454.00	53,753,600
スターツコーポレーション	12,800	2,524.00	32,307,200
フジ住宅	12,100	867.00	10,490,700
空港施設	11,100	569.00	6,315,900
明和地所	5,300	607.00	3,217,100
ゴールドクレスト	7,500	1,643.00	12,322,500
日本エスリード	3,700	1,589.00	5,879,300
日神不動産	14,000	489.00	6,846,000
日本エスコン	17,100	667.00	11,405,700
タカラレーベン	44,300	330.00	14,619,000
サンヨーハウジング名古屋	5,400	1,000.00	5,400,000
イオンモール	47,000	1,903.00	89,441,000
ファースト住建	3,600	1,207.00	4,345,200
カチタス	10,500	2,978.00	31,269,000
トーセイ	13,000	959.00	12,467,000
穴吹興産	1,100	2,961.00	3,257,100
サンフロンティア不動産	13,100	1,129.00	14,789,900
エフ・ジェー・ネクスト	8,300	880.00	7,304,000
インテリックス	2,800	722.00	2,021,600
ランドビジネス	4,700	599.00	2,815,300
グランディハウス	8,400	403.00	3,385,200
日本空港ビルデング	29,900	3,940.00	117,806,000
日本工営	6,100	2,591.00	15,805,100
LIFULL	31,700	825.00	26,152,500

ジェイエイシーリクルートメント	7,400	2,245.00	16,613,000
日本M&Aセンター	67,700	2,693.00	182,316,100
メンバーズ	3,100	998.00	3,093,800
中広	1,100	648.00	712,800
タケエイ	9,600	790.00	7,584,000
E・Jホールディングス	1,200	1,144.00	1,372,800
トラスト・テック	4,400	3,180.00	13,992,000
コシダカホールディングス	24,400	1,438.00	35,087,200
アルトナー	1,800	778.00	1,400,400
パソナグループ	8,700	1,275.00	11,092,500
CDS	2,300	1,334.00	3,068,200
リンクアンドモチベーション	16,800	949.00	15,943,200
GCA	9,300	771.00	7,170,300
エス・エム・エス	33,400	1,757.00	58,683,800
パーソルホールディングス	90,800	1,916.00	173,972,800
リニカル	5,200	1,575.00	8,190,000
クックパッド	28,800	381.00	10,972,800
エスクリ	2,700	632.00	1,706,400
アイ・ケイ・ケイ	4,600	715.00	3,289,000
学情	3,700	1,503.00	5,561,100
スタジオアリス	4,600	2,486.00	11,435,600
シミックホールディングス	5,100	2,019.00	10,296,900
NJS	2,100	1,689.00	3,546,900
総合警備保障	36,100	5,210.00	188,081,000
カカクコム	68,400	2,182.00	149,248,800
アイロムグループ	3,500	1,945.00	6,807,500
セントケア・ホールディング	5,100	556.00	2,835,600
サイネックス	1,700	710.00	1,207,000
ルネサンス	5,100	2,299.00	11,724,900
ディップ	14,700	2,206.00	32,428,200
オプトホールディング	5,600	1,693.00	9,480,800
ツクイ	21,500	950.00	20,425,000
キャリアデザインセンター	2,400	1,161.00	2,786,400
エムスリー	191,200	1,646.00	314,715,200
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	612.00	3,610,800
プラス	800	599.00	479,200
アウトソーシング	47,900	1,318.00	63,132,200
ウェルネット	9,300	1,079.00	10,034,700
ワールドホールディングス	2,500	2,608.00	6,520,000
ディー・エヌ・エー	49,000	2,041.00	100,009,000
博報堂DYホールディングス	126,300	1,676.00	211,678,800
ぐるなび	13,100	792.00	10,375,200



エスアールジータカミヤ	9,500	741.00	7,039,500
ジャパンベストレスキューシステム	7,200	1,488.00	10,713,600
ファンコミュニケーションズ	25,100	698.00	17,519,800
ライク	3,600	1,551.00	5,583,600
ビジネス・ブレイクスルー	4,100	350.00	1,435,000
WDBホールディングス	4,200	2,728.00	11,457,600
ティア	4,300	665.00	2,859,500
C D G	900	1,453.00	1,307,700
バリューコマース	6,200	1,524.00	9,448,800
インフォマート	49,800	1,135.00	56,523,000
J Pホールディングス	26,100	289.00	7,542,900
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	13,700	1,990.00	27,263,000
レグス	2,300	1,051.00	2,417,300
プレステージ・インターナショナル	17,100	1,337.00	22,862,700
アミューズ	5,500	2,553.00	14,041,500
ドリームインキュベータ	2,800	1,640.00	4,592,000
クイック	5,700	1,440.00	8,208,000
T A C	5,300	235.00	1,245,500
ケネディクス	85,100	537.00	45,698,700
電通	110,600	5,000.00	553,000,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,500	1,748.00	6,118,000
ぴあ	2,600	4,535.00	11,791,000
イオンファンタジー	2,900	3,080.00	8,932,000
シーティーエス	10,400	645.00	6,708,000
ネクシィーズグループ	2,800	1,827.00	5,115,600
みらかホールディングス	25,400	2,557.00	64,947,800
アルプス技研	8,000	1,889.00	15,112,000
ダイオーズ	2,200	1,385.00	3,047,000
日本空調サービス	10,400	757.00	7,872,800
オリエンタルランド	107,300	10,860.00	1,165,278,000
ダスキン	24,500	2,500.00	61,250,000
明光ネットワークジャパン	11,600	978.00	11,344,800
ファルコホールディングス	5,100	1,608.00	8,200,800
ラウンドワン	28,300	1,147.00	32,460,100
リゾートトラスト	38,500	1,682.00	64,757,000
ビー・エム・エル	11,700	2,914.00	34,093,800
ワタベウェディング	1,600	925.00	1,480,000
りらいあコミュニケーションズ	16,500	998.00	16,467,000
リソー教育	46,400	382.00	17,724,800
早稲田アカデミー	1,300	2,121.00	2,757,300
ユー・エス・エス	111,000	1,895.00	210,345,000

東京個別指導学院	3,300	1,291.00	4,260,300
サイバーエージェント	56,000	4,695.00	262,920,000
楽天	423,300	859.00	363,614,700
クリーク・アンド・リバー社	5,400	1,145.00	6,183,000
テー・オー・ダブリュー	8,800	785.00	6,908,000
セントラルスポーツ	3,400	3,620.00	12,308,000
フルキャストホールディングス	9,100	2,071.00	18,846,100
エン・ジャパン	9,900	4,210.00	41,679,000
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	17,100	5,150.00	88,065,000
アトラ	2,000	490.00	980,000
インターワークス	1,900	737.00	1,400,300
アイ・アールジャパンホールディングス	3,000	1,417.00	4,251,000
Keeper 技研	3,000	1,086.00	3,258,000
ファーストロジック	1,900	724.00	1,375,600
三機サービス	1,400	1,839.00	2,574,600
Gunosy	5,600	3,300.00	18,480,000
デザインワン・ジャパン	2,100	388.00	814,800
イー・ガーディアン	4,300	2,391.00	10,281,300
リブセンス	5,300	310.00	1,643,000
ジャパンマテリアル	24,900	1,108.00	27,589,200
ベクトル	11,100	1,679.00	18,636,900
ウチヤマホールディングス	4,700	465.00	2,185,500
ライクキッズネクスト	2,000	1,228.00	2,456,000
キャリアリンク	3,600	409.00	1,472,400
I B J	6,200	740.00	4,588,000
アサンテ	3,700	2,129.00	7,877,300
N・フィールド	6,000	1,001.00	6,006,000
バリューHR	1,900	2,033.00	3,862,700
M&Aキャピタルパートナーズ	2,300	3,915.00	9,004,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,502.00	5,707,600
E R Iホールディングス	2,700	872.00	2,354,400
アビスト	1,400	3,330.00	4,662,000
シグマクシス	4,400	918.00	4,039,200
ウィルグループ	6,000	1,065.00	6,390,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,600	403.00	5,077,800
日本ビューホテル	3,000	1,200.00	3,600,000
リクルートホールディングス	650,400	2,995.00	1,947,948,000
エラン	3,200	2,841.00	9,091,200
土木管理総合試験所	4,100	574.00	2,353,400
日本郵政	744,300	1,313.00	977,265,900
ベルシステム24ホールディングス	15,300	1,455.00	22,261,500

鎌倉新書	6,700	1,154.00	7,731,800
一蔵	1,100	673.00	740,300
LITALICO	2,100	1,924.00	4,040,400
グローバルグループ	1,200	1,079.00	1,294,800
エボラブルアジア	2,600	2,081.00	5,410,600
アトラエ	1,800	2,564.00	4,615,200
ストライク	2,300	2,659.00	6,115,700
ソラスト	22,100	1,341.00	29,636,100
セラク	2,200	632.00	1,390,400
インソース	3,000	2,301.00	6,903,000
アイモバイル	2,300	767.00	1,764,100
キャリアインデックス	3,100	1,720.00	5,332,000
MS - Japan	3,700	1,440.00	5,328,000
船場	1,600	982.00	1,571,200
グレイステクノロジー	2,500	2,172.00	5,430,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,400	1,799.00	9,714,600
フルテック	1,100	1,135.00	1,248,500
グリーンズ	2,000	1,480.00	2,960,000
ツナグ・ソリューションズ	1,000	660.00	660,000
日総工産	2,300	1,830.00	4,209,000
キュービーネットホールディングス	4,700	2,172.00	10,208,400
スプリックス	2,600	1,975.00	5,135,000
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	1,113.00	4,006,800
リログループ	49,700	3,010.00	149,597,000
東祥	5,700	4,045.00	23,056,500
エイチ・アイ・エス	16,200	3,725.00	60,345,000
ラックランド	1,800	2,787.00	5,016,600
共立メンテナンス	13,900	5,270.00	73,253,000
イチネンホールディングス	9,500	1,329.00	12,625,500
建設技術研究所	6,300	1,440.00	9,072,000
スペース	6,000	1,173.00	7,038,000
長大	3,800	810.00	3,078,000
燦ホールディングス	2,000	2,406.00	4,812,000
スバル興業	600	5,500.00	3,300,000
東京テアトル	3,600	1,322.00	4,759,200
タナベ経営	1,800	1,533.00	2,759,400
ナガワ	2,600	5,760.00	14,976,000
よみうりランド	2,000	4,065.00	8,130,000
東京都競馬	6,000	3,120.00	18,720,000
カナモト	13,600	3,170.00	43,112,000
東京ドーム	34,000	1,023.00	34,782,000
西尾レントオール	9,200	3,845.00	35,374,000

トランス・コスモス	10,100	2,574.00	25,997,400	
乃村工藝社	21,300	3,015.00	64,219,500	
藤田観光	3,600	3,030.00	10,908,000	
KNT-CTホールディングス	4,800	1,176.00	5,644,800	
日本管財	9,800	2,056.00	20,148,800	
トーカイ	8,800	2,631.00	23,152,800	
白洋舎	1,100	2,989.00	3,287,900	
セコム	96,400	9,394.00	905,581,600	
セントラル警備保障	4,400	5,670.00	24,948,000	
丹青社	17,200	1,218.00	20,949,600	
メイテック	11,500	4,755.00	54,682,500	
応用地質	9,900	1,305.00	12,919,500	
船井総研ホールディングス	18,900	1,826.00	34,511,400	
進学会ホールディングス	4,300	632.00	2,717,600	
オオバ	7,300	700.00	5,110,000	
いであ	1,900	1,066.00	2,025,400	
学究社	3,000	1,599.00	4,797,000	
ベネッセホールディングス	33,300	3,240.00	107,892,000	
イオンディライト	11,200	3,975.00	44,520,000	
ナック	5,800	1,037.00	6,014,600	
ニチイ学館	13,000	1,096.00	14,248,000	
ダイセキ	15,300	2,393.00	36,612,900	
ステップ	3,400	1,396.00	4,746,400	
合 計	108,277,400		213,793,923,570	

## (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17期中間計算期間(2018年12月11日から2019年6月10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A】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2018年12月10日現在)	第17期中間計算期間 (2019年6月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,374,048	4,924,879
親投資信託受益証券	1,974,354,131	1,920,133,607
未収入金	3,337,244	4,683,691
流動資産合計	1,983,065,423	1,929,742,177
資産合計	1,983,065,423	1,929,742,177
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,251,708	4,565,573
未払受託者報酬	570,880	525,025
未払委託者報酬	3,881,892	3,570,137
未払利息	15	10
その他未払費用	65	-
流動負債合計	7,704,560	8,660,745
負債合計	7,704,560	8,660,745
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	845,570,679	832,297,922
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,129,790,184	1,088,783,510
(分配準備積立金)	584,105,376	534,929,756
元本等合計	1,975,360,863	1,921,081,432
純資産合計	1,975,360,863	1,921,081,432
負債純資産合計	1,983,065,423	1,929,742,177

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日	第17期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
営業収益		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	7,269,428	22,071,811
営業収益合計	7,269,428	22,071,809
営業費用		
支払利息	1,564	1,301
受託者報酬	595,264	525,025
委託者報酬	4,047,702	3,570,137
その他費用	103	74
営業費用合計	4,644,633	4,096,537
営業利益又は営業損失（ ）	11,914,061	26,168,346
経常利益又は経常損失（ ）	11,914,061	26,168,346
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,914,061	26,168,346
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（ ）	3,542,265	3,983,333
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,365,193,278	1,129,790,184
剰余金増加額又は欠損金減少額	133,761,952	80,095,802
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	133,761,952	80,095,802
剰余金減少額又は欠損金増加額	119,391,094	98,917,463
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	119,391,094	98,917,463
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,371,192,340	1,088,783,510

## (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16期 (2018年12月10日現在)	第17期中間計算期間 (2019年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	845,570,679口	832,297,922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) 2.3361円 (23,361円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3082円 (23,082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17期中間計算期間 (2019年 6月10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17期中間計算期間 (2019年 6月10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16期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	第17期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	843,966,902円	845,570,679円
期中追加設定元本額	159,092,319円	61,092,833円
期中一部解約元本額	157,488,542円	74,365,590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 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,790,990,437
株式	214,938,460,270

	2019年 6月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	62,118,590
未収入金	3,776,648
未収配当金	1,841,083,772
差入委託証拠金	186,068,990
流動資産合計	220,822,498,707
資産合計	220,822,498,707
負債の部	
流動負債	
前受金	62,119,670
未払金	1,536,044,154
未払解約金	81,322,145
未払利息	7,877
流動負債合計	1,679,493,846
負債合計	1,679,493,846
純資産の部	
元本等	
元本	132,345,809,414
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,797,195,447
元本等合計	219,143,004,861
純資産合計	219,143,004,861
負債純資産合計	220,822,498,707

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2019年 6月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,345,809,414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 1.6558円 (1万口当たり純資産額) (16,558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 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	129,324,616,612円
期中追加設定元本額	8,777,543,170円
期中一部解約元本額	5,756,350,368円
期末元本額	132,345,809,414円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	766,845,043円
D C 日本株式インデックスファンド	337,939,625円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,033,556,114円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,159,641,024円
D C バランスファンド 3 0	2,256,907,136円
D C バランスファンド 5 0	3,320,276,534円
D C バランスファンド 7 0	1,722,156,510円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	626,461,411円
日本株式インデックス e	1,843,536,889円
インデックスコレクション（国内株式）	11,314,665,537円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	7,007,941,702円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,018,413,712円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,522,098,537円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,419,721,367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）	2,321,311,623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）	1,633,193,238円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	133,002,469円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,298,533,728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）	136,026,483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）	762,400,875円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	4,591,192円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	872,495,546円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,405,093,695円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	656,020,951円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	11,170,191,368円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	893,271,764円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	164,080,278円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,816,946,872円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	49,246,562円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	224,185,127円

区分	2019年 6月10日現在
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,789,637,661円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	86,740,581円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	86,289,562円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	15,142,406円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,307,642,385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）	28,628,062円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	471,607,880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）	130,051,529円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	65,481,974円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,933,163円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	189,394,040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）	4,216,943円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2019年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,110,070,330	-	4,172,190,000	62,119,670
合計		4,110,070,330	-	4,172,190,000	62,119,670

(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A】

## 【純資産額計算書】

(2019年 6月28日現在)

資産総額	1,927,254,170円
負債総額	489,670円
純資産総額（ - ）	1,926,764,500円
発行済口数	834,631,055口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3085円
（1万口当たり純資産額）	（23,085円）

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2019年 6月28日現在)

資産総額	222,481,225,722円
負債総額	2,458,896,012円
純資産総額（ - ）	220,022,329,710円
発行済口数	132,833,283,115口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6564円
（1万口当たり純資産額）	（16,564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 6月28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 9月10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6月28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	520	12,240,884
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	90	389,085
単位型公社債投資信託	1	10,065
合計	611	12,640,034

## 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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）を採用してはりましたが、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)	
		千円		千円
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 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (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2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

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 9月10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2月8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Aの2017年12月12日から2018年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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Aの2018年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 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8月9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Aの2018年12月11日から2019年6月10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Aの2019年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月11日から2019年6月10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。