

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年4月22日提出
【計算期間】	第18期(自 2019年1月23日至 2020年1月22日)
【ファンド名】	D C 日本株式インデックスファンド
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

ないファンドをいう。

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

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

<ファンドの特色>

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

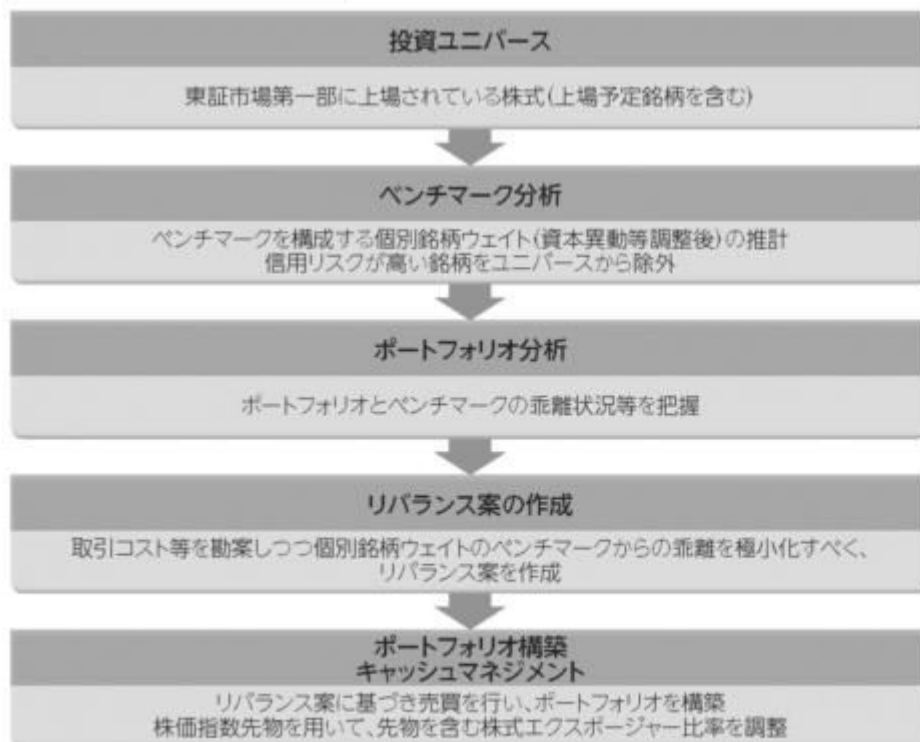
TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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

TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

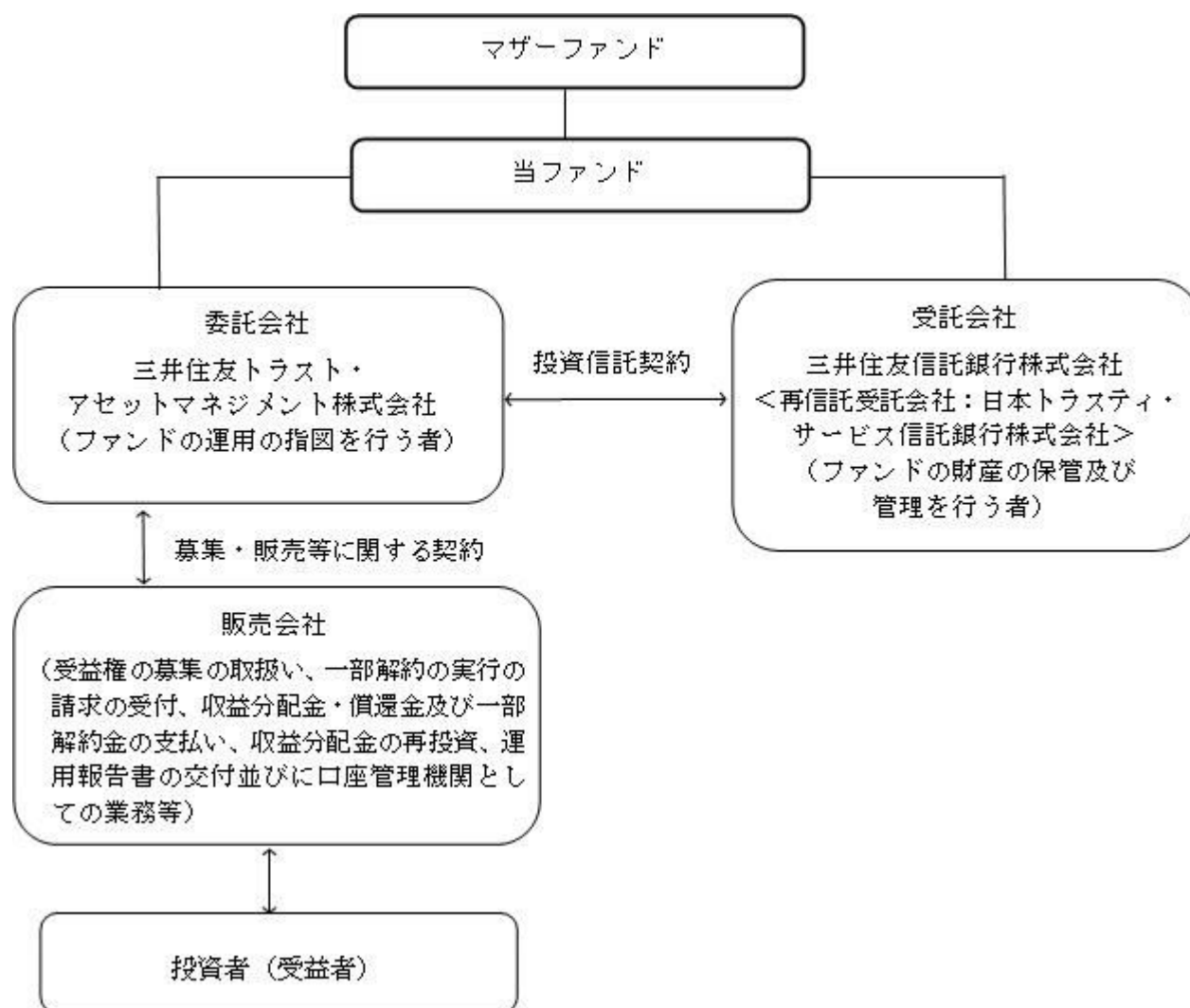
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

委託会社の概況（2020年 2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

八．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

B．次に掲げる特定資産以外の資産

1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

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

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

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

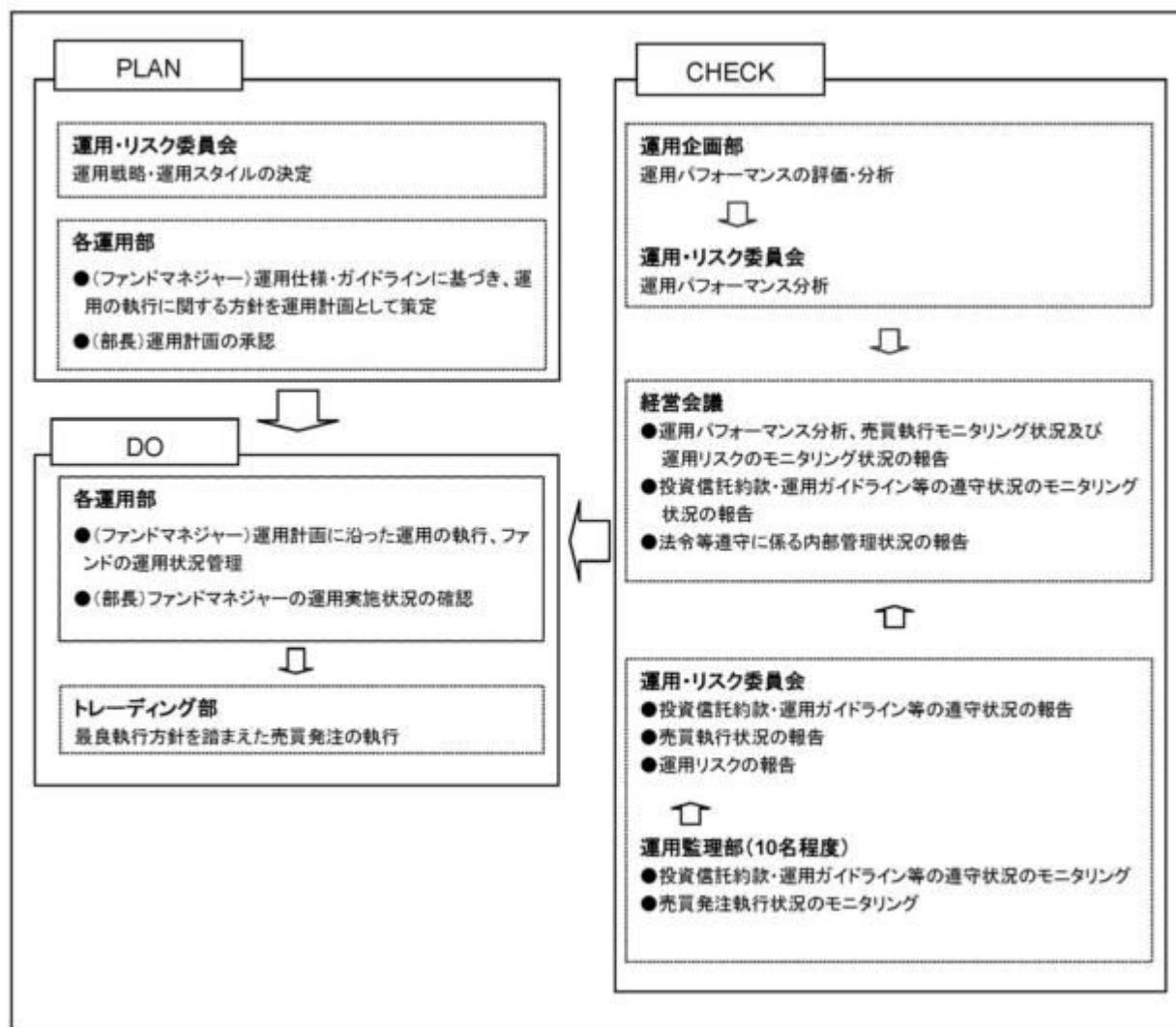
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付け

の一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

囲内とします。

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

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当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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

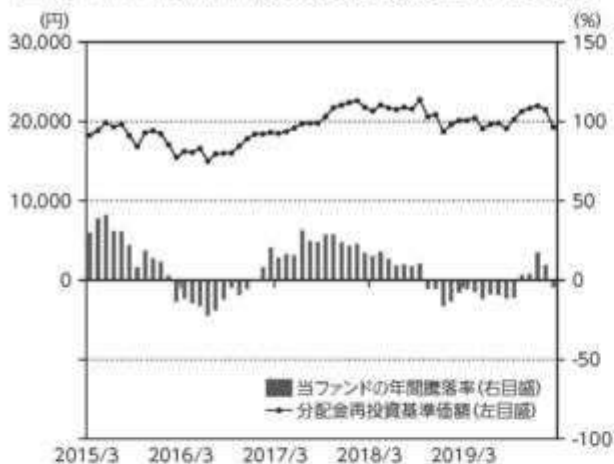
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

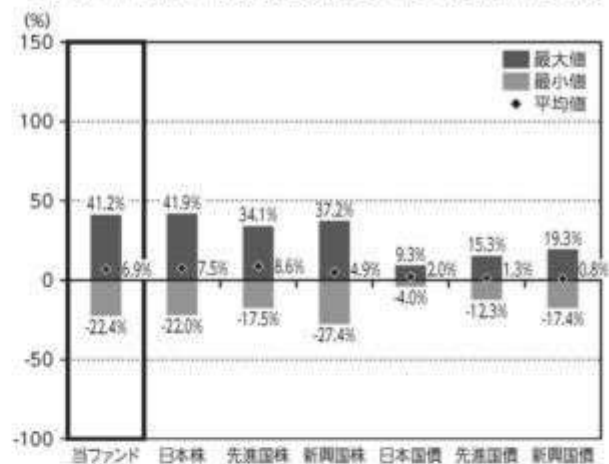
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2015年3月～2020年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年 2月28日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2020年2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】

（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	513,010,312	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		266,345	0.05
合計(純資産総額)		513,276,657	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	314,152,059	1.8829	591,516,912	1.6330	513,010,312	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9期計算期間末 (2011年 1月24日)	257,033,176	257,033,176	10,107	10,107
第10期計算期間末 (2012年 1月23日)	243,195,561	243,195,561	8,481	8,481
第11期計算期間末 (2013年 1月22日)	312,815,977	312,815,977	10,284	10,284
第12期計算期間末 (2014年 1月22日)	450,716,817	450,716,817	15,048	15,048
第13期計算期間末 (2015年 1月22日)	469,174,845	469,174,845	16,330	16,330
第14期計算期間末 (2016年 1月22日)	458,945,200	458,945,200	16,379	16,379
第15期計算期間末 (2017年 1月23日)	516,320,280	516,320,280	18,348	18,348
第16期計算期間末 (2018年 1月22日)	671,479,746	671,479,746	23,282	23,282
第17期計算期間末 (2019年 1月22日)	555,028,301	555,028,301	19,471	19,471
第18期計算期間末 (2020年 1月22日)	593,005,814	593,005,814	22,238	22,238
2019年 2月末日	572,392,819		20,109	
3月末日	577,425,775		20,117	
4月末日	579,701,872		20,442	
5月末日	546,802,549		19,102	
6月末日	561,910,513		19,615	

7月末日	566,302,478		19,784
8月末日	541,761,851		19,107
9月末日	574,080,213		20,250
10月末日	603,805,005		21,250
11月末日	612,129,523		21,655
12月末日	593,640,976		21,956
2020年 1月末日	575,486,053		21,475
2月末日	513,276,657		19,261

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	0
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	0
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	0
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	0
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	1.1
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	16.1
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	21.3
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	46.3
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.5
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.3
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	26.9
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	16.4
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	14.2

(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9期計算期間	2010年 1月23日～2011年 1月24日	69,510,842	42,163,700	254,313,726
第10期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	68,803,835	36,354,693	286,762,868
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	75,246,735	57,833,743	304,175,860
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	86,542,453	91,200,205	299,518,108
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	68,722,554	80,938,767	287,301,895
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	65,174,696	72,268,642	280,207,949
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	50,222,504	49,029,004	281,401,449
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	42,547,977	35,534,313	288,415,113
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	57,375,711	60,736,637	285,054,187
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	35,270,298	53,663,276	266,661,209

(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	224,669,514,570	98.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,731,368,780	1.20
合計(純資産総額)		227,400,883,350	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,399,200,000	1.06

(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	1,178,200	7,823.00	9,217,058,600	7,127.00	8,397,031,400	3.69
日本	株式	ソニー	電気機器	667,600	7,959.00	5,313,428,400	6,611.00	4,413,503,600	1.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	822,300	4,884.00	4,016,113,200	5,013.00	4,122,189,900	1.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,121,800	582.00	4,144,887,600	531.90	3,788,085,420	1.67
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,385,300	2,843.00	3,938,407,900	2,529.50	3,504,116,350	1.54
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	878,600	4,407.00	3,871,990,200	3,763.00	3,306,171,800	1.45
日本	株式	キーエンス	電気機器	95,700	39,830.00	3,811,731,000	34,410.00	3,293,037,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	722,900	4,353.00	3,146,783,700	3,758.00	2,716,658,200	1.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	720,300	3,957.00	2,850,227,100	3,484.00	2,509,525,200	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	772,300	3,281.00	2,533,916,300	3,058.00	2,361,693,400	1.04
日本	株式	任天堂	その他製品	64,800	43,320.00	2,807,136,000	36,270.00	2,350,296,000	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	831,500	3,030.00	2,519,445,000	2,799.50	2,327,784,250	1.02
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	765,500	3,110.00	2,380,705,000	2,927.50	2,241,001,250	0.99
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	372,500	6,126.00	2,281,935,000	5,801.00	2,160,872,500	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	177,600	12,760.00	2,266,176,000	12,145.00	2,156,952,000	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,153,100	166.30	2,353,660,530	147.60	2,088,997,560	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	210,900	11,065.00	2,333,608,500	9,609.00	2,026,538,100	0.89
日本	株式	第一三共	医薬品	302,200	7,480.00	2,260,456,000	6,590.00	1,991,498,000	0.88
日本	株式	花王	化学	252,900	9,194.00	2,325,162,600	7,868.00	1,989,817,200	0.88
日本	株式	ダイキン工業	機械	134,600	16,300.00	2,193,980,000	14,725.00	1,981,985,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	729,900	2,890.50	2,109,775,950	2,690.00	1,963,431,000	0.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	507,500	4,535.00	2,301,512,500	3,637.00	1,845,777,500	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	100,300	20,650.00	2,071,195,000	17,970.00	1,802,391,000	0.79
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	727,500	2,595.00	1,887,862,500	2,461.50	1,790,741,250	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	310,300	6,728.00	2,087,698,400	5,721.00	1,775,226,300	0.78
日本	株式	三井物産	卸売業	914,200	1,987.00	1,816,515,400	1,783.50	1,630,475,700	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	127,100	15,700.00	1,995,470,000	12,780.00	1,624,338,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	928,900	1,892.50	1,757,943,250	1,699.00	1,578,201,100	0.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	70,400	25,120.00	1,768,448,000	22,325.00	1,571,680,000	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,800	21,955.00	1,927,649,000	17,780.00	1,561,084,000	0.69

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.27

建設業	2.74	
食料品	3.77	
繊維製品	0.56	
パルプ・紙	0.24	
化学	7.09	
医薬品	6.05	
石油・石炭製品	0.49	
ゴム製品	0.66	
ガラス・土石製品	0.80	
鉄鋼	0.67	
非鉄金属	0.69	
金属製品	0.57	
機械	4.99	
電気機器	14.28	
輸送用機器	7.76	
精密機器	2.46	
その他製品	2.18	
電気・ガス業	1.52	
陸運業	4.05	
海運業	0.15	
空運業	0.45	
倉庫・運輸関連業	0.18	
情報・通信業	9.21	
卸売業	5.07	
小売業	4.42	
銀行業	5.68	
証券、商品先物取引業	0.80	
保険業	2.36	
その他金融業	1.22	
不動産業	2.38	
サービス業	4.96	
	小計	98.80
合計		98.80

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	160円		2,638,084,050	2,399,200,000	1.06

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

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

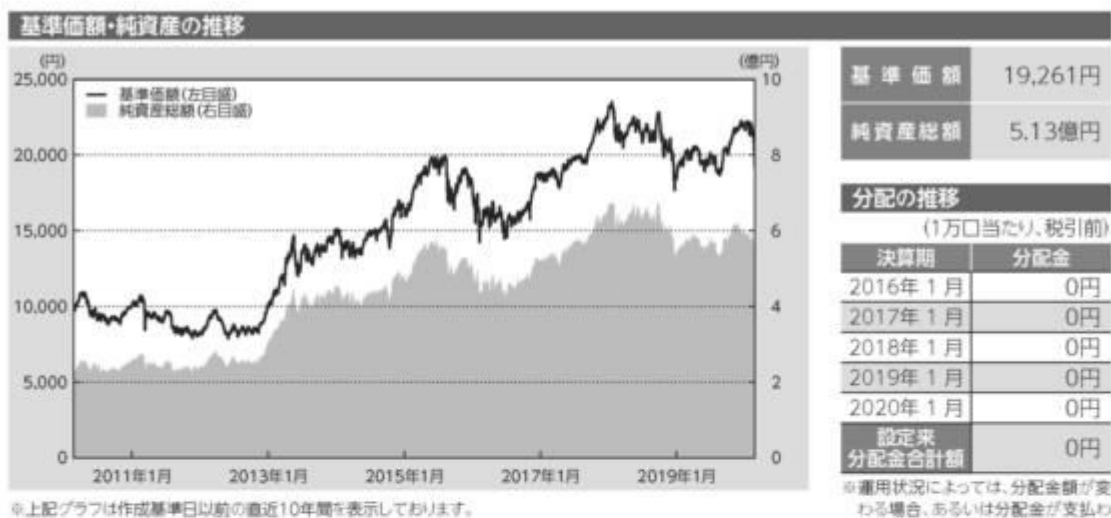
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年1月25日

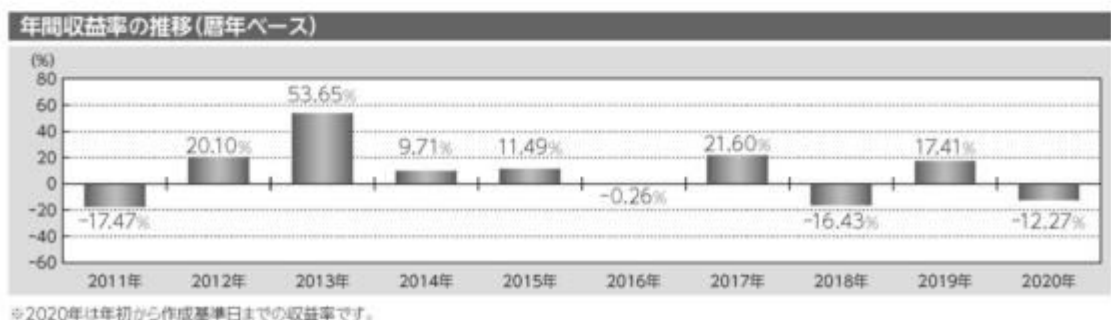
作成基準日：2020年2月28日



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	3.7%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.9%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.8%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.7%
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%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.2%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.1%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.0%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年 1月25日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2019年1月23日から2020年1月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2019年 1月22日現在)	第18期 (2020年 1月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	68,525	-
コール・ローン	2,002,495	2,305,709
親投資信託受益証券	554,749,015	592,710,869
未収入金	29,661	120,970
流動資産合計	556,849,696	595,137,548
資産合計	556,849,696	595,137,548
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	373,487
未払受託者報酬	231,817	223,786
未払委託者報酬	1,589,552	1,534,460
未払利息	5	1
その他未払費用	21	-
流動負債合計	1,821,395	2,131,734
負債合計	1,821,395	2,131,734
純資産の部		
元本等		
元本	285,054,187	266,661,209
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	269,974,114	326,344,605
(分配準備積立金)	213,348,026	188,924,722
元本等合計	555,028,301	593,005,814
純資産合計	555,028,301	593,005,814
負債純資産合計	556,849,696	595,137,548

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自 2018年 1月23日	至 2019年 1月22日	自 2019年 1月23日	至 2020年 1月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		106,875,046		80,365,012
営業収益合計		106,875,046		80,365,012
営業費用				
支払利息		1,000		623
受託者報酬		470,647		436,308
委託者報酬		3,227,184		2,991,694
その他費用		66		-
営業費用合計		3,698,897		3,428,625
営業利益又は営業損失（ ）		110,573,943		76,936,387
経常利益又は経常損失（ ）		110,573,943		76,936,387
当期純利益又は当期純損失（ ）		110,573,943		76,936,387
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（ ）		10,625,300		7,056,900
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		383,064,633		269,974,114
剰余金増加額又は欠損金減少額		66,331,732		37,412,228
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		66,331,732		37,412,228
剰余金減少額又は欠損金増加額		79,473,608		50,921,224
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		79,473,608		50,921,224
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		269,974,114		326,344,605

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2019年 1月22日現在)	第18期 (2020年 1月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	285,054,187口	266,661,209口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9471円 (19,471円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2238円 (22,238円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日	第18期 自 2019年 1月23日 至 2020年 1月22日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>9,509,866円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>347,858,286円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>203,838,160円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>561,206,312円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>285,054,187口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>19,687円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	9,509,866円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	347,858,286円	分配準備積立金額	D	203,838,160円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	561,206,312円	当ファンドの期末残存口数	F	285,054,187口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,687円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,742,502円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>349,127,990円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>176,182,220円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>538,052,712円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>266,661,209口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>20,177円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,742,502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	349,127,990円	分配準備積立金額	D	176,182,220円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	538,052,712円	当ファンドの期末残存口数	F	266,661,209口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,177円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	9,509,866円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	347,858,286円																																																											
分配準備積立金額	D	203,838,160円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	561,206,312円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	285,054,187口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	19,687円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	12,742,502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	349,127,990円																																																											
分配準備積立金額	D	176,182,220円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	538,052,712円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	266,661,209口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,177円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第18期 自 2019年 1月23日 至 2020年 1月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第18期 (2020年 1月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期	第18期
	自 2018年 1月23日 至 2019年 1月22日	自 2019年 1月23日 至 2020年 1月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	288,415,113円	285,054,187円
期中追加設定元本額	57,375,711円	35,270,298円
期中一部解約元本額	60,736,637円	53,663,276円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17期 (2019年 1月22日現在)	第18期 (2020年 1月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	96,183,461	74,030,597
合計	96,183,461	74,030,597

（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	314,535,592	592,710,869	
合計		314,535,592	592,710,869	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,108,815,996
株式	259,560,018,180
派生商品評価勘定	22,544,400
未収入金	730,452
未収配当金	366,912,985
差入委託証拠金	71,965,000
流動資産合計	262,130,987,013
資産合計	262,130,987,013
負債の部	
流動負債	
前受金	22,549,900
未払解約金	103,763,081
未払利息	1,159
流動負債合計	126,314,140
負債合計	126,314,140
純資産の部	
元本等	
元本	139,038,929,074
剰余金	
剰余金又は欠損金()	122,965,743,799
元本等合計	262,004,672,873
純資産合計	262,004,672,873
負債純資産合計	262,130,987,013

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	139,038,929,074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 1.8844円 (1万口当たり純資産額) (18,844円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年 1月22日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 1月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月23日
期首元本額	133,094,892,670円
期中追加設定元本額	21,401,829,541円
期中一部解約元本額	15,457,793,137円
期末元本額	139,038,929,074円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	713,472,830円
D C 日本株式インデックスファンド	314,535,592円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,501,755,266円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,134,183,890円
D C バランスファンド 3 0	2,233,557,595円
D C バランスファンド 5 0	3,381,253,327円
D C バランスファンド 7 0	1,785,396,005円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	601,480,840円
日本株式インデックス e	1,716,961,867円
インデックスコレクション（国内株式）	18,043,173,081円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	12,172,308,217円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,184,586,573円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,663,263,073円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,443,917,215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）	2,265,569,538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）	1,539,487,199円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	102,140,469円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	1,016,547,846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）	109,076,289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）	506,635,643円

区分	2020年 1月22日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,591,192円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	787,286,867円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,223,790,256円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	607,643,382円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	10,199,762,570円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	875,811,220円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	133,481,439円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,602,708,913円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	42,026,489円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	197,622,772円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,595,114,408円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	77,023,779円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	78,985,329円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	37,524,953円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	859,968,515円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	409,694,074円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,513,731,411円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	120,006,435円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	59,157,405円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,584,410円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	166,838,253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）	5,272,647円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		25,315,868,234
合計		25,315,868,234

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,315,750,100	-	2,338,300,000	22,549,900

合計	2,315,750,100	-	2,338,300,000	22,549,900
----	---------------	---	---------------	------------

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,000	2,936.00	14,680,000	
日本水産	143,400	619.00	88,764,600	
マルハニチロ	20,700	2,748.00	56,883,600	
カネコ種苗	4,300	1,404.00	6,037,200	
サカタのタネ	17,100	3,655.00	62,500,500	
ホクト	10,900	1,955.00	21,309,500	
ホクリヨウ	2,200	710.00	1,562,000	
住石ホールディングス	29,000	144.00	4,176,000	
日鉄鉱業	3,300	5,000.00	16,500,000	
三井松島ホールディングス	5,600	1,223.00	6,848,800	
国際石油開発帝石	575,300	1,103.50	634,843,550	
石油資源開発	18,700	2,958.00	55,314,600	
K & O エナジーグループ	7,000	1,576.00	11,032,000	
ヒノキヤグループ	3,600	2,110.00	7,596,000	
ショーボンドホールディングス	20,500	4,705.00	96,452,500	
ミライト・ホールディングス	42,600	1,740.00	74,124,000	
タマホーム	6,800	1,414.00	9,615,200	
サンヨーホームズ	1,200	719.00	862,800	
日本アクア	5,700	625.00	3,562,500	
ファーストコーポレーション	4,400	601.00	2,644,400	
ベステラ	2,500	1,277.00	3,192,500	
T A T E R U	29,600	219.00	6,482,400	
スペースバリューホールディングス	17,500	586.00	10,255,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,224.00	3,427,200	
第一カッター興業	1,800	1,850.00	3,330,000	
明豊ファシリティワークス	3,500	813.00	2,845,500	
安藤・間	85,400	976.00	83,350,400	
東急建設	42,000	815.00	34,230,000	

コムシスホールディングス	50,900	3,275.00	166,697,500
ピーアールホールディングス	15,600	495.00	7,722,000
高松コンストラクショングループ	8,900	2,796.00	24,884,400
東建コーポレーション	4,400	7,720.00	33,968,000
ソネック	1,500	812.00	1,218,000
ヤマウラ	6,200	938.00	5,815,600
大成建設	110,400	4,635.00	511,704,000
大林組	331,200	1,246.00	412,675,200
清水建設	336,100	1,157.00	388,867,700
飛鳥建設	9,500	1,488.00	14,136,000
長谷工コーポレーション	128,200	1,548.00	198,453,600
松井建設	13,000	797.00	10,361,000
銭高組	1,400	4,055.00	5,677,000
鹿島建設	260,000	1,454.00	378,040,000
不動テトラ	8,700	1,780.00	15,486,000
大末建設	3,800	1,005.00	3,819,000
鉄建建設	7,200	2,887.00	20,786,400
西松建設	25,500	2,517.00	64,183,500
三井住友建設	80,000	649.00	51,920,000
大豊建設	7,400	2,841.00	21,023,400
前田建設工業	82,900	1,187.00	98,402,300
佐田建設	7,100	480.00	3,408,000
ナカノフドー建設	9,000	493.00	4,437,000
奥村組	18,000	3,070.00	55,260,000
東鉄工業	14,200	3,230.00	45,866,000
イチケン	2,400	1,828.00	4,387,200
富士ピー・エス	4,900	589.00	2,886,100
浅沼組	3,700	4,925.00	18,222,500
戸田建設	137,500	742.00	102,025,000
熊谷組	15,300	3,360.00	51,408,000
北野建設	2,000	2,618.00	5,236,000
植木組	1,500	2,527.00	3,790,500
矢作建設工業	14,600	856.00	12,497,600
ピーエス三菱	10,900	742.00	8,087,800
日本ハウスホールディングス	22,600	500.00	11,300,000
大東建託	39,700	13,215.00	524,635,500
新日本建設	14,100	916.00	12,915,600
N I P P O	27,400	2,775.00	76,035,000
東亜道路工業	2,100	3,615.00	7,591,500
前田道路	35,100	3,720.00	130,572,000
日本道路	3,200	7,460.00	23,872,000
東亜建設工業	10,300	1,701.00	17,520,300

日本国土開発	19,300	638.00	12,313,400
若築建設	6,000	1,744.00	10,464,000
東洋建設	37,100	597.00	22,148,700
五洋建設	131,300	687.00	90,203,100
世紀東急工業	15,900	1,003.00	15,947,700
福田組	3,800	4,970.00	18,886,000
住友林業	83,900	1,633.00	137,008,700
日本基礎技術	11,100	413.00	4,584,300
巴コーポレーション	14,700	473.00	6,953,100
大和ハウス工業	327,700	3,559.00	1,166,284,300
ライト工業	19,000	1,617.00	30,723,000
積水ハウス	362,300	2,467.50	893,975,250
日特建設	8,600	898.00	7,722,800
北陸電気工事	5,700	1,214.00	6,919,800
ユアテック	18,900	708.00	13,381,200
四電工	1,800	2,930.00	5,274,000
中電工	13,300	2,515.00	33,449,500
関電工	47,100	1,051.00	49,502,100
きんでん	78,700	1,711.00	134,655,700
東京エネシス	11,000	901.00	9,911,000
トーエネック	3,300	3,895.00	12,853,500
住友電設	9,300	2,875.00	26,737,500
日本電設工業	18,200	2,255.00	41,041,000
協和エクシオ	50,200	2,852.00	143,170,400
新日本空調	8,800	2,176.00	19,148,800
九電工	23,200	3,340.00	77,488,000
三機工業	23,900	1,554.00	37,140,600
日揮ホールディングス	101,900	1,675.00	170,682,500
中外炉工業	3,600	1,816.00	6,537,600
ヤマト	10,600	834.00	8,840,400
太平電業	8,000	2,443.00	19,544,000
高砂熱学工業	28,800	1,965.00	56,592,000
三晃金属工業	1,400	2,689.00	3,764,600
朝日工業社	2,200	3,525.00	7,755,000
明星工業	21,400	930.00	19,902,000
大気社	16,100	3,835.00	61,743,500
ダイダン	7,900	2,713.00	21,432,700
日比谷総合設備	10,700	1,956.00	20,929,200
OSJBホールディングス	52,200	275.00	14,355,000
東洋エンジニアリング	13,900	627.00	8,715,300
レイズネクスト	17,800	1,375.00	24,475,000
日本製粉	31,000	1,699.00	52,669,000

日清製粉グループ本社	119,700	1,863.00	223,001,100
日東富士製粉	800	6,290.00	5,032,000
昭和産業	9,700	3,070.00	29,779,000
鳥越製粉	9,400	866.00	8,140,400
中部飼料	12,900	1,677.00	21,633,300
フィード・ワン	71,200	184.00	13,100,800
東洋精糖	1,800	1,216.00	2,188,800
日本甜菜製糖	5,500	1,973.00	10,851,500
三井製糖	9,300	2,214.00	20,590,200
塩水港精糖	11,500	227.00	2,610,500
日新製糖	5,000	2,011.00	10,055,000
森永製菓	24,900	5,380.00	133,962,000
中村屋	2,700	4,275.00	11,542,500
江崎グリコ	31,400	4,840.00	151,976,000
名糖産業	5,100	1,398.00	7,129,800
井村屋グループ	4,500	1,918.00	8,631,000
不二家	5,900	2,149.00	12,679,100
山崎製パン	79,400	2,022.00	160,546,800
第一屋製パン	1,800	948.00	1,706,400
モロゾフ	1,800	5,210.00	9,378,000
亀田製菓	6,000	4,975.00	29,850,000
寿スピリッツ	10,200	8,490.00	86,598,000
カルビー	48,300	3,700.00	178,710,000
森永乳業	19,600	4,360.00	85,456,000
六甲バター	7,000	1,704.00	11,928,000
ヤクルト本社	72,900	5,990.00	436,671,000
明治ホールディングス	70,100	7,680.00	538,368,000
雪印メグミルク	25,500	2,538.00	64,719,000
プリマハム	16,600	2,509.00	41,649,400
日本ハム	40,500	4,795.00	194,197,500
林兼産業	3,500	692.00	2,422,000
丸大食品	11,300	2,173.00	24,554,900
S Foods	8,500	2,903.00	24,675,500
柿安本店	3,700	3,355.00	12,413,500
伊藤ハム米久ホールディングス	68,200	724.00	49,376,800
サッポロホールディングス	36,200	2,684.00	97,160,800
アサヒグループホールディングス	222,000	5,108.00	1,133,976,000
キリンホールディングス	449,500	2,457.50	1,104,646,250
宝ホールディングス	79,400	1,000.00	79,400,000
オエノンホールディングス	28,000	401.00	11,228,000
養命酒製造	3,200	1,988.00	6,361,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,400	2,796.00	208,022,400

サントリー食品インターナショナル	70,900	4,690.00	332,521,000
ダイドーグループホールディングス	5,400	4,475.00	24,165,000
伊藤園	32,200	5,370.00	172,914,000
キーコーヒー	10,400	2,312.00	24,044,800
ユニカフェ	2,700	973.00	2,627,100
ジャパンフーズ	1,500	1,300.00	1,950,000
日清オイリオグループ	13,600	3,810.00	51,816,000
不二製油グループ本社	25,800	2,950.00	76,110,000
かどや製油	1,200	3,845.00	4,614,000
J・オイルミルズ	5,500	4,215.00	23,182,500
キッコーマン	76,300	5,390.00	411,257,000
味の素	234,100	1,820.00	426,062,000
キューピー	59,000	2,388.00	140,892,000
ハウス食品グループ本社	39,600	3,715.00	147,114,000
カゴメ	40,200	2,607.00	104,801,400
焼津水産化学工業	5,100	1,036.00	5,283,600
アリアケジャパン	9,700	7,810.00	75,757,000
ピエトロ	1,400	1,638.00	2,293,200
エバラ食品工業	2,600	2,213.00	5,753,800
やまみ	500	2,431.00	1,215,500
ニチレイ	50,500	2,600.00	131,300,000
東洋水産	54,500	4,590.00	250,155,000
イトアンド	3,700	1,943.00	7,189,100
大冷	1,400	1,969.00	2,756,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,106.00	6,414,800
日清食品ホールディングス	45,100	8,380.00	377,938,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,182.00	11,346,400
一正蒲鉾	4,100	1,001.00	4,104,100
フジッコ	11,500	1,973.00	22,689,500
ロック・フィールド	11,400	1,554.00	17,715,600
日本たばこ産業	612,000	2,382.50	1,458,090,000
ケンコーマヨネーズ	5,900	2,531.00	14,932,900
わらべや日洋ホールディングス	6,900	1,876.00	12,944,400
なとり	5,900	1,726.00	10,183,400
イフジ産業	1,800	756.00	1,360,800
ピククルスコーポレーション	2,300	2,609.00	6,000,700
北の達人コーポレーション	37,000	662.00	24,494,000
ユーグレナ	45,200	771.00	34,849,200
ミヨシ油脂	4,100	1,198.00	4,911,800
理研ビタミン	5,000	4,075.00	20,375,000
片倉工業	15,300	1,298.00	19,859,400
ゲンゼ	7,700	4,760.00	36,652,000

東洋紡	41,100	1,578.00	64,855,800
ユニチカ	31,300	360.00	11,268,000
富士紡ホールディングス	5,100	3,705.00	18,895,500
倉敷紡績	10,800	2,410.00	26,028,000
シキボウ	5,400	1,325.00	7,155,000
日本毛織	34,300	1,111.00	38,107,300
トーア紡コーポレーション	4,100	520.00	2,132,000
帝国繊維	11,800	2,468.00	29,122,400
帝人	84,600	2,064.00	174,614,400
東レ	749,400	762.20	571,192,680
サカイオーベックス	2,900	1,905.00	5,524,500
住江織物	3,000	2,518.00	7,554,000
日本フェルト	6,600	499.00	3,293,400
イチカワ	1,700	1,462.00	2,485,400
日東製網	1,200	1,765.00	2,118,000
アツギ	8,600	854.00	7,344,400
ダイニック	3,900	847.00	3,303,300
セーレン	25,700	1,504.00	38,652,800
ソトー	4,200	974.00	4,090,800
東海染工	1,500	1,134.00	1,701,000
小松マテーレ	17,100	789.00	13,491,900
ワコールホールディングス	27,000	3,005.00	81,135,000
ホギメディカル	11,800	3,540.00	41,772,000
レナウン	26,600	112.00	2,979,200
クラウディアホールディングス	2,700	482.00	1,301,400
T S Iホールディングス	34,800	550.00	19,140,000
マツオカコーポレーション	3,000	2,160.00	6,480,000
ワールド	14,700	2,616.00	38,455,200
三陽商会	5,400	1,323.00	7,144,200
ナイガイ	4,000	455.00	1,820,000
オンワードホールディングス	62,300	652.00	40,619,600
ルックホールディングス	3,600	1,150.00	4,140,000
ゴールドウイン	18,800	7,200.00	135,360,000
デサント	20,200	1,966.00	39,713,200
キング	5,000	565.00	2,825,000
ヤマトインターナショナル	6,500	406.00	2,639,000
特種東海製紙	6,600	4,025.00	26,565,000
王子ホールディングス	432,400	593.00	256,413,200
日本製紙	45,700	1,855.00	84,773,500
三菱製紙	11,700	475.00	5,557,500
北越コーポレーション	68,600	551.00	37,798,600
中越パルプ工業	4,400	1,639.00	7,211,600

巴川製紙所	3,100	882.00	2,734,200
大王製紙	45,400	1,495.00	67,873,000
阿波製紙	2,700	529.00	1,428,300
レンゴー	97,800	831.00	81,271,800
トーモク	6,300	1,821.00	11,472,300
ザ・パック	7,800	4,010.00	31,278,000
クラレ	162,900	1,358.00	221,218,200
旭化成	685,500	1,184.50	811,974,750
共和レザー	5,600	808.00	4,524,800
昭和電工	73,600	2,778.00	204,460,800
住友化学	759,900	485.00	368,551,500
住友精化	4,600	3,335.00	15,341,000
日産化学	57,800	4,725.00	273,105,000
ラサ工業	3,600	1,599.00	5,756,400
クレハ	8,900	6,620.00	58,918,000
多木化学	3,000	4,495.00	13,485,000
テイカ	7,600	1,971.00	14,979,600
石原産業	18,500	1,036.00	19,166,000
片倉コープアグリ	2,700	1,224.00	3,304,800
日本曹達	15,300	3,150.00	48,195,000
東ソー	159,900	1,696.00	271,190,400
トクヤマ	29,800	2,840.00	84,632,000
セントラル硝子	21,100	2,538.00	53,551,800
東亜合成	64,900	1,252.00	81,254,800
大阪ソーダ	10,500	3,015.00	31,657,500
関東電化工業	24,500	1,024.00	25,088,000
デンカ	37,700	3,160.00	119,132,000
信越化学工業	177,600	12,760.00	2,266,176,000
日本カーバイド工業	3,500	1,450.00	5,075,000
堺化学工業	6,700	2,390.00	16,013,000
第一稀元素化学工業	11,200	969.00	10,852,800
エア・ウォーター	96,200	1,600.00	153,920,000
大陽日酸	99,400	2,494.00	247,903,600
日本化学工業	3,200	3,365.00	10,768,000
東邦アセチレン	1,600	1,373.00	2,196,800
日本パーカラライジング	52,200	1,210.00	63,162,000
高压ガス工業	16,400	852.00	13,972,800
チタン工業	1,300	2,596.00	3,374,800
四国化成工業	15,900	1,322.00	21,019,800
戸田工業	2,400	2,164.00	5,193,600
ステラ ケミファ	5,600	3,115.00	17,444,000
保土谷化学工業	3,900	4,070.00	15,873,000

日本触媒	16,100	6,680.00	107,548,000
大日精化工業	9,200	3,080.00	28,336,000
カネカ	26,800	3,550.00	95,140,000
三菱瓦斯化学	97,600	1,755.00	171,288,000
三井化学	93,900	2,590.00	243,201,000
J S R	96,400	2,048.00	197,427,200
東京応化工業	17,700	4,775.00	84,517,500
大阪有機化学工業	9,600	1,926.00	18,489,600
三菱ケミカルホールディングス	691,400	819.00	566,256,600
K Hネオケム	18,200	2,326.00	42,333,200
ダイセル	141,500	1,075.00	152,112,500
住友ベークライト	16,300	4,205.00	68,541,500
積水化学工業	222,400	1,956.00	435,014,400
日本ゼオン	93,300	1,340.00	125,022,000
アイカ工業	31,000	3,590.00	111,290,000
宇部興産	52,200	2,355.00	122,931,000
積水樹脂	18,600	2,327.00	43,282,200
タキロンシーアイ	22,400	718.00	16,083,200
旭有機材	5,800	1,782.00	10,335,600
日立化成	43,700	4,590.00	200,583,000
ニチバン	5,400	1,804.00	9,741,600
リケンテクノス	26,000	520.00	13,520,000
大倉工業	4,900	1,899.00	9,305,100
積水化成品工業	13,900	804.00	11,175,600
群栄化学工業	2,400	2,615.00	6,276,000
タイガースポリマー	5,400	615.00	3,321,000
ミライアル	3,600	1,369.00	4,928,400
ダイキアクシス	3,700	921.00	3,407,700
ダイキョーニシカワ	21,800	832.00	18,137,600
竹本容器	3,700	954.00	3,529,800
森六ホールディングス	5,600	2,317.00	12,975,200
日本化薬	64,000	1,341.00	85,824,000
カーリットホールディングス	11,000	614.00	6,754,000
日本精化	8,300	1,278.00	10,607,400
扶桑化学工業	10,500	3,360.00	35,280,000
トリケミカル研究所	2,300	10,480.00	24,104,000
A D E K A	47,600	1,633.00	77,730,800
日油	38,900	3,535.00	137,511,500
新日本理化	17,100	208.00	3,556,800
ハリマ化成グループ	8,600	1,185.00	10,191,000
花王	252,900	9,194.00	2,325,162,600
第一工業製薬	3,900	4,550.00	17,745,000

石原ケミカル	2,800	2,054.00	5,751,200
日華化学	3,500	941.00	3,293,500
ニイタカ	1,600	2,222.00	3,555,200
三洋化成工業	6,200	5,340.00	33,108,000
有機合成薬品工業	7,900	292.00	2,306,800
大日本塗料	11,700	1,216.00	14,227,200
日本ペイントホールディングス	85,400	5,600.00	478,240,000
関西ペイント	116,200	2,714.00	315,366,800
神東塗料	8,100	223.00	1,806,300
中国塗料	29,400	1,067.00	31,369,800
日本特殊塗料	7,700	1,399.00	10,772,300
藤倉化成	13,900	579.00	8,048,100
太陽ホールディングス	7,600	4,620.00	35,112,000
D I C	43,700	3,040.00	132,848,000
サカタインクス	22,600	1,181.00	26,690,600
東洋インキＳＣホールディングス	21,900	2,621.00	57,399,900
T & K T O K A	8,000	1,045.00	8,360,000
富士フィルムホールディングス	202,500	5,721.00	1,158,502,500
資生堂	209,800	7,574.00	1,589,025,200
ライオン	137,300	2,058.00	282,563,400
高砂香料工業	6,600	2,496.00	16,473,600
マンダム	23,700	2,991.00	70,886,700
ミルボン	14,100	6,390.00	90,099,000
ファンケル	42,700	3,020.00	128,954,000
コーセー	19,900	16,760.00	333,524,000
コタ	5,500	1,603.00	8,816,500
シーボン	1,400	2,514.00	3,519,600
ポーラ・オルビスホールディングス	45,100	2,556.00	115,275,600
ノエビアホールディングス	10,100	5,710.00	57,671,000
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,001.00	2,402,400
エステー	6,800	1,689.00	11,485,200
アグロ カネショウ	3,300	1,515.00	4,999,500
コニシ	17,400	1,583.00	27,544,200
長谷川香料	14,000	2,209.00	30,926,000
星光P M C	6,000	975.00	5,850,000
小林製薬	29,600	9,230.00	273,208,000
荒川化学工業	9,500	1,604.00	15,238,000
メック	7,200	1,522.00	10,958,400
日本高純度化学	2,900	2,651.00	7,687,900
タカラバイオ	27,600	2,121.00	58,539,600
J C U	12,800	3,460.00	44,288,000
新田ゼラチン	6,600	669.00	4,415,400

O A Tアグリオ	1,800	1,515.00	2,727,000
デクセリアルズ	27,200	1,065.00	28,968,000
アース製薬	8,000	5,740.00	45,920,000
北興化学工業	10,800	663.00	7,160,400
大成ラミック	3,500	2,891.00	10,118,500
クミアイ化学工業	43,700	953.00	41,646,100
日本農薬	18,800	596.00	11,204,800
アキレス	7,300	1,849.00	13,497,700
有沢製作所	16,700	1,109.00	18,520,300
日東電工	72,900	6,360.00	463,644,000
レック	11,300	1,235.00	13,955,500
三光合成	12,100	381.00	4,610,100
きもと	18,000	186.00	3,348,000
藤森工業	9,500	3,545.00	33,677,500
前澤化成工業	6,700	1,207.00	8,086,900
未来工業	5,700	2,192.00	12,494,400
ウェーブロックホールディングス	3,600	827.00	2,977,200
J S P	6,200	1,968.00	12,201,600
エフピコ	11,600	6,520.00	75,632,000
天馬	7,000	2,021.00	14,147,000
信越ポリマー	19,000	1,074.00	20,406,000
東リ	26,300	301.00	7,916,300
ニフコ	38,800	2,944.00	114,227,200
バルカー	8,600	2,632.00	22,635,200
ユニ・チャーム	203,600	3,658.00	744,768,800
ショーエイコーポレーション	1,200	808.00	969,600
協和キリン	106,200	2,652.00	281,642,400
武田薬品工業	878,600	4,407.00	3,871,990,200
アステラス製薬	928,900	1,892.50	1,757,943,250
大日本住友製薬	78,300	2,152.00	168,501,600
塩野義製薬	135,000	6,857.00	925,695,000
わかもと製薬	12,600	263.00	3,313,800
あすか製薬	12,000	1,240.00	14,880,000
日本新薬	27,600	10,290.00	284,004,000
バイオフェルミン製薬	1,800	2,376.00	4,276,800
中外製薬	110,100	10,625.00	1,169,812,500
科研製薬	18,100	6,100.00	110,410,000
エーザイ	126,400	8,341.00	1,054,302,400
ロート製薬	54,200	3,385.00	183,467,000
小野薬品工業	242,500	2,621.50	635,713,750
久光製薬	27,900	5,980.00	166,842,000
持田製薬	14,700	4,420.00	64,974,000

参天製薬	196,700	2,148.00	422,511,600
扶桑薬品工業	3,700	2,003.00	7,411,100
日本ケミファ	1,400	3,035.00	4,249,000
ツムラ	32,700	3,160.00	103,332,000
日医工	29,900	1,331.00	39,796,900
キッセイ薬品工業	18,700	3,130.00	58,531,000
生化学工業	20,500	1,237.00	25,358,500
栄研化学	18,600	2,304.00	42,854,400
日水製薬	4,400	1,339.00	5,891,600
鳥居薬品	6,600	3,650.00	24,090,000
JCRファーマ	7,400	9,390.00	69,486,000
東和薬品	13,500	2,800.00	37,800,000
富士製薬工業	7,200	1,420.00	10,224,000
沢井製薬	21,700	7,370.00	159,929,000
ゼリア新薬工業	19,200	2,082.00	39,974,400
第一三共	302,200	7,480.00	2,260,456,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,300	1,951.00	45,458,300
大幸薬品	4,300	3,950.00	16,985,000
ダイト	6,200	3,550.00	22,010,000
大塚ホールディングス	201,200	4,944.00	994,732,800
大正製薬ホールディングス	22,300	8,170.00	182,191,000
ペプチドリーム	53,400	5,580.00	297,972,000
日本コークス工業	89,200	79.00	7,046,800
ニチレキ	12,500	1,349.00	16,862,500
ユシロ化学工業	5,900	1,420.00	8,378,000
ビーピー・カストロール	3,800	1,486.00	5,646,800
富士石油	28,200	235.00	6,627,000
MORESCO	3,800	1,437.00	5,460,600
出光興産	118,800	2,950.00	350,460,000
JXTGホールディングス	1,588,700	492.10	781,799,270
コスモエネルギーホールディングス	30,600	2,348.00	71,848,800
横浜ゴム	61,100	2,014.00	123,055,400
TOYO TIRE	60,600	1,467.00	88,900,200
ブリヂストン	324,600	3,984.00	1,293,206,400
住友ゴム工業	94,900	1,269.00	120,428,100
藤倉コンポジット	9,200	467.00	4,296,400
オカモト	6,400	4,040.00	25,856,000
フコク	4,600	734.00	3,376,400
ニッタ	11,900	3,155.00	37,544,500
住友理工	20,500	928.00	19,024,000
三ツ星ベルト	13,900	2,059.00	28,620,100
バンドー化学	18,600	898.00	16,702,800

日東紡績	15,700	5,020.00	78,814,000
A G C	104,400	4,015.00	419,166,000
日本板硝子	50,500	692.00	34,946,000
石塚硝子	1,900	2,571.00	4,884,900
日本山村硝子	4,400	1,289.00	5,671,600
日本電気硝子	42,400	2,342.00	99,300,800
オハラ	4,200	1,402.00	5,888,400
住友大阪セメント	20,000	4,725.00	94,500,000
太平洋セメント	66,700	3,160.00	210,772,000
日本ヒューム	10,600	849.00	8,999,400
日本コンクリート工業	22,800	291.00	6,634,800
三谷セキサン	4,900	3,810.00	18,669,000
アジアパイルホールディングス	15,000	586.00	8,790,000
東海カーボン	110,700	1,018.00	112,692,600
日本カーボン	5,400	3,960.00	21,384,000
東洋炭素	6,200	2,264.00	14,036,800
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,650.00	26,970,000
T O T O	75,400	4,855.00	366,067,000
日本碍子	128,900	1,959.00	252,515,100
日本特殊陶業	82,200	2,094.00	172,126,800
M A R U W A	4,100	8,660.00	35,506,000
品川リフラクトリーズ	2,800	3,355.00	9,394,000
黒崎播磨	2,100	6,630.00	13,923,000
ヨータイ	8,400	715.00	6,006,000
イソライト工業	5,500	639.00	3,514,500
東京窯業	13,500	339.00	4,576,500
ニッカトー	4,800	754.00	3,619,200
フジミインコーポレーテッド	9,400	3,215.00	30,221,000
クニミネ工業	4,300	1,366.00	5,873,800
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,622.00	2,919,600
ニチアス	28,900	2,838.00	82,018,200
ニチハ	14,700	2,593.00	38,117,100
日本製鉄	467,400	1,670.00	780,558,000
神戸製鋼所	191,200	568.00	108,601,600
中山製鋼所	14,600	526.00	7,679,600
合同製鐵	5,600	2,741.00	15,349,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	282,100	1,457.00	411,019,700
東京製鐵	50,900	824.00	41,941,600
共英製鋼	11,800	2,091.00	24,673,800
大和工業	22,200	2,723.00	60,450,600
東京鐵鋼	4,300	1,509.00	6,488,700
大阪製鐵	5,600	1,595.00	8,932,000

淀川製鋼所	14,100	2,038.00	28,735,800
丸一鋼管	33,900	3,145.00	106,615,500
モリ工業	3,100	2,600.00	8,060,000
大同特殊鋼	17,100	4,660.00	79,686,000
日本高周波鋼業	4,000	431.00	1,724,000
日本冶金工業	8,700	2,295.00	19,966,500
山陽特殊製鋼	7,600	1,617.00	12,289,200
愛知製鋼	5,900	3,715.00	21,918,500
日立金属	112,500	1,744.00	196,200,000
日本金属	2,400	910.00	2,184,000
大太平洋金属	7,100	2,437.00	17,302,700
新日本電工	67,500	167.00	11,272,500
栗本鐵工所	5,200	2,162.00	11,242,400
虹技	1,600	1,438.00	2,300,800
三菱製鋼	7,800	1,043.00	8,135,400
日亜鋼業	15,400	369.00	5,682,600
日本精線	1,700	3,770.00	6,409,000
エンビプロ・ホールディングス	4,000	834.00	3,336,000
シンニッタン	16,300	466.00	7,595,800
新家工業	2,400	1,467.00	3,520,800
大紀アルミニウム工業所	17,300	770.00	13,321,000
日本軽金属ホールディングス	264,700	222.00	58,763,400
三井金属鉱業	28,200	2,809.00	79,213,800
東邦亜鉛	5,400	2,062.00	11,134,800
三菱マテリアル	69,000	2,929.00	202,101,000
住友金属鉱山	133,500	3,415.00	455,902,500
D O W Aホールディングス	26,400	4,215.00	111,276,000
古河機械金属	18,600	1,426.00	26,523,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,900	1,498.00	16,328,200
東邦チタニウム	18,800	954.00	17,935,200
U A C J	15,900	2,325.00	36,967,500
C Kサンエツ	2,200	3,400.00	7,480,000
古河電気工業	32,500	2,770.00	90,025,000
住友電気工業	390,500	1,612.50	629,681,250
フジクラ	126,300	431.00	54,435,300
昭和電線ホールディングス	12,100	1,494.00	18,077,400
東京特殊電線	1,600	2,528.00	4,044,800
タツタ電線	20,900	629.00	13,146,100
カナレ電気	1,800	1,834.00	3,301,200
平河ヒューテック	4,000	1,639.00	6,556,000
リョービ	12,900	1,924.00	24,819,600
アーレスティ	13,900	556.00	7,728,400

アサヒホールディングス	18,300	2,809.00	51,404,700
稲葉製作所	5,900	1,403.00	8,277,700
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,023.00	6,473,600
トーカロ	29,000	1,163.00	33,727,000
アルファC o	3,700	1,371.00	5,072,700
SUMCO	125,000	1,897.00	237,125,000
川田テクノロジーズ	2,100	6,640.00	13,944,000
RS Technologies	2,900	3,320.00	9,628,000
信和	4,500	1,122.00	5,049,000
東洋製罐グループホールディングス	66,500	1,963.00	130,539,500
ホッカンホールディングス	5,700	2,040.00	11,628,000
コロナ	5,800	1,070.00	6,206,000
横河ブリッジホールディングス	19,400	1,950.00	37,830,000
駒井ハルテック	2,000	1,971.00	3,942,000
高田機工	1,000	2,704.00	2,704,000
三和ホールディングス	100,200	1,257.00	125,951,400
文化シャッター	30,800	923.00	28,428,400
三協立山	14,500	1,409.00	20,430,500
アルインコ	7,600	1,272.00	9,667,200
東洋シャッター	2,500	772.00	1,930,000
LIXILグループ	154,100	1,950.00	300,495,000
日本フィルコン	8,000	578.00	4,624,000
ノーリツ	21,700	1,454.00	31,551,800
長府製作所	10,600	2,408.00	25,524,800
リンナイ	20,300	8,430.00	171,129,000
ダイニチ工業	5,600	701.00	3,925,600
日東精工	14,400	634.00	9,129,600
三洋工業	1,400	1,997.00	2,795,800
岡部	21,200	906.00	19,207,200
ジーテクト	13,000	1,709.00	22,217,000
東プレ	19,500	1,741.00	33,949,500
高周波熱錬	20,100	913.00	18,351,300
東京製綱	7,500	1,183.00	8,872,500
サンコール	5,900	560.00	3,304,000
モリテック スチール	8,100	383.00	3,102,300
パイオラックス	15,400	2,137.00	32,909,800
エイチワン	10,200	786.00	8,017,200
日本発條	112,000	977.00	109,424,000
中央発條	1,300	3,035.00	3,945,500
アドバネクス	1,500	1,684.00	2,526,000
立川ブラインド工業	4,600	1,305.00	6,003,000
三益半導体工業	9,300	2,339.00	21,752,700

日本ドライケミカル	2,700	1,909.00	5,154,300
日本製鋼所	31,700	2,203.00	69,835,100
三浦工業	45,200	3,930.00	177,636,000
タクマ	35,500	1,248.00	44,304,000
ツガミ	21,700	1,218.00	26,430,600
オークマ	12,200	5,510.00	67,222,000
東芝機械	11,800	3,385.00	39,943,000
アマダホールディングス	132,900	1,264.00	167,985,600
アイダエンジニアリング	27,400	947.00	25,947,800
滝澤鉄工所	3,300	1,398.00	4,613,400
F U J I	45,000	1,966.00	88,470,000
牧野フライス製作所	12,300	4,800.00	59,040,000
オーエスジー	48,300	2,037.00	98,387,100
ダイジェット工業	1,300	1,480.00	1,924,000
旭ダイヤモンド工業	27,600	645.00	17,802,000
D M G 森精機	66,100	1,744.00	115,278,400
ソディック	24,700	959.00	23,687,300
ディスコ	14,100	26,700.00	376,470,000
日東工器	5,800	2,355.00	13,659,000
日進工具	3,100	3,020.00	9,362,000
パンチ工業	9,700	522.00	5,063,400
富士ダイス	4,800	794.00	3,811,200
豊和工業	5,900	877.00	5,174,300
O K K	4,400	648.00	2,851,200
東洋機械金属	7,700	572.00	4,404,400
津田駒工業	2,100	1,184.00	2,486,400
エンシュウ	2,600	1,332.00	3,463,200
島精機製作所	16,800	2,389.00	40,135,200
オプトラン	11,700	3,520.00	41,184,000
N C ホールディングス	3,400	667.00	2,267,800
イワキポンプ	5,100	1,262.00	6,436,200
フリー	10,300	1,214.00	12,504,200
ヤマシンフィルタ	22,800	815.00	18,582,000
日阪製作所	13,000	967.00	12,571,000
やまびこ	20,400	1,148.00	23,419,200
平田機工	5,000	7,100.00	35,500,000
ペガサスミシン製造	10,900	505.00	5,504,500
マルマエ	4,400	945.00	4,158,000
タツモ	5,000	1,469.00	7,345,000
ナプテスコ	61,600	3,470.00	213,752,000
三井海洋開発	11,100	2,656.00	29,481,600
レオン自動機	10,300	1,552.00	15,985,600

S M C	33,100	52,810.00	1,748,011,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	557.00	5,180,100
ホソカワミクロン	3,700	4,950.00	18,315,000
ユニオンツール	3,900	3,295.00	12,850,500
オイレス工業	13,600	1,637.00	22,263,200
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,350.00	15,660,000
サトーホールディングス	14,900	3,290.00	49,021,000
技研製作所	9,200	4,730.00	43,516,000
日本エアージェット	3,500	1,003.00	3,510,500
カワタ	3,200	1,078.00	3,449,600
日精樹脂工業	8,900	1,008.00	8,971,200
オカダアイオン	3,400	1,284.00	4,365,600
ワイエイシイホールディングス	4,500	725.00	3,262,500
小松製作所	478,400	2,644.00	1,264,889,600
住友重機械工業	60,500	3,155.00	190,877,500
日立建機	42,400	3,315.00	140,556,000
日工	14,600	836.00	12,205,600
巴工業	4,600	2,249.00	10,345,400
井関農機	10,600	1,573.00	16,673,800
T O W A	10,800	1,167.00	12,603,600
丸山製作所	2,400	1,197.00	2,872,800
北川鉄工所	4,800	2,412.00	11,577,600
ローツェ	4,700	4,630.00	21,761,000
タカキタ	3,900	623.00	2,429,700
クボタ	560,300	1,785.50	1,000,415,650
荏原実業	2,700	2,230.00	6,021,000
三菱化工機	3,700	1,899.00	7,026,300
月島機械	19,500	1,595.00	31,102,500
帝国電機製作所	8,800	1,474.00	12,971,200
新東工業	25,200	1,009.00	25,426,800
澁谷工業	9,300	3,160.00	29,388,000
アイチ コーポレーション	18,400	821.00	15,106,400
小森コーポレーション	26,900	1,096.00	29,482,400
鶴見製作所	8,300	1,905.00	15,811,500
住友精密工業	1,600	3,315.00	5,304,000
日本ギア工業	3,500	403.00	1,410,500
酒井重工業	2,000	2,757.00	5,514,000
荏原製作所	43,700	3,285.00	143,554,500
石井鐵工所	1,400	2,803.00	3,924,200
西島製作所	10,800	910.00	9,828,000
北越工業	11,000	1,351.00	14,861,000
ダイキン工業	134,600	16,300.00	2,193,980,000

オルガノ	3,800	7,600.00	28,880,000	
トーヨーカネツ	4,600	2,314.00	10,644,400	
栗田工業	57,200	3,300.00	188,760,000	
椿本チエイン	15,100	3,845.00	58,059,500	
大同工業	5,200	817.00	4,248,400	
木村化工機	8,900	670.00	5,963,000	
アネスト岩田	16,600	1,055.00	17,513,000	
ダイフク	54,000	7,150.00	386,100,000	
サムコ	3,000	2,193.00	6,579,000	
加藤製作所	5,800	1,636.00	9,488,800	
油研工業	1,800	1,742.00	3,135,600	
タダノ	51,100	998.00	50,997,800	
フジテック	38,500	1,820.00	70,070,000	
C K D	29,400	1,958.00	57,565,200	
キトー	8,100	1,707.00	13,826,700	
平和	29,500	2,311.00	68,174,500	
理想科学工業	9,400	1,977.00	18,583,800	
S A N K Y O	23,500	3,830.00	90,005,000	
日本金銭機械	11,800	887.00	10,466,600	
マースグループホールディングス	6,800	2,080.00	14,144,000	
フクシマガリレイ	6,500	4,125.00	26,812,500	
オーイズミ	4,700	585.00	2,749,500	
ダイコク電機	4,900	1,673.00	8,197,700	
竹内製作所	17,800	1,913.00	34,051,400	
アマノ	27,700	3,240.00	89,748,000	
J U K I	14,700	840.00	12,348,000	
蛇の目ミシン工業	9,900	411.00	4,068,900	
マックス	16,200	2,151.00	34,846,200	
グローリー	27,200	3,375.00	91,800,000	
新晃工業	9,900	1,841.00	18,225,900	
大和冷機工業	15,400	1,246.00	19,188,400	
セガサミーホールディングス	104,800	1,591.00	166,736,800	
日本ピストンリング	3,900	1,567.00	6,111,300	
リケン	4,900	4,035.00	19,771,500	
T P R	14,300	1,997.00	28,557,100	
ツバキ・ナカシマ	21,600	1,441.00	31,125,600	
ホシザキ	30,900	10,130.00	313,017,000	
大豊工業	8,800	810.00	7,128,000	
日本精工	199,000	1,018.00	202,582,000	
N T N	244,800	342.00	83,721,600	
ジェイテクト	101,400	1,285.00	130,299,000	
不二越	9,800	4,575.00	44,835,000	

日本トムソン	31,600	491.00	15,515,600
THK	61,500	3,115.00	191,572,500
ユーシン精機	8,300	1,025.00	8,507,500
前澤給装工業	3,900	2,394.00	9,336,600
イーグル工業	13,200	1,040.00	13,728,000
前澤工業	7,400	411.00	3,041,400
日本ピラー工業	10,800	1,592.00	17,193,600
キッツ	43,000	740.00	31,820,000
マキタ	137,800	4,095.00	564,291,000
日立造船	84,000	423.00	35,532,000
三菱重工業	177,000	4,262.00	754,374,000
IHI	76,100	2,848.00	216,732,800
スター精密	16,400	1,549.00	25,403,600
日清紡ホールディングス	70,500	1,024.00	72,192,000
イビデン	64,900	2,720.00	176,528,000
コニカミノルタ	231,600	720.00	166,752,000
ブラザー工業	129,200	2,318.00	299,485,600
ミネベアミツミ	196,300	2,404.00	471,905,200
日立製作所	507,500	4,535.00	2,301,512,500
三菱電機	1,056,100	1,592.00	1,681,311,200
富士電機	63,700	3,615.00	230,275,500
東洋電機製造	4,200	1,550.00	6,510,000
安川電機	113,700	4,130.00	469,581,000
シンフォニアテクノロジー	13,800	1,335.00	18,423,000
明電舎	19,500	2,378.00	46,371,000
オリジン	2,900	1,712.00	4,964,800
山洋電気	5,200	5,550.00	28,860,000
デンヨー	9,100	2,115.00	19,246,500
東芝テック	13,300	4,525.00	60,182,500
芝浦メカトロニクス	2,000	4,555.00	9,110,000
マブチモーター	29,400	4,200.00	123,480,000
日本電産	127,100	15,700.00	1,995,470,000
トレックス・セミコンダクター	6,500	1,663.00	10,809,500
東光高岳	6,400	1,203.00	7,699,200
ダイヘン	11,600	3,495.00	40,542,000
ヤーマン	16,200	767.00	12,425,400
JVCケンウッド	88,400	273.00	24,133,200
ミマキエンジニアリング	10,700	528.00	5,649,600
第一精工	4,500	2,440.00	10,980,000
日新電機	24,800	1,354.00	33,579,200
大崎電気工業	21,200	686.00	14,543,200
オムロン	94,700	6,580.00	623,126,000

日東工業	15,600	2,509.00	39,140,400
I D E C	15,300	2,190.00	33,507,000
正興電機製作所	3,200	1,017.00	3,254,400
不二電機工業	1,800	1,298.00	2,336,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,500	2,363.00	83,886,500
サクサホールディングス	2,500	2,004.00	5,010,000
メルコホールディングス	3,800	2,891.00	10,985,800
テクノメディカ	2,700	2,082.00	5,621,400
日本電気	128,100	5,040.00	645,624,000
富士通	101,800	11,090.00	1,128,962,000
沖電気工業	43,000	1,455.00	62,565,000
岩崎通信機	4,600	834.00	3,836,400
電気興業	5,100	3,705.00	18,895,500
サンケン電気	11,600	3,335.00	38,686,000
ナカヨ	2,100	1,663.00	3,492,300
アイホン	6,000	1,762.00	10,572,000
ルネサスエレクトロニクス	505,100	809.00	408,625,900
セイコーエプソン	131,100	1,668.00	218,674,800
ワコム	72,400	453.00	32,797,200
アルバック	21,100	4,370.00	92,207,000
アクセル	5,100	991.00	5,054,100
E I Z O	8,200	3,815.00	31,283,000
日本信号	27,000	1,455.00	39,285,000
京三製作所	24,900	620.00	15,438,000
能美防災	14,200	2,492.00	35,386,400
ホーチキ	8,000	1,676.00	13,408,000
星和電機	6,300	606.00	3,817,800
エレコム	11,600	4,715.00	54,694,000
パナソニック	1,206,700	1,119.50	1,350,900,650
シャープ	122,300	1,707.00	208,766,100
アンリツ	68,000	2,190.00	148,920,000
富士通ゼネラル	28,700	2,587.00	74,246,900
ソニー	667,600	7,959.00	5,313,428,400
T D K	51,000	12,600.00	642,600,000
帝国通信工業	5,200	1,233.00	6,411,600
タムラ製作所	35,500	731.00	25,950,500
アルプスアルパイン	93,700	2,461.00	230,595,700
池上通信機	3,300	1,276.00	4,210,800
鈴木	6,400	800.00	5,120,000
日本トリム	1,600	4,695.00	7,512,000
ローランド ディー . ジー .	6,100	2,116.00	12,907,600
フォスター電機	11,100	1,924.00	21,356,400

SMK	2,700	3,135.00	8,464,500
ヨコオ	7,000	3,345.00	23,415,000
ホシデン	29,300	1,379.00	40,404,700
ヒロセ電機	16,400	14,400.00	236,160,000
日本航空電子工業	24,300	2,263.00	54,990,900
TOA	11,400	1,176.00	13,406,400
マクセルホールディングス	23,200	1,565.00	36,308,000
古野電気	14,100	1,199.00	16,905,900
ユニデンホールディングス	3,000	2,129.00	6,387,000
スミダコーポレーション	8,600	1,212.00	10,423,200
アイコム	5,900	2,644.00	15,599,600
リオン	4,600	3,790.00	17,434,000
本多通信工業	10,200	586.00	5,977,200
横河電機	96,900	2,065.00	200,098,500
新電元工業	3,800	3,715.00	14,117,000
アズビル	66,700	3,075.00	205,102,500
東亜ディーケーケー	5,800	1,002.00	5,811,600
日本光電工業	43,800	3,095.00	135,561,000
チノー	3,700	1,442.00	5,335,400
共和電業	11,300	442.00	4,994,600
日本電子材料	4,300	1,097.00	4,717,100
堀場製作所	20,900	7,410.00	154,869,000
アドバンテスト	78,500	6,300.00	494,550,000
小野測器	5,600	570.00	3,192,000
エスベック	9,600	2,302.00	22,099,200
キーエンス	95,700	39,830.00	3,811,731,000
日置電機	5,700	3,785.00	21,574,500
シスメックス	75,500	7,963.00	601,206,500
日本マイクロニクス	18,900	1,437.00	27,159,300
メガチップス	10,200	1,892.00	19,298,400
OBARA GROUP	5,600	3,685.00	20,636,000
澤藤電機	1,600	2,299.00	3,678,400
原田工業	5,600	1,016.00	5,689,600
コーセル	13,400	1,294.00	17,339,600
イリソ電子工業	9,000	4,545.00	40,905,000
オブテックスグループ	17,700	1,666.00	29,488,200
千代田インテグレ	5,200	2,169.00	11,278,800
アイ・オー・データ機器	4,500	1,036.00	4,662,000
レーザーテック	43,400	6,000.00	260,400,000
スタンレー電気	74,500	3,140.00	233,930,000
岩崎電気	4,500	1,503.00	6,763,500
ウシオ電機	61,700	1,713.00	105,692,100

岡谷電機産業	9,900	387.00	3,831,300
ヘリオス テクノ ホールディング	11,100	469.00	5,205,900
エノモト	3,600	1,397.00	5,029,200
日本セラミック	10,900	2,670.00	29,103,000
遠藤照明	6,200	719.00	4,457,800
古河電池	8,300	808.00	6,706,400
双信電機	6,400	493.00	3,155,200
山一電機	8,000	1,746.00	13,968,000
図研	7,100	2,653.00	18,836,300
日本電子	21,000	3,620.00	76,020,000
カシオ計算機	93,500	2,287.00	213,834,500
ファナック	100,300	20,650.00	2,071,195,000
日本シイエムケイ	25,800	604.00	15,583,200
エンプラス	5,600	3,430.00	19,208,000
大真空	4,200	2,084.00	8,752,800
ローム	47,000	9,210.00	432,870,000
浜松ホトニクス	75,900	4,725.00	358,627,500
三井ハイテック	12,000	1,729.00	20,748,000
新光電気工業	35,900	1,377.00	49,434,300
京セラ	148,700	7,693.00	1,143,949,100
太陽誘電	47,200	3,505.00	165,436,000
村田製作所	310,300	6,728.00	2,087,698,400
双葉電子工業	17,200	1,354.00	23,288,800
北陸電気工業	4,800	1,358.00	6,518,400
ニチコン	36,400	1,090.00	39,676,000
日本ケミコン	8,000	1,928.00	15,424,000
K O A	16,400	1,421.00	23,304,400
市光工業	16,600	771.00	12,798,600
小糸製作所	63,400	5,140.00	325,876,000
ミツバ	20,300	715.00	14,514,500
S C R E E Nホールディングス	18,300	7,870.00	144,021,000
キャノン電子	11,400	2,117.00	24,133,800
キャノン	568,500	3,071.00	1,745,863,500
リコー	268,800	1,252.00	336,537,600
象印マホービン	31,300	2,290.00	71,677,000
M U T O Hホールディングス	1,800	1,740.00	3,132,000
東京エレクトロン	70,400	25,120.00	1,768,448,000
トヨタ紡織	30,800	1,726.00	53,160,800
芦森工業	2,200	1,408.00	3,097,600
ユニプレス	20,500	1,519.00	31,139,500
豊田自動織機	85,500	6,600.00	564,300,000
モリタホールディングス	18,500	1,739.00	32,171,500

三櫻工業	13,400	1,138.00	15,249,200
デンソー	232,500	4,921.00	1,144,132,500
東海理化電機製作所	27,800	2,076.00	57,712,800
三井E & Sホールディングス	38,100	1,021.00	38,900,100
川崎重工業	82,200	2,379.00	195,553,800
名村造船所	34,000	255.00	8,670,000
日本車輛製造	3,800	3,180.00	12,084,000
三菱ロジスネクスト	14,000	1,672.00	23,408,000
近畿車輛	1,600	1,669.00	2,670,400
日産自動車	1,245,500	631.50	786,533,250
いすゞ自動車	306,000	1,225.50	375,003,000
トヨタ自動車	1,178,200	7,823.00	9,217,058,600
日野自動車	131,900	1,136.00	149,838,400
三菱自動車工業	390,900	435.00	170,041,500
エフテック	7,400	803.00	5,942,200
レシップホールディングス	4,100	682.00	2,796,200
G M B	2,000	837.00	1,674,000
ファルテック	1,900	1,133.00	2,152,700
武蔵精密工業	23,500	1,444.00	33,934,000
日産車体	20,600	1,069.00	22,021,400
新明和工業	28,400	1,497.00	42,514,800
極東開発工業	19,600	1,579.00	30,948,400
日信工業	19,500	2,234.00	43,563,000
トピー工業	8,700	1,914.00	16,651,800
ティラド	3,900	1,937.00	7,554,300
曙ブレーキ工業	58,000	236.00	13,688,000
タチエス	17,400	1,414.00	24,603,600
N O K	56,800	1,613.00	91,618,400
フタバ産業	29,400	735.00	21,609,000
K Y B	11,800	3,170.00	37,406,000
大同メタル工業	20,300	724.00	14,697,200
プレス工業	52,500	412.00	21,630,000
ミクニ	13,600	356.00	4,841,600
太平洋工業	22,200	1,526.00	33,877,200
ケーヒン	22,100	2,582.00	57,062,200
河西工業	14,300	838.00	11,983,400
アイシン精機	87,000	3,950.00	343,650,000
マツダ	310,700	972.00	302,000,400
今仙電機製作所	9,900	948.00	9,385,200
本田技研工業	831,500	3,030.00	2,519,445,000
スズキ	209,300	5,034.00	1,053,616,200
S U B A R U	327,800	2,851.50	934,721,700

安永	5,100	1,218.00	6,211,800
ヤマハ発動機	137,700	2,179.00	300,048,300
ショーワ	22,700	2,282.00	51,801,400
T B K	12,700	487.00	6,184,900
エクセディ	14,400	2,381.00	34,286,400
豊田合成	34,100	2,732.00	93,161,200
愛三工業	16,600	759.00	12,599,400
盟和産業	1,700	1,144.00	1,944,800
日本プラスト	8,400	704.00	5,913,600
ヨロズ	9,900	1,469.00	14,543,100
エフ・シー・シー	17,300	2,387.00	41,295,100
シマノ	39,500	17,450.00	689,275,000
テイ・エス テック	24,500	3,270.00	80,115,000
ジャムコ	5,300	1,444.00	7,653,200
テルモ	298,800	3,954.00	1,181,455,200
クリエートメディック	3,500	1,069.00	3,741,500
日機装	31,700	1,434.00	45,457,800
日本エム・ディ・エム	6,100	2,575.00	15,707,500
島津製作所	126,200	3,255.00	410,781,000
J M S	9,000	782.00	7,038,000
長野計器	7,700	1,037.00	7,984,900
ブイ・テクノロジー	5,000	5,380.00	26,900,000
東京計器	6,800	1,093.00	7,432,400
愛知時計電機	1,400	4,365.00	6,111,000
インターアクション	5,700	2,563.00	14,609,100
オーバル	9,600	254.00	2,438,400
東京精密	19,100	4,205.00	80,315,500
マニー	42,100	3,060.00	128,826,000
ニコン	170,900	1,378.00	235,500,200
トプコン	53,200	1,664.00	88,524,800
オリンパス	584,300	1,791.50	1,046,773,450
理研計器	9,300	2,238.00	20,813,400
タムロン	8,500	2,537.00	21,564,500
H O Y A	210,900	11,065.00	2,333,608,500
シード	4,500	1,060.00	4,770,000
ノーリツ鋼機	7,100	1,575.00	11,182,500
エー・アンド・デイ	9,700	1,019.00	9,884,300
朝日インテック	89,700	3,155.00	283,003,500
シチズン時計	123,700	578.00	71,498,600
リズム時計工業	3,300	931.00	3,072,300
大研医器	7,400	761.00	5,631,400
メニコン	14,500	5,020.00	72,790,000

シンシア	1,200	741.00	889,200
松風	4,800	1,910.00	9,168,000
セイコーホールディングス	14,900	2,942.00	43,835,800
ニプロ	73,100	1,289.00	94,225,900
中本パックス	2,700	1,655.00	4,468,500
スノーピーク	5,000	1,078.00	5,390,000
パラマウントベッドホールディングス	11,100	4,715.00	52,336,500
トランザクション	6,700	1,148.00	7,691,600
粧美堂	3,100	396.00	1,227,600
ニホンフラッシュ	4,900	2,861.00	14,018,900
前田工織	11,600	2,260.00	26,216,000
永大産業	13,800	346.00	4,774,800
アートネイチャー	11,300	847.00	9,571,100
バンダイナムコホールディングス	109,200	6,639.00	724,978,800
アイフィスジャパン	2,700	772.00	2,084,400
共立印刷	17,600	169.00	2,974,400
SHOEI	5,100	5,030.00	25,653,000
フランスベッドホールディングス	14,900	984.00	14,661,600
パイロットコーポレーション	17,200	4,430.00	76,196,000
萩原工業	5,900	1,708.00	10,077,200
トッパン・フォームズ	22,600	1,255.00	28,363,000
フジシールインターナショナル	23,700	2,422.00	57,401,400
タカラトミー	47,400	1,285.00	60,909,000
廣済堂	7,400	874.00	6,467,600
エステールホールディングス	2,800	702.00	1,965,600
アーク	40,300	96.00	3,868,800
タカノ	4,100	801.00	3,284,100
プロネクサス	9,100	1,245.00	11,329,500
ホクシン	6,500	160.00	1,040,000
ウッドワン	3,500	1,242.00	4,347,000
大建工業	7,100	1,958.00	13,901,800
凸版印刷	149,100	2,275.00	339,202,500
大日本印刷	138,200	3,060.00	422,892,000
共同印刷	3,300	3,010.00	9,933,000
NISSHA	21,700	1,093.00	23,718,100
光村印刷	900	1,723.00	1,550,700
TAKARA & COMPANY	5,100	1,735.00	8,848,500
アシックス	87,200	1,709.00	149,024,800
ツツミ	3,300	2,192.00	7,233,600
小松ウオール工業	3,200	2,255.00	7,216,000
ヤマハ	62,800	6,130.00	384,964,000
河合楽器製作所	3,300	3,800.00	12,540,000

クリナップ	9,800	711.00	6,967,800
ピジョン	63,800	4,005.00	255,519,000
オリバー	2,200	3,530.00	7,766,000
兼松サステック	700	1,848.00	1,293,600
キングジム	8,800	865.00	7,612,000
リンテック	25,100	2,457.00	61,670,700
イトーキ	22,500	512.00	11,520,000
任天堂	64,800	43,320.00	2,807,136,000
三菱鉛筆	17,400	1,667.00	29,005,800
タカラスタANDARD	21,800	1,983.00	43,229,400
コクヨ	50,700	1,665.00	84,415,500
ナカバヤシ	10,400	618.00	6,427,200
グローブライド	4,700	2,543.00	11,952,100
オカムラ	36,800	1,116.00	41,068,800
美津濃	9,600	2,685.00	25,776,000
東京電力ホールディングス	843,000	435.00	366,705,000
中部電力	323,100	1,460.50	471,887,550
関西電力	400,100	1,223.00	489,322,300
中国電力	146,000	1,415.00	206,590,000
北陸電力	96,500	793.00	76,524,500
東北電力	263,800	1,015.00	267,757,000
四国電力	95,100	966.00	91,866,600
九州電力	217,700	897.00	195,276,900
北海道電力	98,800	508.00	50,190,400
沖縄電力	19,600	2,010.00	39,396,000
電源開発	84,000	2,554.00	214,536,000
エフオン	5,000	794.00	3,970,000
イーレックス	15,000	1,726.00	25,890,000
レノバ	17,400	1,167.00	20,305,800
東京瓦斯	203,100	2,543.50	516,584,850
大阪瓦斯	204,900	1,968.00	403,243,200
東邦瓦斯	51,900	4,325.00	224,467,500
北海道瓦斯	5,700	1,670.00	9,519,000
広島ガス	21,700	356.00	7,725,200
西部瓦斯	11,900	2,428.00	28,893,200
静岡ガス	30,000	921.00	27,630,000
メタウォーター	5,100	4,310.00	21,981,000
SBSホールディングス	9,100	1,953.00	17,772,300
東武鉄道	111,400	3,985.00	443,929,000
相鉄ホールディングス	33,800	2,944.00	99,507,200
東急	266,300	1,968.00	524,078,400
京浜急行電鉄	135,600	2,065.00	280,014,000

小田急電鉄	157,100	2,482.00	389,922,200
京王電鉄	54,800	6,460.00	354,008,000
京成電鉄	73,500	4,280.00	314,580,000
富士急行	14,400	4,060.00	58,464,000
新京成電鉄	2,700	2,440.00	6,588,000
東日本旅客鉄道	185,900	9,991.00	1,857,326,900
西日本旅客鉄道	94,100	9,417.00	886,139,700
東海旅客鉄道	87,800	21,955.00	1,927,649,000
西武ホールディングス	141,700	1,777.00	251,800,900
鴻池運輸	16,800	1,624.00	27,283,200
西日本鉄道	29,300	2,528.00	74,070,400
ハマキョウレックス	8,100	3,560.00	28,836,000
サカイ引越センター	5,600	6,620.00	37,072,000
近鉄グループホールディングス	100,000	5,940.00	594,000,000
阪急阪神ホールディングス	133,400	4,590.00	612,306,000
南海電気鉄道	47,400	2,968.00	140,683,200
京阪ホールディングス	44,500	5,210.00	231,845,000
神戸電鉄	2,400	3,970.00	9,528,000
名古屋鉄道	82,200	3,360.00	276,192,000
山陽電気鉄道	7,100	2,154.00	15,293,400
日本通運	35,300	6,630.00	234,039,000
ヤマトホールディングス	175,300	1,876.00	328,862,800
山九	27,800	5,520.00	153,456,000
丸運	5,700	379.00	2,160,300
丸全昭和運輸	8,100	3,100.00	25,110,000
センコーグループホールディングス	55,100	916.00	50,471,600
トナミホールディングス	2,400	5,070.00	12,168,000
ニッコンホールディングス	35,800	2,666.00	95,442,800
日本石油輸送	1,100	2,903.00	3,193,300
福山通運	12,800	3,900.00	49,920,000
セイノーホールディングス	74,900	1,479.00	110,777,100
エスライン	3,000	1,022.00	3,066,000
神奈川中央交通	2,500	4,135.00	10,337,500
日立物流	18,300	3,240.00	59,292,000
丸和運輸機関	10,500	2,436.00	25,578,000
C & F ロジホールディングス	10,100	1,399.00	14,129,900
九州旅客鉄道	89,200	3,615.00	322,458,000
S Gホールディングス	105,000	2,449.00	257,145,000
日本郵船	84,000	1,908.00	160,272,000
商船三井	63,500	2,925.00	185,737,500
川崎汽船	30,800	1,642.00	50,573,600
N S ユナイテッド海運	5,800	2,144.00	12,435,200

飯野海運	49,400	367.00	18,129,800
共栄タンカー	2,600	992.00	2,579,200
乾汽船	5,800	1,170.00	6,786,000
日本航空	180,000	3,292.00	592,560,000
A N Aホールディングス	182,800	3,584.00	655,155,200
パスコ	1,900	2,194.00	4,168,600
トランコム	2,800	8,050.00	22,540,000
日新	8,600	1,841.00	15,832,600
三菱倉庫	31,700	2,859.00	90,630,300
三井倉庫ホールディングス	11,400	1,963.00	22,378,200
住友倉庫	36,800	1,509.00	55,531,200
澁澤倉庫	5,500	2,318.00	12,749,000
東陽倉庫	18,100	331.00	5,991,100
日本トランスシティ	22,000	508.00	11,176,000
ケイヒン	1,900	1,330.00	2,527,000
中央倉庫	6,100	1,172.00	7,149,200
川西倉庫	1,800	1,048.00	1,886,400
安田倉庫	8,200	1,082.00	8,872,400
ファイズホールディングス	2,100	524.00	1,100,400
東洋埠頭	3,000	1,413.00	4,239,000
宇徳	8,500	607.00	5,159,500
上組	57,300	2,418.00	138,551,400
サンリツ	2,400	752.00	1,804,800
キムラユニティー	2,700	1,153.00	3,113,100
キューソー流通システム	2,500	1,936.00	4,840,000
近鉄エクスプレス	21,200	2,014.00	42,696,800
東海運	5,700	289.00	1,647,300
エーアイティー	7,100	1,028.00	7,298,800
内外トランスライン	3,500	1,339.00	4,686,500
日本コンセプト	3,200	1,533.00	4,905,600
N E C ネットズエスアイ	9,900	4,210.00	41,679,000
クロスキャット	2,900	1,352.00	3,920,800
システナ	37,100	1,916.00	71,083,600
デジタルアーツ	5,100	5,830.00	29,733,000
日鉄ソリューションズ	15,600	3,510.00	54,756,000
キューブシステム	5,800	834.00	4,837,200
エイジア	2,100	1,443.00	3,030,300
コア	4,600	1,556.00	7,157,600
ソリトンシステムズ	4,700	1,301.00	6,114,700
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	1,769.00	8,314,300
T I S	34,600	6,680.00	231,128,000
ネオス	4,100	816.00	3,345,600

電算システム	4,000	3,050.00	12,200,000
グリー	72,000	476.00	34,272,000
コーエーテクモホールディングス	21,300	2,952.00	62,877,600
三菱総合研究所	4,500	4,380.00	19,710,000
電算	1,300	2,282.00	2,966,600
A G S	6,200	857.00	5,313,400
ファインデックス	8,900	1,272.00	11,320,800
ブレインパッド	2,200	6,140.00	13,508,000
K L a b	20,000	839.00	16,780,000
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,800	939.00	12,019,200
イーブুকイニシアティブジャパン	1,600	2,094.00	3,350,400
ネクソン	295,200	1,540.00	454,608,000
アイスタイル	27,200	559.00	15,204,800
エムアップ	3,100	2,890.00	8,959,000
エイチーム	7,400	1,093.00	8,088,200
エニグモ	7,600	899.00	6,832,400
テクノスジャパン	8,500	510.00	4,335,000
コロプラ	34,100	1,128.00	38,464,800
ブロードリーフ	51,800	668.00	34,602,400
クロス・マーケティンググループ	5,300	401.00	2,125,300
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,043.00	5,945,100
システム情報	5,500	1,104.00	6,072,000
メディアドゥホールディングス	3,300	3,435.00	11,335,500
じげん	26,100	526.00	13,728,600
エンカレッジ・テクノロジー	2,000	943.00	1,886,000
サイバーリンクス	1,800	1,269.00	2,284,200
フィックスターズ	11,200	1,648.00	18,457,600
C A R T A H O L D I N G S	5,200	1,122.00	5,834,400
オブティム	2,800	4,045.00	11,326,000
セレス	3,600	1,346.00	4,845,600
S H I F T	2,700	8,440.00	22,788,000
ティーガイア	9,300	2,767.00	25,733,100
セック	1,600	3,955.00	6,328,000
日本アジアグループ	10,900	396.00	4,316,400
豆蔵ホールディングス	7,200	1,557.00	11,210,400
テクマトリックス	7,400	2,654.00	19,639,600
プロシップ	3,200	1,599.00	5,116,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,100	2,265.00	56,851,500
G M O ペイメントゲートウェイ	17,100	7,830.00	133,893,000
ザッパラス	6,000	423.00	2,538,000
システムリサーチ	2,900	1,939.00	5,623,100
インターネットイニシアティブ	15,400	3,040.00	46,816,000

さくらインターネット	11,500	738.00	8,487,000
ヴィンクス	3,100	1,185.00	3,673,500
GMOクラウド	2,000	2,633.00	5,266,000
SRAホールディングス	5,600	2,613.00	14,632,800
システムインテグレータ	3,600	1,033.00	3,718,800
朝日ネット	7,800	694.00	5,413,200
eBASE	6,400	1,481.00	9,478,400
アバント	7,600	1,191.00	9,051,600
アドソル日進	3,800	2,465.00	9,367,000
フリービット	6,400	970.00	6,208,000
コムチュア	11,700	2,486.00	29,086,200
サイバーコム	2,000	2,325.00	4,650,000
アステリア	6,700	593.00	3,973,100
アイル	3,800	2,171.00	8,249,800
マークライنز	5,300	2,113.00	11,198,900
メディカル・データ・ビジョン	8,200	889.00	7,289,800
ショーケース	2,800	743.00	2,080,400
モバイルファクトリー	2,500	1,419.00	3,547,500
テラスカイ	3,800	3,310.00	12,578,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,822.00	8,563,400
PCIホールディングス	2,200	2,301.00	5,062,200
パイプドHD	1,500	1,983.00	2,974,500
アイビーシー	2,100	1,519.00	3,189,900
ネオジャパン	2,200	1,288.00	2,833,600
PR TIMES	1,000	2,536.00	2,536,000
ランドコンピュータ	1,800	1,192.00	2,145,600
ダブルスタンダード	1,400	4,650.00	6,510,000
オープンドア	5,300	1,478.00	7,833,400
マイネット	3,300	735.00	2,425,500
アカツキ	3,700	5,650.00	20,905,000
ベネフィットジャパン	900	1,934.00	1,740,600
Ubicomホールディングス	2,500	1,384.00	3,460,000
LINE	21,600	5,360.00	115,776,000
カナミックネットワーク	6,600	800.00	5,280,000
ノムラシステムコーポレーション	2,700	561.00	1,514,700
チェンジ	2,200	3,325.00	7,315,000
シンクロ・フード	4,900	578.00	2,832,200
オークネット	6,600	1,253.00	8,269,800
セグエグループ	2,000	930.00	1,860,000
エイトレッド	1,400	1,804.00	2,525,600
AOI TYO Holdings	10,800	738.00	7,970,400
マクロミル	18,700	1,125.00	21,037,500

ビーグリー	2,200	1,260.00	2,772,000
オロ	2,800	3,800.00	10,640,000
ユーザーローカル	600	3,350.00	2,010,000
テモナ	1,900	561.00	1,065,900
ニーズウェル	1,600	854.00	1,366,400
サインポスト	1,700	2,016.00	3,427,200
ソルクシーズ	4,700	1,053.00	4,949,100
フェイス	4,000	788.00	3,152,000
プロトコーポレーション	9,500	1,371.00	13,024,500
ハイマックス	1,300	2,070.00	2,691,000
野村総合研究所	173,300	2,380.00	412,454,000
サイバネットシステム	7,700	932.00	7,176,400
C Eホールディングス	6,500	506.00	3,289,000
日本システム技術	1,800	1,449.00	2,608,200
インテージホールディングス	13,200	910.00	12,012,000
東邦システムサイエンス	3,000	925.00	2,775,000
ソースネクスト	49,700	539.00	26,788,300
インフォコム	11,400	2,898.00	33,037,200
ラクスル	5,500	3,835.00	21,092,500
F I G	12,100	307.00	3,714,700
システムサポート	1,000	2,552.00	2,552,000
イーソル	3,800	2,480.00	9,424,000
アルテリア・ネットワークス	11,600	1,963.00	22,770,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,611.00	4,027,500
フォーカスシステムズ	6,700	1,004.00	6,726,800
クレスコ	3,200	4,010.00	12,832,000
フジ・メディア・ホールディングス	100,000	1,606.00	160,600,000
オービック	35,900	15,530.00	557,527,000
ジャストシステム	16,900	6,300.00	106,470,000
T D Cソフト	9,300	1,180.00	10,974,000
Zホールディングス	1,423,600	460.00	654,856,000
トレンドマイクロ	46,100	5,810.00	267,841,000
I Dホールディングス	4,100	1,640.00	6,724,000
日本オラクル	21,000	9,880.00	207,480,000
アルファシステムズ	3,300	2,973.00	9,810,900
フューチャー	12,600	2,087.00	26,296,200
C A C Holdings	6,900	1,559.00	10,757,100
S Bテクノロジー	3,800	2,327.00	8,842,600
トーセ	3,100	910.00	2,821,000
オービックビジネスコンサルタント	10,600	5,070.00	53,742,000
伊藤忠テクノソリューションズ	47,300	3,325.00	157,272,500
アイティフォー	12,800	943.00	12,070,400

東計電算	1,600	3,670.00	5,872,000
エクスネット	1,900	1,003.00	1,905,700
大塚商会	56,100	4,635.00	260,023,500
サイボウズ	12,300	1,825.00	22,447,500
ソフトブレン	6,500	661.00	4,296,500
電通国際情報サービス	6,500	4,775.00	31,037,500
デジタルガレージ	18,700	4,405.00	82,373,500
E Mシステムズ	14,800	978.00	14,474,400
ウェザーニューズ	3,600	3,835.00	13,806,000
C I J	8,000	936.00	7,488,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,440.00	4,472,000
日本エンタープライズ	11,600	251.00	2,911,600
WOWOW	5,100	2,691.00	13,724,100
スカラ	7,700	807.00	6,213,900
インテリジェント ウェイブ	4,200	833.00	3,498,600
I M A G I C A G R O U P	9,200	580.00	5,336,000
ネットワンシステムズ	39,600	2,494.00	98,762,400
システムソフト	27,000	108.00	2,916,000
アルゴグラフィックス	8,900	3,525.00	31,372,500
マーベラス	16,200	727.00	11,777,400
エイベックス	18,000	1,254.00	22,572,000
日本ユニシス	32,400	3,505.00	113,562,000
兼松エレクトロニクス	5,700	3,625.00	20,662,500
東京放送ホールディングス	63,100	1,945.00	122,729,500
日本テレビホールディングス	86,700	1,504.00	130,396,800
朝日放送グループホールディングス	10,600	770.00	8,162,000
テレビ朝日ホールディングス	28,600	2,160.00	61,776,000
スカパーJ S A Tホールディングス	68,700	479.00	32,907,300
テレビ東京ホールディングス	8,600	2,439.00	20,975,400
日本BS放送	3,700	1,246.00	4,610,200
ビジョン	9,800	1,711.00	16,767,800
スマートバリュー	3,400	801.00	2,723,400
ワイヤレスゲート	5,200	768.00	3,993,600
コネクシオ	6,000	1,782.00	10,692,000
クロップス	2,200	748.00	1,645,600
日本電信電話	1,385,300	2,843.00	3,938,407,900
K D D I	772,300	3,281.00	2,533,916,300
ソフトバンク	941,900	1,478.50	1,392,599,150
光通信	10,700	27,600.00	295,320,000
N T T ドコモ	765,500	3,110.00	2,380,705,000
エムティーアイ	10,400	732.00	7,612,800
G M O インターネット	41,000	2,174.00	89,134,000

ファイバーゲート	2,100	1,388.00	2,914,800
アイドママーケティングコミュニケーション	3,500	686.00	2,401,000
KADOKAWA	28,000	2,055.00	57,540,000
学研ホールディングス	3,500	7,560.00	26,460,000
ゼンリン	20,800	1,773.00	36,878,400
昭文社	5,400	390.00	2,106,000
インプレスホールディングス	8,600	185.00	1,591,000
アイネット	5,500	1,617.00	8,893,500
松竹	6,900	15,420.00	106,398,000
東宝	62,000	4,280.00	265,360,000
東映	3,900	15,560.00	60,684,000
エヌ・ティ・ティ・データ	276,100	1,571.00	433,753,100
ピー・シー・エー	1,400	6,080.00	8,512,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,582.00	4,905,800
D T S	23,300	2,606.00	60,719,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,200	5,550.00	245,310,000
シーイーシー	11,200	2,266.00	25,379,200
カプコン	48,900	2,998.00	146,602,200
アイ・エス・ビー	2,100	2,117.00	4,445,700
ジャステック	6,800	1,148.00	7,806,400
S C S K	24,000	6,070.00	145,680,000
日本システムウエア	3,500	2,688.00	9,408,000
アイネス	10,400	1,463.00	15,215,200
T K C	8,800	5,480.00	48,224,000
富士ソフト	13,300	4,440.00	59,052,000
N S D	34,200	1,791.00	61,252,200
コナミホールディングス	37,700	4,585.00	172,854,500
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,700.00	15,170,000
J B C Cホールディングス	7,100	2,114.00	15,009,400
ミロク情報サービス	9,200	3,280.00	30,176,000
ソフトバンクグループ	822,300	4,884.00	4,016,113,200
ハウスイ	900	895.00	805,500
高千穂交易	4,000	1,232.00	4,928,000
伊藤忠食品	2,600	5,280.00	13,728,000
エレマテック	9,700	1,161.00	11,261,700
J A L U X	2,900	2,472.00	7,168,800
あらた	8,300	4,655.00	38,636,500
トーメンデバイス	1,600	3,885.00	6,216,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,877.00	10,932,600
フィールズ	8,000	627.00	5,016,000
双日	574,500	354.00	203,373,000
アルフレッサ ホールディングス	115,600	2,293.00	265,070,800

横浜冷凍	29,200	979.00	28,586,800
ラサ商事	5,500	1,046.00	5,753,000
ラクーンホールディングス	5,000	849.00	4,245,000
アルコニックス	11,100	1,417.00	15,728,700
神戸物産	35,900	4,420.00	158,678,000
あいホールディングス	14,900	1,970.00	29,353,000
ディーブイエックス	3,700	938.00	3,470,600
ダイワボウホールディングス	8,800	6,820.00	60,016,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,800	1,815.00	45,012,000
ラクト・ジャパン	3,900	3,915.00	15,268,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,600	1,069.00	20,952,400
八洲電機	8,100	922.00	7,468,200
メディアスホールディングス	5,900	876.00	5,168,400
レスターホールディングス	10,800	2,087.00	22,539,600
ジューテックホールディングス	2,400	1,211.00	2,906,400
大光	4,500	671.00	3,019,500
O C H Iホールディングス	3,000	1,491.00	4,473,000
T O K A Iホールディングス	55,000	1,077.00	59,235,000
黒谷	2,400	510.00	1,224,000
C o m i n i x	1,800	840.00	1,512,000
三洋貿易	5,200	2,760.00	14,352,000
ビューティガレージ	1,700	2,412.00	4,100,400
ウイン・パートナーズ	7,500	1,330.00	9,975,000
ミタチ産業	3,100	753.00	2,334,300
シップヘルスケアホールディングス	16,700	5,150.00	86,005,000
明治電機工業	3,300	1,639.00	5,408,700
デリカフーズホールディングス	3,700	730.00	2,701,000
スターティアホールディングス	2,400	806.00	1,934,400
コメダホールディングス	22,700	2,218.00	50,348,600
アセンテック	800	2,270.00	1,816,000
富士興産	3,200	692.00	2,214,400
協栄産業	1,200	1,480.00	1,776,000
小野建	9,300	1,395.00	12,973,500
南陽	2,300	1,921.00	4,418,300
佐島電機	7,700	920.00	7,084,000
エコートレーディング	2,400	576.00	1,382,400
伯東	6,400	1,367.00	8,748,800
コンドーテック	8,100	1,170.00	9,477,000
中山福	6,000	566.00	3,396,000
ナガイレーベン	15,100	2,380.00	35,938,000
三菱食品	11,400	3,155.00	35,967,000
松田産業	7,600	1,621.00	12,319,600

第一興商	15,500	5,590.00	86,645,000
メディバルホールディングス	112,300	2,427.00	272,552,100
S P K	2,200	2,829.00	6,223,800
萩原電気ホールディングス	3,900	2,730.00	10,647,000
アズワン	6,800	10,420.00	70,856,000
スズデン	3,600	1,462.00	5,263,200
尾家産業	3,100	1,355.00	4,200,500
シモジマ	6,400	1,191.00	7,622,400
ドウシシャ	9,800	1,707.00	16,728,600
小津産業	2,300	1,831.00	4,211,300
高速	6,200	1,262.00	7,824,400
たけびし	3,700	1,511.00	5,590,700
リックス	2,400	1,750.00	4,200,000
丸文	9,200	627.00	5,768,400
ハピネット	8,700	1,371.00	11,927,700
橋本総業ホールディングス	2,100	1,919.00	4,029,900
日本ライフライン	30,800	1,437.00	44,259,600
タカショー	5,100	476.00	2,427,600
エクセル	2,700	1,595.00	4,306,500
マルカ	3,700	2,180.00	8,066,000
I D O M	28,100	651.00	18,293,100
進和	6,200	2,303.00	14,278,600
エスケイジャパン	2,300	496.00	1,140,800
ダイトロン	4,400	1,974.00	8,685,600
シークス	13,200	1,449.00	19,126,800
田中商事	3,200	764.00	2,444,800
オーハシテクニカ	5,900	1,598.00	9,428,200
白銅	3,700	1,495.00	5,531,500
伊藤忠商事	727,500	2,595.00	1,887,862,500
丸紅	1,082,600	824.90	893,036,740
高島	1,700	2,026.00	3,444,200
長瀬産業	58,500	1,606.00	93,951,000
蝶理	6,600	2,259.00	14,909,400
豊田通商	116,100	3,930.00	456,273,000
三共生興	15,800	599.00	9,464,200
兼松	38,800	1,477.00	57,307,600
ツカモトコーポレーション	1,900	1,142.00	2,169,800
三井物産	914,200	1,987.00	1,816,515,400
日本紙パルプ商事	5,900	4,095.00	24,160,500
日立ハイテクノロジーズ	36,100	7,850.00	283,385,000
カメイ	13,600	1,201.00	16,333,600
東都水産	1,300	2,773.00	3,604,900

OUGホールディングス	1,700	2,675.00	4,547,500
スターゼン	3,800	4,425.00	16,815,000
山善	40,600	1,079.00	43,807,400
椿本興業	1,900	4,245.00	8,065,500
住友商事	656,300	1,668.00	1,094,708,400
内田洋行	4,400	7,710.00	33,924,000
三菱商事	729,900	2,890.50	2,109,775,950
第一実業	5,100	3,640.00	18,564,000
キャノンマーケティングジャパン	29,700	2,605.00	77,368,500
西華産業	5,900	1,342.00	7,917,800
佐藤商事	8,600	994.00	8,548,400
菱洋エレクトロ	10,600	2,123.00	22,503,800
東京産業	9,400	683.00	6,420,200
ユアサ商事	9,900	3,645.00	36,085,500
神鋼商事	2,600	2,743.00	7,131,800
小林産業	6,300	286.00	1,801,800
阪和興業	19,400	2,825.00	54,805,000
正栄食品工業	6,700	3,965.00	26,565,500
カナデン	8,500	1,347.00	11,449,500
菱電商事	7,500	1,636.00	12,270,000
フルサト工業	5,700	1,771.00	10,094,700
岩谷産業	23,100	3,695.00	85,354,500
すてきナイスグループ	4,000	1,328.00	5,312,000
昭光通商	3,300	736.00	2,428,800
ニチモウ	1,600	2,021.00	3,233,600
極東貿易	3,000	2,204.00	6,612,000
イワキ	13,700	484.00	6,630,800
三愛石油	25,600	1,141.00	29,209,600
稲畑産業	22,900	1,591.00	36,433,900
G S Iクレオス	2,600	1,337.00	3,476,200
明和産業	9,600	613.00	5,884,800
クワザワ	3,700	676.00	2,501,200
ワキタ	22,200	1,104.00	24,508,800
東邦ホールディングス	33,400	2,421.00	80,861,400
サンゲツ	28,600	2,048.00	58,572,800
ミツウロコグループホールディングス	15,300	1,177.00	18,008,100
シナネンホールディングス	4,300	2,033.00	8,741,900
伊藤忠エネクス	23,000	922.00	21,206,000
サンリオ	29,200	2,193.00	64,035,600
サンワテクノス	7,400	1,114.00	8,243,600
リョーサン	11,500	2,732.00	31,418,000
新光商事	16,300	898.00	14,637,400

トーホー	4,700	1,919.00	9,019,300
三信電気	5,600	1,782.00	9,979,200
東陽テクニカ	12,000	1,346.00	16,152,000
モスフードサービス	13,700	3,035.00	41,579,500
加賀電子	10,400	2,565.00	26,676,000
ソーダニッカ	10,800	648.00	6,998,400
立花エレテック	7,700	1,867.00	14,375,900
フォーバル	4,600	1,163.00	5,349,800
PALTA C	16,700	5,380.00	89,846,000
三谷産業	13,800	343.00	4,733,400
西本Wismettacホールディングス	1,900	3,650.00	6,935,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,424.00	2,181,600
国際紙パルプ商事	24,700	297.00	7,335,900
ヤマタネ	5,200	1,596.00	8,299,200
丸紅建材リース	1,000	1,883.00	1,883,000
日鉄物産	7,400	5,170.00	38,258,000
泉州電業	3,200	3,320.00	10,624,000
トラスコ中山	21,700	2,716.00	58,937,200
オートバックスセブン	38,600	1,643.00	63,419,800
モリト	7,600	794.00	6,034,400
加藤産業	16,300	3,445.00	56,153,500
北恵	2,000	916.00	1,832,000
イノテック	6,200	1,269.00	7,867,800
イエローハット	19,700	1,860.00	36,642,000
J Kホールディングス	9,400	775.00	7,285,000
日伝	9,400	2,121.00	19,937,400
北沢産業	7,900	283.00	2,235,700
杉本商事	5,600	2,049.00	11,474,400
因幡電機産業	29,600	2,783.00	82,376,800
東テク	3,500	2,800.00	9,800,000
ミスミグループ本社	130,300	3,025.00	394,157,500
アルテック	8,400	259.00	2,175,600
タキヒヨー	3,200	1,916.00	6,131,200
蔵王産業	2,000	1,490.00	2,980,000
スズケン	44,100	4,360.00	192,276,000
ジェコス	7,200	1,123.00	8,085,600
グローセル	10,500	471.00	4,945,500
ローソン	26,300	6,440.00	169,372,000
サンエー	8,700	4,670.00	40,629,000
カワチ薬品	8,200	2,177.00	17,851,400
エービーシー・マート	16,300	7,120.00	116,056,000
ハードオフコーポレーション	4,400	843.00	3,709,200

アスクル	10,900	3,340.00	36,406,000
ゲオホールディングス	18,900	1,300.00	24,570,000
アダストリア	14,500	2,297.00	33,306,500
ジーフット	6,600	620.00	4,092,000
くら寿司	5,500	5,450.00	29,975,000
キャンドウ	5,100	1,637.00	8,348,700
パルグループホールディングス	5,400	3,445.00	18,603,000
エディオン	47,900	1,178.00	56,426,200
サーラコーポレーション	21,400	643.00	13,760,200
ワッツ	4,900	633.00	3,101,700
ハローズ	4,000	2,706.00	10,824,000
フジオフードシステム	8,900	1,859.00	16,545,100
あみやき亭	2,300	3,670.00	8,441,000
ひらまつ	19,900	279.00	5,552,100
大黒天物産	2,600	3,685.00	9,581,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,474.00	13,708,200
ファーマライズホールディングス	2,800	655.00	1,834,000
アルペン	8,100	1,719.00	13,923,900
ハブ	3,200	1,095.00	3,504,000
クオールホールディングス	15,400	1,464.00	22,545,600
ジーンズホールディングス	5,500	7,980.00	43,890,000
ビックカメラ	61,900	1,284.00	79,479,600
D C Mホールディングス	56,300	1,052.00	59,227,600
Monotaro	74,000	2,703.00	200,022,000
東京一番フーズ	3,000	641.00	1,923,000
D Dホールディングス	4,100	1,834.00	7,519,400
きちりホールディングス	3,000	789.00	2,367,000
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,058.00	15,846,600
J . フロント リテイリング	124,300	1,462.00	181,726,600
ドトール・日レスホールディングス	16,700	2,126.00	35,504,200
マツモトキヨシホールディングス	43,000	4,430.00	190,490,000
ブロンコビリー	5,500	2,787.00	15,328,500
Z O Z O	71,600	1,888.00	135,180,800
トレジャー・ファクトリー	3,200	958.00	3,065,600
物語コーポレーション	2,600	9,120.00	23,712,000
ココカラファイン	10,900	6,720.00	73,248,000
三越伊勢丹ホールディングス	182,000	935.00	170,170,000
Hamee	3,300	1,512.00	4,989,600
ウエルシアホールディングス	31,000	6,740.00	208,940,000
クリエイトSDホールディングス	15,400	2,926.00	45,060,400
丸善C H Iホールディングス	12,100	366.00	4,428,600
ティーライフ	1,600	909.00	1,454,400

エー・ピーカンパニー	2,300	640.00	1,472,000	
チムニー	3,300	2,342.00	7,728,600	
シュッピン	7,200	1,251.00	9,007,200	
ネクステージ	15,000	1,158.00	17,370,000	
ジョイフル本田	30,600	1,311.00	40,116,600	
鳥貴族	3,500	2,537.00	8,879,500	
キリン堂ホールディングス	4,200	1,915.00	8,043,000	
ホットランド	7,100	1,342.00	9,528,200	
すかいらーくホールディングス	116,700	2,170.00	253,239,000	
SFPホールディングス	4,500	2,478.00	11,151,000	
綿半ホールディングス	4,000	1,843.00	7,372,000	
ヨシックス	1,800	2,955.00	5,319,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,400	984.00	29,913,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,100	676.00	3,447,600	
B E E N O S	4,206	1,285.00	5,404,710	
あさひ	7,900	1,355.00	10,704,500	
日本調剤	3,200	3,835.00	12,272,000	
コスモス薬品	4,600	24,800.00	114,080,000	
トーエル	5,300	801.00	4,245,300	
オンリー	2,000	807.00	1,614,000	
セブン&アイ・ホールディングス	406,900	4,233.00	1,722,407,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28,100	2,302.00	64,686,200	
ツルハホールディングス	22,600	13,820.00	312,332,000	
サンマルクホールディングス	8,300	2,357.00	19,563,100	
フェリシモ	2,500	1,020.00	2,550,000	
トリドールホールディングス	12,900	2,791.00	36,003,900	
T O K Y O B A S E	9,700	548.00	5,315,600	
ウイルプラスホールディングス	1,800	936.00	1,684,800	
ジャパンミート	5,300	2,292.00	12,147,600	
サツドラホールディングス	1,700	1,890.00	3,213,000	
アレンザホールディングス	5,400	1,045.00	5,643,000	
串カツ田中ホールディングス	1,700	2,447.00	4,159,900	
バロックジャパンリミテッド	7,400	1,122.00	8,302,800	
クスリのアオキホールディングス	10,400	6,970.00	72,488,000	
力の源ホールディングス	4,900	1,136.00	5,566,400	
スシローグローバルホールディングス	11,400	10,030.00	114,342,000	
L I X I L ビバ	10,400	1,994.00	20,737,600	
メディカルシステムネットワーク	10,400	541.00	5,626,400	
はるやまホールディングス	5,100	882.00	4,498,200	
ノジマ	18,600	2,267.00	42,166,200	
カップ・クリエイト	14,600	1,512.00	22,075,200	

ライトオン	7,800	606.00	4,726,800
良品計画	138,200	2,057.00	284,277,400
三城ホールディングス	11,700	307.00	3,591,900
アドヴァン	16,100	1,220.00	19,642,000
アルビス	4,000	2,271.00	9,084,000
コナカ	12,800	420.00	5,376,000
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,700.00	2,380,000
G - 7ホールディングス	6,200	2,699.00	16,733,800
イオン北海道	10,600	796.00	8,437,600
コジマ	18,300	547.00	10,010,100
ヒマラヤ	3,900	850.00	3,315,000
コーナン商事	14,900	2,472.00	36,832,800
エコス	3,900	1,721.00	6,711,900
ワタミ	12,500	1,320.00	16,500,000
マルシェ	3,000	786.00	2,358,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	249,400	1,814.00	452,411,600
西松屋チェーン	23,000	931.00	21,413,000
ゼンショーホールディングス	49,900	2,427.00	121,107,300
幸楽苑ホールディングス	6,700	2,106.00	14,110,200
ハークスレイ	2,400	1,340.00	3,216,000
サイゼリヤ	17,200	2,727.00	46,904,400
V Tホールディングス	43,500	461.00	20,053,500
魚力	3,000	1,593.00	4,779,000
フジ・コーポレーション	2,800	2,243.00	6,280,400
ユナイテッドアローズ	11,000	2,868.00	31,548,000
ハイデイ日高	15,100	2,049.00	30,939,900
京都きもの友禅	7,200	342.00	2,462,400
コロワイド	34,700	2,322.00	80,573,400
ピーシーデポコーポレーション	14,200	590.00	8,378,000
壱番屋	7,400	6,010.00	44,474,000
P L A N T	3,000	609.00	1,827,000
スギホールディングス	20,800	5,740.00	119,392,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,278.00	10,478,800
スクロール	16,500	390.00	6,435,000
ヨンドシーホールディングス	10,700	2,465.00	26,375,500
ファミリーマート	83,100	2,544.00	211,406,400
木曽路	13,700	3,010.00	41,237,000
S R Sホールディングス	12,500	1,054.00	13,175,000
タカキュー	9,200	185.00	1,702,000
ケーヨー	21,600	567.00	12,247,200
上新電機	12,400	2,499.00	30,987,600
日本瓦斯	16,500	3,475.00	57,337,500

ロイヤルホールディングス	18,200	2,470.00	44,954,000
いなげや	13,000	1,480.00	19,240,000
島忠	19,600	3,190.00	62,524,000
チヨダ	11,000	1,536.00	16,896,000
ライフコーポレーション	7,900	2,487.00	19,647,300
リンガーハット	12,900	2,502.00	32,275,800
MrMaxHD	14,700	487.00	7,158,900
テンアライド	9,600	443.00	4,252,800
AOKIホールディングス	21,000	1,094.00	22,974,000
オークワ	16,400	1,454.00	23,845,600
コメリ	16,100	2,217.00	35,693,700
青山商事	21,600	1,491.00	32,205,600
しまむら	12,100	8,050.00	97,405,000
はせがわ	6,000	401.00	2,406,000
高島屋	75,900	1,227.00	93,129,300
松屋	21,100	806.00	17,006,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,400	1,174.00	57,995,600
近鉄百貨店	4,000	3,735.00	14,940,000
パルコ	9,300	1,848.00	17,186,400
丸井グループ	95,400	2,656.00	253,382,400
アクシアル リテイリング	8,700	3,710.00	32,277,000
イオン	400,300	2,333.00	933,899,900
イズミ	21,200	3,705.00	78,546,000
平和堂	21,200	2,019.00	42,802,800
フジ	12,600	1,853.00	23,347,800
ヤオコー	11,800	5,630.00	66,434,000
ゼビオホールディングス	12,700	1,261.00	16,014,700
ケーズホールディングス	100,500	1,359.00	136,579,500
Olympicグループ	5,700	622.00	3,545,400
日産東京販売ホールディングス	16,000	283.00	4,528,000
Genky DrugStores	5,200	2,230.00	11,596,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,900	1,332.00	2,530,800
総合メディカルホールディングス	9,200	2,140.00	19,688,000
ブックオフグループホールディングス	6,100	1,040.00	6,344,000
アインホールディングス	14,000	6,470.00	90,580,000
元気寿司	2,700	3,155.00	8,518,500
ヤマダ電機	317,200	560.00	177,632,000
アーランドサカモト	16,500	1,251.00	20,641,500
ニトリホールディングス	45,000	17,230.00	775,350,000
グルメ杵屋	7,600	1,229.00	9,340,400
愛眼	8,300	250.00	2,075,000
ケーユーホールディングス	5,700	930.00	5,301,000

吉野家ホールディングス	34,200	2,670.00	91,314,000
松屋フーズホールディングス	5,000	4,975.00	24,875,000
サガミホールディングス	14,100	1,370.00	19,317,000
関西スーパーマーケット	8,800	1,040.00	9,152,000
王将フードサービス	7,700	6,690.00	51,513,000
プレナス	11,800	1,998.00	23,576,400
ミニストップ	7,800	1,556.00	12,136,800
アークス	21,400	2,045.00	43,763,000
パローホールディングス	23,100	2,022.00	46,708,200
ベルク	5,200	5,850.00	30,420,000
大庄	5,700	1,662.00	9,473,400
ファーストリテイリング	13,900	63,180.00	878,202,000
サンドラッグ	39,200	3,965.00	155,428,000
サクスパー ホールディングス	9,000	898.00	8,082,000
ヤマザワ	2,600	1,692.00	4,399,200
やまや	2,200	2,252.00	4,954,400
ペルーナ	22,600	684.00	15,458,400
島根銀行	2,100	648.00	1,360,800
じもとホールディングス	70,400	111.00	7,814,400
めぶきフィナンシャルグループ	541,200	255.00	138,006,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,100	1,369.00	19,302,900
九州フィナンシャルグループ	170,900	469.00	80,152,100
ゆうちょ銀行	295,100	1,031.00	304,248,100
富山第一銀行	24,800	331.00	8,208,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	612,600	433.00	265,255,800
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	776.00	55,096,000
関西みらいフィナンシャルグループ	61,100	657.00	40,142,700
三十三フィナンシャルグループ	9,700	1,642.00	15,927,400
第四北越フィナンシャルグループ	18,100	2,864.00	51,838,400
新生銀行	76,400	1,686.00	128,810,400
あおぞら銀行	62,100	2,908.00	180,586,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,169,900	582.00	4,172,881,800
りそなホールディングス	1,143,000	466.70	533,438,100
三井住友トラスト・ホールディングス	196,900	4,164.00	819,891,600
三井住友フィナンシャルグループ	720,300	3,957.00	2,850,227,100
千葉銀行	358,300	629.00	225,370,700
群馬銀行	204,700	367.00	75,124,900
武蔵野銀行	15,500	1,787.00	27,698,500
千葉興業銀行	28,600	376.00	10,753,600
筑波銀行	43,300	221.00	9,569,300
七十七銀行	35,200	1,690.00	59,488,000
青森銀行	8,100	2,786.00	22,566,600

秋田銀行	6,700	2,101.00	14,076,700
山形銀行	11,700	1,500.00	17,550,000
岩手銀行	6,800	2,672.00	18,169,600
東邦銀行	93,100	258.00	24,019,800
東北銀行	5,000	1,024.00	5,120,000
みちのく銀行	6,700	1,468.00	9,835,600
ふくおかフィナンシャルグループ	87,700	2,010.00	176,277,000
静岡銀行	257,900	783.00	201,935,700
十六銀行	13,100	2,370.00	31,047,000
スルガ銀行	106,600	453.00	48,289,800
八十二銀行	251,400	444.00	111,621,600
山梨中央銀行	12,100	1,044.00	12,632,400
大垣共立銀行	20,600	2,286.00	47,091,600
福井銀行	8,900	1,722.00	15,325,800
北國銀行	10,700	3,260.00	34,882,000
清水銀行	4,300	2,120.00	9,116,000
富山銀行	2,000	2,331.00	4,662,000
滋賀銀行	20,900	2,649.00	55,364,100
南都銀行	17,300	2,696.00	46,640,800
百五銀行	93,700	338.00	31,670,600
京都銀行	37,300	4,580.00	170,834,000
紀陽銀行	36,900	1,608.00	59,335,200
ほくほくフィナンシャルグループ	69,300	1,106.00	76,645,800
広島銀行	153,800	511.00	78,591,800
山陰合同銀行	61,800	633.00	39,119,400
中国銀行	89,600	1,049.00	93,990,400
鳥取銀行	3,500	1,360.00	4,760,000
伊予銀行	148,600	587.00	87,228,200
百十四銀行	11,100	2,016.00	22,377,600
四国銀行	15,800	989.00	15,626,200
阿波銀行	17,000	2,351.00	39,967,000
大分銀行	6,000	2,664.00	15,984,000
宮崎銀行	6,900	2,556.00	17,636,400
佐賀銀行	6,300	1,617.00	10,187,100
沖縄銀行	9,500	3,535.00	33,582,500
琉球銀行	24,000	1,123.00	26,952,000
セブン銀行	347,900	336.00	116,894,400
みずほフィナンシャルグループ	14,153,100	166.30	2,353,660,530
高知銀行	3,800	865.00	3,287,000
山口フィナンシャルグループ	130,000	691.00	89,830,000
長野銀行	3,400	1,676.00	5,698,400
名古屋銀行	8,400	3,300.00	27,720,000

北洋銀行	157,000	227.00	35,639,000
愛知銀行	3,800	3,555.00	13,509,000
中京銀行	4,300	2,232.00	9,597,600
大光銀行	3,600	1,690.00	6,084,000
愛媛銀行	14,500	1,161.00	16,834,500
トマト銀行	4,000	1,057.00	4,228,000
京葉銀行	44,400	605.00	26,862,000
栃木銀行	50,300	216.00	10,864,800
北日本銀行	3,200	2,236.00	7,155,200
東和銀行	18,300	831.00	15,207,300
福島銀行	9,800	252.00	2,469,600
大東銀行	5,400	645.00	3,483,000
トモニホールディングス	80,500	386.00	31,073,000
フィデアホールディングス	101,100	128.00	12,940,800
池田泉州ホールディングス	119,800	204.00	24,439,200
F P G	32,300	1,048.00	33,850,400
マーキュリアインベストメント	4,800	753.00	3,614,400
S B Iホールディングス	116,400	2,449.00	285,063,600
ジャフコ	16,000	4,130.00	66,080,000
大和証券グループ本社	836,000	573.40	479,362,400
野村ホールディングス	1,833,000	576.00	1,055,808,000
岡三証券グループ	89,100	389.00	34,659,900
丸三証券	31,300	526.00	16,463,800
東洋証券	38,300	153.00	5,859,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120,100	352.00	42,275,200
光世証券	2,700	655.00	1,768,500
水戸証券	30,800	232.00	7,145,600
いちよし証券	19,700	659.00	12,982,300
松井証券	59,700	887.00	52,953,900
だいこう証券ビジネス	5,300	703.00	3,725,900
マネックスグループ	79,200	295.00	23,364,000
極東証券	14,200	775.00	11,005,000
岩井コスモホールディングス	10,000	1,325.00	13,250,000
藍澤証券	18,900	757.00	14,307,300
マネーパートナーズグループ	11,700	246.00	2,878,200
スパークス・グループ	36,700	274.00	10,055,800
かんぽ生命保険	36,900	1,994.00	73,578,600
S O M P Oホールディングス	195,800	4,285.00	839,003,000
アニコム ホールディングス	8,600	3,895.00	33,497,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	272,300	3,694.00	1,005,876,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	85,600	2,572.00	220,163,200
第一生命ホールディングス	589,400	1,742.50	1,027,029,500

東京海上ホールディングス	372,500	6,126.00	2,281,935,000
T & Dホールディングス	311,300	1,290.00	401,577,000
アドバンスクリエイト	2,400	1,884.00	4,521,600
全国保証	29,400	4,730.00	139,062,000
ジェイリース	2,900	424.00	1,229,600
イントラスト	3,600	883.00	3,178,800
日本モーゲージサービス	2,100	2,135.00	4,483,500
C a s a	3,600	1,556.00	5,601,600
アルヒ	16,600	2,288.00	37,980,800
プレミアグループ	5,600	2,262.00	12,667,200
クレディセゾン	73,000	1,905.00	139,065,000
芙蓉総合リース	10,900	7,260.00	79,134,000
みずほリース	16,100	3,430.00	55,223,000
東京センチュリー	21,000	5,800.00	121,800,000
日本証券金融	45,900	523.00	24,005,700
アイフル	158,900	314.00	49,894,600
リコーリース	8,200	4,475.00	36,695,000
イオンフィナンシャルサービス	63,700	1,759.00	112,048,300
アコム	209,300	521.00	109,045,300
ジャックス	11,500	2,724.00	31,326,000
オリエントコーポレーション	281,700	182.00	51,269,400
日立キャピタル	24,600	3,030.00	74,538,000
アプラスフィナンシャル	50,000	102.00	5,100,000
オリックス	651,500	1,876.00	1,222,214,000
三菱UFJリース	264,300	713.00	188,445,900
九州リースサービス	5,100	601.00	3,065,100
日本取引所グループ	298,900	2,001.00	598,098,900
イー・ギャランティ	11,100	1,366.00	15,162,600
アサックス	5,400	743.00	4,012,200
NECキャピタルソリューション	4,200	2,721.00	11,428,200
いちご	135,900	473.00	64,280,700
日本駐車場開発	124,400	145.00	18,038,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,300	1,764.00	11,113,200
ヒューリック	223,600	1,329.00	297,164,400
三栄建築設計	5,100	1,512.00	7,711,200
野村不動産ホールディングス	63,800	2,769.00	176,662,200
三重交通グループホールディングス	23,600	617.00	14,561,200
サムティ	15,500	1,919.00	29,744,500
ディア・ライフ	16,100	611.00	9,837,100
エー・ディー・ワークス	193,200	30.00	5,796,000
日本商業開発	7,500	1,731.00	12,982,500
ユニゾホールディングス	14,600	5,190.00	75,774,000

ハウスコム	2,300	1,583.00	3,640,900
日本管理センター	8,100	1,322.00	10,708,200
サンセイランディック	4,800	918.00	4,406,400
エストラスト	1,400	867.00	1,213,800
フージャースホールディングス	20,800	723.00	15,038,400
オープンハウス	30,700	3,040.00	93,328,000
東急不動産ホールディングス	285,300	770.00	219,681,000
飯田グループホールディングス	87,700	1,960.00	171,892,000
イーランド	3,500	860.00	3,010,000
ムゲンエステート	9,300	761.00	7,077,300
ハウズドゥ	5,700	1,430.00	8,151,000
シーアールイー	4,000	1,183.00	4,732,000
ケイアイスター不動産	4,000	2,052.00	8,208,000
グッドコムアセット	3,200	2,365.00	7,568,000
ジェイ・エス・ビー	1,400	5,360.00	7,504,000
テンポイノベーション	3,900	940.00	3,666,000
パーク24	56,500	2,811.00	158,821,500
パラカ	3,400	2,019.00	6,864,600
三井不動産	514,300	2,773.50	1,426,411,050
三菱地所	730,500	2,120.50	1,549,025,250
平和不動産	19,600	3,150.00	61,740,000
東京建物	114,700	1,749.00	200,610,300
ダイビル	28,100	1,348.00	37,878,800
京阪神ビルディング	18,000	1,518.00	27,324,000
住友不動産	234,600	3,838.00	900,394,800
テーオーシー	22,200	930.00	20,646,000
東京楽天地	2,000	6,140.00	12,280,000
スターツコーポレーション	14,700	2,761.00	40,586,700
フジ住宅	14,300	696.00	9,952,800
空港施設	13,300	556.00	7,394,800
明和地所	8,300	636.00	5,278,800
ゴールドクレスト	9,000	2,090.00	18,810,000
エスリード	4,800	2,090.00	10,032,000
日神グループホールディングス	18,300	555.00	10,156,500
日本エスコン	20,500	956.00	19,598,000
タカラレーベン	50,700	495.00	25,096,500
A V A N T I A	7,400	1,033.00	7,644,200
イオンモール	53,000	2,034.00	107,802,000
毎日コムネット	4,000	949.00	3,796,000
ファースト住建	5,700	1,250.00	7,125,000
カチタス	13,200	4,660.00	61,512,000
トーセイ	15,400	1,507.00	23,207,800

穴吹興産	3,100	1,746.00	5,412,600
サンフロンティア不動産	15,600	1,310.00	20,436,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	1,206.00	12,663,000
インテリックス	5,000	757.00	3,785,000
ランドビジネス	4,400	726.00	3,194,400
日本社宅サービス	4,000	1,137.00	4,548,000
グランディハウス	11,300	509.00	5,751,700
日本空港ビルディング	33,500	5,490.00	183,915,000
日本工営	6,800	3,635.00	24,718,000
L I F U L L	35,400	543.00	19,222,200
ジェイエイシーリクルートメント	6,800	1,807.00	12,287,600
日本M&Aセンター	76,300	4,035.00	307,870,500
メンバーズ	3,000	2,061.00	6,183,000
中広	1,300	546.00	709,800
UTグループ	11,900	3,125.00	37,187,500
アイティメディア	3,200	899.00	2,876,800
タケエイ	9,800	1,217.00	11,926,600
E・Jホールディングス	1,300	1,925.00	2,502,500
ビーネックスグループ	11,200	1,366.00	15,299,200
コシダカホールディングス	24,400	1,733.00	42,285,200
アルトナー	2,600	930.00	2,418,000
パソナグループ	12,400	1,586.00	19,666,400
C D S	2,600	1,582.00	4,113,200
リンクアンドモチベーション	22,400	617.00	13,820,800
G C A	12,300	980.00	12,054,000
エス・エム・エス	31,400	2,954.00	92,755,600
サニーサイドアップグループ	2,400	1,248.00	2,995,200
パーソルホールディングス	100,900	2,085.00	210,376,500
リニカル	5,000	1,131.00	5,655,000
クックパッド	35,600	358.00	12,744,800
エスクリ	3,300	820.00	2,706,000
アイ・ケイ・ケイ	5,100	743.00	3,789,300
学情	3,600	2,254.00	8,114,400
スタジオアリス	5,100	1,980.00	10,098,000
シミックホールディングス	5,600	1,838.00	10,292,800
エプコ	1,700	1,403.00	2,385,100
N J S	2,300	1,874.00	4,310,200
総合警備保障	40,200	5,970.00	239,994,000
カカクコム	75,600	2,961.00	223,851,600
アイロムグループ	3,600	1,434.00	5,162,400
セントケア・ホールディング	6,800	486.00	3,304,800
サイネックス	1,900	700.00	1,330,000

ルネサンス	5,700	1,752.00	9,986,400
ディップ	14,300	3,455.00	49,406,500
オプトホールディング	5,500	1,637.00	9,003,500
ツクイ	24,000	617.00	14,808,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,398.00	3,634,800
ベネフィット・ワン	27,600	2,299.00	63,452,400
エムスリー	222,500	3,260.00	725,350,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	595.00	3,927,000
プラス	1,300	819.00	1,064,700
アウトソーシング	57,800	1,085.00	62,713,000
ウェルネット	9,700	710.00	6,887,000
ワールドホールディングス	3,400	1,799.00	6,116,600
ディー・エヌ・エー	49,500	1,854.00	91,773,000
博報堂D Yホールディングス	140,400	1,697.00	238,258,800
ぐるなび	17,700	970.00	17,169,000
タカミヤ	10,900	678.00	7,390,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	1,130.00	7,684,000
ファンコミュニケーションズ	28,000	473.00	13,244,000
ライク	4,100	1,627.00	6,670,700
ビジネス・ブレークスルー	4,600	429.00	1,973,400
エスプール	19,600	860.00	16,856,000
WDBホールディングス	4,600	2,760.00	12,696,000
ティア	6,100	598.00	3,647,800
C D G	1,200	1,440.00	1,728,000
バリューコマース	5,700	2,525.00	14,392,500
インフォマート	110,700	976.00	108,043,200
J Pホールディングス	32,100	331.00	10,625,100
エコナックホールディングス	19,100	147.00	2,807,700
E P Sホールディングス	15,300	1,404.00	21,481,200
レッグス	2,600	1,690.00	4,394,000
プレステージ・インターナショナル	37,900	1,006.00	38,127,400
アミューズ	5,500	3,020.00	16,610,000
ドリームインキュベータ	3,100	1,570.00	4,867,000
クイック	6,300	1,605.00	10,111,500
T A C	6,600	228.00	1,504,800
ケネディクス	96,200	563.00	54,160,600
電通グループ	104,000	3,795.00	394,680,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	1,132.00	4,414,800
ぴあ	2,900	4,650.00	13,485,000
イオンファンタジー	3,900	2,541.00	9,909,900
シーティーエス	11,500	726.00	8,349,000
ネクシィーズグループ	3,600	1,817.00	6,541,200

みらかホールディングス	28,300	2,744.00	77,655,200
アルプス技研	9,000	1,979.00	17,811,000
ダイオーズ	2,100	1,402.00	2,944,200
日本空調サービス	10,700	807.00	8,634,900
オリエンタルランド	107,300	15,385.00	1,650,810,500
ダスキン	26,000	3,060.00	79,560,000
明光ネットワークジャパン	12,000	1,005.00	12,060,000
ファルコホールディングス	5,600	1,785.00	9,996,000
ラウンドワン	28,300	1,088.00	30,790,400
リゾートトラスト	46,300	1,809.00	83,756,700
ビー・エム・エル	13,000	3,050.00	39,650,000
ワタベウェディング	1,800	559.00	1,006,200
りらいあコミュニケーションズ	18,300	1,492.00	27,303,600
リソー教育	46,400	372.00	17,260,800
早稲田アカデミー	3,400	1,190.00	4,046,000
ユー・エス・エス	113,000	2,021.00	228,373,000
東京個別指導学院	3,700	740.00	2,738,000
サイバーエージェント	58,100	3,850.00	223,685,000
楽天	470,500	921.00	433,330,500
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,160.00	6,148,000
テー・オー・ダブリュー	9,000	1,080.00	9,720,000
山田コンサルティンググループ	5,000	1,605.00	8,025,000
セントラルスポーツ	3,800	3,185.00	12,103,000
フルキャストホールディングス	10,100	2,531.00	25,563,100
エン・ジャパン	18,000	4,630.00	83,340,000
リソルホールディングス	1,100	4,230.00	4,653,000
テクノプロ・ホールディングス	20,200	7,770.00	156,954,000
アトラ	2,600	339.00	881,400
インターワークス	2,100	570.00	1,197,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	5,660.00	23,206,000
Keeper 技研	3,800	1,329.00	5,050,200
ファーストロジック	2,500	620.00	1,550,000
三機サービス	2,200	1,069.00	2,351,800
Gunosy	7,100	1,217.00	8,640,700
デザインワン・ジャパン	2,400	333.00	799,200
イー・ガーディアン	5,200	2,054.00	10,680,800
リブセンス	6,900	293.00	2,021,700
ジャパンマテリアル	31,100	1,785.00	55,513,500
ベクトル	12,700	1,223.00	15,532,100
ウチヤマホールディングス	5,200	555.00	2,886,000
チャーム・ケア・コーポレーション	7,500	955.00	7,162,500
ライクキッズ	2,300	819.00	1,883,700

キャリアリンク	3,500	647.00	2,264,500
I B J	7,000	1,306.00	9,142,000
アサンテ	4,100	2,031.00	8,327,100
N・フィールド	7,100	643.00	4,565,300
バリューHR	2,000	3,250.00	6,500,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,200	4,595.00	33,084,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	2,095.00	8,170,500
E R Iホールディングス	3,000	770.00	2,310,000
アビスト	1,600	2,738.00	4,380,800
シグマクシス	7,000	2,318.00	16,226,000
ウィルグループ	6,700	1,250.00	8,375,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	14,400	225.00	3,240,000
リクルートホールディングス	722,900	4,353.00	3,146,783,700
エラン	6,000	1,720.00	10,320,000
土木管理総合試験所	4,600	455.00	2,093,000
ネットマーケティング	3,800	1,065.00	4,047,000
日本郵政	827,200	1,023.00	846,225,600
ベルシステム24ホールディングス	17,000	1,636.00	27,812,000
鎌倉新書	7,600	1,713.00	13,018,800
S M N	1,700	884.00	1,502,800
一蔵	1,200	818.00	981,600
L I T A L I C O	3,500	2,656.00	9,296,000
グローバルキッズCOMPANY	1,700	775.00	1,317,500
エアトリ	4,600	1,934.00	8,896,400
アトラエ	2,600	3,875.00	10,075,000
ストライク	3,800	5,530.00	21,014,000
ソラスト	27,900	1,235.00	34,456,500
セラク	3,300	1,260.00	4,158,000
インソース	4,900	3,730.00	18,277,000
ベйкаレント・コンサルティング	6,100	7,940.00	48,434,000
Orchestra Holdings	2,100	1,409.00	2,958,900
アイモバイル	3,300	779.00	2,570,700
キャリアインデックス	4,400	416.00	1,830,400
M S - J a p a n	3,300	1,527.00	5,039,100
船場	1,700	1,101.00	1,871,700
グレイステクノロジー	4,600	2,988.00	13,744,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,700	2,684.00	28,718,800
フルテック	1,500	1,359.00	2,038,500
グリーンズ	3,900	1,045.00	4,075,500
ツナググループ・ホールディングス	1,300	803.00	1,043,900
GameWith	2,400	777.00	1,864,800
ソウルドアウト	1,600	2,018.00	3,228,800

MS&Consulting	1,500	1,071.00	1,606,500
日総工産	6,800	1,118.00	7,602,400
キュービーネットホールディングス	6,200	2,415.00	14,973,000
RPAホールディングス	5,800	1,085.00	6,293,000
スプリックス	3,500	1,135.00	3,972,500
マネジメントソリューションズ	1,100	3,240.00	3,564,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	990.00	5,148,000
リログループ	55,200	3,055.00	168,636,000
東祥	6,300	2,301.00	14,496,300
エイチ・アイ・エス	15,800	2,773.00	43,813,400
ラックランド	2,400	2,259.00	5,421,600
共立メンテナンス	16,700	4,735.00	79,074,500
イチネンホールディングス	11,400	1,631.00	18,593,400
建設技術研究所	7,000	2,436.00	17,052,000
スペース	6,600	1,272.00	8,395,200
長大	3,800	1,317.00	5,004,600
燦ホールディングス	4,500	1,480.00	6,660,000
スバル興業	600	10,740.00	6,444,000
東京テアトル	4,000	1,385.00	5,540,000
タナベ経営	2,000	1,300.00	2,600,000
ナガワ	3,200	7,720.00	24,704,000
よみうりランド	2,200	4,490.00	9,878,000
東京都競馬	6,600	3,235.00	21,351,000
カナモト	16,600	2,779.00	46,131,400
東京ドーム	41,000	1,090.00	44,690,000
西尾レントオール	10,300	3,105.00	31,981,500
トランス・コスモス	9,600	2,865.00	27,504,000
乃村工藝社	43,300	1,350.00	58,455,000
藤田観光	4,400	2,778.00	12,223,200
KNT-CTホールディングス	6,300	1,453.00	9,153,900
日本管財	10,900	1,991.00	21,701,900
トーカイ	9,800	2,660.00	26,068,000
白洋舎	1,200	2,838.00	3,405,600
セコム	107,100	9,711.00	1,040,048,100
セントラル警備保障	4,900	6,020.00	29,498,000
丹青社	19,100	1,338.00	25,555,800
メイテック	12,500	6,350.00	79,375,000
応用地質	10,900	1,460.00	15,914,000
船井総研ホールディングス	20,900	2,783.00	58,164,700
進学会ホールディングス	4,200	538.00	2,259,600
オオバ	8,000	875.00	7,000,000
いであ	1,900	2,969.00	5,641,100

学究社	3,000	1,449.00	4,347,000	
ベネッセホールディングス	33,700	3,115.00	104,975,500	
イオンディライト	12,500	3,855.00	48,187,500	
ナック	5,700	1,020.00	5,814,000	
ニチイ学館	14,400	1,583.00	22,795,200	
ダイセキ	17,000	3,010.00	51,170,000	
ステップ	3,800	1,629.00	6,190,200	
合 計	123,703,406		259,560,018,180	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

(2020年 2月28日現在)

資産総額	516,304,710円
負債総額	3,028,053円
純資産総額（ - ）	513,276,657円
発行済口数	266,483,319口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9261円
（1万口当たり純資産額）	（19,261円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2020年 2月28日現在)

資産総額	228,093,120,870円
負債総額	692,237,520円
純資産総額（ - ）	227,400,883,350円
発行済口数	139,253,495,530口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6330円
（1万口当たり純資産額）	（16,330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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年 2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2020年 4月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年2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	542	12,905,410
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	84	345,778
単位型公社債投資信託	21	173,541
合計	647	13,424,729

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。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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。

- (2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（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。また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (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	282,407
器具備品	1	79,655	564,981
その他	1	1,912	14,462
有形固定資産合計		118,350	861,851
無形固定資産			
ソフトウェア		210,679	1,487,265
その他		4,377	7,256
無形固定資産合計		215,056	1,494,522
投資その他の資産			
投資有価証券		42,802	11,334,053
関係会社株式		-	4,663,000
長期貸付金		17,088	-
繰延税金資産		248,633	141,789
その他		32,880	32,492
貸倒引当金		17,088	-
投資その他の資産合計		324,317	16,171,335
固定資産合計		657,724	18,527,709
資産合計		30,171,641	59,176,157

（単位：千円）

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

負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157
----------	------------	------------

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	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 (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				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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）を採用しておりましたが、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なっております。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なっております。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なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社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 その他有価証券	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

(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)	18,603,427		
							うち、投資有価証券	13,907,536		
							うち、関係会社株式	4,663,000		
							(承継負債合計)	13,989		
							(差引純資産)	18,589,438		
							(分割対価)	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おりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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)
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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826
固定資産		
有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780
資産合計		62,606
負債の部		
流動負債		
未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216
固定負債		
退職給付引当金		582
資産除去債務		132
その他		3
固定負債合計		718

負債合計

9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,961
運用受託報酬		5,393
その他営業収益		253
営業収益合計		22,608
営業費用		11,776
一般管理費	1	4,411
営業利益		6,421
営業外収益	2	1,110
営業外費用	3	456
経常利益		7,075
税引前中間純利益		7,075
法人税、住民税及び事業税		2,197
法人税等調整額		18
法人税等合計		2,179

中間純利益

4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 （純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間

（自 2019年4月1日
至 2019年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

7．ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日
----------------------	------	-------	---------	------------	------------

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません((注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(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	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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。

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

(1)現金及び預金

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

(2)金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額:投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円)は、市場

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

１．子会社株式

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

２．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

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

（デリバティブ取引関係）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引				
為替予約取引				
売建				
米ドル	872	-	1	1
英ポンド	52	-	0	0
カナダドル	2	-	0	0
スイスフラン	6	-	0	0
香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2
合計	1,285	-	5	5

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(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。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,500	-	5
	英ポンド		2,259	-	41
	カナダドル		22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
	ユーロ		113	-	1
	合計			5,046	-

(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。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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中間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中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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、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

2020年4月22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。

再信託受託会社である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社及び資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 4月22日	有価証券届出書
2019年 4月22日	有価証券報告書
2019年10月21日	有価証券届出書

2019年10月21日

半期報告書

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

2020年3月19日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドの2019年1月23日から2020年1月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドの2020年1月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤 澤	孝 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹 内	知 明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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に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、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。