

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年9月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンドA
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンドA

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2020年 9月11日から2021年 3月10日までとします。

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

れます。

( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する

金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  日本	ファミリー ファンド  ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニ ア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ  中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の



資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

#### < ファンドの特色 >

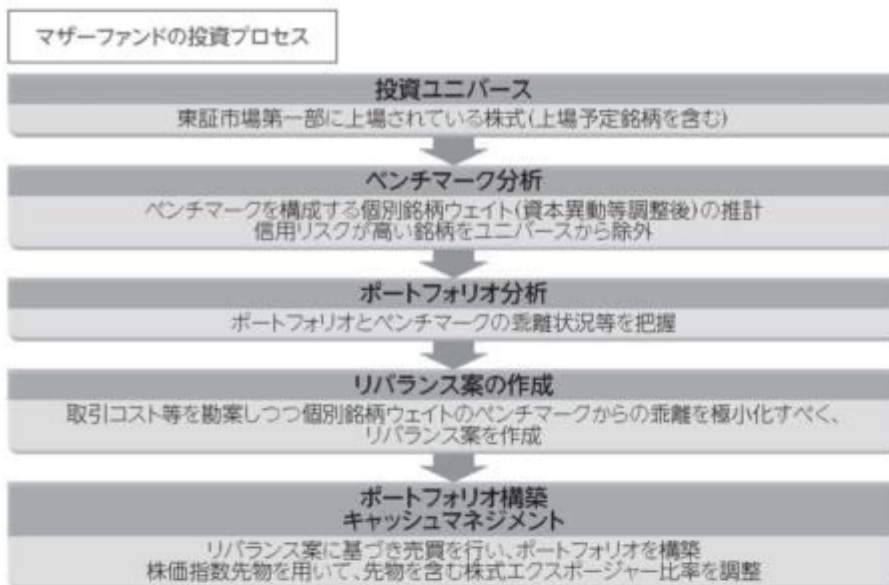
## 東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>(注)</sup>とは

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

### (注) TOPIX(東証株価指数)の著作権等について

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### ファンドのしくみ

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



### 分配方針

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

### 主な投資制限

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

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

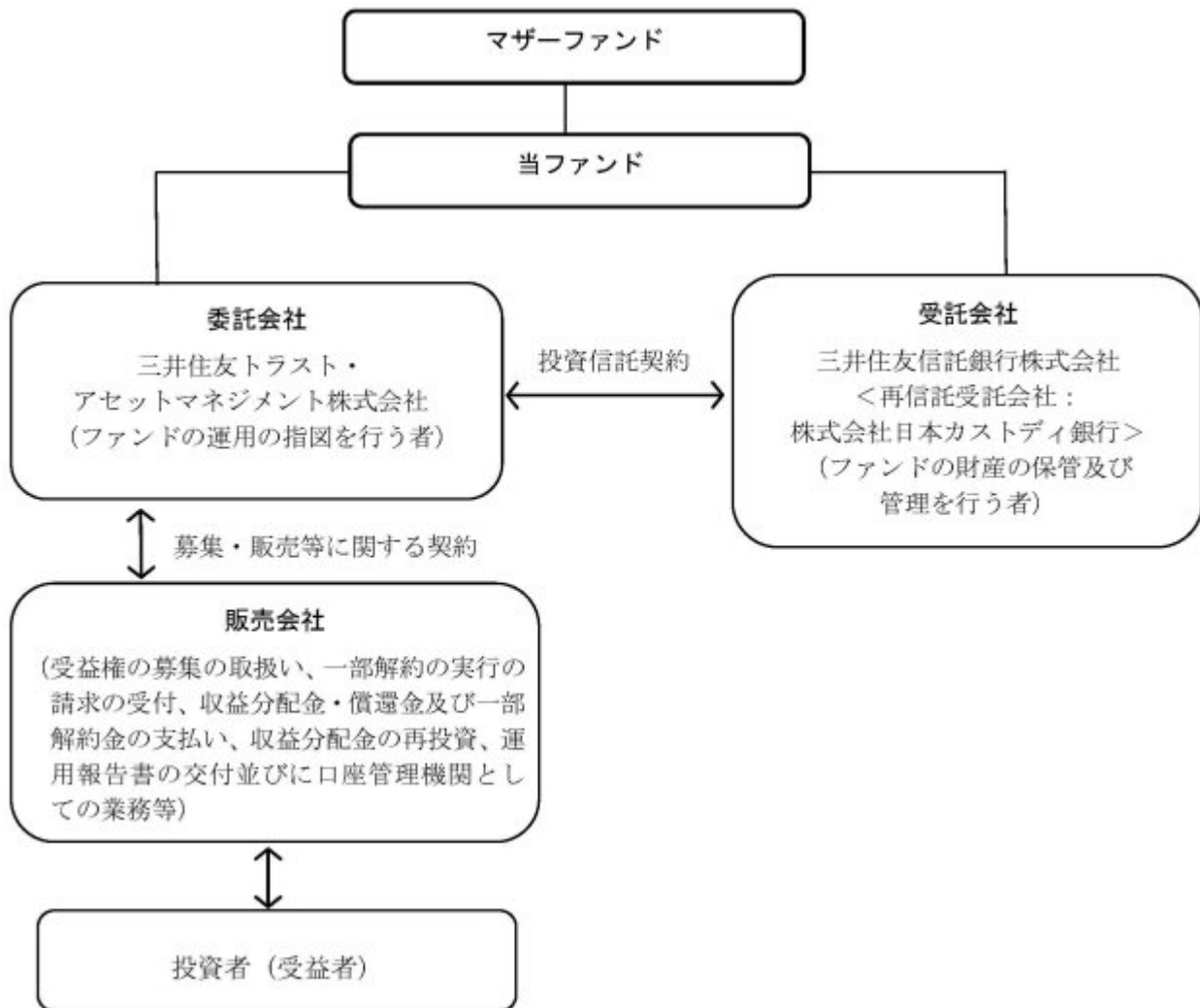
## (2) 【ファンドの沿革】

2002年12月11日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2020年 6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

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

## ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 運用方針

当ファンドは、主としてわが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

### 投資態度

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - A．有価証券
  - B．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（５）投資制限＜約款に定める投資制限＞J．、K．及びL．に定めるものに限りません。）
  - C．金銭債権（上記A．、B．及び下記D．に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - D．約束手形（上記A．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産

## A．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

A．株券又は新株引受権証書

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

E．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

F．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

G．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

H．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書

I．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

J．コマーシャル・ペーパー

K．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

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

M．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）

N．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

O．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

P．オプションを表示する証券又は証書（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。）

Q．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。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

T．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

U．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2．運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

### 3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

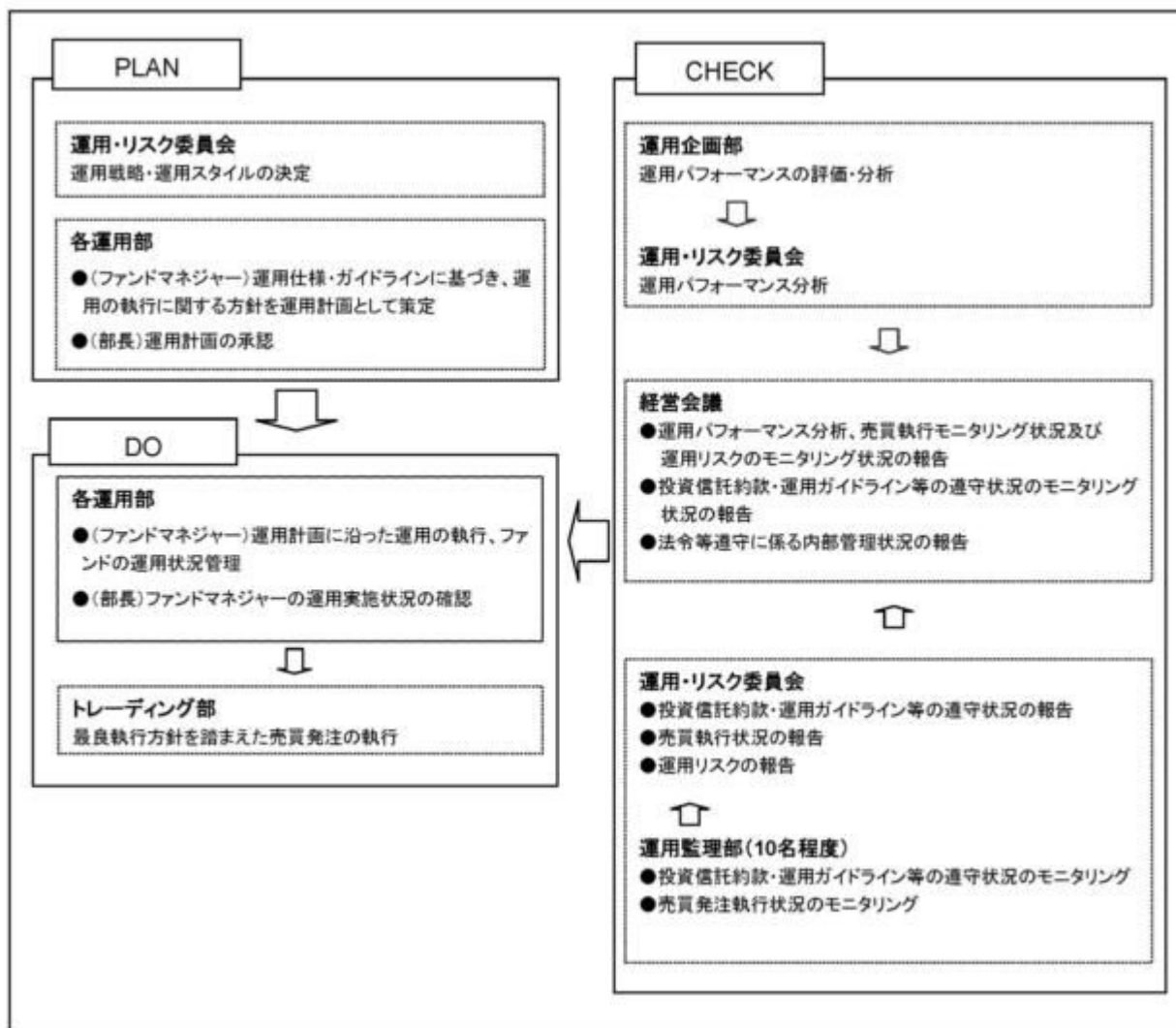
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### （3）【運用体制】

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





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

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

#### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は12月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

#### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

#### C．新株引受権証券等への投資割合

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

#### D．投資信託証券への投資割合

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

#### E．同一銘柄の株式への投資割合

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

#### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

#### G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

#### H．投資する株式等の範囲

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

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

#### I．信用取引の運用指図

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

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の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

ニ．上記ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時

価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### J．先物取引等の運用指図

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

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

#### K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

#### L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

#### M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

#### N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有していない公社債又は、下記ロ．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

囲内とします。

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

#### 〇．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

#### Ｑ．再投資の指図

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

#### Ｒ．資金の借入れ

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### Ｓ．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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

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

価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

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

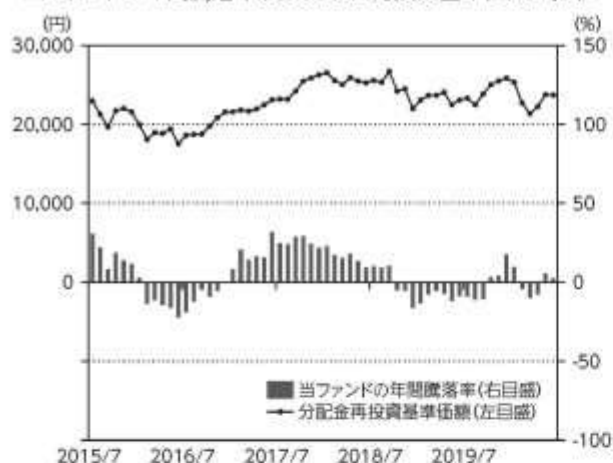
## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2015年7月～2020年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

### 各資産クラスの指数について

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全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公債固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及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 JPEIグローバル・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・ロー・レティレーション・ファンド(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】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

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

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

## (3) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.429%（税抜 0.39%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.242% (税抜 0.22%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.132% (税抜 0.12%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料



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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年6月30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6月30日現在の状況について記載してあります。

#### 【DC日本株式インデックスファンドA】

##### （１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,817,387,296	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		903,557	0.05
合計(純資産総額)		1,818,290,853	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	1,063,670,430	1.8343	1,951,090,670	1.7086	1,817,387,296	99.95

(注1)国ノ地域は、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8期計算期間末 (2010年12月10日)	1,201,314,433	1,201,314,433	11,341	11,341
第9期計算期間末 (2011年12月12日)	1,089,966,022	1,089,966,022	9,711	9,711
第10期計算期間末 (2012年12月10日)	1,172,924,685	1,172,924,685	10,460	10,460
第11期計算期間末 (2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末 (2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末 (2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末 (2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末 (2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
第16期計算期間末 (2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
第17期計算期間末 (2019年12月10日)	2,105,502,404	2,105,502,404	25,822	25,822
2019年 6月末日	1,926,764,500		23,085	
7月末日	1,940,074,979		23,287	
8月末日	1,876,905,607		22,494	
9月末日	1,980,614,937		23,842	
10月末日	2,066,110,153		25,024	
11月末日	2,089,889,718		25,504	
12月末日	2,119,406,025		25,863	
2020年 1月末日	2,058,127,124		25,301	
2月末日	1,811,625,001		22,696	

3月末日	1,651,378,093		21,337
4月末日	1,741,732,397		22,255
5月末日	1,871,916,240		23,760
6月末日	1,818,290,853		23,714

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	3.4
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	14.4
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	7.7
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	10.5
第18期中間計算期間	2019年12月11日～2020年 6月10日	4.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
--	-----	---------	---------	-----------

第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	219,646,942	257,914,603	1,059,276,904
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	222,832,492	159,705,810	1,122,403,586
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	232,065,601	233,152,933	1,121,316,254
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	109,110,724	139,292,136	815,389,267
第18期中間計算期間	2019年12月11日～2020年6月10日	122,081,367	156,357,037	781,113,597

(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	238,743,990,890	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,320,523,071	1.37
合計(純資産総額)		242,064,513,961	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,257,265,000	1.35

(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	1,218,100	7,743.48	9,432,339,082	6,762.00	8,236,792,200	3.40
日本	株式	ソニー	電気機器	683,900	7,859.27	5,374,960,003	7,384.00	5,049,917,600	2.09
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	850,000	4,839.79	4,113,826,688	5,450.00	4,632,500,000	1.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,900	39,521.96	3,908,722,142	45,030.00	4,453,467,000	1.84
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,432,000	2,816.66	4,033,470,830	2,515.50	3,602,196,000	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	908,300	4,346.52	3,947,944,284	3,848.00	3,495,138,400	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	66,900	43,032.03	2,878,843,058	48,010.00	3,211,869,000	1.33
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,365,300	571.98	4,212,844,231	421.60	3,105,210,480	1.28
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	747,400	4,279.49	3,198,497,720	3,682.00	2,751,926,800	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	312,400	7,430.50	2,321,290,851	8,806.00	2,750,994,400	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	781,000	3,261.12	2,546,934,720	3,234.00	2,525,754,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	139,100	16,133.50	2,244,170,988	17,335.00	2,411,298,500	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	859,500	2,994.76	2,574,000,900	2,755.50	2,368,352,250	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	183,600	12,619.32	2,316,907,479	12,595.00	2,312,442,000	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	744,700	3,889.90	2,896,813,649	3,032.00	2,257,930,400	0.93
日本	株式	花王	化学	261,400	9,112.12	2,381,909,410	8,540.00	2,232,356,000	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	216,600	10,953.30	2,372,485,263	10,260.00	2,222,316,000	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	766,100	3,099.28	2,374,363,379	2,882.00	2,207,900,200	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	320,700	6,644.52	2,130,898,956	6,316.00	2,025,541,200	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	102,700	20,364.53	2,091,437,840	19,260.00	1,978,002,000	0.82
日本	株式	中外製薬	医薬品	341,400	3,573.95	1,220,146,726	5,765.00	1,968,171,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,630,600	163.64	2,394,232,848	132.20	1,934,165,320	0.80
日本	株式	S M C	機械	34,300	52,291.31	1,793,592,025	55,180.00	1,892,674,000	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	262,800	7,741.12	2,034,367,600	7,196.00	1,891,108,800	0.78
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,300	24,855.78	1,722,506,060	26,440.00	1,832,292,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	380,700	6,033.29	2,296,876,746	4,698.00	1,788,528,600	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	524,600	4,451.15	2,335,078,385	3,403.00	1,785,213,800	0.74
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	752,000	2,567.89	1,931,059,952	2,321.50	1,745,768,000	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	946,500	1,875.60	1,775,263,182	1,799.50	1,703,226,750	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	705,000	2,863.44	2,018,725,200	2,270.00	1,600,350,000	0.66

(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	0.19

建設業	2.56	
食料品	3.88	
繊維製品	0.50	
パルプ・紙	0.23	
化学	7.21	
医薬品	6.80	
石油・石炭製品	0.41	
ゴム製品	0.62	
ガラス・土石製品	0.76	
鉄鋼	0.56	
非鉄金属	0.67	
金属製品	0.54	
機械	5.21	
電気機器	14.91	
輸送用機器	7.18	
精密機器	2.61	
その他製品	2.46	
電気・ガス業	1.54	
陸運業	3.96	
海運業	0.13	
空運業	0.34	
倉庫・運輸関連業	0.18	
情報・通信業	9.82	
卸売業	4.41	
小売業	4.92	
銀行業	4.88	
証券、商品先物取引業	0.77	
保険業	1.97	
その他金融業	1.12	
不動産業	1.99	
サービス業	5.21	
	小計	98.63
合計		98.63

(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	209円		3,311,684,650	3,257,265,000	1.35

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2002年12月11日

作成基準日：2020年6月30日

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 23,714円

純資産総額 18.18億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2015年12月	0円
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

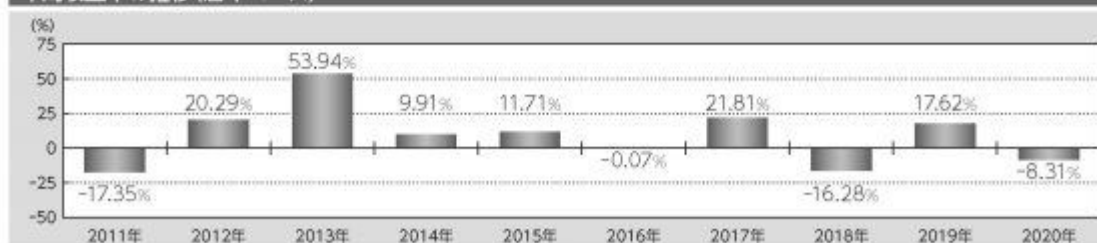
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.4%
ソニー	日本	株式	電気機器	2.1%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.9%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
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	1.4%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.1%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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基づき、振り込まれることとなります。

#### < 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12月11日設定）

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

#### （4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年12月11日から翌年12月10日までとすることを原則とします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### （1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

##### （2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4 【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

#### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

#### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

#### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(2018年12月11日から2019年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【DC日本株式インデックスファンドA】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2018年12月10日現在)	第17期 (2019年12月10日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	5,374,048	5,197,317
親投資信託受益証券	1,974,354,131	2,104,448,858
未収入金	3,337,244	3,903,432
流動資産合計	1,983,065,423	2,113,549,607
<b>資産合計</b>	1,983,065,423	2,113,549,607
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	3,251,708	3,850,441
未払受託者報酬	570,880	538,052
未払委託者報酬	3,881,892	3,658,709
未払利息	15	1
その他未払費用	65	-
流動負債合計	7,704,560	8,047,203
<b>負債合計</b>	7,704,560	8,047,203
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	845,570,679	815,389,267
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,129,790,184	1,290,113,137
(分配準備積立金)	584,105,376	540,690,655
元本等合計	1,975,360,863	2,105,502,404
<b>純資産合計</b>	1,975,360,863	2,105,502,404
<b>負債純資産合計</b>	1,983,065,423	2,113,549,607

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	2017年12月12日 至 2018年12月10日	自	2018年12月11日 至 2019年12月10日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		229,626,981		209,484,080
営業収益合計		229,626,981		209,484,082
営業費用				
支払利息		3,295		2,183
受託者報酬		1,166,144		1,063,077
委託者報酬		7,929,594		7,228,846
その他費用		181		74
営業費用合計		9,099,214		8,294,180
営業利益又は営業損失（ ）		238,726,195		201,189,902
経常利益又は経常損失（ ）		238,726,195		201,189,902
当期純利益又は当期純損失（ ）		238,726,195		201,189,902
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（ ）		11,561,683		1,914,695
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,365,193,278		1,129,790,184
剰余金増加額又は欠損金減少額		245,142,688		146,371,199
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		245,142,688		146,371,199
剰余金減少額又は欠損金増加額		253,381,270		185,323,453
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		253,381,270		185,323,453
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,129,790,184		1,290,113,137

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2018年12月10日現在)	第17期 (2019年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	845,570,679口	815,389,267口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3361円 (23,361円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5822円 (25,822円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 2017年12月12日 至 2018年12月10日			第17期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,839,864円	費用控除後の配当等収益額	A	45,885,019円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	1,169,330,674円	収益調整金額	C	1,196,972,840円
分配準備積立金額	D	547,265,512円	分配準備積立金額	D	494,805,636円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,753,436,050円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,737,663,495円
当ファンドの期末残存口数	F	845,570,679口	当ファンドの期末残存口数	F	815,389,267口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,736円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	21,310円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第17期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第17期 (2019年12月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第16期	第17期
	自 2017年12月12日 至 2018年12月10日	自 2018年12月11日 至 2019年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	843,966,902円	845,570,679円
期中追加設定元本額	159,092,319円	109,110,724円
期中一部解約元本額	157,488,542円	139,292,136円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 (2018年12月10日現在)	第17期 (2019年12月10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	216,985,345	210,172,817
合計	216,985,345	210,172,817

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,133,618,217	2,104,448,858	
合計		1,133,618,217	2,104,448,858	

(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

項目	2019年12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,562,513,099
株式	234,639,743,500
派生商品評価勘定	2,079,000
未収入金	37,778,950
未収配当金	74,257,120
差入委託証拠金	26,746,200
流動資産合計	237,343,117,869
資産合計	237,343,117,869
負債の部	
流動負債	
前受金	2,079,000
未払金	4,195,504
未払解約金	347,367,819
未払利息	864
その他未払費用	199
流動負債合計	353,643,386
負債合計	353,643,386
純資産の部	
元本等	
元本	127,660,137,704
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	109,329,336,779
元本等合計	236,989,474,483
純資産合計	236,989,474,483
負債純資産合計	237,343,117,869

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,660,137,704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 1.8564円 (1万口当たり純資産額) (18,564円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2019年12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2019年12月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2019年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>



## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年12月11日
期首元本額	129,324,616,612円
期中追加設定元本額	13,428,657,782円
期中一部解約元本額	15,093,136,690円
期末元本額	127,660,137,704円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	725,781,165円
DC日本株式インデックスファンド	323,115,069円
DC日本株式インデックスファンドL	53,572,450,438円
DC日本株式インデックスファンドA	1,133,618,217円
DCバランスファンド30	2,243,301,232円
DCバランスファンド50	3,394,509,560円
DCバランスファンド70	1,765,772,606円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	604,733,459円
日本株式インデックスe	1,744,495,479円
インデックスコレクション（国内株式）	11,185,664,770円
インデックスコレクション（バランス株式30）	7,083,172,146円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,152,144,326円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,627,920,766円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,445,543,562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）	2,290,144,704円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,574,265,730円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	109,572,534円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,067,776,416円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	111,657,340円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	546,598,719円

区分	2019年12月10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）	795,142,921円
バランスV A 25（適格機関投資家専用）	1,253,978,389円
バランスV A 37.5（適格機関投資家専用）	610,839,933円
バランスV A 50 L（適格機関投資家専用）	10,273,519,081円
バランスV A 75（適格機関投資家専用）	879,717,680円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	135,845,151円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,622,148,914円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	43,351,234円
バランスV A 40（適格機関投資家専用）	212,109,143円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,604,217,268円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	78,700,135円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	79,610,223円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	75,597,130円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	873,441,405円
バランスV A 20 L（適格機関投資家専用）	612,966円
バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	421,739,285円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	6,618,069,331円
世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	125,112,042円
国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	63,003,379円
国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	11,637,849円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	169,640,820円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	5,273,995円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2019年12月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	21,997,054,105
合計	21,997,054,105

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2019年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引		うち1年超	(円)

	買建	2,163,231,000	-	2,165,310,000	2,079,000
合計		2,163,231,000	-	2,165,310,000	2,079,000

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,600	2,880.00	13,248,000	
日本水産	131,200	639.00	83,836,800	
マルハニチロ	18,900	2,812.00	53,146,800	
カネコ種苗	4,000	1,499.00	5,996,000	
サカタのタネ	15,600	3,535.00	55,146,000	
ホクト	10,000	2,009.00	20,090,000	
ホクリヨウ	2,000	667.00	1,334,000	
住石ホールディングス	26,500	150.00	3,975,000	
日鉄鉱業	3,000	4,715.00	14,145,000	
三井松島ホールディングス	5,100	1,225.00	6,247,500	
国際石油開発帝石	526,200	1,091.50	574,347,300	
石油資源開発	17,100	3,045.00	52,069,500	
K&Oエナジーグループ	6,400	1,576.00	10,086,400	
ヒノキヤグループ	3,300	2,400.00	7,920,000	
ショーボンドホールディングス	18,700	4,620.00	86,394,000	
ミライト・ホールディングス	39,000	1,677.00	65,403,000	
タマホーム	6,300	1,749.00	11,018,700	
サンヨーホームズ	1,100	684.00	752,400	
日本アクア	5,200	635.00	3,302,000	
ファーストコーポレーション	4,000	656.00	2,624,000	
ベステラ	2,300	1,319.00	3,033,700	
TATERU	27,000	234.00	6,318,000	
スペースバリューホールディングス	16,000	529.00	8,464,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,500	1,078.00	2,695,000	
第一カッター興業	1,600	1,794.00	2,870,400	
安藤・間	78,100	937.00	73,179,700	
東急建設	38,400	795.00	30,528,000	

コムシスホールディングス	46,500	3,240.00	150,660,000
ミサワホーム	9,000	1,183.00	10,647,000
ビーアールホールディングス	14,300	505.00	7,221,500
高松コンストラクショングループ	8,200	2,774.00	22,746,800
東建コーポレーション	4,000	7,270.00	29,080,000
ソネック	1,300	806.00	1,047,800
ヤマウラ	5,700	881.00	5,021,700
大成建設	101,000	4,510.00	455,510,000
大林組	302,900	1,256.00	380,442,400
清水建設	307,400	1,099.00	337,832,600
飛鳥建設	8,700	1,571.00	13,667,700
長谷工コーポレーション	117,300	1,463.00	171,609,900
松井建設	11,900	804.00	9,567,600
銭高組	1,300	4,100.00	5,330,000
鹿島建設	237,800	1,504.00	357,651,200
不動テトラ	7,900	1,736.00	13,714,400
大末建設	3,500	1,000.00	3,500,000
鉄建建設	6,600	2,959.00	19,529,400
西松建設	23,300	2,516.00	58,622,800
三井住友建設	73,200	652.00	47,726,400
大豊建設	6,800	3,035.00	20,638,000
前田建設工業	75,900	1,054.00	79,998,600
佐田建設	6,500	433.00	2,814,500
ナカノフドー建設	8,300	479.00	3,975,700
奥村組	16,400	3,110.00	51,004,000
東鉄工業	13,000	3,325.00	43,225,000
イチケン	2,200	1,813.00	3,988,600
富士ピー・エス	4,500	601.00	2,704,500
浅沼組	3,400	4,505.00	15,317,000
戸田建設	125,800	722.00	90,827,600
熊谷組	14,000	3,390.00	47,460,000
北野建設	1,800	2,700.00	4,860,000
植木組	1,300	2,584.00	3,359,200
矢作建設工業	13,400	815.00	10,921,000
ピーエス三菱	10,000	765.00	7,650,000
日本ハウスホールディングス	20,700	487.00	10,080,900
大東建託	36,300	13,550.00	491,865,000
新日本建設	12,900	984.00	12,693,600
N I P P O	25,100	2,377.00	59,662,700
東亜道路工業	1,900	3,540.00	6,726,000
前田道路	32,100	2,656.00	85,257,600
日本道路	2,900	6,970.00	20,213,000

東亜建設工業	9,400	1,651.00	15,519,400
日本国土開発	17,700	666.00	11,788,200
若築建設	5,400	1,740.00	9,396,000
東洋建設	34,000	535.00	18,190,000
五洋建設	120,100	689.00	82,748,900
世紀東急工業	14,500	923.00	13,383,500
福田組	3,500	5,140.00	17,990,000
住友林業	76,700	1,644.00	126,094,800
日本基礎技術	10,200	420.00	4,284,000
巴コーポレーション	13,400	426.00	5,708,400
大和ハウス工業	299,700	3,433.00	1,028,870,100
ライト工業	17,300	1,639.00	28,354,700
積水ハウス	331,400	2,402.00	796,022,800
日特建設	7,900	872.00	6,888,800
北陸電気工事	5,200	1,132.00	5,886,400
ユアテック	17,300	707.00	12,231,100
四電工	1,600	2,858.00	4,572,800
中電工	12,200	2,641.00	32,220,200
関電工	43,100	1,086.00	46,806,600
きんでん	72,000	1,701.00	122,472,000
東京エネシス	10,100	919.00	9,281,900
トーエネック	3,000	3,855.00	11,565,000
住友電設	8,500	2,552.00	21,692,000
日本電設工業	16,600	2,313.00	38,395,800
協和エクシオ	45,900	2,908.00	133,477,200
新日本空調	8,000	2,230.00	17,840,000
九電工	21,300	3,570.00	76,041,000
三機工業	21,800	1,552.00	33,833,600
日揮ホールディングス	93,200	1,700.00	158,440,000
中外炉工業	3,300	1,844.00	6,085,200
ヤマト	9,700	739.00	7,168,300
太平電業	7,300	2,367.00	17,279,100
高砂熱学工業	26,300	1,978.00	52,021,400
三晃金属工業	1,300	2,659.00	3,456,700
朝日工業社	2,000	3,495.00	6,990,000
明星工業	19,600	957.00	18,757,200
大気社	14,700	3,910.00	57,477,000
ダイダン	7,200	2,715.00	19,548,000
日比谷総合設備	9,700	1,972.00	19,128,400
東芝プラントシステム	23,300	2,663.00	62,047,900
OSJBホールディングス	47,800	275.00	13,145,000
東洋エンジニアリング	12,700	740.00	9,398,000

レイズネクスト	16,200	1,390.00	22,518,000
日本製粉	28,400	1,733.00	49,217,200
日清製粉グループ本社	109,500	1,985.00	217,357,500
日東富士製粉	700	6,460.00	4,522,000
昭和産業	8,900	3,145.00	27,990,500
鳥越製粉	8,600	943.00	8,109,800
中部飼料	11,800	1,487.00	17,546,600
フィード・ワン	65,100	176.00	11,457,600
東洋精糖	1,600	1,166.00	1,865,600
日本甜菜製糖	5,100	2,034.00	10,373,400
三井製糖	8,500	2,346.00	19,941,000
塩水港精糖	10,500	221.00	2,320,500
日新製糖	4,600	2,039.00	9,379,400
森永製菓	22,800	5,530.00	126,084,000
中村屋	2,500	4,510.00	11,275,000
江崎グリコ	28,700	4,910.00	140,917,000
名糖産業	4,700	1,320.00	6,204,000
井村屋グループ	4,100	2,018.00	8,273,800
不二家	5,400	2,217.00	11,971,800
山崎製パン	72,700	1,941.00	141,110,700
第一屋製パン	1,700	983.00	1,671,100
モロゾフ	1,700	4,980.00	8,466,000
亀田製菓	5,500	5,040.00	27,720,000
寿スピリッツ	9,300	7,400.00	68,820,000
カルビー	44,200	3,600.00	159,120,000
森永乳業	17,900	4,500.00	80,550,000
六甲バター	6,400	1,824.00	11,673,600
ヤクルト本社	66,700	6,230.00	415,541,000
明治ホールディングス	64,100	7,490.00	480,109,000
雪印メグミルク	23,300	2,631.00	61,302,300
プリマハム	15,200	2,593.00	39,413,600
日本ハム	37,000	4,620.00	170,940,000
林兼産業	3,200	748.00	2,393,600
丸大食品	10,300	2,368.00	24,390,400
S Foods	7,700	2,924.00	22,514,800
伊藤ハム米久ホールディングス	62,400	726.00	45,302,400
サッポロホールディングス	33,100	2,700.00	89,370,000
アサヒグループホールディングス	203,000	5,149.00	1,045,247,000
キリンホールディングス	411,100	2,477.00	1,018,294,700
宝ホールディングス	72,600	1,049.00	76,157,400
オエノンホールディングス	25,600	406.00	10,393,600
養命酒製造	3,000	1,990.00	5,970,000

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	68,000	2,719.00	184,892,000
サントリー食品インターナショナル	64,900	4,710.00	305,679,000
ダイドーグループホールディングス	5,000	4,650.00	23,250,000
伊藤園	29,400	5,590.00	164,346,000
キーコーヒー	9,500	2,385.00	22,657,500
ユニカフェ	2,500	1,042.00	2,605,000
ジャパンフーズ	1,400	1,245.00	1,743,000
日清オイリオグループ	12,500	3,930.00	49,125,000
不二製油グループ本社	23,600	3,100.00	73,160,000
かどや製油	1,100	3,710.00	4,081,000
J - オイルミルズ	5,000	4,375.00	21,875,000
キッコーマン	69,800	5,520.00	385,296,000
味の素	214,100	1,804.00	386,236,400
キューピー	54,000	2,471.00	133,434,000
ハウス食品グループ本社	36,300	3,850.00	139,755,000
カゴメ	36,800	2,700.00	99,360,000
焼津水産化学工業	4,700	1,041.00	4,892,700
アリアケジャパン	8,900	7,890.00	70,221,000
ピエトロ	1,300	1,624.00	2,111,200
エバラ食品工業	2,400	2,207.00	5,296,800
やまみ	500	2,190.00	1,095,000
ニチレイ	46,200	2,579.00	119,149,800
東洋水産	49,900	4,755.00	237,274,500
イトアンド	3,400	1,784.00	6,065,600
大冷	1,300	1,957.00	2,544,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	1,133.00	6,004,900
日清食品ホールディングス	41,200	8,240.00	339,488,000
永谷園ホールディングス	4,700	2,189.00	10,288,300
一正蒲鉾	3,800	1,048.00	3,982,400
フジッコ	10,500	1,991.00	20,905,500
ロック・フィールド	10,400	1,586.00	16,494,400
日本たばこ産業	559,800	2,504.00	1,401,739,200
ケンコーマヨネーズ	5,400	2,593.00	14,002,200
わらべや日洋ホールディングス	6,300	1,780.00	11,214,000
なとり	5,400	1,669.00	9,012,600
イフジ産業	1,700	773.00	1,314,100
ピクルスコーポレーション	2,100	2,813.00	5,907,300
北の達人コーポレーション	33,800	717.00	24,234,600
ユーグレナ	41,300	817.00	33,742,100
ミヨシ油脂	3,700	1,303.00	4,821,100
理研ビタミン	4,600	3,970.00	18,262,000
片倉工業	14,000	1,350.00	18,900,000

グンゼ	7,000	5,310.00	37,170,000
東洋紡	37,600	1,663.00	62,528,800
ユニチカ	28,600	396.00	11,325,600
富士紡ホールディングス	4,700	3,400.00	15,980,000
倉敷紡績	9,900	2,611.00	25,848,900
シキボウ	5,000	1,010.00	5,050,000
日本毛織	31,400	1,106.00	34,728,400
トーア紡コーポレーション	3,800	583.00	2,215,400
帝国繊維	10,800	2,078.00	22,442,400
帝人	77,300	2,093.00	161,788,900
東レ	685,400	746.30	511,514,020
サカイオーベックス	2,700	1,904.00	5,140,800
住江織物	2,800	2,921.00	8,178,800
日本フェルト	6,000	497.00	2,982,000
イチカワ	1,600	1,474.00	2,358,400
日東製網	1,100	1,706.00	1,876,600
アツギ	7,900	835.00	6,596,500
ダイニック	3,600	775.00	2,790,000
セーレン	23,500	1,583.00	37,200,500
ソトー	3,900	977.00	3,810,300
東海染工	1,400	1,128.00	1,579,200
小松マテーレ	15,600	820.00	12,792,000
ワコールホールディングス	24,700	2,981.00	73,630,700
ホギメディカル	10,800	3,650.00	39,420,000
レナウン	24,300	114.00	2,770,200
クラウディアホールディングス	2,500	480.00	1,200,000
T S Iホールディングス	31,900	562.00	17,927,800
マツオカコーポレーション	2,700	2,292.00	6,188,400
ワールド	13,400	2,880.00	38,592,000
三陽商会	5,000	1,398.00	6,990,000
ナイガイ	3,700	457.00	1,690,900
オンワードホールディングス	57,000	664.00	37,848,000
ルックホールディングス	3,300	1,242.00	4,098,600
ゴールドウイン	17,200	8,360.00	143,792,000
デサント	18,500	1,978.00	36,593,000
キング	4,600	528.00	2,428,800
ヤマトインターナショナル	6,000	399.00	2,394,000
特種東海製紙	6,000	4,015.00	24,090,000
王子ホールディングス	395,400	626.00	247,520,400
日本製紙	41,800	1,906.00	79,670,800
三菱製紙	10,700	500.00	5,350,000
北越コーポレーション	62,800	578.00	36,298,400



中越パルプ工業	4,000	1,663.00	6,652,000
巴川製紙所	2,800	915.00	2,562,000
大王製紙	41,500	1,500.00	62,250,000
阿波製紙	2,400	639.00	1,533,600
レンゴー	89,400	821.00	73,397,400
トモク	5,800	1,830.00	10,614,000
ザ・パック	7,200	3,960.00	28,512,000
クラレ	149,000	1,372.00	204,428,000
旭化成	627,000	1,252.00	785,004,000
共和レザー	5,100	840.00	4,284,000
昭和電工	67,300	2,995.00	201,563,500
住友化学	695,000	505.00	350,975,000
住友精化	4,200	3,535.00	14,847,000
日産化学	52,900	4,480.00	236,992,000
ラサ工業	3,300	1,548.00	5,108,400
クレハ	8,100	6,700.00	54,270,000
多木化学	2,800	4,435.00	12,418,000
テイカ	6,900	1,947.00	13,434,300
石原産業	17,000	1,151.00	19,567,000
片倉コープアグリ	2,400	1,189.00	2,853,600
日本曹達	14,000	3,040.00	42,560,000
東ソー	146,200	1,678.00	245,323,600
トクヤマ	27,300	2,900.00	79,170,000
セントラル硝子	19,300	2,765.00	53,364,500
東亜合成	59,400	1,281.00	76,091,400
大阪ソーダ	9,600	3,270.00	31,392,000
関東電化工業	22,400	1,016.00	22,758,400
デンカ	34,500	3,285.00	113,332,500
信越化学工業	162,400	11,750.00	1,908,200,000
日本カーバイド工業	3,200	1,507.00	4,822,400
堺化学工業	6,100	2,586.00	15,774,600
第一稀元素化学工業	10,200	901.00	9,190,200
エア・ウォーター	88,000	1,610.00	141,680,000
大陽日酸	90,900	2,460.00	223,614,000
日本化学工業	2,900	3,300.00	9,570,000
東邦アセチレン	1,400	1,346.00	1,884,400
日本パーカライズिंग	47,700	1,176.00	56,095,200
高圧ガス工業	15,000	812.00	12,180,000
チタン工業	1,200	2,649.00	3,178,800
四国化成工業	14,600	1,255.00	18,323,000
戸田工業	2,200	2,252.00	4,954,400
ステラ ケミファ	5,200	3,095.00	16,094,000

保土谷化学工業	3,500	3,870.00	13,545,000
日本触媒	14,700	6,730.00	98,931,000
大日精化工業	8,400	3,235.00	27,174,000
カネカ	24,500	3,555.00	87,097,500
三菱瓦斯化学	89,300	1,677.00	149,756,100
三井化学	85,900	2,671.00	229,438,900
J S R	88,200	1,940.00	171,108,000
東京応化工業	16,200	4,075.00	66,015,000
大阪有機化学工業	8,700	1,393.00	12,119,100
三菱ケミカルホールディングス	632,400	823.80	520,971,120
K Hネオケム	16,700	2,466.00	41,182,200
ダイセル	129,400	1,087.00	140,657,800
住友ベークライト	14,900	4,260.00	63,474,000
積水化学工業	203,400	1,912.00	388,900,800
日本ゼオン	85,300	1,425.00	121,552,500
アイカ工業	28,400	3,555.00	100,962,000
宇部興産	47,800	2,376.00	113,572,800
積水樹脂	17,000	2,265.00	38,505,000
タキロンシーアイ	20,500	693.00	14,206,500
旭有機材	5,300	1,746.00	9,253,800
日立化成	43,700	4,075.00	178,077,500
ニチバン	5,000	1,961.00	9,805,000
リケンテクノス	23,800	534.00	12,709,200
大倉工業	4,500	1,982.00	8,919,000
積水化成成品工業	12,700	800.00	10,160,000
群栄化学工業	2,200	2,621.00	5,766,200
タイガースポリマー	5,000	615.00	3,075,000
ミライアル	3,300	1,324.00	4,369,200
ダイキアクシス	3,300	1,006.00	3,319,800
ダイキョーニシカワ	19,900	878.00	17,472,200
竹本容器	3,400	1,094.00	3,719,600
森六ホールディングス	5,100	2,481.00	12,653,100
日本化薬	58,600	1,377.00	80,692,200
カーリットホールディングス	10,100	655.00	6,615,500
日本精化	7,600	1,295.00	9,842,000
扶桑化学工業	9,600	3,025.00	29,040,000
トリケミカル研究所	2,100	7,490.00	15,729,000
A D E K A	43,500	1,677.00	72,949,500
日油	35,600	3,710.00	132,076,000
新日本理化	15,700	212.00	3,328,400
ハリマ化成グループ	7,800	1,213.00	9,461,400
花王	231,300	8,919.00	2,062,964,700

第一工業製薬	3,500	4,360.00	15,260,000
石原ケミカル	2,600	1,978.00	5,142,800
日華化学	3,200	920.00	2,944,000
ニイタカ	1,500	1,684.00	2,526,000
三洋化成工業	5,600	5,430.00	30,408,000
有機合成薬品工業	7,200	299.00	2,152,800
大日本塗料	10,700	1,200.00	12,840,000
日本ペイントホールディングス	78,100	5,670.00	442,827,000
関西ペイント	106,300	2,805.00	298,171,500
神東塗料	7,400	224.00	1,657,600
中国塗料	26,900	1,061.00	28,540,900
日本特殊塗料	7,100	1,468.00	10,422,800
藤倉化成	12,800	567.00	7,257,600
太陽ホールディングス	6,900	4,215.00	29,083,500
D I C	39,900	3,060.00	122,094,000
サカティクス	20,600	1,235.00	25,441,000
東洋インキＳＣホールディングス	20,000	2,709.00	54,180,000
T & K T O K A	7,300	997.00	7,278,100
富士フィルムホールディングス	185,200	5,167.00	956,928,400
資生堂	191,900	7,609.00	1,460,167,100
ライオン	125,600	2,169.00	272,426,400
高砂香料工業	6,000	2,580.00	15,480,000
マンダム	21,700	2,949.00	63,993,300
ミルボン	12,900	6,210.00	80,109,000
ファンケル	39,100	2,850.00	111,435,000
コーセー	18,200	16,880.00	307,216,000
コタ	5,100	1,538.00	7,843,800
シーボン	1,300	2,523.00	3,279,900
ポーラ・オルビスホールディングス	41,200	2,708.00	111,569,600
ノエビアホールディングス	9,200	6,150.00	56,580,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	951.00	2,092,200
エステー	6,200	1,742.00	10,800,400
アグロ カネショウ	3,000	1,431.00	4,293,000
コニシ	15,900	1,500.00	23,850,000
長谷川香料	12,800	1,989.00	25,459,200
星光 P M C	5,500	1,028.00	5,654,000
小林製薬	27,100	9,130.00	247,423,000
荒川化学工業	8,700	1,571.00	13,667,700
メック	6,600	1,581.00	10,434,600
日本高純度化学	2,700	2,637.00	7,119,900
タカラバイオ	25,300	2,104.00	53,231,200
J C U	11,700	3,055.00	35,743,500

新田ゼラチン	6,100	698.00	4,257,800
O A Tアグリオ	1,700	1,660.00	2,822,000
デクセリアルズ	24,900	1,127.00	28,062,300
アース製薬	7,300	5,750.00	41,975,000
北興化学工業	9,900	573.00	5,672,700
大成ラミック	3,200	2,880.00	9,216,000
クミアイ化学工業	39,900	1,029.00	41,057,100
日本農薬	17,200	597.00	10,268,400
アキレス	6,700	1,914.00	12,823,800
有沢製作所	15,300	1,006.00	15,391,800
日東電工	66,700	6,170.00	411,539,000
レック	10,300	1,332.00	13,719,600
三光合成	11,000	459.00	5,049,000
きもと	16,400	178.00	2,919,200
藤森工業	8,700	3,540.00	30,798,000
前澤化成工業	6,100	1,192.00	7,271,200
未来工業	5,200	2,213.00	11,507,600
ウェーブロックホールディングス	3,300	795.00	2,623,500
J S P	5,700	1,929.00	10,995,300
エフピコ	10,600	6,620.00	70,172,000
天馬	6,400	1,998.00	12,787,200
信越ポリマー	17,300	1,011.00	17,490,300
東リ	24,000	332.00	7,968,000
ニフコ	35,500	3,105.00	110,227,500
バルカー	7,800	2,565.00	20,007,000
ユニ・チャーム	186,200	3,466.00	645,369,200
ショーエイコーポレーション	1,100	740.00	814,000
協和キリン	97,200	2,398.00	233,085,600
武田薬品工業	803,600	4,422.00	3,553,519,200
アステラス製薬	849,600	1,881.00	1,598,097,600
大日本住友製薬	71,600	2,155.00	154,298,000
塩野義製薬	123,500	6,481.00	800,403,500
田辺三菱製薬	117,000	2,002.00	234,234,000
わかもと製薬	11,500	262.00	3,013,000
あすか製薬	11,000	1,315.00	14,465,000
日本新薬	25,300	9,550.00	241,615,000
ビオフェルミン製薬	1,600	2,409.00	3,854,400
中外製薬	100,700	9,939.00	1,000,857,300
科研製薬	16,500	6,000.00	99,000,000
エーザイ	115,600	8,111.00	937,631,600
ロート製薬	49,600	3,470.00	172,112,000
小野薬品工業	221,800	2,461.50	545,960,700

久光製薬	28,500	5,340.00	152,190,000
持田製薬	13,400	4,550.00	60,970,000
参天製薬	179,900	2,066.00	371,673,400
扶桑薬品工業	3,400	2,009.00	6,830,600
日本ケミファ	1,300	2,977.00	3,870,100
ツムラ	29,900	3,230.00	96,577,000
日医工	27,400	1,422.00	38,962,800
キッセイ薬品工業	17,100	3,030.00	51,813,000
生化学工業	18,700	1,275.00	23,842,500
栄研化学	17,000	2,067.00	35,139,000
日水製薬	4,100	1,296.00	5,313,600
鳥居薬品	6,000	2,957.00	17,742,000
JCRファーマ	6,800	9,160.00	62,288,000
東和薬品	12,400	2,885.00	35,774,000
富士製薬工業	6,600	1,384.00	9,134,400
沢井製薬	19,800	6,770.00	134,046,000
ゼリア新薬工業	17,500	2,150.00	37,625,000
第一三共	276,400	7,177.00	1,983,722,800
キョーリン製薬ホールディングス	21,300	1,916.00	40,810,800
大幸薬品	3,900	3,075.00	11,992,500
ダイト	5,700	3,250.00	18,525,000
大塚ホールディングス	184,000	4,915.00	904,360,000
大正製薬ホールディングス	20,400	8,130.00	165,852,000
ペプチドリーム	48,900	5,150.00	251,835,000
日本コークス工業	81,600	79.00	6,446,400
ニチレキ	11,400	1,320.00	15,048,000
ユシロ化学工業	5,400	1,464.00	7,905,600
ビーピー・カストロール	3,400	1,584.00	5,385,600
富士石油	25,800	246.00	6,346,800
MORESCO	3,500	1,412.00	4,942,000
出光興産	108,600	3,000.00	325,800,000
JXTGホールディングス	1,498,000	496.20	743,307,600
コスモエネルギーホールディングス	28,000	2,583.00	72,324,000
横浜ゴム	55,900	2,291.00	128,066,900
TOYO TIRE	55,500	1,626.00	90,243,000
ブリヂストン	296,900	4,335.00	1,287,061,500
住友ゴム工業	86,800	1,420.00	123,256,000
藤倉コンポジット	8,400	495.00	4,158,000
オカモト	5,900	4,190.00	24,721,000
フコク	4,200	723.00	3,036,600
ニッタ	10,900	3,220.00	35,098,000
住友理工	18,700	1,076.00	20,121,200

三ツ星ベルト	12,700	2,191.00	27,825,700
バンドー化学	17,000	941.00	15,997,000
日東紡績	14,400	4,185.00	60,264,000
A G C	95,500	3,965.00	378,657,500
日本板硝子	46,200	659.00	30,445,800
石塚硝子	1,800	2,375.00	4,275,000
日本山村硝子	4,000	1,276.00	5,104,000
日本電気硝子	38,800	2,397.00	93,003,600
オハラ	3,800	1,478.00	5,616,400
住友大阪セメント	18,300	4,850.00	88,755,000
太平洋セメント	61,000	3,440.00	209,840,000
日本ヒューム	9,700	852.00	8,264,400
日本コンクリート工業	20,900	300.00	6,270,000
三谷セキサン	4,500	3,615.00	16,267,500
アジアパイルホールディングス	13,800	629.00	8,680,200
東海カーボン	101,200	1,127.00	114,052,400
日本カーボン	5,000	4,435.00	22,175,000
東洋炭素	5,700	2,388.00	13,611,600
ノリタケカンパニーリミテド	5,300	4,795.00	25,413,500
T O T O	69,000	4,810.00	331,890,000
日本碍子	117,900	1,896.00	223,538,400
日本特殊陶業	75,200	2,203.00	165,665,600
M A R U W A	3,700	8,110.00	30,007,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,460.00	8,996,000
黒崎播磨	1,900	6,490.00	12,331,000
ヨータイ	7,700	755.00	5,813,500
イソライト工業	5,000	723.00	3,615,000
東京窯業	12,400	352.00	4,364,800
ニッカトー	4,400	799.00	3,515,600
フジミインコーポレーテッド	8,600	2,872.00	24,699,200
クニミネ工業	3,900	1,206.00	4,703,400
エーアンドエーマテリアル	1,600	1,381.00	2,209,600
ニチアス	26,400	2,691.00	71,042,400
ニチハ	13,400	2,791.00	37,399,400
日本製鉄	427,500	1,737.00	742,567,500
神戸製鋼所	174,900	621.00	108,612,900
中山製鋼所	13,300	547.00	7,275,100
合同製鐵	5,200	2,860.00	14,872,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	258,000	1,472.00	379,776,000
東京製鐵	46,600	809.00	37,699,400
共英製鋼	10,800	2,176.00	23,500,800
大和工業	20,300	2,809.00	57,022,700

東京鐵鋼	4,000	1,593.00	6,372,000
大阪製鐵	5,100	1,492.00	7,609,200
淀川製鋼所	12,900	2,111.00	27,231,900
丸一鋼管	31,000	3,140.00	97,340,000
モリ工業	2,900	2,424.00	7,029,600
大同特殊鋼	15,600	4,945.00	77,142,000
日本高周波鋼業	3,600	443.00	1,594,800
日本冶金工業	7,900	2,318.00	18,312,200
山陽特殊製鋼	6,900	1,564.00	10,791,600
愛知製鋼	5,400	3,775.00	20,385,000
日立金属	102,900	1,546.00	159,083,400
日本金属	2,200	969.00	2,131,800
大平洋金属	6,500	2,434.00	15,821,000
新日本電工	61,800	181.00	11,185,800
栗本鐵工所	4,800	2,077.00	9,969,600
虹技	1,400	1,501.00	2,101,400
三菱製鋼	7,100	1,139.00	8,086,900
日亜鋼業	14,100	347.00	4,892,700
日本精線	1,600	3,275.00	5,240,000
エンビプロ・ホールディングス	3,700	789.00	2,919,300
シンニッタン	15,000	444.00	6,660,000
新家工業	2,200	1,459.00	3,209,800
大紀アルミニウム工業所	15,800	800.00	12,640,000
日本軽金属ホールディングス	242,100	232.00	56,167,200
三井金属鉱業	25,800	2,852.00	73,581,600
東邦亜鉛	4,900	2,170.00	10,633,000
三菱マテリアル	63,100	3,010.00	189,931,000
住友金属鉱山	122,100	3,412.00	416,605,200
D O W A ホールディングス	24,200	4,135.00	100,067,000
古河機械金属	17,000	1,540.00	26,180,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,000	1,567.00	15,670,000
東邦チタニウム	17,200	983.00	16,907,600
U A C J	14,500	2,530.00	36,685,000
C K サンエツ	2,000	3,030.00	6,060,000
古河電気工業	29,700	2,998.00	89,040,600
住友電気工業	357,200	1,650.00	589,380,000
フジクラ	115,500	475.00	54,862,500
昭和電線ホールディングス	11,100	1,275.00	14,152,500
東京特殊電線	1,500	2,278.00	3,417,000
タツタ電線	19,100	623.00	11,899,300
カナレ電気	1,600	1,857.00	2,971,200
平河ヒューテック	3,600	1,456.00	5,241,600

リヨービ	11,800	2,165.00	25,547,000
アーレスティ	12,700	564.00	7,162,800
アサヒホールディングス	16,800	2,679.00	45,007,200
稲葉製作所	5,400	1,467.00	7,921,800
宮地エンジニアリンググループ	2,900	2,216.00	6,426,400
トーカロ	26,500	1,102.00	29,203,000
アルファC o	3,400	1,308.00	4,447,200
SUMCO	114,300	1,705.00	194,881,500
川田テクノロジーズ	2,000	7,120.00	14,240,000
RS Technologies	2,700	3,630.00	9,801,000
信和	4,100	1,092.00	4,477,200
東洋製罐グループホールディングス	60,800	1,925.00	117,040,000
ホッカンホールディングス	5,300	1,951.00	10,340,300
コロナ	5,300	1,154.00	6,116,200
横河ブリッジホールディングス	17,800	2,031.00	36,151,800
駒井ハルテック	1,800	1,790.00	3,222,000
高田機工	900	2,638.00	2,374,200
三和ホールディングス	91,600	1,231.00	112,759,600
文化シャッター	28,100	992.00	27,875,200
三協立山	13,200	1,263.00	16,671,600
アルインコ	6,900	1,309.00	9,032,100
東洋シャッター	2,300	753.00	1,731,900
LIXILグループ	140,900	1,974.00	278,136,600
日本フィルコン	7,300	511.00	3,730,300
ノーリツ	19,800	1,549.00	30,670,200
長府製作所	9,700	2,460.00	23,862,000
リンナイ	18,600	8,500.00	158,100,000
ダイニチ工業	5,100	692.00	3,529,200
日東精工	13,200	650.00	8,580,000
三洋工業	1,300	2,034.00	2,644,200
岡部	19,400	962.00	18,662,800
ジーテクト	11,900	1,788.00	21,277,200
東プレ	17,800	1,829.00	32,556,200
高周波熱錬	18,400	891.00	16,394,400
東京製綱	6,800	1,298.00	8,826,400
サンコール	5,400	525.00	2,835,000
モリテック スチール	7,400	426.00	3,152,400
パイオラックス	14,100	2,196.00	30,963,600
エイチワン	9,400	847.00	7,961,800
日本発條	102,500	1,005.00	103,012,500
中央発條	1,100	3,065.00	3,371,500
アドバネクス	1,400	1,577.00	2,207,800



立川ブラインド工業	4,200	1,405.00	5,901,000
三益半導体工業	8,500	2,035.00	17,297,500
日本ドライケミカル	2,400	1,664.00	3,993,600
日本製鋼所	29,000	2,197.00	63,713,000
三浦工業	41,400	3,650.00	151,110,000
タクマ	32,400	1,296.00	41,990,400
ツガミ	19,900	1,114.00	22,168,600
オークマ	11,100	6,090.00	67,599,000
東芝機械	10,800	3,035.00	32,778,000
アマダホールディングス	121,500	1,268.00	154,062,000
アイダエンジニアリング	25,900	1,032.00	26,728,800
滝澤鉄工所	3,000	1,395.00	4,185,000
F U J I	41,100	1,989.00	81,747,900
牧野フライス製作所	11,200	5,410.00	60,592,000
オーエスジー	44,200	2,218.00	98,035,600
ダイジェット工業	1,100	1,494.00	1,643,400
旭ダイヤモンド工業	25,200	668.00	16,833,600
D M G 森精機	60,500	1,743.00	105,451,500
ソディック	22,600	1,030.00	23,278,000
ディスコ	12,900	23,440.00	302,376,000
日東工器	5,300	2,391.00	12,672,300
日進工具	2,900	2,310.00	6,699,000
パンチ工業	8,800	535.00	4,708,000
富士ダイス	4,400	675.00	2,970,000
豊和工業	5,400	835.00	4,509,000
O K K	4,000	685.00	2,740,000
東洋機械金属	7,000	575.00	4,025,000
津田駒工業	1,900	1,350.00	2,565,000
エンシュウ	2,400	1,418.00	3,403,200
島精機製作所	15,400	2,755.00	42,427,000
オプトラン	10,700	2,899.00	31,019,300
N C ホールディングス	3,100	638.00	1,977,800
イワキポンプ	4,600	1,229.00	5,653,400
フリー	9,400	1,100.00	10,340,000
ヤマシンフィルタ	20,900	850.00	17,765,000
日阪製作所	11,900	994.00	11,828,600
やまびこ	18,600	1,204.00	22,394,400
平田機工	4,500	7,760.00	34,920,000
ペガサスミシン製造	9,900	515.00	5,098,500
マルマエ	4,000	976.00	3,904,000
タツモ	4,600	1,208.00	5,556,800
ナブテスコ	56,300	3,395.00	191,138,500

三井海洋開発	10,200	2,606.00	26,581,200
レオン自動機	9,400	1,650.00	15,510,000
S M C	30,300	50,150.00	1,519,545,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	8,500	541.00	4,598,500
ホソカワミクロン	3,400	4,740.00	16,116,000
ユニオンツール	3,600	3,230.00	11,628,000
オイレス工業	12,400	1,719.00	21,315,600
日精エー・エス・ビー機械	3,200	4,630.00	14,816,000
サトーホールディングス	13,600	3,425.00	46,580,000
技研製作所	8,400	4,995.00	41,958,000
日本エアーテック	3,200	706.00	2,259,200
カワタ	2,900	1,204.00	3,491,600
日精樹脂工業	8,100	1,033.00	8,367,300
オカダアイヨン	3,100	1,257.00	3,896,700
ワイエイシイホールディングス	4,100	726.00	2,976,600
小松製作所	437,500	2,691.50	1,177,531,250
住友重機械工業	55,300	3,115.00	172,259,500
日立建機	38,700	3,105.00	120,163,500
日工	13,300	840.00	11,172,000
巴工業	4,200	2,273.00	9,546,600
井関農機	9,700	1,698.00	16,470,600
T O W A	9,900	1,122.00	11,107,800
丸山製作所	2,200	1,260.00	2,772,000
北川鉄工所	4,400	2,370.00	10,428,000
ローツェ	4,300	3,800.00	16,340,000
タカキタ	3,600	550.00	1,980,000
クボタ	512,500	1,722.00	882,525,000
荏原実業	2,500	2,261.00	5,652,500
三菱化工機	3,400	1,908.00	6,487,200
月島機械	17,800	1,686.00	30,010,800
帝国電機製作所	8,000	1,405.00	11,240,000
新東工業	23,000	1,041.00	23,943,000
澁谷工業	8,500	3,265.00	27,752,500
アイチ コーポレーション	16,800	747.00	12,549,600
小森コーポレーション	24,600	1,164.00	28,634,400
鶴見製作所	7,600	2,034.00	15,458,400
住友精密工業	1,500	3,440.00	5,160,000
日本ギア工業	3,200	408.00	1,305,600
酒井重工業	1,800	2,967.00	5,340,600
荏原製作所	40,000	3,395.00	135,800,000
石井鐵工所	1,300	2,522.00	3,278,600
西島製作所	9,800	950.00	9,310,000

北越工業	10,000	1,285.00	12,850,000
ダイキン工業	123,100	15,675.00	1,929,592,500
オルガノ	3,500	6,750.00	23,625,000
トーヨーカネツ	4,200	2,326.00	9,769,200
栗田工業	52,300	3,160.00	165,268,000
椿本チエイン	13,800	3,900.00	53,820,000
大同工業	4,700	840.00	3,948,000
木村化工機	8,200	754.00	6,182,800
アネスト岩田	15,100	1,055.00	15,930,500
ダイフク	49,400	6,590.00	325,546,000
サムコ	2,700	1,227.00	3,312,900
加藤製作所	5,300	1,838.00	9,741,400
油研工業	1,700	1,737.00	2,952,900
タダノ	46,700	1,069.00	49,922,300
フジテック	35,200	1,815.00	63,888,000
C K D	26,900	1,867.00	50,222,300
キトー	7,400	1,700.00	12,580,000
平和	27,000	2,266.00	61,182,000
理想科学工業	8,600	1,948.00	16,752,800
S A N K Y O	21,500	3,650.00	78,475,000
日本金銭機械	10,800	929.00	10,033,200
マースグループホールディングス	6,200	2,103.00	13,038,600
フクシマガリレイ	6,000	3,935.00	23,610,000
オーイズミ	4,200	600.00	2,520,000
ダイコク電機	4,500	1,695.00	7,627,500
竹内製作所	16,200	1,680.00	27,216,000
アマノ	25,300	3,385.00	85,640,500
J U K I	13,400	914.00	12,247,600
蛇の目ミシン工業	9,100	410.00	3,731,000
マックス	14,800	2,146.00	31,760,800
グローリー	26,800	3,355.00	89,914,000
新晃工業	9,000	1,984.00	17,856,000
大和冷機工業	14,000	1,269.00	17,766,000
セガサミーホールディングス	95,900	1,595.00	152,960,500
日本ピストンリング	3,600	1,488.00	5,356,800
リケン	4,500	4,285.00	19,282,500
T P R	13,000	2,117.00	27,521,000
ツバキ・ナカシマ	19,700	1,703.00	33,549,100
ホシザキ	28,200	9,820.00	276,924,000
大豊工業	8,000	871.00	6,968,000
日本精工	181,900	1,067.00	194,087,300
N T N	223,900	351.00	78,588,900

ジェイテクト	92,700	1,353.00	125,423,100
不二越	9,000	5,020.00	45,180,000
日本トムソン	28,900	505.00	14,594,500
THK	56,200	3,000.00	168,600,000
ユーシン精機	7,600	1,034.00	7,858,400
前澤給装工業	3,600	2,233.00	8,038,800
イーグル工業	12,000	1,125.00	13,500,000
前澤工業	6,700	403.00	2,700,100
日本ピラー工業	9,800	1,474.00	14,445,200
キッツ	39,300	760.00	29,868,000
マキタ	126,000	3,665.00	461,790,000
日立造船	76,800	440.00	33,792,000
三菱重工業	161,900	4,244.00	687,103,600
IHI	69,600	2,593.00	180,472,800
スター精密	15,200	1,606.00	24,411,200
日清紡ホールディングス	64,500	1,045.00	67,402,500
イビデン	59,300	2,613.00	154,950,900
コニカミノルタ	211,800	725.00	153,555,000
ブラザー工業	118,200	2,258.00	266,895,600
ミネベアミツミ	179,500	2,244.00	402,798,000
日立製作所	464,100	4,306.00	1,998,414,600
三菱電機	965,900	1,535.00	1,482,656,500
富士電機	58,200	3,360.00	195,552,000
東洋電機製造	3,900	1,547.00	6,033,300
安川電機	104,000	4,035.00	419,640,000
シンフォニアテクノロジー	12,600	1,419.00	17,879,400
明電舎	17,800	2,251.00	40,067,800
オリジン	2,700	1,482.00	4,001,400
山洋電気	4,800	5,520.00	26,496,000
デンヨー	8,300	2,173.00	18,035,900
東芝テック	12,100	4,685.00	56,688,500
芝浦メカトロニクス	1,800	3,830.00	6,894,000
マブチモーター	26,900	4,305.00	115,804,500
日本電産	116,300	15,725.00	1,828,817,500
トレックス・セミコンダクター	5,900	1,479.00	8,726,100
東光高岳	5,800	1,186.00	6,878,800
ダイヘン	10,600	3,680.00	39,008,000
ヤーマン	14,800	687.00	10,167,600
JVCケンウッド	80,600	269.00	21,681,400
ミマキエンジニアリング	9,700	523.00	5,073,100
第一精工	4,100	2,693.00	11,041,300
日新電機	22,700	1,297.00	29,441,900

大崎電気工業	19,400	727.00	14,103,800
オムロン	89,800	6,470.00	581,006,000
日東工業	14,200	2,591.00	36,792,200
I D E C	14,000	2,309.00	32,326,000
正興電機製作所	2,900	837.00	2,427,300
不二電機工業	1,600	1,291.00	2,065,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32,500	2,382.00	77,415,000
サクサホールディングス	2,300	1,943.00	4,468,900
メルコホールディングス	3,500	3,135.00	10,972,500
テクノメディカ	2,400	2,058.00	4,939,200
日本電気	117,200	4,545.00	532,674,000
富士通	93,100	10,215.00	951,016,500
沖電気工業	39,300	1,566.00	61,543,800
岩崎通信機	4,200	815.00	3,423,000
電気興業	4,700	3,195.00	15,016,500
サンケン電気	10,600	3,245.00	34,397,000
ナカヨ	1,900	1,627.00	3,091,300
アイホン	5,500	1,991.00	10,950,500
ルネサスエレクトロニクス	461,500	719.00	331,818,500
セイコーエプソン	119,900	1,704.00	204,309,600
ワコム	66,100	469.00	31,000,900
アルバック	19,300	4,265.00	82,314,500
アクセル	4,800	677.00	3,249,600
E I Z O	7,500	4,150.00	31,125,000
日本信号	24,700	1,413.00	34,901,100
京三製作所	22,900	552.00	12,640,800
能美防災	13,000	2,538.00	32,994,000
ホーチキ	7,300	1,765.00	12,884,500
星和電機	5,700	567.00	3,231,900
エレコム	10,600	4,125.00	43,725,000
パナソニック	1,103,600	1,057.50	1,167,057,000
シャープ	111,800	1,702.00	190,283,600
アンリツ	62,200	2,086.00	129,749,200
富士通ゼネラル	26,300	2,283.00	60,042,900
ソニー	610,500	7,245.00	4,423,072,500
T D K	46,700	12,150.00	567,405,000
帝国通信工業	4,700	1,214.00	5,705,800
タムラ製作所	32,500	690.00	22,425,000
アルプスアルパイン	85,700	2,584.00	221,448,800
池上通信機	3,100	1,036.00	3,211,600
鈴木	5,800	802.00	4,651,600
日本トリム	1,400	4,760.00	6,664,000

ローランド ディー・ジー・	5,600	2,202.00	12,331,200
フォスター電機	10,200	2,021.00	20,614,200
S M K	2,500	3,005.00	7,512,500
ヨコオ	6,400	3,150.00	20,160,000
ホシデン	26,800	1,366.00	36,608,800
ヒロセ電機	15,000	13,660.00	204,900,000
日本航空電子工業	22,200	2,229.00	49,483,800
T O A	10,500	1,150.00	12,075,000
マクセルホールディングス	21,100	1,500.00	31,650,000
古野電気	12,800	1,352.00	17,305,600
ユニデンホールディングス	2,700	1,882.00	5,081,400
スミダコーポレーション	7,800	1,349.00	10,522,200
アイコム	5,400	2,720.00	14,688,000
リオン	4,200	2,957.00	12,419,400
本多通信工業	9,200	553.00	5,087,600
横河電機	88,700	1,965.00	174,295,500
新電元工業	3,400	3,765.00	12,801,000
アズビル	61,000	3,205.00	195,505,000
東亜ディーケーケー	5,300	914.00	4,844,200
日本光電工業	40,100	2,966.00	118,936,600
チノー	3,400	1,426.00	4,848,400
共和電業	10,400	441.00	4,586,400
日本電子材料	4,000	830.00	3,320,000
堀場製作所	19,100	7,470.00	142,677,000
アドバンテスト	71,800	5,340.00	383,412,000
小野測器	5,000	545.00	2,725,000
エスベック	8,800	2,210.00	19,448,000
キーエンス	87,500	39,180.00	3,428,250,000
日置電機	5,200	3,905.00	20,306,000
シスメックス	69,100	7,616.00	526,265,600
日本マイクロニクス	17,300	1,086.00	18,787,800
メガチップス	9,200	2,382.00	21,914,400
O B A R A G R O U P	5,100	3,840.00	19,584,000
澤藤電機	1,400	2,221.00	3,109,400
原田工業	5,100	1,024.00	5,222,400
コーセル	12,200	1,260.00	15,372,000
イリソ電子工業	8,200	5,310.00	43,542,000
オブテックスグループ	16,200	1,621.00	26,260,200
千代田インテグレ	4,700	2,476.00	11,637,200
アイ・オー・データ機器	4,100	1,108.00	4,542,800
レーザーテック	19,800	9,620.00	190,476,000
スタンレー電気	68,300	3,120.00	213,096,000

岩崎電気	4,100	1,448.00	5,936,800
ウシオ電機	56,400	1,637.00	92,326,800
岡谷電機産業	8,900	380.00	3,382,000
ハリオス テクノ ホールディング	10,000	501.00	5,010,000
エノモト	3,300	1,122.00	3,702,600
日本セラミック	10,000	2,819.00	28,190,000
遠藤照明	5,600	707.00	3,959,200
古河電池	7,600	795.00	6,042,000
双信電機	5,700	502.00	2,861,400
山一電機	7,300	1,688.00	12,322,400
図研	6,500	2,437.00	15,840,500
日本電子	19,200	3,135.00	60,192,000
カシオ計算機	85,500	2,155.00	184,252,500
ファナック	91,800	21,270.00	1,952,586,000
日本シイエムケイ	23,500	661.00	15,533,500
エンプラス	5,100	3,480.00	17,748,000
大真空	4,000	1,608.00	6,432,000
ローム	42,900	8,920.00	382,668,000
浜松ホトニクス	69,400	4,535.00	314,729,000
三井ハイテック	10,900	2,099.00	22,879,100
新光電気工業	32,800	1,187.00	38,933,600
京セラ	136,000	7,395.00	1,005,720,000
太陽誘電	43,100	3,055.00	131,670,500
村田製作所	283,800	6,635.00	1,883,013,000
双葉電子工業	15,600	1,388.00	21,652,800
北陸電気工業	4,300	1,135.00	4,880,500
ニチコン	33,200	1,179.00	39,142,800
日本ケミコン	7,300	2,039.00	14,884,700
K O A	14,900	1,458.00	21,724,200
市光工業	15,100	843.00	12,729,300
小糸製作所	58,000	5,540.00	321,320,000
ミツバ	18,500	765.00	14,152,500
S C R E E Nホールディングス	16,800	7,360.00	123,648,000
キャノン電子	10,400	2,152.00	22,380,800
キャノン	520,000	3,059.00	1,590,680,000
リコー	245,800	1,168.00	287,094,400
象印マホービン	28,600	1,825.00	52,195,000
M U T O Hホールディングス	1,600	1,752.00	2,803,200
東京エレクトロン	64,400	22,250.00	1,432,900,000
トヨタ紡織	28,200	1,781.00	50,224,200
芦森工業	2,000	1,397.00	2,794,000
ユニプレス	18,700	1,625.00	30,387,500

豊田自動織機	78,200	6,380.00	498,916,000
モリタホールディングス	16,900	1,787.00	30,200,300
三櫻工業	12,300	1,293.00	15,903,900
デンソー	212,700	4,984.00	1,060,096,800
東海理化電機製作所	25,500	2,193.00	55,921,500
三井E & Sホールディングス	34,900	950.00	33,155,000
川崎重工業	75,200	2,495.00	187,624,000
名村造船所	31,100	279.00	8,676,900
日本車輛製造	3,500	3,025.00	10,587,500
三菱ロジスネクスト	12,800	1,234.00	15,795,200
近畿車輛	1,500	1,589.00	2,383,500
日産自動車	1,139,100	679.60	774,132,360
いすゞ自動車	279,900	1,287.50	360,371,250
トヨタ自動車	1,076,300	7,650.00	8,233,695,000
日野自動車	120,600	1,151.00	138,810,600
三菱自動車工業	357,500	482.00	172,315,000
エフテック	6,800	775.00	5,270,000
レシップホールディングス	3,800	689.00	2,618,200
G M B	1,800	817.00	1,470,600
ファルテック	1,700	1,183.00	2,011,100
武蔵精密工業	21,500	1,484.00	31,906,000
日産車体	18,900	1,103.00	20,846,700
新明和工業	26,000	1,514.00	39,364,000
極東開発工業	17,900	1,650.00	29,535,000
日信工業	19,500	2,222.00	43,329,000
トピー工業	8,000	2,096.00	16,768,000
ティラド	3,500	1,990.00	6,965,000
曙ブレーキ工業	53,000	242.00	12,826,000
タチエス	15,900	1,445.00	22,975,500
N O K	52,000	1,726.00	89,752,000
フタバ産業	26,900	808.00	21,735,200
K Y B	10,800	3,315.00	35,802,000
大同メタル工業	18,600	793.00	14,749,800
プレス工業	48,000	443.00	21,264,000
ミクニ	12,400	343.00	4,253,200
太平洋工業	20,300	1,477.00	29,983,100
ケーヒン	22,100	2,572.00	56,841,200
河西工業	13,100	923.00	12,091,300
アイシン精機	79,500	4,210.00	334,695,000
マツダ	284,200	958.00	272,263,600
今仙電機製作所	9,000	983.00	8,847,000
本田技研工業	760,500	3,135.00	2,384,167,500



スズキ	191,400	4,651.00	890,201,400
S U B A R U	299,900	2,809.00	842,419,100
安永	4,700	1,289.00	6,058,300
ヤマハ発動機	126,000	2,282.00	287,532,000
ショーワ	22,700	2,273.00	51,597,100
T B K	11,600	431.00	4,999,600
エクセディ	13,100	2,542.00	33,300,200
豊田合成	31,200	2,710.00	84,552,000
愛三工業	15,200	850.00	12,920,000
盟和産業	1,500	1,135.00	1,702,500
日本プラスト	7,600	736.00	5,593,600
ヨロズ	9,100	1,437.00	13,076,700
エフ・シー・シー	15,800	2,420.00	38,236,000
シマノ	36,100	17,740.00	640,414,000
テイ・エス テック	22,400	3,545.00	79,408,000
ジャムコ	4,900	1,517.00	7,433,300
テルモ	273,300	3,793.00	1,036,626,900
クリエートメディック	3,200	1,061.00	3,395,200
日機装	29,000	1,442.00	41,818,000
日本エム・ディ・エム	5,600	2,220.00	12,432,000
島津製作所	115,400	3,355.00	387,167,000
J M S	8,200	774.00	6,346,800
長野計器	7,000	861.00	6,027,000
ブイ・テクノロジー	4,500	5,900.00	26,550,000
東京計器	6,200	1,055.00	6,541,000
愛知時計電機	1,300	4,330.00	5,629,000
インターアクション	5,200	2,630.00	13,676,000
オーバル	8,800	251.00	2,208,800
東京精密	17,500	4,080.00	71,400,000
マニー	38,500	2,914.00	112,189,000
ニコン	156,300	1,453.00	227,103,900
トプコン	48,700	1,456.00	70,907,200
オリンパス	534,400	1,598.00	853,971,200
理研計器	8,500	2,319.00	19,711,500
タムロン	7,800	2,651.00	20,677,800
H O Y A	194,500	9,924.00	1,930,218,000
シード	4,100	1,077.00	4,415,700
ノーリツ鋼機	6,500	1,930.00	12,545,000
エー・アンド・デイ	8,800	899.00	7,911,200
朝日インテック	82,000	3,090.00	253,380,000
シチズン時計	113,200	610.00	69,052,000
リズム時計工業	3,100	957.00	2,966,700

大研医器	6,700	639.00	4,281,300
メニコン	13,300	4,395.00	58,453,500
シンシア	1,100	606.00	666,600
松風	4,400	1,689.00	7,431,600
セイコーホールディングス	13,700	2,977.00	40,784,900
ニプロ	66,900	1,296.00	86,702,400
中本パックス	2,500	1,535.00	3,837,500
スノーピーク	4,400	1,071.00	4,712,400
パラマウントベッドホールディングス	10,200	4,565.00	46,563,000
トランザクション	6,200	1,063.00	6,590,600
S H O - B I	2,800	398.00	1,114,400
ニホンフラッシュ	4,500	2,828.00	12,726,000
前田工織	10,600	2,066.00	21,899,600
永大産業	12,600	350.00	4,410,000
アートネイチャー	10,300	800.00	8,240,000
バンダイナムコホールディングス	99,900	6,682.00	667,531,800
アイフィスジャパン	2,500	788.00	1,970,000
共立印刷	16,100	167.00	2,688,700
S H O E I	4,600	5,230.00	24,058,000
フランスベッドホールディングス	13,700	1,006.00	13,782,200
パイロットコーポレーション	16,800	4,480.00	75,264,000
萩原工業	5,400	1,676.00	9,050,400
トッパン・フォームズ	20,700	1,220.00	25,254,000
フジシールインターナショナル	21,600	2,383.00	51,472,800
タカラトミー	43,300	1,295.00	56,073,500
廣濟堂	6,700	859.00	5,755,300
エステールホールディングス	2,600	685.00	1,781,000
アーク	36,900	96.00	3,542,400
タカノ	3,800	831.00	3,157,800
プロネクサス	8,300	1,222.00	10,142,600
ホクシン	6,000	168.00	1,008,000
ウッドワン	3,200	1,204.00	3,852,800
大建工業	6,500	2,077.00	13,500,500
凸版印刷	136,300	2,176.00	296,588,800
大日本印刷	126,400	2,952.00	373,132,800
共同印刷	3,000	2,965.00	8,895,000
N I S S H A	19,800	1,155.00	22,869,000
光村印刷	800	1,793.00	1,434,400
T A K A R A & C O M P A N Y	4,700	1,710.00	8,037,000
アシックス	79,700	1,750.00	139,475,000
ツツミ	3,000	2,235.00	6,705,000
小松ウオール工業	2,900	2,405.00	6,974,500

ヤマハ	57,400	6,090.00	349,566,000
河合楽器製作所	3,000	3,825.00	11,475,000
クリナップ	9,000	799.00	7,191,000
ピジョン	58,400	4,230.00	247,032,000
オリバー	2,000	3,565.00	7,130,000
兼松サステック	600	1,772.00	1,063,200
キングジム	8,000	890.00	7,120,000
リンテック	23,000	2,437.00	56,051,000
イトーキ	20,500	555.00	11,377,500
任天堂	59,200	46,370.00	2,745,104,000
三菱鉛筆	15,900	1,720.00	27,348,000
タカラスタANDARD	20,000	2,007.00	40,140,000
コクヨ	46,300	1,710.00	79,173,000
ナカバヤシ	9,500	613.00	5,823,500
グローブライド	4,300	2,680.00	11,524,000
オカムラ	33,700	1,082.00	36,463,400
美津濃	8,800	2,885.00	25,388,000
東京電力ホールディングス	771,000	478.00	368,538,000
中部電力	295,500	1,518.50	448,716,750
関西電力	366,000	1,222.50	447,435,000
中国電力	133,500	1,445.00	192,907,500
北陸電力	88,300	783.00	69,138,900
東北電力	241,300	1,076.00	259,638,800
四国電力	87,000	1,058.00	92,046,000
九州電力	199,100	935.00	186,158,500
北海道電力	90,400	518.00	46,827,200
沖縄電力	17,900	1,991.00	35,638,900
電源開発	76,800	2,666.00	204,748,800
エフオン	4,500	764.00	3,438,000
イーレックス	13,700	1,810.00	24,797,000
レノバ	15,900	1,126.00	17,903,400
東京瓦斯	185,700	2,618.50	486,255,450
大阪瓦斯	187,400	2,098.00	393,165,200
東邦瓦斯	47,800	4,200.00	200,760,000
北海道瓦斯	5,200	1,596.00	8,299,200
広島ガス	19,900	355.00	7,064,500
西部瓦斯	10,900	2,437.00	26,563,300
静岡ガス	27,400	930.00	25,482,000
メタウォーター	4,700	4,230.00	19,881,000
SBSホールディングス	8,300	2,018.00	16,749,400
東武鉄道	101,900	4,070.00	414,733,000
相鉄ホールディングス	30,900	3,025.00	93,472,500

東急	243,600	2,136.00	520,329,600
京浜急行電鉄	124,000	2,168.00	268,832,000
小田急電鉄	143,700	2,630.00	377,931,000
京王電鉄	50,100	6,830.00	342,183,000
京成電鉄	67,200	4,440.00	298,368,000
富士急行	13,200	4,255.00	56,166,000
新京成電鉄	2,500	2,332.00	5,830,000
東日本旅客鉄道	170,000	9,870.00	1,677,900,000
西日本旅客鉄道	86,100	9,473.00	815,625,300
東海旅客鉄道	80,300	21,865.00	1,755,759,500
西武ホールディングス	129,600	1,906.00	247,017,600
鴻池運輸	15,400	1,659.00	25,548,600
西日本鉄道	26,800	2,605.00	69,814,000
ハマキョウレックス	7,400	3,570.00	26,418,000
サカイ引越センター	5,100	7,000.00	35,700,000
近鉄グループホールディングス	91,500	6,000.00	549,000,000
阪急阪神ホールディングス	122,000	4,755.00	580,110,000
南海電気鉄道	43,400	3,005.00	130,417,000
京阪ホールディングス	40,700	5,370.00	218,559,000
神戸電鉄	2,200	3,990.00	8,778,000
名古屋鉄道	75,200	3,450.00	259,440,000
山陽電気鉄道	6,500	2,231.00	14,501,500
日本通運	32,300	6,770.00	218,671,000
ヤマトホールディングス	160,400	1,837.00	294,654,800
山九	25,400	5,580.00	141,732,000
丸運	5,200	285.00	1,482,000
丸全昭和運輸	7,400	3,110.00	23,014,000
センコーグループホールディングス	50,400	928.00	46,771,200
トナミホールディングス	2,200	5,240.00	11,528,000
ニッコンホールディングス	32,700	2,752.00	89,990,400
日本石油輸送	1,000	2,813.00	2,813,000
福山通運	11,700	4,135.00	48,379,500
セイノーホールディングス	68,500	1,513.00	103,640,500
エスライン	2,700	1,006.00	2,716,200
神奈川中央交通	2,300	4,035.00	9,280,500
日立物流	16,800	3,030.00	50,904,000
丸和運輸機関	9,600	2,561.00	24,585,600
C & F ロジホールディングス	9,200	1,455.00	13,386,000
九州旅客鉄道	81,600	3,725.00	303,960,000
S Gホールディングス	96,000	2,589.00	248,544,000
日本郵船	76,800	1,980.00	152,064,000
商船三井	58,100	3,005.00	174,590,500

川崎汽船	28,200	1,958.00	55,215,600
N Sユナイテッド海運	5,300	2,292.00	12,147,600
飯野海運	45,100	376.00	16,957,600
共栄タンカー	1,300	1,844.00	2,397,200
乾汽船	5,300	1,153.00	6,110,900
日本航空	167,500	3,350.00	561,125,000
A N Aホールディングス	167,200	3,700.00	618,640,000
パスコ	1,800	2,137.00	3,846,600
トランコム	2,600	7,850.00	20,410,000
日新	7,900	1,816.00	14,346,400
三菱倉庫	29,000	2,809.00	81,461,000
三井倉庫ホールディングス	10,400	2,007.00	20,872,800
住友倉庫	33,700	1,505.00	50,718,500
澁澤倉庫	5,000	2,240.00	11,200,000
東陽倉庫	16,500	338.00	5,577,000
日本トランスシティ	20,100	545.00	10,954,500
ケイヒン	1,800	1,314.00	2,365,200
中央倉庫	5,600	1,219.00	6,826,400
川西倉庫	1,700	1,056.00	1,795,200
安田倉庫	7,500	1,006.00	7,545,000
ファイズホールディングス	1,900	625.00	1,187,500
東洋埠頭	2,800	1,397.00	3,911,600
宇徳	7,800	542.00	4,227,600
上組	52,400	2,418.00	126,703,200
サンリツ	2,200	703.00	1,546,600
キムラユニティー	2,400	1,111.00	2,666,400
キューソー流通システム	2,300	1,905.00	4,381,500
近鉄エクスプレス	19,400	1,887.00	36,607,800
東海運	5,200	285.00	1,482,000
エーアイティー	6,500	954.00	6,201,000
内外トランスライン	3,200	1,510.00	4,832,000
日本コンセプト	2,900	1,480.00	4,292,000
N E C ネットズエスアイ	9,000	3,625.00	32,625,000
クロスキャット	2,700	1,086.00	2,932,200
システナ	33,900	1,803.00	61,121,700
デジタルアーツ	4,700	5,800.00	27,260,000
日鉄ソリューションズ	14,300	3,860.00	55,198,000
キューブシステム	5,300	803.00	4,255,900
エイジア	1,900	1,395.00	2,650,500
コア	4,200	1,416.00	5,947,200
ソリトンシステムズ	4,300	1,259.00	5,413,700
ソフトクリエイイトホールディングス	4,300	1,811.00	7,787,300

T I S	31,600	6,740.00	212,984,000
ネオス	3,800	906.00	3,442,800
電算システム	3,700	3,090.00	11,433,000
グリー	65,800	515.00	33,887,000
コーエーテクモホールディングス	19,500	2,693.00	52,513,500
三菱総合研究所	4,100	4,085.00	16,748,500
電算	1,100	2,240.00	2,464,000
A G S	5,600	787.00	4,407,200
ファインデックス	8,200	1,292.00	10,594,400
ブレインパッド	2,000	5,570.00	11,140,000
K L a b	18,300	861.00	15,756,300
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	11,600	994.00	11,530,400
イーブুকイニシアティブジャパン	1,500	1,958.00	2,937,000
ネクソン	269,800	1,502.00	405,239,600
アイスタイル	24,800	756.00	18,748,800
エムアップ	2,800	2,700.00	7,560,000
エイチーム	6,700	1,179.00	7,899,300
エニグモ	6,900	1,009.00	6,962,100
テクノスジャパン	7,800	512.00	3,993,600
コロプラ	31,200	1,270.00	39,624,000
ブロードリーフ	47,300	697.00	32,968,100
クロス・マーケティンググループ	4,800	370.00	1,776,000
デジタルハーツホールディングス	5,200	1,107.00	5,756,400
システム情報	5,000	1,076.00	5,380,000
メディアドゥホールディングス	3,000	3,910.00	11,730,000
じげん	23,800	567.00	13,494,600
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	852.00	1,533,600
サイバーリンクス	1,600	1,296.00	2,073,600
フィックスターズ	10,200	1,582.00	16,136,400
C A R T A H O L D I N G S	4,700	1,299.00	6,105,300
オブティム	2,500	3,370.00	8,425,000
セレス	3,300	1,204.00	3,973,200
S H I F T	2,500	7,840.00	19,600,000
ティーガイア	8,500	2,672.00	22,712,000
セック	1,400	3,770.00	5,278,000
日本アジアグループ	10,000	388.00	3,880,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,444.00	9,530,400
テクマトリックス	6,800	2,390.00	16,252,000
プロシップ	2,900	1,337.00	3,877,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,900	2,390.00	54,731,000
G M O ペイメントゲートウェイ	15,600	7,630.00	119,028,000
ザッパラス	5,400	421.00	2,273,400

システムリサーチ	2,600	1,761.00	4,578,600
インターネットイニシアティブ	14,100	2,656.00	37,449,600
さくらインターネット	10,500	730.00	7,665,000
ヴィンクス	2,800	1,242.00	3,477,600
GMOクラウド	1,800	2,853.00	5,135,400
SRAホールディングス	5,100	2,585.00	13,183,500
Minorityソリューションズ	1,900	2,700.00	5,130,000
システムインテグレータ	3,200	917.00	2,934,400
朝日ネット	7,100	638.00	4,529,800
eBASE	5,800	1,190.00	6,902,000
アバント	7,000	1,049.00	7,343,000
アドソル日進	3,400	2,328.00	7,915,200
フリービット	5,800	962.00	5,579,600
コムチュア	10,700	2,403.00	25,712,100
サイバーコム	1,800	2,190.00	3,942,000
アステリア	6,100	663.00	4,044,300
アイル	3,500	2,040.00	7,140,000
マークラインズ	4,800	2,127.00	10,209,600
メディカル・データ・ビジョン	7,400	912.00	6,748,800
ショーケース	2,600	646.00	1,679,600
モバイルファクトリー	2,300	1,417.00	3,259,100
テラスカイ	3,500	2,580.00	9,030,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,635.00	7,030,500
PCIホールディングス	2,000	2,202.00	4,404,000
パイプドHD	1,300	1,705.00	2,216,500
アイビーシー	1,900	1,250.00	2,375,000
ネオジャパン	2,000	1,131.00	2,262,000
PR TIMES	900	2,259.00	2,033,100
ランドコンピュータ	1,600	1,147.00	1,835,200
ダブルスタンダード	1,300	5,080.00	6,604,000
オープンドア	4,800	1,725.00	8,280,000
マイネット	3,000	682.00	2,046,000
アカツキ	3,400	6,170.00	20,978,000
ベネフィットジャパン	900	1,529.00	1,376,100
Ubicomホールディングス	2,300	1,166.00	2,681,800
LINE	21,600	5,200.00	112,320,000
カナミックネットワーク	6,100	711.00	4,337,100
ノムラシステムコーポレーション	2,500	567.00	1,417,500
チェンジ	2,000	2,727.00	5,454,000
シンクロ・フード	4,400	607.00	2,670,800
オークネット	6,000	1,404.00	8,424,000
セグエグループ	1,800	909.00	1,636,200

エイトレッド	1,300	1,527.00	1,985,100
A O I T Y O H o l d i n g s	9,900	713.00	7,058,700
マクロミル	17,100	1,028.00	17,578,800
ビーグリー	2,000	1,313.00	2,626,000
オロ	2,500	4,070.00	10,175,000
テモナ	1,700	486.00	826,200
ニーズウェル	1,500	703.00	1,054,500
サインポスト	1,600	2,525.00	4,040,000
ソルクシーズ	4,300	939.00	4,037,700
フェイス	3,600	797.00	2,869,200
プロトコーポレーション	8,700	1,191.00	10,361,700
ハイマックス	1,200	1,971.00	2,365,200
野村総合研究所	158,500	2,380.00	377,230,000
サイバネットシステム	7,000	813.00	5,691,000
C E ホールディングス	5,900	458.00	2,702,200
日本システム技術	1,700	1,263.00	2,147,100
インテージホールディングス	12,000	960.00	11,520,000
東邦システムサイエンス	2,700	939.00	2,535,300
ソースネクスト	45,300	489.00	22,151,700
インフォコム	10,500	2,487.00	26,113,500
ラクスル	5,100	3,395.00	17,314,500
F I G	11,000	312.00	3,432,000
システムサポート	900	2,322.00	2,089,800
イーソル	3,500	2,036.00	7,126,000
アルテリア・ネットワークス	10,600	1,674.00	17,744,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,610.00	3,703,000
フォーカスシステムズ	6,100	893.00	5,447,300
クレスコ	2,900	3,590.00	10,411,000
フジ・メディア・ホールディングス	91,400	1,530.00	139,842,000
オービック	32,900	14,960.00	492,184,000
ジャストシステム	15,400	6,050.00	93,170,000
T D C ソフト	8,500	910.00	7,735,000
Zホールディングス	1,302,100	376.00	489,589,600
トレンドマイクロ	42,200	5,840.00	246,448,000
I D ホールディングス	3,800	1,433.00	5,445,400
日本オラクル	19,200	10,050.00	192,960,000
アルファシステムズ	3,000	3,010.00	9,030,000
フューチャー	11,600	1,869.00	21,680,400
C A C H o l d i n g s	6,300	1,629.00	10,262,700
S B テクノロジー	3,500	1,982.00	6,937,000
トーセ	2,800	953.00	2,668,400
オービックビジネスコンサルタント	9,700	5,010.00	48,597,000



伊藤忠テクノソリューションズ	43,300	3,030.00	131,199,000
アイティフォー	11,700	871.00	10,190,700
東計電算	1,500	3,785.00	5,677,500
エクスネット	1,700	971.00	1,650,700
大塚商会	51,300	4,810.00	246,753,000
サイボウズ	11,300	1,223.00	13,819,900
ソフトブレーン	6,000	596.00	3,576,000
電通国際情報サービス	5,900	4,290.00	25,311,000
デジタルガレージ	17,100	4,170.00	71,307,000
E Mシステムズ	6,700	2,143.00	14,358,100
ウェザーニューズ	3,300	3,465.00	11,434,500
C I J	7,300	1,009.00	7,365,700
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,225.00	3,547,500
日本エンタープライズ	10,500	230.00	2,415,000
WOWOW	4,600	2,773.00	12,755,800
スカラ	7,000	780.00	5,460,000
インテリジェント ウェイブ	3,800	754.00	2,865,200
I M A G I C A G R O U P	8,400	614.00	5,157,600
ネットワンシステムズ	36,200	3,170.00	114,754,000
システムソフト	24,400	110.00	2,684,000
アルゴグラフィックス	8,100	3,500.00	28,350,000
マーベラス	14,800	760.00	11,248,000
エイベックス	16,400	1,300.00	21,320,000
日本ユニシス	29,700	3,685.00	109,444,500
兼松エレクトロニクス	5,200	3,580.00	18,616,000
東京放送ホールディングス	57,800	1,761.00	101,785,800
日本テレビホールディングス	79,300	1,474.00	116,888,200
朝日放送グループホールディングス	9,700	744.00	7,216,800
テレビ朝日ホールディングス	26,200	1,958.00	51,299,600
スカパーJ S A Tホールディングス	62,800	471.00	29,578,800
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,347.00	18,541,300
日本BS放送	3,400	1,083.00	3,682,200
ビジョン	8,900	1,860.00	16,554,000
スマートバリュー	3,000	820.00	2,460,000
ワイヤレスゲート	4,800	671.00	3,220,800
コネクシオ	5,500	1,607.00	8,838,500
クロップス	2,000	800.00	1,600,000
日本電信電話	633,500	5,582.00	3,536,197,000
K D D I	706,400	3,200.00	2,260,480,000
ソフトバンク	861,500	1,456.00	1,254,344,000
光通信	9,800	26,450.00	259,210,000
N T T ドコモ	700,200	3,012.00	2,109,002,400

エムティーアイ	9,500	702.00	6,669,000
GMOインターネット	37,500	2,248.00	84,300,000
ファイバーゲート	1,900	1,447.00	2,749,300
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	715.00	2,288,000
KADOKAWA	25,600	1,910.00	48,896,000
学研ホールディングス	3,200	7,350.00	23,520,000
ゼンリン	19,000	1,933.00	36,727,000
昭文社	4,900	411.00	2,013,900
インプレスホールディングス	7,800	202.00	1,575,600
アイネット	5,000	1,565.00	7,825,000
松竹	6,300	16,150.00	101,745,000
東宝	56,700	4,440.00	251,748,000
東映	3,600	17,090.00	61,524,000
エヌ・ティ・ティ・データ	252,500	1,507.00	380,517,500
ピー・シー・エー	1,300	4,700.00	6,110,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,345.00	3,986,500
D T S	21,300	2,515.00	53,569,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,500	5,620.00	227,610,000
シーイーシー	10,200	2,285.00	23,307,000
カブコン	44,800	2,721.00	121,900,800
アイ・エス・ビー	1,900	1,976.00	3,754,400
ジャステック	6,200	1,113.00	6,900,600
S C S K	21,900	5,890.00	128,991,000
日本システムウエア	3,200	2,566.00	8,211,200
アイネス	9,500	1,425.00	13,537,500
T K C	8,100	5,200.00	42,120,000
富士ソフト	12,200	4,255.00	51,911,000
N S D	15,600	3,650.00	56,940,000
コナミホールディングス	34,500	4,850.00	167,325,000
福井コンピュータホールディングス	3,800	4,145.00	15,751,000
J B C Cホールディングス	6,500	1,948.00	12,662,000
ミロク情報サービス	8,400	3,455.00	29,022,000
ソフトバンクグループ	752,100	4,295.00	3,230,269,500
ハウスイ	800	876.00	700,800
高千穂交易	3,700	1,104.00	4,084,800
伊藤忠食品	2,300	5,140.00	11,822,000
エレマテック	8,900	1,113.00	9,905,700
J A L U X	2,700	2,530.00	6,831,000
あらた	7,600	4,430.00	33,668,000
トーマンデバイス	1,400	2,991.00	4,187,400
東京エレクトロン デバイス	3,500	2,394.00	8,379,000
フィールズ	7,300	532.00	3,883,600

双日	525,400	360.00	189,144,000
アルフレッサ ホールディングス	105,700	2,292.00	242,264,400
横浜冷凍	26,700	1,067.00	28,488,900
ラサ商事	5,100	921.00	4,697,100
ラクーンホールディングス	4,600	860.00	3,956,000
アルコニックス	10,100	1,499.00	15,139,900
神戸物産	32,800	3,580.00	117,424,000
あい ホールディングス	13,600	1,980.00	26,928,000
ディーブイエックス	3,400	899.00	3,056,600
ダイワボウホールディングス	8,100	6,500.00	52,650,000
マクニカ・富士エレホールディングス	22,700	1,952.00	44,310,400
ラクト・ジャパン	3,500	3,545.00	12,407,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,900	1,091.00	19,528,900
八洲電機	7,400	898.00	6,645,200
メディアスホールディングス	5,400	812.00	4,384,800
レスターホールディングス	9,900	2,106.00	20,849,400
ジューテックホールディングス	2,200	1,142.00	2,512,400
大光	4,100	673.00	2,759,300
OCHIホールディングス	2,800	1,418.00	3,970,400
TOKAIホールディングス	50,300	1,115.00	56,084,500
黒谷	2,200	453.00	996,600
Cominix	1,700	826.00	1,404,200
三洋貿易	4,800	2,400.00	11,520,000
ビューティガレージ	1,500	2,367.00	3,550,500
ウイン・パートナーズ	6,900	1,458.00	10,060,200
ミタチ産業	2,900	754.00	2,186,600
シップヘルスケアホールディングス	15,200	4,625.00	70,300,000
明治電機工業	3,000	1,645.00	4,935,000
デリカフーズホールディングス	3,400	699.00	2,376,600
スターティアホールディングス	2,200	634.00	1,394,800
コメダホールディングス	20,700	2,106.00	43,594,200
アセンテック	800	2,048.00	1,638,400
富士興産	2,900	739.00	2,143,100
協栄産業	1,100	1,558.00	1,713,800
小野建	8,500	1,383.00	11,755,500
南陽	2,100	1,857.00	3,899,700
佐島電機	7,000	923.00	6,461,000
エコートレーディング	2,200	549.00	1,207,800
伯東	5,800	1,355.00	7,859,000
コンドーテック	7,400	1,142.00	8,450,800
中山福	5,500	548.00	3,014,000
ナガイレーベン	13,800	2,588.00	35,714,400

三菱食品	10,500	3,065.00	32,182,500
松田産業	7,000	1,576.00	11,032,000
第一興商	14,200	5,510.00	78,242,000
メディバルホールディングス	102,700	2,392.00	245,658,400
S P K	2,000	2,834.00	5,668,000
萩原電気ホールディングス	3,500	2,849.00	9,971,500
アズワン	6,200	9,840.00	61,008,000
スズデン	3,300	1,514.00	4,996,200
尾家産業	2,800	1,354.00	3,791,200
シモジマ	5,800	1,237.00	7,174,600
ドウシシャ	9,000	1,856.00	16,704,000
小津産業	2,100	1,767.00	3,710,700
高速	5,700	1,180.00	6,726,000
たけびし	3,300	1,452.00	4,791,600
リックス	2,200	1,683.00	3,702,600
丸文	8,500	613.00	5,210,500
ハピネット	8,000	1,440.00	11,520,000
橋本総業ホールディングス	1,900	1,977.00	3,756,300
日本ライフライン	28,200	1,557.00	43,907,400
タカショー	4,700	501.00	2,354,700
エクセル	2,700	1,561.00	4,214,700
マルカ	3,400	2,339.00	7,952,600
I D O M	25,700	574.00	14,751,800
進和	5,600	2,449.00	13,714,400
エスケイジャパン	2,100	460.00	966,000
ダイトロン	4,000	1,837.00	7,348,000
シークス	12,100	1,549.00	18,742,900
田中商事	2,900	714.00	2,070,600
オーハシテクニカ	5,400	1,453.00	7,846,200
白銅	3,400	1,538.00	5,229,200
伊藤忠商事	665,400	2,457.50	1,635,220,500
丸紅	990,200	829.20	821,073,840
高島	1,500	1,763.00	2,644,500
長瀬産業	53,500	1,666.00	89,131,000
蝶理	6,100	2,131.00	12,999,100
豊田通商	106,200	3,865.00	410,463,000
三共生興	14,400	600.00	8,640,000
兼松	35,500	1,462.00	51,901,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,070.00	1,819,000
三井物産	836,100	1,968.00	1,645,444,800
日本紙パルプ商事	5,400	4,140.00	22,356,000
日立ハイテクノロジーズ	33,000	7,440.00	245,520,000

カメイ	12,400	1,258.00	15,599,200
東都水産	1,200	2,681.00	3,217,200
OUGホールディングス	1,500	2,684.00	4,026,000
スターゼン	3,500	4,430.00	15,505,000
山善	37,200	1,054.00	39,208,800
椿本興業	1,800	4,075.00	7,335,000
住友商事	600,200	1,665.00	999,333,000
内田洋行	4,100	7,150.00	29,315,000
三菱商事	667,500	2,920.50	1,949,433,750
第一実業	4,700	3,825.00	17,977,500
キャノンマーケティングジャパン	27,200	2,586.00	70,339,200
西華産業	5,400	1,382.00	7,462,800
佐藤商事	7,900	964.00	7,615,600
菱洋エレクトロ	9,700	2,035.00	19,739,500
東京産業	8,600	601.00	5,168,600
ユアサ商事	9,000	3,775.00	33,975,000
神鋼商事	2,400	2,690.00	6,456,000
小林産業	5,800	305.00	1,769,000
阪和興業	17,800	2,889.00	51,424,200
正栄食品工業	6,200	3,430.00	21,266,000
カナデン	7,700	1,351.00	10,402,700
菱電商事	6,900	1,632.00	11,260,800
フルサト工業	5,300	1,674.00	8,872,200
岩谷産業	21,100	3,700.00	78,070,000
すてきナイスグループ	4,000	1,193.00	4,772,000
昭光通商	3,000	719.00	2,157,000
ニチモウ	1,500	2,007.00	3,010,500
極東貿易	2,700	2,248.00	6,069,600
イワキ	12,500	476.00	5,950,000
三愛石油	23,400	1,121.00	26,231,400
稲畑産業	21,000	1,630.00	34,230,000
G S Iクレオス	2,300	1,348.00	3,100,400
明和産業	8,800	621.00	5,464,800
クワザワ	3,400	614.00	2,087,600
ワキタ	20,300	1,100.00	22,330,000
東邦ホールディングス	30,500	2,495.00	76,097,500
サンゲツ	26,100	2,115.00	55,201,500
ミツウロコグループホールディングス	14,000	1,443.00	20,202,000
シナネンホールディングス	3,900	1,917.00	7,476,300
伊藤忠エネクス	21,100	930.00	19,623,000
サンリオ	26,700	2,222.00	59,327,400
サンワテクノス	6,800	1,203.00	8,180,400

リョーサン	10,500	2,845.00	29,872,500
新光商事	14,900	895.00	13,335,500
トーホー	4,300	1,894.00	8,144,200
三信電気	5,100	1,758.00	8,965,800
東陽テクニカ	11,000	1,264.00	13,904,000
モスフードサービス	12,500	3,075.00	38,437,500
加賀電子	9,500	2,615.00	24,842,500
ソーダニッカ	9,900	611.00	6,048,900
立花エレテック	7,000	1,736.00	12,152,000
フォーバル	4,200	1,050.00	4,410,000
PALTAC	15,300	5,440.00	83,232,000
三谷産業	12,600	340.00	4,284,000
西本Wismettacホールディングス	1,700	3,900.00	6,630,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,538.00	1,230,400
国際紙パルプ商事	22,600	306.00	6,915,600
ヤマタネ	4,800	1,534.00	7,363,200
丸紅建材リース	900	1,761.00	1,584,900
日鉄物産	6,800	5,160.00	35,088,000
泉州電業	2,900	3,175.00	9,207,500
トラスコ中山	19,800	2,924.00	57,895,200
オートバックスセブン	35,300	1,780.00	62,834,000
モリト	7,000	794.00	5,558,000
加藤産業	14,900	3,730.00	55,577,000
北恵	1,800	961.00	1,729,800
イノテック	5,700	1,073.00	6,116,100
イエローハット	18,000	2,031.00	36,558,000
JKホールディングス	8,600	659.00	5,667,400
日伝	8,600	2,081.00	17,896,600
北沢産業	7,200	284.00	2,044,800
杉本商事	5,100	2,065.00	10,531,500
因幡電機産業	27,100	2,762.00	74,850,200
東テク	3,200	2,446.00	7,827,200
ミスミグループ本社	119,200	2,733.00	325,773,600
アルテック	7,700	230.00	1,771,000
タキヒヨー	2,900	1,957.00	5,675,300
蔵王産業	1,800	1,443.00	2,597,400
スズケン	40,300	4,785.00	192,835,500
ジェコス	6,600	1,021.00	6,738,600
グローセル	9,600	454.00	4,358,400
ローソン	24,100	5,960.00	143,636,000
サンエー	8,000	4,950.00	39,600,000
カワチ薬品	7,500	2,217.00	16,627,500

エービーシー・マート	14,900	7,520.00	112,048,000	
ハードオフコーポレーション	4,000	826.00	3,304,000	
アスクル	10,000	2,976.00	29,760,000	
ゲオホールディングス	17,300	1,344.00	23,251,200	
アダストリア	13,200	2,600.00	34,320,000	
ジーフット	6,000	624.00	3,744,000	
くら寿司	5,000	5,030.00	25,150,000	
キャンドウ	4,600	1,657.00	7,622,200	
パルグループホールディングス	4,900	3,560.00	17,444,000	
エディオン	43,800	1,242.00	54,399,600	
サーラコーポレーション	19,600	630.00	12,348,000	
ワッツ	4,500	610.00	2,745,000	
ハローズ	3,600	2,711.00	9,759,600	
フジオフードシステム	4,100	3,650.00	14,965,000	
あみやき亭	2,100	3,700.00	7,770,000	
ひらまつ	18,100	301.00	5,448,100	
大黒天物産	2,300	3,155.00	7,256,500	
ハニーズホールディングス	8,500	1,606.00	13,651,000	
ファーマライズホールディングス	2,500	644.00	1,610,000	
アルペン	7,400	1,890.00	13,986,000	
ハブ	2,900	1,042.00	3,021,800	
クオールホールディングス	14,100	1,562.00	22,024,200	
ジinzホールディングス	5,100	7,020.00	35,802,000	
ビックカメラ	56,600	1,282.00	72,561,200	
D C Mホールディングス	51,500	1,073.00	55,259,500	
Monotaro	67,700	3,040.00	205,808,000	
東京一番フーズ	2,700	622.00	1,679,400	
DDホールディングス	3,800	1,549.00	5,886,200	
きちりホールディングス	2,800	858.00	2,402,400	
アークランドサービスホールディングス	7,100	1,850.00	13,135,000	
J.フロント リテイリング	113,700	1,482.00	168,503,400	
ドトール・日レスホールディングス	15,300	2,197.00	33,614,100	
マツモトキヨシホールディングス	39,400	4,210.00	165,874,000	
ブロンコビリー	5,000	2,762.00	13,810,000	
Z O Z O	65,500	2,118.00	138,729,000	
トレジャー・ファクトリー	3,000	1,122.00	3,366,000	
物語コーポレーション	2,400	8,640.00	20,736,000	
ココカラファイン	10,000	6,310.00	63,100,000	
三越伊勢丹ホールディングス	166,400	1,015.00	168,896,000	
Hamee	3,000	1,342.00	4,026,000	
ウエルシアホールディングス	28,300	6,830.00	193,289,000	
クリエイトSDホールディングス	14,100	2,747.00	38,732,700	

丸善C H Iホールディングス	11,100	375.00	4,162,500
ティーライフ	1,500	858.00	1,287,000
エー・ピーカンパニー	2,200	533.00	1,172,600
チムニー	3,000	2,326.00	6,978,000
シュッピン	6,600	1,186.00	7,827,600
ネクステージ	13,700	1,239.00	16,974,300
ジョイフル本田	28,000	1,442.00	40,376,000
鳥貴族	3,200	2,378.00	7,609,600
キリン堂ホールディングス	3,800	2,088.00	7,934,400
ホットランド	6,500	1,394.00	9,061,000
すかいらーくホールディングス	106,700	2,187.00	233,352,900
S F Pホールディングス	4,100	2,238.00	9,175,800
綿半ホールディングス	3,700	1,989.00	7,359,300
ヨシックス	1,600	2,808.00	4,492,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,800	972.00	27,021,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	695.00	3,266,500
B E E N O S	3,500	1,437.00	5,029,500
あさひ	7,200	1,293.00	9,309,600
日本調剤	2,900	3,845.00	11,150,500
コスモス薬品	4,200	22,900.00	96,180,000
トーエル	4,800	782.00	3,753,600
オンリー	1,900	805.00	1,529,500
セブン&アイ・ホールディングス	372,200	4,063.00	1,512,248,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	25,700	1,815.00	46,645,500
ツルハホールディングス	20,700	13,100.00	271,170,000
サンマルクホールディングス	7,600	2,320.00	17,632,000
フェリシモ	2,300	1,022.00	2,350,600
トリドールホールディングス	11,800	2,827.00	33,358,600
T O K Y O B A S E	8,800	702.00	6,177,600
ウイルプラスホールディングス	1,700	979.00	1,664,300
ジャパンミート	4,900	2,194.00	10,750,600
サツドラホールディングス	1,500	1,775.00	2,662,500
デファクトスタンダード	1,300	412.00	535,600
アレンザホールディングス	5,000	914.00	4,570,000
串カツ田中ホールディングス	1,500	2,151.00	3,226,500
パロックジャパンリミテッド	6,800	973.00	6,616,400
クスリのアオキホールディングス	9,500	8,280.00	78,660,000
力の源ホールディングス	4,500	892.00	4,014,000
スシローグローバルホールディングス	10,500	8,710.00	91,455,000
L I X I L ビバ	9,500	1,940.00	18,430,000
メディカルシステムネットワーク	9,500	551.00	5,234,500



はるやまホールディングス	4,700	847.00	3,980,900
ノジマ	17,000	2,361.00	40,137,000
カッパ・クリエイト	13,300	1,538.00	20,455,400
ライトオン	7,100	610.00	4,331,000
良品計画	126,400	2,552.00	322,572,800
三城ホールディングス	10,700	290.00	3,103,000
アドヴァン	14,700	1,284.00	18,874,800
アルビス	3,700	2,312.00	8,554,400
コナカ	11,700	403.00	4,715,100
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,666.00	2,165,800
G - 7ホールディングス	2,800	4,680.00	13,104,000
イオン北海道	9,700	789.00	7,653,300
コジマ	16,800	490.00	8,232,000
ヒマラヤ	3,600	832.00	2,995,200
コーナン商事	13,600	2,568.00	34,924,800
エコス	3,600	1,682.00	6,055,200
ワタミ	11,400	1,312.00	14,956,800
マルシェ	2,700	779.00	2,103,300
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	228,100	1,795.00	409,439,500
西松屋チェーン	21,100	1,018.00	21,479,800
ゼンショーホールディングス	45,700	2,459.00	112,376,300
幸楽苑ホールディングス	6,100	2,127.00	12,974,700
ハークスレイ	2,200	1,070.00	2,354,000
サイゼリヤ	15,700	2,628.00	41,259,600
V Tホールディングス	39,800	486.00	19,342,800
魚力	2,800	1,556.00	4,356,800
フジ・コーポレーション	2,600	2,386.00	6,203,600
ユナイテッドアローズ	10,000	3,355.00	33,550,000
ハイデイ日高	13,800	2,215.00	30,567,000
京都きもの友禅	6,600	358.00	2,362,800
コロナイド	31,700	2,198.00	69,676,600
ピーシーデポコーポレーション	13,000	518.00	6,734,000
壱番屋	6,700	5,380.00	36,046,000
P L A N T	2,700	661.00	1,784,700
スギホールディングス	19,000	6,140.00	116,660,000
薬王堂ホールディングス	4,200	2,490.00	10,458,000
スクロール	15,200	365.00	5,548,000
ヨンドシーホールディングス	9,700	2,619.00	25,404,300
ファミリーマート	76,000	2,541.00	193,116,000
木曽路	12,500	2,945.00	36,812,500
S R Sホールディングス	11,400	1,037.00	11,821,800
タカキュー	8,300	194.00	1,610,200

ケーヨー	19,800	538.00	10,652,400
上新電機	11,300	2,555.00	28,871,500
日本瓦斯	15,100	3,530.00	53,303,000
ロイヤルホールディングス	16,700	2,543.00	42,468,100
いなげや	11,900	1,511.00	17,980,900
鳥忠	18,000	3,035.00	54,630,000
チヨダ	10,100	1,626.00	16,422,600
ライフコーポレーション	7,300	2,502.00	18,264,600
リンガーハット	11,800	2,521.00	29,747,800
MrMaxHD	13,500	498.00	6,723,000
テンアライド	8,800	435.00	3,828,000
AOKIホールディングス	19,200	1,146.00	22,003,200
オークワ	15,000	1,463.00	21,945,000
コメリ	14,800	2,379.00	35,209,200
青山商事	19,800	1,613.00	31,937,400
しまむら	11,100	9,280.00	103,008,000
はせがわ	5,500	402.00	2,211,000
高島屋	69,400	1,304.00	90,497,600
松屋	19,300	891.00	17,196,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	45,200	1,266.00	57,223,200
近鉄百貨店	3,700	3,675.00	13,597,500
パルコ	9,300	1,347.00	12,527,100
丸井グループ	87,200	2,659.00	231,864,800
アクシアル リテイリング	7,900	3,985.00	31,481,500
イオン	366,100	2,231.50	816,952,150
イズミ	19,400	4,220.00	81,868,000
平和堂	19,400	2,099.00	40,720,600
フジ	11,600	1,939.00	22,492,400
ヤオコー	10,800	5,430.00	58,644,000
ゼビオホールディングス	11,600	1,312.00	15,219,200
ケーズホールディングス	91,900	1,441.00	132,427,900
Olympicグループ	5,200	649.00	3,374,800
日産東京販売ホールディングス	14,700	283.00	4,160,100
Genky DrugStores	4,700	2,550.00	11,985,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	1,324.00	2,250,800
総合メディカルホールディングス	8,400	2,073.00	17,413,200
ブックオフグループホールディングス	5,500	1,087.00	5,978,500
アインホールディングス	12,800	6,480.00	82,944,000
元気寿司	2,500	2,978.00	7,445,000
ヤマダ電機	290,200	572.00	165,994,400
アーランドサカモト	15,000	1,265.00	18,975,000
ニトリホールディングス	41,200	17,400.00	716,880,000

グルメ杵屋	6,900	1,199.00	8,273,100
愛眼	7,600	240.00	1,824,000
ケーユーホールディングス	5,200	948.00	4,929,600
吉野家ホールディングス	31,300	2,782.00	87,076,600
松屋フーズホールディングス	4,600	4,570.00	21,022,000
サガミホールディングス	12,900	1,381.00	17,814,900
関西スーパーマーケット	8,100	1,077.00	8,723,700
王将フードサービス	7,000	6,570.00	45,990,000
プレナス	10,700	1,936.00	20,715,200
ミニストップ	7,100	1,462.00	10,380,200
アークス	19,500	2,307.00	44,986,500
パローホールディングス	21,100	2,081.00	43,909,100
ベルク	4,700	5,200.00	24,440,000
大庄	5,200	1,611.00	8,377,200
ファーストリテイリング	12,700	64,040.00	813,308,000
サンドラッグ	35,800	3,980.00	142,484,000
サックスパー ホールディングス	8,300	910.00	7,553,000
ヤマザワ	2,300	1,674.00	3,850,200
やまや	2,000	2,269.00	4,538,000
ベルーナ	20,700	718.00	14,862,600
島根銀行	1,900	669.00	1,271,100
じもとホールディングス	64,400	108.00	6,955,200
めぶきフィナンシャルグループ	495,000	282.00	139,590,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	12,900	1,546.00	19,943,400
九州フィナンシャルグループ	156,300	488.00	76,274,400
ゆうちょ銀行	269,900	1,071.00	289,062,900
富山第一銀行	22,700	346.00	7,854,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	560,300	450.00	252,135,000
西日本フィナンシャルホールディングス	64,900	870.00	56,463,000
関西みらいフィナンシャルグループ	55,900	716.00	40,024,400
三十三フィナンシャルグループ	8,800	1,699.00	14,951,200
第四北越フィナンシャルグループ	16,500	3,080.00	50,820,000
新生銀行	69,900	1,659.00	115,964,100
あおぞら銀行	56,800	2,847.00	161,709,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,557,700	586.80	3,848,058,360
りそなホールディングス	1,045,400	483.30	505,241,820
三井住友トラスト・ホールディングス	180,100	4,210.00	758,221,000
三井住友フィナンシャルグループ	658,800	4,009.00	2,641,129,200
千葉銀行	327,700	634.00	207,761,800
群馬銀行	187,200	388.00	72,633,600
武蔵野銀行	14,200	1,979.00	28,101,800
千葉興業銀行	26,100	344.00	8,978,400

筑波銀行	39,600	235.00	9,306,000	
七十七銀行	32,200	1,827.00	58,829,400	
青森銀行	7,400	2,789.00	20,638,600	
秋田銀行	6,100	2,180.00	13,298,000	
山形銀行	10,700	1,625.00	17,387,500	
岩手銀行	6,200	2,999.00	18,593,800	
東邦銀行	85,200	277.00	23,600,400	
東北銀行	4,600	1,029.00	4,733,400	
みちのく銀行	6,100	1,549.00	9,448,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	80,200	2,128.00	170,665,600	
静岡銀行	235,900	841.00	198,391,900	
十六銀行	11,900	2,640.00	31,416,000	
スルガ銀行	97,500	547.00	53,332,500	
八十二銀行	229,900	475.00	109,202,500	
山梨中央銀行	11,100	1,166.00	12,942,600	
大垣共立銀行	18,800	2,476.00	46,548,800	
福井銀行	8,100	1,758.00	14,239,800	
北國銀行	9,800	3,695.00	36,211,000	
清水銀行	3,900	2,129.00	8,303,100	
富山銀行	1,800	2,526.00	4,546,800	
滋賀銀行	19,100	2,772.00	52,945,200	
南都銀行	15,800	2,743.00	43,339,400	
百五銀行	85,700	346.00	29,652,200	
京都銀行	34,100	4,640.00	158,224,000	
紀陽銀行	33,700	1,668.00	56,211,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	63,400	1,138.00	72,149,200	
広島銀行	140,600	539.00	75,783,400	
山陰合同銀行	56,500	680.00	38,420,000	
中国銀行	82,000	1,082.00	88,724,000	
鳥取銀行	3,200	1,360.00	4,352,000	
伊予銀行	135,900	619.00	84,122,100	
百十四銀行	10,100	2,204.00	22,260,400	
四国銀行	14,500	1,052.00	15,254,000	
阿波銀行	15,600	2,618.00	40,840,800	
大分銀行	5,500	2,783.00	15,306,500	
宮崎銀行	6,300	2,712.00	17,085,600	
佐賀銀行	5,800	1,796.00	10,416,800	
沖縄銀行	8,700	3,610.00	31,407,000	
琉球銀行	22,000	1,222.00	26,884,000	
セブン銀行	318,200	352.00	112,006,400	
みずほフィナンシャルグループ	12,944,700	170.90	2,212,249,230	
高知銀行	3,500	925.00	3,237,500	

山口フィナンシャルグループ	118,900	760.00	90,364,000
長野銀行	3,100	1,665.00	5,161,500
名古屋銀行	7,700	3,355.00	25,833,500
北洋銀行	143,600	240.00	34,464,000
愛知銀行	3,400	3,745.00	12,733,000
中京銀行	3,900	2,219.00	8,654,100
大光銀行	3,300	1,664.00	5,491,200
愛媛銀行	13,300	1,183.00	15,733,900
トマト銀行	3,700	1,071.00	3,962,700
京葉銀行	40,600	628.00	25,496,800
栃木銀行	46,000	235.00	10,810,000
北日本銀行	3,000	2,155.00	6,465,000
東和銀行	16,700	884.00	14,762,800
福島銀行	9,000	287.00	2,583,000
大東銀行	5,000	631.00	3,155,000
トモニホールディングス	73,600	441.00	32,457,600
フィデアホールディングス	92,500	130.00	12,025,000
池田泉州ホールディングス	109,500	215.00	23,542,500
F P G	30,000	1,064.00	31,920,000
マーキュリアインベストメント	4,400	771.00	3,392,400
S B Iホールディングス	106,500	2,305.00	245,482,500
ジャフコ	14,700	4,205.00	61,813,500
大和証券グループ本社	764,700	549.00	419,820,300
野村ホールディングス	1,676,500	565.00	947,222,500
岡三証券グループ	81,500	400.00	32,600,000
丸三証券	28,600	540.00	15,444,000
東洋証券	34,900	164.00	5,723,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	109,800	334.00	36,673,200
光世証券	2,500	661.00	1,652,500
水戸証券	28,200	244.00	6,880,800
いちよし証券	18,000	675.00	12,150,000
松井証券	54,600	891.00	48,648,600
だいこう証券ビジネス	4,800	640.00	3,072,000
マネックスグループ	72,400	276.00	19,982,400
極東証券	13,000	777.00	10,101,000
岩井コスモホールディングス	9,100	1,300.00	11,830,000
藍澤證券	17,300	752.00	13,009,600
マネーパートナーズグループ	10,700	246.00	2,632,200
スパークス・グループ	33,600	254.00	8,534,400
かんぽ生命保険	33,700	1,932.00	65,108,400
S O M P Oホールディングス	179,100	4,410.00	789,831,000
アニコム ホールディングス	7,900	3,435.00	27,136,500

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	249,100	3,641.00	906,973,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	78,300	2,604.00	203,893,200
第一生命ホールディングス	539,100	1,825.50	984,127,050
東京海上ホールディングス	340,700	6,171.00	2,102,459,700
T & Dホールディングス	294,600	1,362.00	401,245,200
アドバンスクリエイト	2,200	1,839.00	4,045,800
全国保証	26,800	4,510.00	120,868,000
ジェイリース	2,600	319.00	829,400
イントラスト	3,300	732.00	2,415,600
日本モーゲージサービス	1,900	1,596.00	3,032,400
C a s a	3,300	1,280.00	4,224,000
アルヒ	15,100	2,463.00	37,191,300
プレミアグループ	5,200	2,395.00	12,454,000
クレディセゾン	66,700	1,823.00	121,594,100
芙蓉総合リース	10,000	7,280.00	72,800,000
みずほリース	14,700	3,345.00	49,171,500
東京センチュリー	19,200	5,920.00	113,664,000
日本証券金融	42,000	552.00	23,184,000
アイフル	145,300	245.00	35,598,500
リコーリース	7,500	4,145.00	31,087,500
イオンフィナンシャルサービス	58,300	1,691.00	98,585,300
アコム	191,500	470.00	90,005,000
ジャックス	10,500	2,776.00	29,148,000
オリエントコーポレーション	257,700	159.00	40,974,300
日立キャピタル	22,500	2,710.00	60,975,000
アプラスフィナンシャル	45,700	90.00	4,113,000
オリックス	595,800	1,850.50	1,102,527,900
三菱UFJリース	241,800	710.00	171,678,000
九州リースサービス	4,700	600.00	2,820,000
日本取引所グループ	273,400	1,945.00	531,763,000
イー・ギャランティ	10,200	1,389.00	14,167,800
アサックス	4,900	663.00	3,248,700
NECキャピタルソリューション	3,900	2,500.00	9,750,000
いちご	123,400	452.00	55,776,800
日本駐車場開発	110,000	163.00	17,930,000
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,669.00	9,179,500
ヒューリック	204,200	1,287.00	262,805,400
三栄建築設計	4,400	1,604.00	7,057,600
野村不動産ホールディングス	58,100	2,690.00	156,289,000
三重交通グループホールディングス	20,900	606.00	12,665,400
サムティ	14,000	2,078.00	29,092,000
ディア・ライフ	13,900	574.00	7,978,600

コーセーアールイー	4,000	843.00	3,372,000
エー・ディー・ワークス	176,700	31.00	5,477,700
日本商業開発	6,600	1,610.00	10,626,000
プレサンスコーポレーション	15,900	1,783.00	28,349,700
ユニゾホールディングス	14,600	4,805.00	70,153,000
ハウスコム	1,900	1,488.00	2,827,200
日本管理センター	7,000	1,300.00	9,100,000
サンセイランディック	3,900	908.00	3,541,200
エストラスト	1,300	806.00	1,047,800
フージャースホールディングス	19,000	739.00	14,041,000
オープンハウス	28,000	3,080.00	86,240,000
東急不動産ホールディングス	260,300	753.00	196,005,900
飯田グループホールディングス	79,900	1,944.00	155,325,600
イーグランド	2,800	815.00	2,282,000
ムゲンエステート	7,900	806.00	6,367,400
ハウズドゥ	5,300	1,562.00	8,278,600
シーアールイー	3,200	1,079.00	3,452,800
ケイアイスター不動産	3,500	2,072.00	7,252,000
グッドコムアセット	2,700	1,889.00	5,100,300
ジェイ・エス・ビー	1,200	4,820.00	5,784,000
テンポイノベーション	3,200	1,071.00	3,427,200
パーク24	51,500	2,539.00	130,758,500
パラカ	2,900	2,024.00	5,869,600
三井不動産	476,000	2,692.50	1,281,630,000
三菱地所	668,000	2,022.00	1,350,696,000
平和不動産	17,800	2,837.00	50,498,600
東京建物	104,700	1,682.00	176,105,400
ダイビル	25,300	1,172.00	29,651,600
京阪神ビルディング	16,100	1,478.00	23,795,800
住友不動産	214,400	3,913.00	838,947,200
テーオーシー	19,700	903.00	17,789,100
東京楽天地	1,700	6,360.00	10,812,000
スターツコーポレーション	13,300	2,730.00	36,309,000
フジ住宅	12,400	700.00	8,680,000
空港施設	11,300	547.00	6,181,100
明和地所	6,800	630.00	4,284,000
ゴールドクレスト	7,900	2,189.00	17,293,100
エスリード	4,100	2,204.00	9,036,400
日神不動産	15,900	548.00	8,713,200
日本エスコン	18,200	1,001.00	18,218,200
タカラレーベン	45,400	510.00	23,154,000
サンヨーハウジング名古屋	6,300	1,000.00	6,300,000

イオンモール	48,300	1,824.00	88,099,200
毎日コムネット	3,200	844.00	2,700,800
ファースト住建	4,800	1,322.00	6,345,600
カチタス	12,000	4,650.00	55,800,000
トーセイ	13,800	1,534.00	21,169,200
穴吹興産	1,400	3,500.00	4,900,000
サンフロンティア不動産	13,900	1,318.00	18,320,200
エフ・ジェー・ネクスト	9,200	1,090.00	10,028,000
インテリックス	4,000	714.00	2,856,000
ランドビジネス	4,000	749.00	2,996,000
日本社宅サービス	3,300	1,151.00	3,798,300
グランディハウス	9,400	485.00	4,559,000
日本空港ビルデング	30,600	5,830.00	178,398,000
日本工営	6,200	3,645.00	22,599,000
L I F U L L	32,400	559.00	18,111,600
ジェイエシーリクルートメント	6,200	2,134.00	13,230,800
日本M&Aセンター	69,700	3,755.00	261,723,500
メンバーズ	2,800	2,313.00	6,476,400
中広	1,200	533.00	639,600
アイティメディア	2,900	762.00	2,209,800
タケエイ	8,900	1,318.00	11,730,200
E・Jホールディングス	1,200	1,572.00	1,886,400
トラスト・テック	10,300	1,352.00	13,925,600
コシダカホールディングス	22,300	1,537.00	34,275,100
アルトナー	2,400	814.00	1,953,600
パソナグループ	11,300	1,698.00	19,187,400
C D S	2,400	1,523.00	3,655,200
リンクアンドモチベーション	20,500	673.00	13,796,500
G C A	11,200	974.00	10,908,800
エス・エム・エス	28,800	3,055.00	87,984,000
サニーサイドアップ	2,200	1,102.00	2,424,400
パーソルホールディングス	92,300	2,001.00	184,692,300
リニカル	4,600	1,235.00	5,681,000
クックパッド	32,500	377.00	12,252,500
エスクリ	3,000	805.00	2,415,000
アイ・ケイ・ケイ	4,700	717.00	3,369,900
学情	3,300	2,055.00	6,781,500
スタジオアリス	4,700	1,938.00	9,108,600
シミックホールディングス	5,200	1,874.00	9,744,800
エプコ	1,500	1,499.00	2,248,500
N J S	2,100	1,828.00	3,838,800
総合警備保障	36,700	5,880.00	215,796,000



カカクコム	69,200	2,707.00	187,324,400
アイロムグループ	3,300	1,553.00	5,124,900
セントケア・ホールディング	6,200	504.00	3,124,800
サイネックス	1,700	692.00	1,176,400
ルネサンス	5,200	1,764.00	9,172,800
ディップ	13,100	3,290.00	43,099,000
オプトホールディング	5,100	1,772.00	9,037,200
ツクイ	21,900	564.00	12,351,600
キャリアデザインセンター	2,400	1,329.00	3,189,600
ベネフィット・ワン	25,300	2,353.00	59,530,900
エムスリー	203,500	3,085.00	627,797,500
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	627.00	3,824,700
プラス	1,200	744.00	892,800
アウトソーシング	52,900	1,227.00	64,908,300
ウェルネット	8,900	806.00	7,173,400
ワールドホールディングス	3,100	1,945.00	6,029,500
ディー・エヌ・エー	45,300	1,777.00	80,498,100
博報堂D Yホールディングス	128,400	1,761.00	226,112,400
ぐるなび	16,200	1,024.00	16,588,800
タカミヤ	9,900	720.00	7,128,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,200	1,190.00	7,378,000
ファンコミュニケーションズ	25,600	510.00	13,056,000
ライク	3,700	1,640.00	6,068,000
ビジネス・ブレークスルー	4,200	340.00	1,428,000
エスプール	17,900	741.00	13,263,900
WDBホールディングス	4,300	2,559.00	11,003,700
ティア	5,600	601.00	3,365,600
C D G	1,100	1,419.00	1,560,900
バリューコマース	5,200	2,192.00	11,398,400
インフォマート	50,600	2,004.00	101,402,400
J Pホールディングス	29,400	295.00	8,673,000
エコナックホールディングス	17,500	132.00	2,310,000
E P Sホールディングス	14,000	1,463.00	20,482,000
レグス	2,300	1,640.00	3,772,000
プレステージ・インターナショナル	34,700	971.00	33,693,700
アミューズ	5,100	3,000.00	15,300,000
ドリームインキュベータ	2,900	1,582.00	4,587,800
クイック	5,800	1,675.00	9,715,000
T A C	6,000	243.00	1,458,000
ケネディクス	88,000	593.00	52,184,000
電通	95,200	4,030.00	383,656,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,389.00	5,000,400

ぴあ	2,700	4,770.00	12,879,000
イオンファンタジー	3,600	3,055.00	10,998,000
シーティーエス	10,600	815.00	8,639,000
ネクシィーズグループ	3,300	1,836.00	6,058,800
みらかホールディングス	25,900	2,691.00	69,696,900
アルプス技研	8,200	1,975.00	16,195,000
ダイオーズ	1,900	1,330.00	2,527,000
日本空調サービス	9,800	792.00	7,761,600
オリエンタルランド	98,200	14,815.00	1,454,833,000
ダスキン	23,700	3,085.00	73,114,500
明光ネットワークジャパン	11,000	1,034.00	11,374,000
ファルコホールディングス	5,100	1,752.00	8,935,200
ラウンドワン	25,900	1,114.00	28,852,600
リゾートトラスト	42,400	1,931.00	81,874,400
ビー・エム・エル	11,900	3,195.00	38,020,500
ワタベウェディング	1,700	598.00	1,016,600
りらいあコミュニケーションズ	16,800	1,456.00	24,460,800
リソー教育	42,400	402.00	17,044,800
早稲田アカデミー	3,100	958.00	2,969,800
ユー・エス・エス	103,400	2,102.00	217,346,800
東京個別指導学院	3,400	747.00	2,539,800
サイバーエージェント	53,100	3,745.00	198,859,500
楽天	430,300	919.00	395,445,700
クリーク・アンド・リバー社	4,800	1,145.00	5,496,000
テー・オー・ダブリュー	8,200	968.00	7,937,600
山田コンサルティンググループ	4,500	1,797.00	8,086,500
セントラルスポーツ	3,500	3,220.00	11,270,000
フルキャストホールディングス	9,300	2,431.00	22,608,300
エン・ジャパン	16,400	5,170.00	84,788,000
リソルホールディングス	1,000	4,100.00	4,100,000
テクノプロ・ホールディングス	18,500	7,670.00	141,895,000
アトラ	2,400	387.00	928,800
インターワークス	2,000	541.00	1,082,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	4,480.00	17,024,000
Keeper 技研	3,500	1,302.00	4,557,000
ファーストロジック	2,300	645.00	1,483,500
三機サービス	2,100	1,090.00	2,289,000
Gunosy	6,500	1,555.00	10,107,500
デザインワン・ジャパン	2,200	343.00	754,600
イー・ガーディアン	4,700	2,080.00	9,776,000
リブセンス	6,300	318.00	2,003,400
ジャパンマテリアル	28,500	1,541.00	43,918,500

ベクトル	11,600	1,076.00	12,481,600
ウチヤマホールディングス	4,700	555.00	2,608,500
チャーム・ケア・コーポレーション	3,400	1,989.00	6,762,600
ライクキッズ	2,300	865.00	1,989,500
キャリアリンク	3,200	573.00	1,833,600
I B J	6,400	1,141.00	7,302,400
アサンテ	3,800	2,050.00	7,790,000
N・フィールド	6,500	707.00	4,595,500
バリューHR	1,800	3,575.00	6,435,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,600	4,350.00	28,710,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,600	2,054.00	7,394,400
E R Iホールディングス	2,700	784.00	2,116,800
アビスト	1,500	2,641.00	3,961,500
シグマクシス	6,400	2,245.00	14,368,000
ウィルグループ	6,100	1,242.00	7,576,200
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	13,200	234.00	3,088,800
リクルートホールディングス	661,200	4,010.00	2,651,412,000
エラン	5,500	1,666.00	9,163,000
土木管理総合試験所	4,300	483.00	2,076,900
ネットマーケティング	3,400	1,009.00	3,430,600
日本郵政	756,600	1,047.00	792,160,200
ベルシステム24ホールディングス	15,500	1,711.00	26,520,500
鎌倉新書	6,900	1,751.00	12,081,900
S M N	1,600	893.00	1,428,800
一蔵	1,100	759.00	834,900
L I T A L I C O	3,200	2,528.00	8,089,600
グローバルキッズCOMPANY	1,500	745.00	1,117,500
エボラブルアジア	4,200	2,110.00	8,862,000
アトラエ	2,400	3,640.00	8,736,000
ストライク	3,500	4,335.00	15,172,500
ソラスト	25,500	1,295.00	33,022,500
セラク	3,000	784.00	2,352,000
インソース	4,500	3,450.00	15,525,000
ベイカレント・コンサルティング	5,600	5,510.00	30,856,000
Orchestra Holdings	1,900	1,136.00	2,158,400
アイモバイル	3,100	731.00	2,266,100
キャリアインデックス	4,000	472.00	1,888,000
MS - J a p a n	3,100	1,639.00	5,080,900
船場	1,600	1,189.00	1,902,400
グレイステクノロジー	4,200	2,862.00	12,020,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9,800	2,903.00	28,449,400
フルテック	1,400	1,413.00	1,978,200

グリーンズ	3,600	1,192.00	4,291,200
ツナググループ・ホールディングス	1,300	638.00	829,400
GameWith	2,200	836.00	1,839,200
ソウルドアウト	1,500	2,042.00	3,063,000
MS&Consulting	1,400	1,045.00	1,463,000
日総工産	6,200	1,049.00	6,503,800
キュービーネットホールディングス	5,700	2,397.00	13,662,900
RPAホールディングス	5,300	1,214.00	6,434,200
スプリックス	3,200	1,288.00	4,121,600
マネジメントソリューションズ	1,000	2,209.00	2,209,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	982.00	4,713,600
リログループ	50,500	3,010.00	152,005,000
東祥	5,800	2,532.00	14,685,600
エイチ・アイ・エス	14,400	3,120.00	44,928,000
ラックランド	1,900	2,505.00	4,759,500
共立メンテナンス	15,300	5,020.00	76,806,000
イチネンホールディングス	10,400	1,511.00	15,714,400
建設技術研究所	6,400	2,184.00	13,977,600
スペース	6,100	1,321.00	8,058,100
長大	3,500	1,296.00	4,536,000
燦ホールディングス	4,100	1,382.00	5,666,200
スバル興業	600	8,900.00	5,340,000
東京テアトル	3,700	1,393.00	5,154,100
タナベ経営	1,900	1,281.00	2,433,900
ナガワ	3,000	7,650.00	22,950,000
よみうりランド	2,000	4,640.00	9,280,000
東京都競馬	6,100	3,450.00	21,045,000
カナモト	15,100	3,050.00	46,055,000
東京ドーム	37,500	1,018.00	38,175,000
西尾レントオール	9,400	3,245.00	30,503,000
トランス・コスモス	8,800	2,904.00	25,555,200
乃村工藝社	39,600	1,493.00	59,122,800
藤田観光	4,100	2,888.00	11,840,800
KNT-CTホールディングス	5,700	1,506.00	8,584,200
日本管財	9,900	1,993.00	19,730,700
トーカイ	9,000	3,010.00	27,090,000
白洋舎	1,100	2,909.00	3,199,900
セコム	98,000	9,600.00	940,800,000
セントラル警備保障	4,500	6,400.00	28,800,000
丹青社	17,500	1,325.00	23,187,500
メイテック	11,400	6,040.00	68,856,000
応用地質	10,000	1,483.00	14,830,000

船井総研ホールディングス	19,100	2,550.00	48,705,000	
進学会ホールディングス	3,800	529.00	2,010,200	
オオバ	7,400	932.00	6,896,800	
いであ	1,700	3,365.00	5,720,500	
学究社	2,800	1,362.00	3,813,600	
ベネッセホールディングス	30,800	2,898.00	89,258,400	
イオンディライト	11,400	3,865.00	44,061,000	
ナック	5,200	1,045.00	5,434,000	
ニチイ学館	13,200	1,553.00	20,499,600	
ダイセキ	15,500	3,340.00	51,770,000	
ステップ	3,400	1,545.00	5,253,000	
合 計	112,613,500		234,639,743,500	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2019年12月11日から2020年6月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DC日本株式インデックスファンドA】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2019年12月10日現在)	第18期中間計算期間 (2020年6月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,197,317	5,321,826
親投資信託受益証券	2,104,448,858	1,927,130,583
未収入金	3,903,432	19,330,954
流動資産合計	2,113,549,607	1,951,783,363
資産合計	2,113,549,607	1,951,783,363
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,850,441	19,651,287
未払受託者報酬	538,052	517,336
未払委託者報酬	3,658,709	3,517,859
未払利息	1	7
その他未払費用	-	9
流動負債合計	8,047,203	23,686,498
負債合計	8,047,203	23,686,498
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	815,389,267	781,113,597
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,290,113,137	1,146,983,268
(分配準備積立金)	540,690,655	444,303,000
元本等合計	2,105,502,404	1,928,096,865
純資産合計	2,105,502,404	1,928,096,865
負債純資産合計	2,113,549,607	1,951,783,363

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自 2018年12月11日 至 2019年 6月10日	第18期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	2	14
有価証券売買等損益	22,071,811	97,355,466
営業収益合計	22,071,809	97,355,452
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,301	1,477
受託者報酬	525,025	517,336
委託者報酬	3,570,137	3,517,859
その他費用	74	9
営業費用合計	4,096,537	4,036,681
営業利益又は営業損失（ ）	26,168,346	101,392,133
経常利益又は経常損失（ ）	26,168,346	101,392,133
中間純利益又は中間純損失（ ）	26,168,346	101,392,133
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,983,333	49,803,396
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,129,790,184	1,290,113,137
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,095,802	152,511,584
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,095,802	152,511,584
剰余金減少額又は欠損金増加額	98,917,463	244,052,716
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	98,917,463	244,052,716
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,088,783,510	1,146,983,268



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第17期 (2019年12月10日現在)	第18期中間計算期間 (2020年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	815,389,267口	781,113,597口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5822円 (25,822円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4684円 (24,684円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第18期中間計算期間 (2020年 6月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第18期中間計算期間 (2020年 6月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第17期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	第18期中間計算期間 自 2019年12月11日 至 2020年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	845,570,679円	815,389,267円
期中追加設定元本額	109,110,724円	122,081,367円
期中一部解約元本額	139,292,136円	156,357,037円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 日本株式マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,067,088,335
株式	247,199,274,550

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	28,907,500
未収入金	2,614,314,357
未収配当金	2,000,874,213
差入委託証拠金	121,508,000
流動資産合計	253,031,966,955
資産合計	253,031,966,955
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,909,900
前受金	20,997,600
未払解約金	1,724,353,185
未払利息	1,571
その他未払費用	4,035
流動負債合計	1,753,266,291
負債合計	1,753,266,291
純資産の部	
元本等	
元本	141,320,500,211
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	109,958,200,453
元本等合計	251,278,700,664
純資産合計	251,278,700,664
負債純資産合計	253,031,966,955

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 新株予約権証券 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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	2020年 6月10日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,320,500,211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 1.7781円 (1万口当たり純資産額) (17,781円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

	2020年 6月10日現在

（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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	127,660,137,704円
期中追加設定元本額	24,887,756,896円
期中一部解約元本額	11,227,394,389円
期末元本額	141,320,500,211円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	686,815,105円
DC日本株式インデックスファンド	316,771,682円
DC日本株式インデックスファンドL	53,910,728,738円
DC日本株式インデックスファンドA	1,083,814,512円
DCバランスファンド30	2,317,197,495円
DCバランスファンド50	3,550,907,483円
DCバランスファンド70	1,879,550,257円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	608,515,485円
日本株式インデックスe	1,644,497,086円
インデックスコレクション（国内株式）	18,872,032,906円
インデックスコレクション（バランス株式30）	13,077,195,413円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,346,615,261円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,802,505,688円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,547,521,895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）	2,419,865,444円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,389,028,446円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	80,472,134円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	926,099,610円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	112,549,443円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	408,328,283円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,745,762円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	767,238,848円

区分	2020年 6月10日現在
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	1,141,425,335円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	587,077,148円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	9,859,235,992円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	849,776,401円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	132,845,825円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,654,886,785円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	44,234,078円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	199,099,988円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,416,518,836円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	77,767,144円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	79,843,723円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	40,382,782円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	901,156,988円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	400,509,125円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	6,812,780,962円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	125,913,646円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	54,347,995円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	11,917,082円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	175,628,772円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,154,628円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2020年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,822,702,400	-	3,843,700,000	20,997,600
	合計	3,822,702,400	-	3,843,700,000	20,997,600

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【DC日本株式インデックスファンドA】

## 【純資産額計算書】

(2020年 6月30日現在)

資産総額	1,822,582,141円
負債総額	4,291,288円
純資産総額（ - ）	1,818,290,853円
発行済口数	766,751,759口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3714円
（1万口当たり純資産額）	（23,714円）

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年 6月30日現在)

資産総額	244,641,308,363円
負債総額	2,576,794,402円
純資産総額（ - ）	242,064,513,961円
発行済口数	141,677,369,735口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7086円
（1万口当たり純資産額）	（17,086円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2020年6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（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 - DO - 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 9月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	12,437,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	78	292,295
単位型公社債投資信託	32	234,734
合計	643	12,964,574

## 3【委託会社等の経理状況】

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

なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者の財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載していましたが、当事業年度より百万円単位で記載することに变更いたしました。
- (3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			

当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産



定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

## （リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2019年3月31日)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
	ユーロ	2	-	0	0
合計	1,346	-	7	7	

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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



## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

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

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

## (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

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

## [ 関連情報 ]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

## ( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 吸収分割

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1)自己又はその役員との取引

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

##### (2)運用財産相互間の取引

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

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年9月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

あります。

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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



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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2018年12月11日から2019年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2019年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年8月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2019年12月11日から2020年6月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2020年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月11日から2020年6月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。