

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成26年6月30日

【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】 取締役社長 鈴木 郁也

【本店の所在の場所】 東京都港区芝3丁目33番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド・レポートニング部長 橋詰 廣志

【電話番号】 03-6737-0521

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 DC日本株式インデックス・オープン

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 上限10兆円

【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・オープン

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。

**(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。

本ファンドについて、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また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。

本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、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。委託者は、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。

**(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（純資産総額）をそのときの受益権総口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより、日々変動します。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当りに換算した価額で行われます。）。また、委託者、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）で入手できますので、委託者または指定販売会社（以下「販売会社」といいます。）にお問い合わせください。

委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**(5)【申込手数料】**

ありません。

**(6)【申込単位】**

1円以上1円単位

**(7)【申込期間】**

継続募集期間

平成26年7月1日から平成26年12月26日まで

継続募集を行う期間は、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って更新されます。

(8)【申込取扱場所】

委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行(売出)価格」に記載されている先と同じです。

(9)【払込期日】

取得申込者は、取得申込みに係る金額を指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとし、各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」または「委託会社」ということがあります。）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「受託者」または「受託会社」ということがあります。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込みの指定販売会社とします。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行(売出)価格」に記載されている先と同じです。

(11)【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、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

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(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したがって取り扱われるものとします。

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(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したがって支払われます。

投資信託振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステムの帳簿（振替口座簿）への記載・記録によって行われますので、やむを得ない事情等がある場合を除き、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

わが国の株式に投資し、東証株価指数（以下「TOPIX」ということがあります。）に連動する投資成果を目指します。

なお、信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

###### ファンドの特色

1.わが国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

2.東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指します。

? 東証株価指数（TOPIX）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。

同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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

###### 分配方針

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。

原則として、毎年9月30日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。

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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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。

同一銘柄の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。
--

[ ファンドの商品分類 ]

本ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[ 分類における定義 ]

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書また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います。
補足分類	インデックス型	目論見書また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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		
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)	欧州	ファミリーファンド	日経225
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	日々	中南米		
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	その他 ( )	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

[ 区分における定義 ]

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。)、実質的に主として株式 一般(大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。)に投資する旨の記載があるものをいいます。 本ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて株式に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「株式」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券)」となっています。
決算頻度	年1回	目論見書また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います。
投資対象地域	日本	目論見書また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います。
投資形態	ファミリーファン ド	目論見書また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きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。

対象インデックス	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	-------	---

## (2) 【ファンドの沿革】

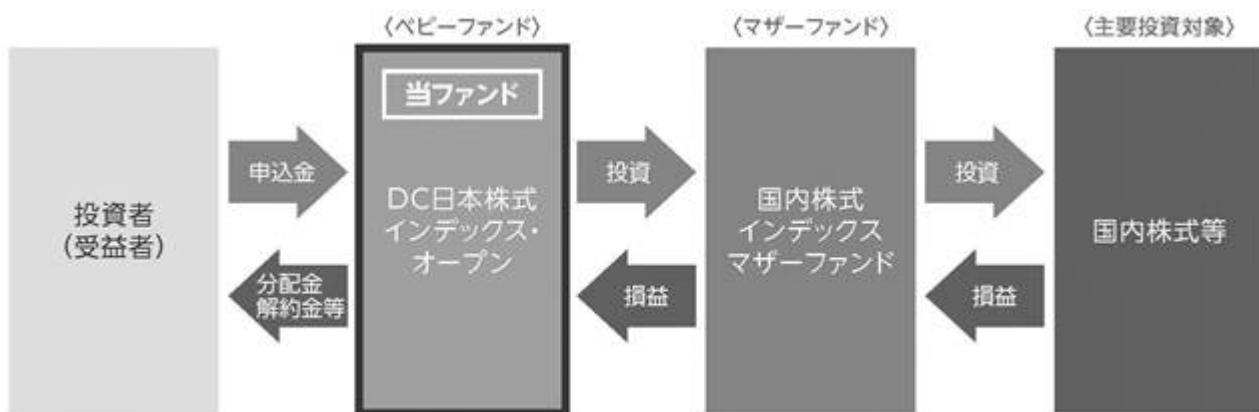
平成13年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
平成24年4月 1日	本ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープン」から「DC日本株式インデックス・オープン」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

### (イ) ファミリーファンド方式での運用

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（DC日本株式インデックス・オープン）とし、その資金をマザーファンド（国内株式インデックス 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。

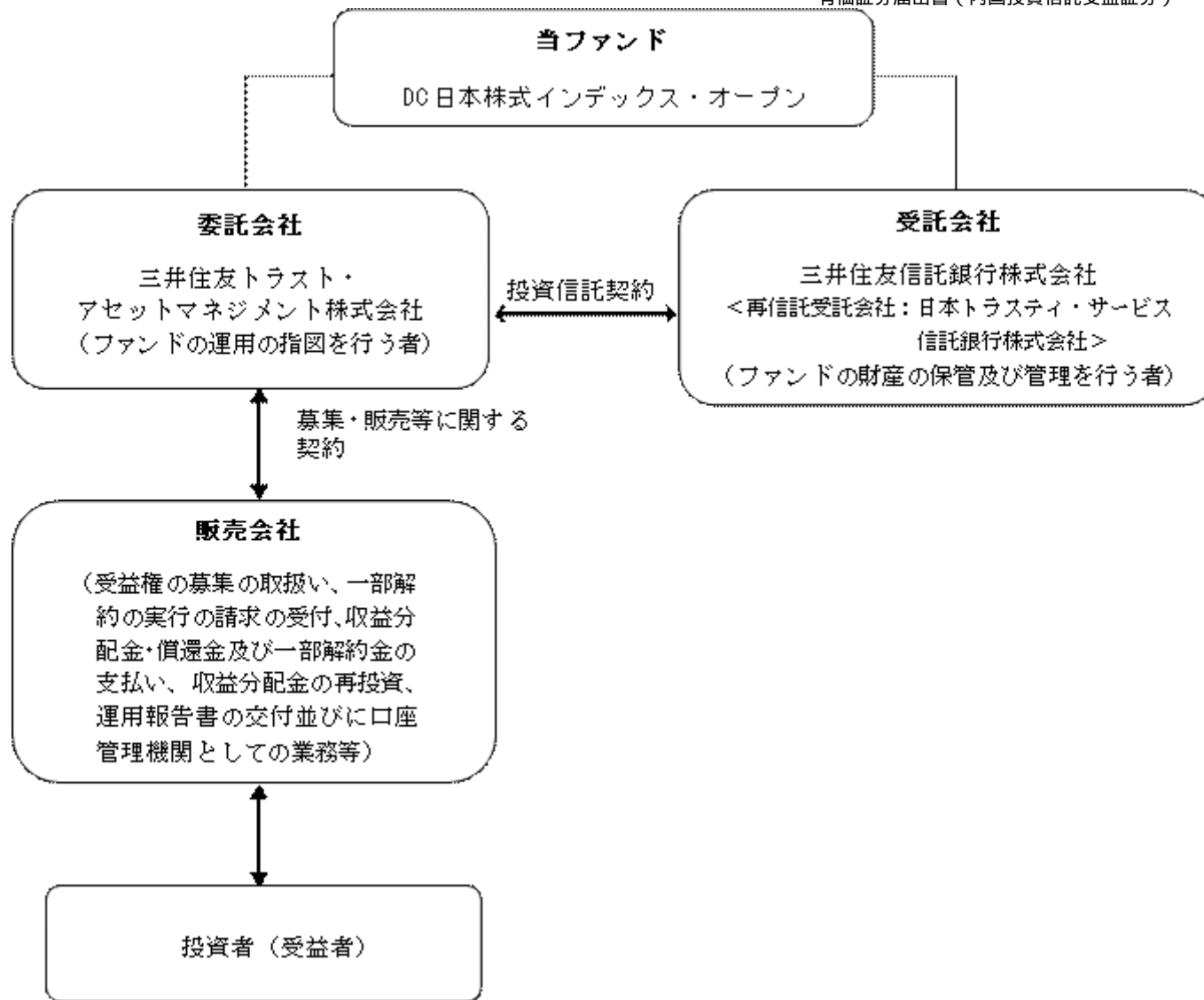


※マザーファンドの運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

### 〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### (ロ) 当ファンドの関係法人図



## (八) 委託会社等の概況

## 資本金

平成26年4月30日現在 3億円

## 会社の沿革

昭和61年11月 1日 住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和62年 2月20日 投資顧問業の登録

昭和62年 9月 9日 投資一任契約に係る業務の認可

平成 2年10月 1日 住信投資顧問株式会社に商号変更

平成11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

平成11年 3月25日 証券投資信託委託業の認可

平成19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)

平成24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

## 大株主の状況(平成26年4月30日現在)

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】

#### (イ)基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ)運用方法

##### 投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

##### 投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIXと連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資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。
- 5)国内外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を行うことができます。

#### (参考)「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1.基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

##### 2.運用方法

###### (1)投資対象

わが国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

運用の効率化をはかるため、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、投資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ならびに投資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。

国内外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を行うことができます。

##### 3.運用制限

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。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資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割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに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号および第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。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

## (2)【投資対象】

(イ) 本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。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに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くとともに、本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 証券投資信託または外国証券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ます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの  
なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

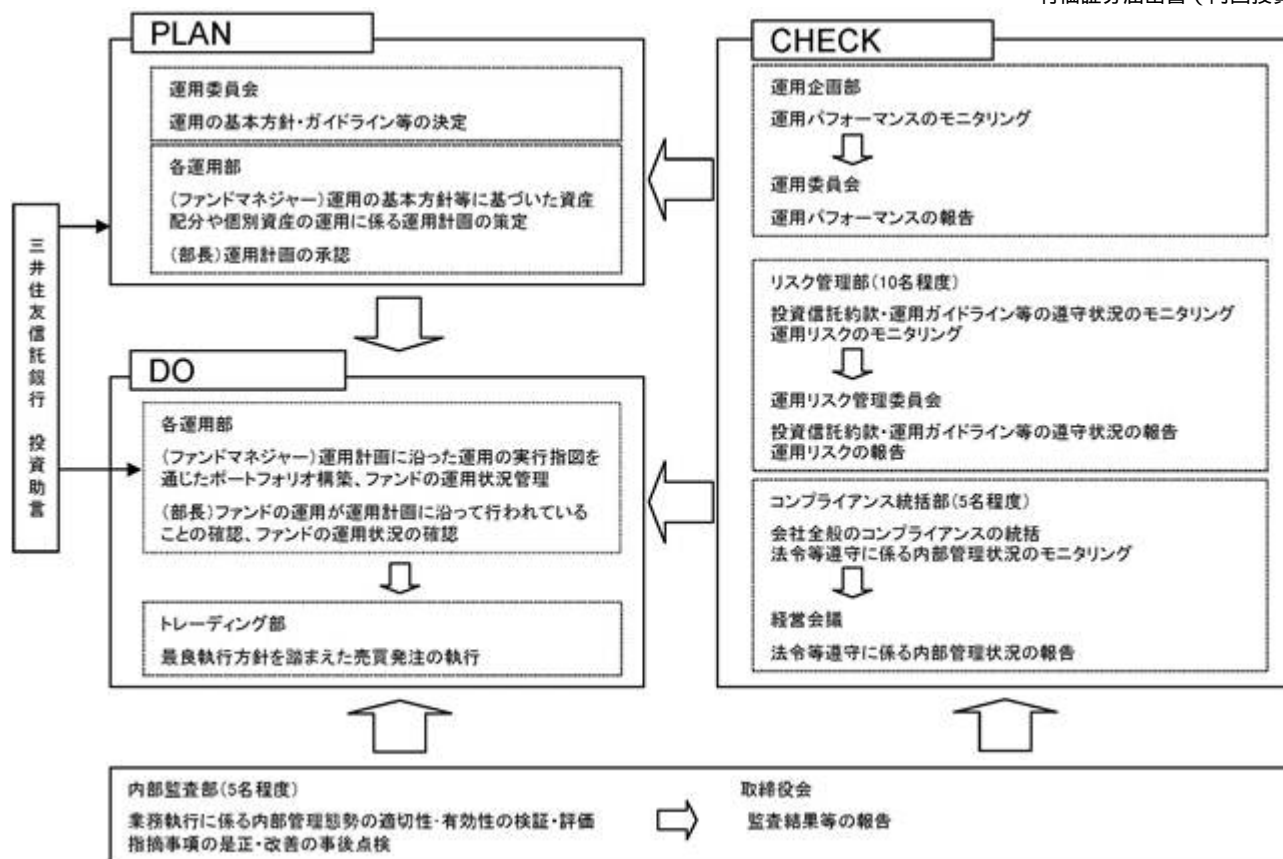
(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号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。

### (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、平成26年6月30日現在のものであり、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)【配分方針】

##### (イ) 配分方針

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

##### 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### 分配対象額についての配分方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

##### 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

##### (ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

## (5) 【投資制限】

### (イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の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、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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資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、株券の引渡しまた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。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをい

います。) ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等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て取扱うものとし、(投資信託約款第23条)

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。(投資信託約款第24条)

1. 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、投資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。
2. 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、投資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。

委託者は、投資信託財産の効率的な運用なら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(一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。(投資信託約款第32条)

前記 および から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 および から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (ロ) 法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

##### < 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)

運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

##### < デリバティブ取引に係る投資制限 > (金融商品取引業等に関する内閣府令)

投資信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図してはならない。





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

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

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

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

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

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

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

#### (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、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。

#### 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】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

(イ) 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0.648%（税抜（ ） 0.6%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2268%	（税抜 0.21%）
販売会社	年率 0.3672%	（税抜 0.34%）
受託会社	年率 0.054%	（税抜 0.05%）

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

(ロ) 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。

(ハ) 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】

(イ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ロ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ハ) 投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

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、平成26年4月30日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変  
更されることがあります。

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】

以下の記載は、平成26年4月30日現在の状況について記載してあります。

## (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	3,891,908,998	99.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		242,378	0.01
合計(純資産総額)		3,892,151,376	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】

## a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	4,046,484,715	0.9776	3,956,015,682	0.9618	3,891,908,998	99.99

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

(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。

## c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【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3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	200,489,632	200,489,632	10,690	10,690
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	476,978,305	476,978,305	13,780	13,780

第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	893,426,250	893,426,250	15,974	15,974
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	1,306,560,567	1,306,560,567	16,007	16,007
第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	1,289,136,205	1,289,136,205	10,920	10,920
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	1,594,352,852	1,594,352,852	9,262	9,262
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	1,763,856,746	1,763,856,746	8,576	8,576
第10期計算期間末 (平成23年 9月30日)	1,914,318,968	1,914,318,968	8,006	8,006
第11期計算期間末 (平成24年10月 1日)	2,099,913,529	2,099,913,529	7,832	7,832
第12期計算期間末 (平成25年 9月30日)	3,797,442,442	3,797,442,442	12,935	12,935
平成25年 4月末日	3,511,664,711		12,547	
5月末日	3,414,018,058		12,226	
6月末日	3,494,429,696		12,212	
7月末日	3,513,552,846		12,183	
8月末日	3,434,813,357		11,905	
9月末日	3,797,442,442		12,935	
10月末日	3,855,675,083		12,931	
11月末日	4,029,222,238		13,624	
12月末日	4,161,565,425		14,099	
平成26年 1月末日	3,954,144,657		13,207	
2月末日	4,003,568,440		13,110	
3月末日	4,041,212,941		13,134	
4月末日	3,892,151,376		12,685	

## 【分配の推移】

期 間	1 万口当たりの分配金(円)
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	0
第4期計算期間(平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	0
第5期計算期間(平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	0
第6期計算期間(平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	0
第7期計算期間(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	0
第8期計算期間(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	0
第9期計算期間(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	0
第10期計算期間(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	0
第11期計算期間(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	0
第12期計算期間(平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	0

## 【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
-----	--------

第3期計算期間(平成15年10月1日～平成16年9月30日)	8.7
第4期計算期間(平成16年10月1日～平成17年9月30日)	28.9
第5期計算期間(平成17年10月1日～平成18年10月2日)	15.9
第6期計算期間(平成18年10月3日～平成19年10月1日)	0.2
第7期計算期間(平成19年10月2日～平成20年9月30日)	31.8
第8期計算期間(平成20年10月1日～平成21年9月30日)	15.2
第9期計算期間(平成21年10月1日～平成22年9月30日)	7.4
第10期計算期間(平成22年10月1日～平成23年9月30日)	6.6
第11期計算期間(平成23年10月1日～平成24年10月1日)	2.2
第12期計算期間(平成24年10月2日～平成25年9月30日)	65.2
第13期中間計算期間(平成25年10月1日～平成26年3月31日)	1.5

(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3期計算期間 (平成15年10月1日～平成16年9月30日)	136,065,489	1,577,305	187,547,125
第4期計算期間 (平成16年10月1日～平成17年9月30日)	191,268,240	32,685,830	346,129,535
第5期計算期間 (平成17年10月1日～平成18年10月2日)	320,230,107	107,074,258	559,285,384
第6期計算期間 (平成18年10月3日～平成19年10月1日)	381,257,439	124,324,047	816,218,776
第7期計算期間 (平成19年10月2日～平成20年9月30日)	535,378,697	171,046,020	1,180,551,453
第8期計算期間 (平成20年10月1日～平成21年9月30日)	699,949,984	159,146,830	1,721,354,607
第9期計算期間 (平成21年10月1日～平成22年9月30日)	548,476,476	213,143,739	2,056,687,344
第10期計算期間 (平成22年10月1日～平成23年9月30日)	646,054,246	311,558,408	2,391,183,182
第11期計算期間 (平成23年10月1日～平成24年10月1日)	766,520,228	476,640,765	2,681,062,645
第12期計算期間 (平成24年10月2日～平成25年9月30日)	1,221,033,540	966,324,863	2,935,771,322
第13期中間計算期間 (平成25年10月1日～平成26年3月31日)	616,736,050	475,679,103	3,076,828,269

(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。

(参考情報)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### (1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

株式	日本	134,634,644,360	98.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,151,181,180	1.57
合計(純資産総額)		136,785,825,540	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。

## (2)投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,131,000	6,184.28	6,994,431,746	5,516.00	6,238,596,000	4.56
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,075,700	611.70	3,716,536,448	542.00	3,293,029,400	2.41
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	393,900	5,422.91	2,136,086,343	7,590.00	2,989,701,000	2.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	731,300	3,982.47	2,912,382,882	3,380.00	2,471,794,000	1.81
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	606,600	4,205.04	2,550,778,132	4,033.00	2,446,417,800	1.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,403,100	201.04	2,091,523,040	200.00	2,080,620,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	315,200	5,208.57	1,641,742,710	5,661.00	1,784,347,200	1.30
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	504,700	3,594.11	1,813,947,960	3,356.00	1,693,773,200	1.24
日本	株式	ファナック	電気機器	90,700	15,340.08	1,391,345,550	18,400.00	1,668,880,000	1.22
日本	株式	キヤノン	電気機器	471,200	3,634.40	1,712,530,642	3,215.00	1,514,908,000	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	318,800	4,682.98	1,492,935,690	4,588.00	1,462,654,400	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,956,000	702.43	1,373,957,600	727.00	1,422,012,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	249,000	4,884.76	1,216,306,615	5,442.00	1,355,058,000	0.99
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	335,500	3,682.50	1,235,480,370	4,031.00	1,352,400,500	0.99
日本	株式	三菱地所	不動産業	561,000	2,641.65	1,481,967,950	2,314.00	1,298,154,000	0.95
日本	株式	三菱商事	卸売業	625,800	1,850.13	1,157,814,305	1,828.00	1,143,962,400	0.84
日本	株式	三井不動産	不動産業	378,000	2,984.62	1,128,187,820	3,021.00	1,141,938,000	0.83
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	980,000	1,089.11	1,067,332,975	1,137.00	1,114,260,000	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	149,500	7,699.02	1,151,003,924	7,453.00	1,114,223,500	0.81
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	660,900	1,522.40	1,006,154,905	1,622.00	1,071,979,800	0.78
日本	株式	三井物産	卸売業	738,500	1,373.11	1,014,044,485	1,449.00	1,070,086,500	0.78
日本	株式	パナソニック	電気機器	928,500	849.45	788,719,251	1,119.00	1,038,991,500	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,140,700	1,112.96	1,269,559,715	877.00	1,000,393,900	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	266,700	3,471.88	925,953,041	3,660.00	976,122,000	0.71
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,640,600	833.09	1,366,774,761	588.00	964,672,800	0.71
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,597,000	274.88	988,750,000	268.00	963,996,000	0.70



日本	株式	三菱電機	電気機器	813,000	1,049.22	853,018,020	1,163.00	945,519,000	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	310,700	3,143.64	976,728,971	3,011.00	935,517,700	0.68
日本	株式	デンソー	輸送用機器	200,800	4,490.39	901,670,652	4,652.00	934,121,600	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	152,600	6,479.18	988,724,364	5,998.00	915,294,800	0.67

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	98.43
合計	98.43

(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の時価の比率です。

#### c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.54
		建設業	2.61
		食料品	4.11
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.42
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.64
		ゴム製品	0.94
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	1.04
		金属製品	0.68
		機械	5.10
		電気機器	12.43
		輸送用機器	11.39
		精密機器	1.37
		その他製品	1.39
		電気・ガス業	2.02
		陸運業	3.84
		海運業	0.33
		空運業	0.53
		倉庫・運輸関連業	0.23
情報・通信業	7.16		
卸売業	4.57		
小売業	4.22		
銀行業	9.09		

	証券、商品先物取引業	1.47
	保険業	2.17
	その他金融業	1.29
	不動産業	3.21
	サービス業	2.55
合計		98.43

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	TOPIX先物	大阪取引所	買建	円	186	2,153,002,760	2,149,230,000	2,149,230,000	1.57

(注)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。

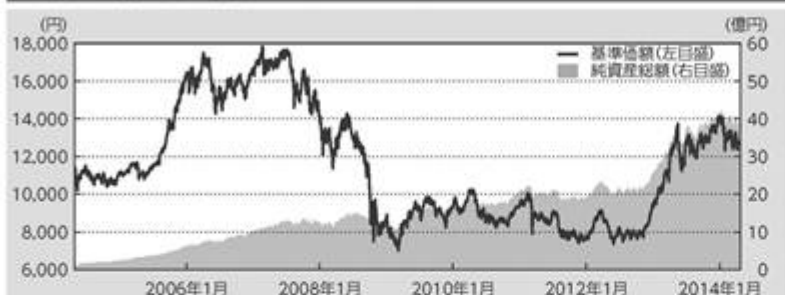
(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2001年10月1日  
作成基準日：2014年4月30日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	12,685円
純資産総額	38.92億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

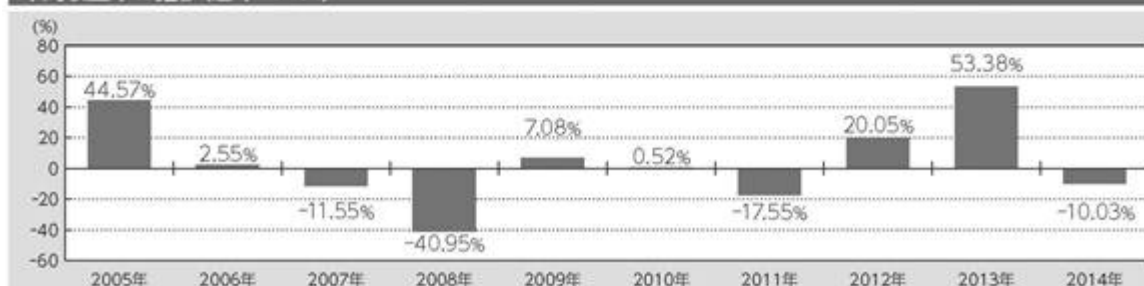
決算期	2009年9月	2010年9月	2011年9月	2012年10月	2013年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

### 主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.6%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	2.4%
ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	2.2%
本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.8%
みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.3%
日本たばこ産業	日本	株式	食料品	1.2%
ファナック	日本	株式	電気機器	1.2%
キヤノン	日本	株式	電気機器	1.1%

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2014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】

本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。

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、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または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により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また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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

#### （イ）申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。

取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。

取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

本ファンドの受益権の販売価額は、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。

申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとし、

本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」（以下、「分配金再投資コース」と読み替えるものとし、）専用ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金再投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金再投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、

なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、）を行うものとし、

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を除き、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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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。

#### （ロ）申込単位

1円以上1円単位

#### （ハ）申込手数料

ありません。

### 2【換金（解約）手続等】

#### （イ）受益権の買取請求

本ファンドにおいては、指定販売会社による受益権の買取は行っておりません。ご換金は解約請求制のみとなります。

#### (ロ) 受益権のご解約の請求

ご解約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者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、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

受益者が前記のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、

委託者は、前記のご解約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。

ご解約の価額は、解約請求受付日の基準価額（解約価額）とします。信託財産留保金の控除はありません。

「信託財産留保金」（「信託財産留保額」ということがあります。）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頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドは、ご解約による換金時および償還時の差益が非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して4営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠ることとなります。

委託者は、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、前記によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

前記により、ご解約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ご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、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ご解約の請求を受け付けたものとして、前記の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### (ハ) 換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(ロ) 受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

**(イ) 基準価額の算出方法**

基準価額とは、投資信託財産に属する有価証券（受入担保金代用有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を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純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

**[主要な投資対象の評価方法]**

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における最終相場で評価します。

**(ロ) 基準価額の算出頻度**

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

**(ハ) 基準価額に関する投資者による照会方法等**

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。

投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「2換金（解約）手続等（ロ）受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口あたりに換算した価額で行われます。

**(2) 【保管】**

該当事項はありません。

**(3) 【信託期間】**

平成13年10月1日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

**(4) 【計算期間】**

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、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、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

**(5) 【その他】****(イ) 信託の終了**

(a)委託者は、投資信託約款に定める信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b)委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(c)委託者は、前記(a)および(b)の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。

(d)前記(c)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

- (e)前記(d)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、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f)委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、この投資信託契約に係るすべ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。
- (g)前記(d)から(f)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、前記(d)の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ)投資信託約款の変更 (d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### (ロ)投資信託約款の変更

- (a)委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (b)委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。
- (c)前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- (d)前記(c)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、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e)委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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すべ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。

委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

#### (ハ)指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

#### (ニ)運用報告書

委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

#### (ホ)信託事務処理の再信託

受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。

(ヘ) 公告

委託者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。

#### 4【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

本ファンドの収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対して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。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

分配金は無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金請求権

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、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

(ハ) 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、ご解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

(ニ) 反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。



### 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12期計算期間(平成24年10月2日から平成25年9月30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・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,878,216	13,388,397
親投資信託受益証券	2,099,759,720	3,797,202,311
未収入金	2,772,726	-
未収利息	12	14
流動資産合計	2,109,410,674	3,810,590,722
資産合計	2,109,410,674	3,810,590,722
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,714,257	1,860,542
未払受託者報酬	556,266	927,447
未払委託者報酬	6,118,868	10,201,903
その他未払費用	107,754	158,388
流動負債合計	9,497,145	13,148,280
負債合計	9,497,145	13,148,280
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,681,062,645	2,935,771,322
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	581,149,116	861,671,120
（分配準備積立金）	59,663,122	723,340,644
元本等合計	2,099,913,529	3,797,442,442
純資産合計	2,099,913,529	3,797,442,442
負債純資産合計	2,109,410,674	3,810,590,722

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日)	第12期 (自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	2,544	5,561
有価証券売買等損益	35,064,703	1,424,436,144
営業収益合計	35,062,159	1,424,441,705
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,078,777	1,585,129
委託者報酬	11,866,417	17,436,398
その他費用	107,754	158,388
営業費用合計	13,052,948	19,179,915
営業利益又は営業損失( )	48,115,107	1,405,261,790
経常利益又は経常損失( )	48,115,107	1,405,261,790
当期純利益又は当期純損失( )	48,115,107	1,405,261,790
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( )	5,155,891	269,702,829
期首剰余金又は期首欠損金( )	476,864,214	581,149,116
剰余金増加額又は欠損金減少額	94,409,571	307,261,275
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	94,409,571	165,064,882
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	142,196,393
剰余金減少額又は欠損金増加額	145,423,475	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	145,423,475	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	581,149,116	861,671,120

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第12期(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は平成24年10月 2日から平成25年 9月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
1. 期首元本額	2,391,183,182円	2,681,062,645円
期中追加設定元本額	766,520,228円	1,221,033,540円
期中一部解約元本額	476,640,765円	966,324,863円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,681,062,645口	2,935,771,322口
3. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 581,149,116円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7832円 (7,832円)	1.2935円 (12,935円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第11期 自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日	第12期 自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日
費用控除後の配当等収益額	A	- 円 (52,307,461円)	5,155円 (64,314,092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	681,184,106円
収益調整金額	C	1,343,372,933円	1,494,180,006円
分配準備積立金額	D	59,663,122円	42,151,383円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,403,036,055円	2,217,520,650円
当ファンドの期末残存口数	F	2,681,062,645口	2,935,771,322口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,233.13円	7,553.45円

1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	- 円	- 円

(注)( )内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(株価変動リスク)、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リスク管理部及びコンプライアンス統括部が、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コンプライアンス会議に報告します。 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

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
	計算期間(自 平成23年10月1日 至 平成24年10月 1日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	29,281,612	1,329,730,073
合計	29,281,612	1,329,730,073

## (デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

## (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。

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	3,886,196,205	3,797,202,311	
親投資信託受益証券 小計		3,886,196,205	3,797,202,311	
合計		3,886,196,205	3,797,202,311	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等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。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## &lt; 参考 &gt;

「DC日本株式インデックス・オープン」は、「国内株式インデックス マザーファンド」の受益証券を主要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」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成25年9月30日現在(以下、「計算日」といいます。)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。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,417,478,657
株式	142,069,740,440
派生商品評価勘定	6,156,000
未収入金	1,527,722,213
未収配当金	1,057,549,694
未収利息	1,489
差入委託証拠金	83,700,000
流動資産合計	146,162,348,493
資産合計	146,162,348,493
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,541,400
前受金	24,334,000
未払金	19,539,100
未払解約金	249,773,767
流動負債合計	315,188,267
負債合計	315,188,267
純資産の部	
元本等	
元本	149,271,308,678
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,424,148,452
元本等合計	145,847,160,226
純資産合計	145,847,160,226
負債純資産合計	146,162,348,493

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)



平成25年 9月30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	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 原則として、株式の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の計上基準 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)

平成25年 9月30日現在	
1. 計算期間の期首元本額	202,283,825,678円
計算期間中の追加設定元本額	22,045,665,274円
計算期間中の一部解約元本額	75,058,182,274円
計算日の元本額	149,271,308,678円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,243,873,831円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,581,752,558円
SBI資産設計オープン(分配型)	28,221,189円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,368,293,897円
世界経済インデックスファンド	239,081,429円
マイセレクション25	73,980,936円
マイセレクション50	142,735,656円
マイセレクション75	162,458,306円
日本株式インデックス・オープン	17,466,433,859円
DCマイセレクション25	4,673,661,015円
DCマイセレクション50	15,706,940,536円
DCマイセレクション75	14,799,139,344円

DC日本株式インデックス・オープン	3,886,196,205円
DCマイセレクションS25	1,621,858,394円
DCマイセレクションS50	5,151,158,994円
DCマイセレクションS75	3,278,138,792円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,301,063,563円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	15,356,726円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	409,007,923円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	417,923,333円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	191,648,376円
DC世界経済インデックスファンド	161,708,897円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	353,273,682円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	206,231,329円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	460,400,831円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	229,655,665円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	2,202,503,139円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,541,631円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	27,603,008円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,205,519,135円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	4,489,155,648円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	10,460,220,518円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,688,246,205円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,507,680,570円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,948,488,646円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,595,260,285円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,178,647,580円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,238,706,638円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,188,274,062円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,361,448,159円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,227,171,504円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,675,643,502円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	131,316,892円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,015,311,643円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,449,181,875円
日本株式ファンド・シリーズ2	509,090,344円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
2. 計算日における受益権総数	149,271,308,678口

3. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 3,424,148,452円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9771円 (9,771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

	平成25年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、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コンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</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> <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>
<p>4. 金銭債権の計算日後の償還予定額</p>	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成25年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,121,438,888	
合計	2,121,438,888	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,611,790,400	-	2,596,405,000	15,385,400
	合計	2,611,790,400	-	2,596,405,000	15,385,400

## (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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成25年9月30日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	41,000	284.00	11,644,000	
日本水産	103,100	211.00	21,754,100	
マルハニチロホールディングス	185,000	186.00	34,410,000	
サカタのタネ	14,100	1,354.00	19,091,400	
ホクト	9,800	1,779.00	17,434,200	
住石ホールディングス	28,200	169.00	4,765,800	
日鉄鉱業	24,000	548.00	13,152,000	
三井松島産業	63,000	165.00	10,395,000	
国際石油開発帝石	466,300	1,158.00	539,975,400	
日本海洋掘削	2,400	7,550.00	18,120,000	
関東天然瓦斯開発	10,000	755.00	7,550,000	
石油資源開発	13,700	4,220.00	57,814,000	
ショーボンドホールディングス	8,500	4,465.00	37,952,500	
ミライト・ホールディングス	28,000	837.00	23,436,000	
タマホーム	4,600	1,216.00	5,593,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,710.00	2,394,000	
安藤・間	56,900	327.00	18,606,300	
東急建設	35,680	563.00	20,087,840	
コムシスホールディングス	46,600	1,368.00	63,748,800	
ミサワホーム	12,600	1,554.00	19,580,400	
高松コンストラクショングループ	7,400	1,769.00	13,090,600	
東建コーポレーション	3,750	5,440.00	20,400,000	
ヤマウラ	5,000	299.00	1,495,000	
大成建設	485,000	483.00	234,255,000	
大林組	288,000	586.00	168,768,000	
清水建設	294,000	479.00	140,826,000	
長谷工コーポレーション	119,900	703.00	84,289,700	
松井建設	13,000	400.00	5,200,000	
鹿島建設	424,000	399.00	169,176,000	
不動テトラ	67,700	181.00	12,253,700	
鉄建建設	58,000	312.00	18,096,000	
太平工業	19,000	385.00	7,315,000	
西松建設	126,000	285.00	35,910,000	
三井住友建設	198,000	124.00	24,552,000	

前田建設工業	62,000	604.00	37,448,000	
ナカノフード建設	13,500	250.00	3,375,000	
奥村組	85,000	426.00	36,210,000	
大和小田急建設	4,500	267.00	1,201,500	
東鉄工業	12,500	2,201.00	27,512,500	
イチケン	18,000	182.00	3,276,000	
戸田建設	111,000	336.00	37,296,000	
熊谷組	71,000	234.00	16,614,000	
青木あすなる建設	5,500	592.00	3,256,000	
北野建設	25,000	225.00	5,625,000	
植木組	20,000	205.00	4,100,000	
三井ホーム	13,000	484.00	6,292,000	
矢作建設工業	13,900	525.00	7,297,500	
ピーエス三菱	8,200	487.00	3,993,400	
大東建託	36,400	9,810.00	357,084,000	
新日本建設	16,300	321.00	5,232,300	
N I P P O	22,000	1,682.00	37,004,000	
東亜道路工業	20,000	477.00	9,540,000	
前田道路	28,000	1,629.00	45,612,000	
日本道路	30,000	590.00	17,700,000	
東亜建設工業	86,000	215.00	18,490,000	
東洋建設	29,800	317.00	9,446,600	
五洋建設	115,000	274.00	31,510,000	
大林道路	13,000	545.00	7,085,000	
福田組	18,000	376.00	6,768,000	
住友林業	66,200	1,064.00	70,436,800	
日本基礎技術	11,900	425.00	5,057,500	
日成ビルド工業	37,000	194.00	7,178,000	
巴コーポレーション	13,000	521.00	6,773,000	
パナホーム	36,000	646.00	23,256,000	
大和ハウス工業	260,000	1,848.00	480,480,000	
ライト工業	22,700	775.00	17,592,500	
積水ハウス	288,000	1,318.00	379,584,000	
日特建設	10,300	416.00	4,284,800	
北陸電気工事	7,000	348.00	2,436,000	
ユアテック	15,000	321.00	4,815,000	
西部電気工業	8,000	420.00	3,360,000	
四電工	8,000	354.00	2,832,000	
中電工	13,900	1,371.00	19,056,900	

関電工	44,000	594.00	26,136,000	
きんでん	52,000	1,055.00	54,860,000	
東京エネシス	11,000	526.00	5,786,000	
トーエネック	14,000	585.00	8,190,000	
住友電設	7,100	1,337.00	9,492,700	
日本電設工業	17,000	1,067.00	18,139,000	
協和エクシオ	34,500	1,156.00	39,882,000	
新日本空調	7,100	618.00	4,387,800	
N D S	15,000	285.00	4,275,000	
九電工	16,000	528.00	8,448,000	
三機工業	21,000	603.00	12,663,000	
日揮	96,000	3,540.00	339,840,000	
中外炉工業	32,000	258.00	8,256,000	
ヤマト	11,000	360.00	3,960,000	
太平電業	12,000	718.00	8,616,000	
高砂熱学工業	27,600	833.00	22,990,800	
三晃金属工業	16,000	286.00	4,576,000	
朝日工業社	11,000	366.00	4,026,000	
明星工業	10,000	394.00	3,940,000	
大気社	13,800	2,342.00	32,319,600	
ダイダン	13,000	537.00	6,981,000	
日比谷総合設備	11,800	1,192.00	14,065,600	
東芝プラントシステム	16,000	1,627.00	26,032,000	
東洋エンジニアリング	55,000	425.00	23,375,000	
千代田化工建設	69,000	1,180.00	81,420,000	
新興プランテック	19,700	820.00	16,154,000	
日本製粉	59,000	493.00	29,087,000	
日清製粉グループ本社	95,600	990.00	94,644,000	
日東富士製粉	7,000	304.00	2,128,000	
昭和産業	39,000	304.00	11,856,000	
鳥越製粉	7,600	641.00	4,871,600	
協同飼料	33,000	115.00	3,795,000	
中部飼料	8,500	558.00	4,743,000	
日本配合飼料	27,000	126.00	3,402,000	
東洋精糖	15,000	107.00	1,605,000	
日本甜菜製糖	49,000	183.00	8,967,000	
三井製糖	38,000	309.00	11,742,000	
森永製菓	95,000	211.00	20,045,000	
中村屋	22,000	404.00	8,888,000	



江崎グリコ	35,000	930.00	32,550,000	
名糖産業	4,200	1,032.00	4,334,400	
不二家	55,000	194.00	10,670,000	
山崎製パン	70,000	1,060.00	74,200,000	
モロゾフ	15,000	315.00	4,725,000	
亀田製菓	5,400	2,937.00	15,859,800	
カルビー	35,100	2,846.00	99,894,600	
森永乳業	82,000	310.00	25,420,000	
六甲バター	2,800	788.00	2,206,400	
ヤクルト本社	56,100	4,915.00	275,731,500	
明治ホールディングス	28,400	5,370.00	152,508,000	
雪印メグミルク	18,800	1,452.00	27,297,600	
プリマハム	55,000	206.00	11,330,000	
日本ハム	73,000	1,405.00	102,565,000	
伊藤ハム	53,000	409.00	21,677,000	
丸大食品	46,000	318.00	14,628,000	
米久	3,800	771.00	2,929,800	
S Foods	6,000	903.00	5,418,000	
サッポロホールディングス	158,000	426.00	67,308,000	
アサヒグループホールディングス	192,700	2,579.00	496,973,300	
キリンホールディングス	410,000	1,429.00	585,890,000	
宝ホールディングス	76,000	895.00	68,020,000	
オエノンホールディングス	23,000	250.00	5,750,000	
養命酒製造	7,000	813.00	5,691,000	
コカ・コーラウエスト	29,500	1,961.00	57,849,500	
コカ・コーライーストジャパン	19,800	1,578.00	31,244,400	
サントリー食品インターナショナル	49,300	3,315.00	163,429,500	
ダイトードリンコ	4,800	4,025.00	19,320,000	
伊藤園	26,100	2,231.00	58,229,100	
キーコーヒー	8,400	1,563.00	13,129,200	
ユニカフェ	2,600	540.00	1,404,000	
ジャパンフーズ	1,300	1,274.00	1,656,200	
日清オイリオグループ	41,000	341.00	13,981,000	
不二製油	23,300	1,705.00	39,726,500	
かどや製油	700	2,692.00	1,884,400	
J - オイルミルズ	41,000	313.00	12,833,000	
キッコーマン	78,000	1,795.00	140,010,000	
味の素	236,000	1,290.00	304,440,000	
キューピー	48,800	1,559.00	76,079,200	

ハウス食品	33,700	1,525.00	51,392,500	
カゴメ	34,400	1,669.00	57,413,600	
焼津水産化学工業	4,500	873.00	3,928,500	
アリアケジャパン	8,700	2,432.00	21,158,400	
ニチレイ	102,000	534.00	54,468,000	
東洋水産	44,000	2,878.00	126,632,000	
日清食品ホールディングス	37,500	4,030.00	151,125,000	
永谷園	9,000	882.00	7,938,000	
フジッコ	10,000	1,211.00	12,110,000	
ロック・フィールド	5,000	1,944.00	9,720,000	
日本たばこ産業	532,800	3,530.00	1,880,784,000	
ケンコーマヨネーズ	2,900	893.00	2,589,700	
わらべや日洋	5,700	1,739.00	9,912,300	
なとり	4,400	938.00	4,127,200	
ミヨシ油脂	34,000	159.00	5,406,000	
片倉工業	10,300	1,331.00	13,709,300	
ゲンゼ	67,000	267.00	17,889,000	
東洋紡	379,000	188.00	71,252,000	
ユニチカ	246,000	59.00	14,514,000	
富士紡ホールディングス	43,000	222.00	9,546,000	
日清紡ホールディングス	57,000	809.00	46,113,000	
倉敷紡績	92,000	166.00	15,272,000	
シキボウ	55,000	127.00	6,985,000	
日本毛織	28,000	775.00	21,700,000	
トーア紡コーポレーション	38,000	76.00	2,888,000	
ダイドーリミテッド	10,100	706.00	7,130,600	
帝国繊維	9,000	851.00	7,659,000	
帝人	340,000	226.00	76,840,000	
東レ	694,000	645.00	447,630,000	
サカイオーベックス	24,000	148.00	3,552,000	
住江織物	29,000	252.00	7,308,000	
日本フェルト	5,100	436.00	2,223,600	
イチカワ	6,000	297.00	1,782,000	
日本バイリーン	11,000	510.00	5,610,000	
芦森工業	27,000	137.00	3,699,000	
アツギ	75,000	113.00	8,475,000	
ダイニック	17,000	171.00	2,907,000	
セーレン	24,100	666.00	16,050,600	
東海染工	12,000	120.00	1,440,000	

小松精練	15,000	516.00	7,740,000	
ワコールホールディングス	53,000	1,046.00	55,438,000	
ホギメディカル	5,700	5,440.00	31,008,000	
レナウン	19,400	134.00	2,599,600	
クラウドシア	1,700	1,070.00	1,819,000	
T S Iホールディングス	47,000	663.00	31,161,000	
三陽商会	47,000	255.00	11,985,000	
オンワードホールディングス	60,000	864.00	51,840,000	
ルック	19,000	322.00	6,118,000	
ゴールドウイン	21,000	483.00	10,143,000	
デサント	23,000	707.00	16,261,000	
キング	2,800	429.00	1,201,200	
ヤマトインターナショナル	5,500	440.00	2,420,000	
特種東海製紙	52,000	206.00	10,712,000	
王子ホールディングス	396,000	460.00	182,160,000	
日本製紙	43,200	1,550.00	66,960,000	
三菱製紙	127,000	89.00	11,303,000	
北越紀州製紙	55,500	464.00	25,752,000	
中越パルプ工業	34,000	154.00	5,236,000	
巴川製紙所	14,000	176.00	2,464,000	
大王製紙	38,000	605.00	22,990,000	
レンゴー	72,000	541.00	38,952,000	
トーモク	28,000	304.00	8,512,000	
ザ・パック	6,300	1,796.00	11,314,800	
クラレ	152,600	1,175.00	179,305,000	
旭化成	559,000	739.00	413,101,000	
共和レザー	5,300	321.00	1,701,300	
コープケミカル	13,000	149.00	1,937,000	
昭和電工	597,000	133.00	79,401,000	
住友化学	616,000	374.00	230,384,000	
日本化成	17,000	140.00	2,380,000	
住友精化	17,000	587.00	9,979,000	
日産化学工業	61,400	1,477.00	90,687,800	
ラサ工業	32,000	243.00	7,776,000	
クレハ	63,000	354.00	22,302,000	
多木化学	4,000	775.00	3,100,000	
テイカ	15,000	322.00	4,830,000	
石原産業	161,000	102.00	16,422,000	
片倉チッカリン	6,000	262.00	1,572,000	

日本曹達	53,000	583.00	30,899,000	
東ソー	240,000	404.00	96,960,000	
トクヤマ	130,000	383.00	49,790,000	
セントラル硝子	80,000	325.00	26,000,000	
東亜合成	105,000	437.00	45,885,000	
ダイソー	36,000	306.00	11,016,000	
関東電化工業	21,000	218.00	4,578,000	
電気化学工業	179,000	382.00	68,378,000	
信越化学工業	160,700	6,000.00	964,200,000	
日本カーバイド工業	26,000	339.00	8,814,000	
堺化学工業	33,000	353.00	11,649,000	
エア・ウォーター	74,000	1,447.00	107,078,000	
大陽日酸	118,000	658.00	77,644,000	
日本化学工業	33,000	175.00	5,775,000	
日本パーカライジング	21,000	2,008.00	42,168,000	
高圧ガス工業	13,000	529.00	6,877,000	
チタン工業	10,000	340.00	3,400,000	
四国化成工業	13,000	829.00	10,777,000	
戸田工業	13,000	314.00	4,082,000	
ステラ ケミファ	3,900	1,555.00	6,064,500	
保土谷化学工業	20,000	202.00	4,040,000	
日本触媒	65,000	1,138.00	73,970,000	
大日精化工業	32,000	429.00	13,728,000	
カネカ	112,000	640.00	71,680,000	
三菱瓦斯化学	141,000	824.00	116,184,000	
三井化学	380,000	269.00	102,220,000	
J S R	82,200	1,821.00	149,686,200	
東京応化工業	17,300	2,180.00	37,714,000	
大阪有機化学工業	6,000	449.00	2,694,000	
三菱ケミカルホールディングス	560,500	458.00	256,709,000	
日本合成化学工業	18,000	936.00	16,848,000	
ダイセル	107,000	885.00	94,695,000	
住友ベークライト	70,000	355.00	24,850,000	
積水化学工業	184,000	998.00	183,632,000	
日本ゼオン	77,000	1,252.00	96,404,000	
アイカ工業	25,200	1,955.00	49,266,000	
宇部興産	452,000	185.00	83,620,000	
積水樹脂	13,000	1,422.00	18,486,000	
タキロン	21,000	422.00	8,862,000	

旭有機材工業	32,000	225.00	7,200,000	
日立化成	38,800	1,579.00	61,265,200	
ニチバン	9,000	397.00	3,573,000	
リケンテクノス	14,000	415.00	5,810,000	
大倉工業	21,000	388.00	8,148,000	
積水化成成品工業	23,000	276.00	6,348,000	
群栄化学工業	24,000	532.00	12,768,000	
タイガースポリマー	4,500	414.00	1,863,000	
ミライアル	2,200	1,594.00	3,506,800	
日本カーリット	7,200	529.00	3,808,800	
日本化薬	63,000	1,411.00	88,893,000	
日本精化	7,400	657.00	4,861,800	
A D E K A	38,600	1,162.00	44,853,200	
日油	70,000	631.00	44,170,000	
ハリマ化成グループ	7,700	479.00	3,688,300	
花王	233,100	3,060.00	713,286,000	
第一工業製薬	16,000	243.00	3,888,000	
三洋化成工業	28,000	676.00	18,928,000	
大日本塗料	51,000	172.00	8,772,000	
日本ペイント	78,000	1,567.00	122,226,000	
関西ペイント	101,000	1,302.00	131,502,000	
神東塗料	3,000	235.00	705,000	
中国塗料	28,000	611.00	17,108,000	
日本特殊塗料	6,900	414.00	2,856,600	
藤倉化成	10,400	513.00	5,335,200	
太陽ホールディングス	7,300	3,050.00	22,265,000	
D I C	318,000	271.00	86,178,000	
サカタインクス	18,000	890.00	16,020,000	
東洋インキ S C ホールディングス	81,000	510.00	41,310,000	
T & K T O K A	3,000	2,035.00	6,105,000	
富士フイルムホールディングス	191,500	2,354.00	450,791,000	
資生堂	159,500	1,764.00	281,358,000	
ライオン	103,000	598.00	61,594,000	
高砂香料工業	30,000	513.00	15,390,000	
マンダム	9,600	3,430.00	32,928,000	
ミルボン	4,800	4,025.00	19,320,000	
ファンケル	22,600	1,195.00	27,007,000	
コーセー	16,100	2,840.00	45,724,000	
ドクターシーラボ	61	291,800.00	17,799,800	

シーボン	700	1,998.00	1,398,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,100	3,520.00	32,032,000	
ノエビアホールディングス	6,000	1,678.00	10,068,000	
エステー	5,500	1,000.00	5,500,000	
コニシ	6,500	1,899.00	12,343,500	
長谷川香料	11,300	1,436.00	16,226,800	
星光PMC	3,800	466.00	1,770,800	
小林製薬	13,600	5,620.00	76,432,000	
荒川化学工業	7,000	875.00	6,125,000	
メック	6,500	438.00	2,847,000	
日本高純度化学	24	215,300.00	5,167,200	
JCU	1,300	4,345.00	5,648,500	
新田ゼラチン	5,300	1,177.00	6,238,100	
アース製薬	6,500	3,725.00	24,212,500	
イハラケミカル工業	14,000	705.00	9,870,000	
北興化学工業	9,000	300.00	2,700,000	
大成ラミック	2,500	2,446.00	6,115,000	
クミアイ化学工業	18,000	697.00	12,546,000	
日本農薬	20,000	1,084.00	21,680,000	
アキレス	71,000	138.00	9,798,000	
有沢製作所	14,000	631.00	8,834,000	
日東電工	73,900	6,390.00	472,221,000	
レック	2,800	1,263.00	3,536,400	
きもと	8,100	978.00	7,921,800	
藤森工業	7,600	3,205.00	24,358,000	
前澤化成工業	6,300	1,054.00	6,640,200	
JSP	5,900	1,604.00	9,463,600	
エフピコ	4,400	7,380.00	32,472,000	
天馬	7,200	1,337.00	9,626,400	
信越ポリマー	17,600	340.00	5,984,000	
東リ	23,000	209.00	4,807,000	
ニフコ	20,000	2,624.00	52,480,000	
日本バルカー工業	37,000	275.00	10,175,000	
ユニ・チャーム	49,500	5,730.00	283,635,000	
協和発酵キリン	107,000	1,008.00	107,856,000	
武田薬品工業	335,700	4,635.00	1,555,969,500	
アステラス製薬	194,300	5,000.00	971,500,000	
大日本住友製薬	63,400	1,336.00	84,702,400	
塩野義製薬	130,600	2,061.00	269,166,600	

田辺三菱製薬	74,600	1,377.00	102,724,200	
わかもと製薬	10,000	276.00	2,760,000	
あすか製薬	11,000	714.00	7,854,000	
日本新薬	19,000	1,692.00	32,148,000	
ビオフェルミン製薬	1,000	2,634.00	2,634,000	
中外製薬	89,200	2,014.00	179,648,800	
科研製薬	35,000	1,489.00	52,115,000	
エーザイ	110,300	3,990.00	440,097,000	
ロート製薬	38,000	1,385.00	52,630,000	
小野薬品工業	43,800	6,030.00	264,114,000	
久光製薬	27,800	5,480.00	152,344,000	
有機合成薬品工業	6,000	291.00	1,746,000	
持田製薬	6,600	6,430.00	42,438,000	
参天製薬	30,700	4,765.00	146,285,500	
扶桑薬品工業	30,000	321.00	9,630,000	
日本ケミファ	12,000	478.00	5,736,000	
ツムラ	24,400	2,878.00	70,223,200	
日医工	13,000	2,290.00	29,770,000	
キッセイ薬品工業	16,600	2,248.00	37,316,800	
生化学工業	17,100	1,327.00	22,691,700	
栄研化学	6,400	1,833.00	11,731,200	
日水製薬	3,600	1,132.00	4,075,200	
鳥居薬品	5,400	2,640.00	14,256,000	
東和薬品	4,600	4,875.00	22,425,000	
富士製薬工業	2,500	1,737.00	4,342,500	
沢井製薬	11,800	6,890.00	81,302,000	
ゼリア新薬工業	14,100	2,135.00	30,103,500	
第一三共	282,600	1,778.00	502,462,800	
キョーリン製薬ホールディングス	23,900	2,095.00	50,070,500	
大幸薬品	4,200	1,652.00	6,938,400	
ダイト	2,900	1,456.00	4,222,400	
大塚ホールディングス	177,900	2,846.00	506,303,400	
大正製薬ホールディングス	21,600	6,470.00	139,752,000	
日本コークス工業	72,500	137.00	9,932,500	
昭和シェル石油	80,100	1,098.00	87,949,800	
コスモ石油	248,000	184.00	45,632,000	
ニチレキ	11,000	878.00	9,658,000	
東燃ゼネラル石油	135,000	907.00	122,445,000	
ユシロ化学工業	4,800	939.00	4,507,200	

ビーピー・カストロール	3,700	452.00	1,672,400	
AOCホールディングス	20,800	357.00	7,425,600	
MORESCO	1,900	1,118.00	2,124,200	
出光興産	10,600	8,500.00	90,100,000	
JXホールディングス	994,600	509.00	506,251,400	
横浜ゴム	100,000	968.00	96,800,000	
東洋ゴム工業	74,000	591.00	43,734,000	
ブリヂストン	280,900	3,575.00	1,004,217,500	
住友ゴム工業	69,900	1,511.00	105,618,900	
藤倉ゴム工業	5,000	416.00	2,080,000	
オカモト	31,000	311.00	9,641,000	
フコク	3,700	825.00	3,052,500	
ニッタ	8,800	2,094.00	18,427,200	
東海ゴム工業	16,600	955.00	15,853,000	
三ツ星ベルト	23,000	521.00	11,983,000	
バンドー化学	30,000	389.00	11,670,000	
日東紡績	66,000	414.00	27,324,000	
旭硝子	441,000	609.00	268,569,000	
日本板硝子	408,000	126.00	51,408,000	
石塚硝子	12,000	286.00	3,432,000	
日本山村硝子	36,000	185.00	6,660,000	
日本電気硝子	159,000	525.00	83,475,000	
オハラ	3,400	636.00	2,162,400	
住友大阪セメント	159,000	395.00	62,805,000	
太平洋セメント	494,000	428.00	211,432,000	
デイ・シイ	9,800	678.00	6,644,400	
日本ヒューム	9,000	865.00	7,785,000	
日本コンクリート工業	15,000	524.00	7,860,000	
三谷セキサン	2,800	1,517.00	4,247,600	
ジャパンパイル	6,800	1,064.00	7,235,200	
東海カーボン	84,000	340.00	28,560,000	
日本カーボン	47,000	197.00	9,259,000	
東洋炭素	5,000	1,830.00	9,150,000	
ノリタケカンパニーリミテド	46,000	261.00	12,006,000	
TOTO	132,000	1,374.00	181,368,000	
日本碍子	117,000	1,488.00	174,096,000	
日本特殊陶業	77,000	2,169.00	167,013,000	
MARUWA	2,000	3,490.00	6,980,000	
品川リフラクトリーズ	23,000	222.00	5,106,000	



黒崎播磨	21,000	237.00	4,977,000	
ヨータイ	4,000	314.00	1,256,000	
イソライト工業	4,400	201.00	884,400	
東京窯業	11,000	253.00	2,783,000	
ニッカトー	3,100	418.00	1,295,800	
フジミインコーポレーテッド	8,200	1,324.00	10,856,800	
ニチアス	40,000	661.00	26,440,000	
ニチハ	10,200	1,339.00	13,657,800	
新日鐵住金	3,811,000	333.00	1,269,063,000	
神戸製鋼所	1,244,000	182.00	226,408,000	
合同製鐵	50,000	194.00	9,700,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	228,600	2,543.00	581,329,800	
日新製鋼ホールディングス	38,300	1,300.00	49,790,000	
東京製鐵	50,200	580.00	29,116,000	
共英製鋼	8,400	1,793.00	15,061,200	
大和工業	18,600	3,640.00	67,704,000	
東京鐵鋼	18,000	427.00	7,686,000	
大阪製鐵	4,500	1,934.00	8,703,000	
淀川製鋼所	64,000	433.00	27,712,000	
東洋鋼鈹	19,000	376.00	7,144,000	
丸一鋼管	30,000	2,438.00	73,140,000	
モリ工業	14,000	412.00	5,768,000	
大同特殊鋼	139,000	576.00	80,064,000	
日本高周波鋼業	36,000	121.00	4,356,000	
日本冶金工業	67,500	362.00	24,435,000	
山陽特殊製鋼	45,000	511.00	22,995,000	
愛知製鋼	48,000	537.00	25,776,000	
日立金属	75,000	1,204.00	90,300,000	
日本金属	23,000	153.00	3,519,000	
大平洋金属	57,000	403.00	22,971,000	
日本電工	38,000	296.00	11,248,000	
栗本鐵工所	39,000	292.00	11,388,000	
虹技	7,000	207.00	1,449,000	
日本鑄鉄管	10,000	237.00	2,370,000	
三菱製鋼	55,000	319.00	17,545,000	
日垂鋼業	13,000	348.00	4,524,000	
日本精線	6,000	480.00	2,880,000	
シンニッタン	7,100	373.00	2,648,300	
新家工業	20,000	179.00	3,580,000	

大紀アルミニウム工業所	17,000	310.00	5,270,000	
日本軽金属ホールディングス	188,400	151.00	28,448,400	
三井金属鉱業	228,000	285.00	64,980,000	
東邦亜鉛	51,000	316.00	16,116,000	
三菱マテリアル	524,000	405.00	212,220,000	
住友金属鉱山	232,000	1,386.00	321,552,000	
DOWAホールディングス	99,000	988.00	97,812,000	
古河機械金属	152,000	223.00	33,896,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,800	2,105.00	18,524,000	
東邦チタニウム	15,200	816.00	12,403,200	
住友軽金属工業	219,000	107.00	23,433,000	
古河スカイ	30,000	329.00	9,870,000	
古河電気工業	282,000	226.00	63,732,000	
住友電気工業	316,500	1,422.00	450,063,000	
フジクラ	144,000	380.00	54,720,000	
昭和電線ホールディングス	115,000	121.00	13,915,000	
タツタ電線	17,400	750.00	13,050,000	
沖電線	12,000	184.00	2,208,000	
カナレ電気	1,300	1,533.00	1,992,900	
平河ヒューテック	2,200	777.00	1,709,400	
リョービ	51,000	441.00	22,491,000	
アサヒホールディングス	13,700	1,650.00	22,605,000	
稲葉製作所	4,000	1,346.00	5,384,000	
トーカロ	5,200	1,463.00	7,607,600	
アルファC o	4,100	1,041.00	4,268,100	
SUMCO	56,300	797.00	44,871,100	
川田テクノロジーズ	2,500	2,888.00	7,220,000	
東洋製罐グループホールディングス	63,600	1,924.00	122,366,400	
ホッカンホールディングス	26,000	305.00	7,930,000	
コロナ	4,100	1,105.00	4,530,500	
横河ブリッジホールディングス	18,000	1,399.00	25,182,000	
日本橋梁	13,000	211.00	2,743,000	
駒井ハルテック	22,000	252.00	5,544,000	
高田機工	10,000	230.00	2,300,000	
三和ホールディングス	83,000	598.00	49,634,000	
文化シャッター	26,000	507.00	13,182,000	
三協立山	12,300	2,172.00	26,715,600	
東洋シャッター	4,400	614.00	2,701,600	
LIXILグループ	124,800	2,019.00	251,971,200	

日本ファイルコン	8,200	432.00	3,542,400	
ノーリツ	17,600	2,115.00	37,224,000	
長府製作所	9,600	2,248.00	21,580,800	
リンナイ	13,900	7,280.00	101,192,000	
ダイニチ工業	4,600	877.00	4,034,200	
日東精工	15,000	348.00	5,220,000	
三洋工業	16,000	196.00	3,136,000	
岡部	18,100	1,199.00	21,701,900	
東ブレ	17,700	1,262.00	22,337,400	
高周波熱錬	12,600	952.00	11,995,200	
サンコール	4,000	597.00	2,388,000	
モリテック スチール	4,500	281.00	1,264,500	
パイオラックス	3,800	3,075.00	11,685,000	
日本発條	64,900	1,004.00	65,159,600	
中央発條	12,000	330.00	3,960,000	
三益半導体工業	7,800	864.00	6,739,200	
アタカ大機	6,000	547.00	3,282,000	
日本製鋼所	138,000	569.00	78,522,000	
三浦工業	13,300	2,703.00	35,949,900	
タクマ	30,000	927.00	27,810,000	
ツガミ	24,000	484.00	11,616,000	
オークマ	58,000	852.00	49,416,000	
東芝機械	44,000	507.00	22,308,000	
アマダ	137,000	883.00	120,971,000	
アイダエンジニアリング	21,100	899.00	18,968,900	
滝澤鉄工所	26,000	154.00	4,004,000	
富士機械製造	27,400	978.00	26,797,200	
牧野フライス製作所	42,000	694.00	29,148,000	
オーエスジー	36,800	1,715.00	63,112,000	
ダイジェット工業	13,000	161.00	2,093,000	
旭ダイヤモンド工業	21,500	973.00	20,919,500	
森精機製作所	47,300	1,523.00	72,037,900	
ディスコ	10,000	5,620.00	56,200,000	
日東工器	5,300	1,842.00	9,762,600	
豊和工業	5,700	864.00	4,924,800	
大阪機工	35,000	167.00	5,845,000	
東洋機械金属	8,300	382.00	3,170,600	
津田駒工業	22,000	186.00	4,092,000	
島精機製作所	11,700	2,158.00	25,248,600	

日阪製作所	11,000	937.00	10,307,000	
やまびこ	3,500	2,763.00	9,670,500	
ペガサスミシン製造	10,000	395.00	3,950,000	
ナブテスコ	44,300	2,392.00	105,965,600	
三井海洋開発	7,400	3,075.00	22,755,000	
レオン自動機	10,000	252.00	2,520,000	
S M C	25,600	23,340.00	597,504,000	
新川	8,000	656.00	5,248,000	
ホソカワミクロン	15,000	692.00	10,380,000	
ユニオンツール	3,900	2,089.00	8,147,100	
オイレス工業	9,400	2,253.00	21,178,200	
サトーホールディングス	9,400	2,005.00	18,847,000	
日本エアテック	3,700	487.00	1,801,900	
日精樹脂工業	7,300	671.00	4,898,300	
ワイエイシイ	4,400	553.00	2,433,200	
小松製作所	418,000	2,439.00	1,019,502,000	
住友重機械工業	245,000	446.00	109,270,000	
日立建機	45,800	2,195.00	100,531,000	
日工	12,000	452.00	5,424,000	
巴工業	3,300	1,702.00	5,616,600	
井関農機	86,000	348.00	29,928,000	
T O W A	8,900	552.00	4,912,800	
丸山製作所	21,000	278.00	5,838,000	
北川鉄工所	39,000	195.00	7,605,000	
クボタ	467,000	1,417.00	661,739,000	
荏原実業	2,400	1,331.00	3,194,400	
三菱化工機	28,000	192.00	5,376,000	
月島機械	15,000	1,036.00	15,540,000	
帝国電機製作所	2,900	1,987.00	5,762,300	
新東工業	18,100	737.00	13,339,700	
澁谷工業	5,800	2,081.00	12,069,800	
アイチ コーポレーション	14,900	528.00	7,867,200	
小森コーポレーション	21,800	1,442.00	31,435,600	
鶴見製作所	7,000	949.00	6,643,000	
住友精密工業	16,000	432.00	6,912,000	
酒井重工業	18,000	401.00	7,218,000	
荏原製作所	184,000	550.00	101,200,000	
石井鐵工所	16,000	326.00	5,216,000	
西島製作所	10,400	963.00	10,015,200	

ダイキン工業	116,800	5,210.00	608,528,000	
オルガノ	16,000	496.00	7,936,000	
トーヨーカネツ	48,000	294.00	14,112,000	
栗田工業	44,400	2,083.00	92,485,200	
椿本チエイン	46,000	684.00	31,464,000	
大同工業	21,000	271.00	5,691,000	
日本コンベヤ	28,000	156.00	4,368,000	
木村化工機	9,900	584.00	5,781,600	
アネスト岩田	14,000	495.00	6,930,000	
ダイフク	39,500	1,061.00	41,909,500	
加藤製作所	22,000	589.00	12,958,000	
油研工業	20,000	233.00	4,660,000	
タダノ	41,000	1,257.00	51,537,000	
フジテック	25,000	1,234.00	30,850,000	
C K D	24,100	863.00	20,798,300	
キトー	5,600	1,516.00	8,489,600	
平和	19,000	1,706.00	32,414,000	
理想科学工業	5,700	2,295.00	13,081,500	
S A N K Y O	25,900	4,795.00	124,190,500	
日本金銭機械	8,000	2,356.00	18,848,000	
マースエンジニアリング	4,900	1,895.00	9,285,500	
福島工業	4,800	1,535.00	7,368,000	
オーイズミ	3,300	1,330.00	4,389,000	
ダイコク電機	3,600	2,124.00	7,646,400	
アマノ	24,500	1,015.00	24,867,500	
サンデン	51,000	443.00	22,593,000	
マックス	13,000	1,139.00	14,807,000	
グローリー	25,600	2,465.00	63,104,000	
新晃工業	3,900	834.00	3,252,600	
大和冷機工業	14,000	618.00	8,652,000	
セガサミーホールディングス	92,000	2,829.00	260,268,000	
日本ピストンリング	31,000	181.00	5,611,000	
リケン	31,000	417.00	12,927,000	
T P R	9,700	1,804.00	17,498,800	
ホシザキ電機	18,700	3,385.00	63,299,500	
大豊工業	6,300	1,277.00	8,045,100	
日本精工	190,000	1,001.00	190,190,000	
N T N	186,000	442.00	82,212,000	
ジェイテクト	91,000	1,342.00	122,122,000	

不二越	80,000	547.00	43,760,000	
日本トムソン	30,000	557.00	16,710,000	
THK	56,900	2,174.00	123,700,600	
ユースン精機	4,300	1,829.00	7,864,700	
前澤給装工業	3,300	1,268.00	4,184,400	
イーグル工業	11,000	1,599.00	17,589,000	
前澤工業	7,800	392.00	3,057,600	
日本ピラー工業	9,000	721.00	6,489,000	
キッツ	35,700	443.00	15,815,100	
日立工機	23,000	775.00	17,825,000	
マキタ	52,100	5,700.00	296,970,000	
日立造船	67,800	769.00	52,138,200	
三菱重工業	1,434,000	563.00	807,342,000	
IHI	585,000	413.00	241,605,000	
イビデン	52,100	1,603.00	83,516,300	
コニカミノルタ	226,000	824.00	186,224,000	
ブラザー工業	110,600	1,106.00	122,323,600	
ミネベア	117,000	500.00	58,500,000	
日立製作所	2,055,000	647.00	1,329,585,000	
東芝	1,689,000	440.00	743,160,000	
三菱電機	856,000	1,030.00	881,680,000	
富士電機	258,000	400.00	103,200,000	
東洋電機製造	17,000	339.00	5,763,000	
安川電機	94,000	1,379.00	129,626,000	
シンフォニアテクノロジー	52,000	175.00	9,100,000	
明電舎	85,000	359.00	30,515,000	
オリジン電気	13,000	334.00	4,342,000	
山洋電気	13,000	730.00	9,490,000	
デンヨー	8,500	1,228.00	10,438,000	
東芝テック	54,000	604.00	32,616,000	
芝浦メカトロニクス	17,000	246.00	4,182,000	
マブチモーター	12,100	5,170.00	62,557,000	
日本電産	46,200	8,100.00	374,220,000	
東光高岳ホールディングス	4,300	1,707.00	7,340,100	
ダイヘン	47,000	393.00	18,471,000	
ヤーマン	1,100	1,295.00	1,424,500	
JVCケンウッド	53,300	188.00	10,020,400	
第一精工	3,600	1,379.00	4,964,400	
日新電機	17,000	527.00	8,959,000	

大崎電気工業	11,000	605.00	6,655,000	
オムロン	90,500	3,545.00	320,822,500	
日東工業	12,600	1,637.00	20,626,200	
I D E C	11,200	921.00	10,315,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	165,000	570.00	94,050,000	
サクサホールディングス	22,000	158.00	3,476,000	
メルコホールディングス	5,300	1,371.00	7,266,300	
テクノメディカ	1,800	2,163.00	3,893,400	
日本電気	1,108,000	227.00	251,516,000	
富士通	825,000	366.00	301,950,000	
沖電気工業	311,000	185.00	57,535,000	
岩崎通信機	37,000	104.00	3,848,000	
電気興業	23,000	626.00	14,398,000	
サンケン電気	43,000	501.00	21,543,000	
ナカヨ通信機	8,000	303.00	2,424,000	
アイホン	5,000	1,680.00	8,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	22,200	468.00	10,389,600	
セイコーエプソン	58,400	1,607.00	93,848,800	
ワコム	62,900	939.00	59,063,100	
アルバック	14,400	898.00	12,931,200	
アクセル	4,300	1,940.00	8,342,000	
E I Z O	7,300	2,534.00	18,498,200	
日本信号	21,600	752.00	16,243,200	
京三製作所	19,000	352.00	6,688,000	
能美防災	11,000	824.00	9,064,000	
ホーチキ	8,000	478.00	3,824,000	
エレコム	2,700	1,343.00	3,626,100	
日本無線	18,000	360.00	6,480,000	
パナソニック	977,800	948.00	926,954,400	
シャープ	454,000	360.00	163,440,000	
アンリツ	45,900	1,246.00	57,191,400	
富士通ゼネラル	20,000	1,130.00	22,600,000	
日立国際電気	20,000	1,179.00	23,580,000	
ソニー	537,800	2,098.00	1,128,304,400	
T D K	48,200	3,850.00	185,570,000	
帝国通信工業	20,000	177.00	3,540,000	
ミツミ電機	32,600	692.00	22,559,200	
タムラ製作所	33,000	255.00	8,415,000	
アルプス電気	62,700	791.00	49,595,700	

パイオニア	104,300	169.00	17,626,700	
日本電波工業	7,700	915.00	7,045,500	
日本トリム	2,300	6,000.00	13,800,000	
ローランド ディー・ジー・	3,900	2,663.00	10,385,700	
フォスター電機	8,800	2,034.00	17,899,200	
クラリオン	45,000	129.00	5,805,000	
S M K	25,000	447.00	11,175,000	
ヨコオ	6,700	530.00	3,551,000	
東光	40,000	353.00	14,120,000	
ホシデン	23,200	529.00	12,272,800	
ヒロセ電機	14,900	15,060.00	224,394,000	
日本航空電子工業	20,000	1,133.00	22,660,000	
T O A	9,000	825.00	7,425,000	
古野電気	5,200	654.00	3,400,800	
ユニデン	25,000	230.00	5,750,000	
アルパイン	16,700	1,067.00	17,818,900	
スミダコーポレーション	8,100	464.00	3,758,400	
アイコム	4,800	2,323.00	11,150,400	
リオン	2,100	1,384.00	2,906,400	
船井電機	8,700	1,059.00	9,213,300	
横河電機	85,700	1,398.00	119,808,600	
新電元工業	28,000	715.00	20,020,000	
アズビル	24,000	2,279.00	54,696,000	
日本光電工業	17,000	4,015.00	68,255,000	
チノー	15,000	221.00	3,315,000	
共和電業	10,000	362.00	3,620,000	
日本電子材料	3,800	362.00	1,375,600	
堀場製作所	15,800	3,675.00	58,065,000	
アドバンテスト	58,400	1,131.00	66,050,400	
小野測器	9,000	442.00	3,978,000	
エスペック	8,900	768.00	6,835,200	
パナソニック デバイス S U N X	7,500	426.00	3,195,000	
キーエンス	21,000	37,250.00	782,250,000	
日置電機	4,500	1,394.00	6,273,000	
シスメックス	30,300	6,260.00	189,678,000	
メガチップス	7,000	1,567.00	10,969,000	
O B A R A G R O U P	5,600	2,428.00	13,596,800	
日本電産コパル電子	8,900	510.00	4,539,000	
澤藤電機	6,000	246.00	1,476,000	



コーセル	12,400	1,191.00	14,768,400	
日立メディコ	6,000	1,320.00	7,920,000	
新日本無線	6,000	438.00	2,628,000	
オプテックス	5,400	1,481.00	7,997,400	
千代田インテグレ	3,800	1,364.00	5,183,200	
レーザーテック	6,300	978.00	6,161,400	
スタンレー電気	66,600	2,085.00	138,861,000	
岩崎電気	33,000	228.00	7,524,000	
ウシオ電機	52,000	1,215.00	63,180,000	
岡谷電機産業	4,600	341.00	1,568,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	7,300	277.00	2,022,100	
日本セラミック	4,900	1,415.00	6,933,500	
遠藤照明	2,100	2,207.00	4,634,700	
日本デジタル研究所	7,300	1,164.00	8,497,200	
古河電池	7,000	527.00	3,689,000	
双信電機	4,200	345.00	1,449,000	
図研	5,000	806.00	4,030,000	
日本電子	32,000	469.00	15,008,000	
カシオ計算機	81,600	908.00	74,092,800	
ファナック	89,100	16,210.00	1,444,311,000	
日本シイエムケイ	19,000	277.00	5,263,000	
エンプラス	3,800	6,220.00	23,636,000	
大真空	7,000	388.00	2,716,000	
ローム	45,200	4,030.00	182,156,000	
浜松ホトニクス	33,400	3,695.00	123,413,000	
三井ハイテック	12,400	712.00	8,828,800	
新光電気工業	28,700	1,028.00	29,503,600	
京セラ	142,300	5,210.00	741,383,000	
太陽誘電	41,600	1,277.00	53,123,200	
村田製作所	90,000	7,490.00	674,100,000	
ユーシン	12,600	732.00	9,223,200	
双葉電子工業	15,900	1,257.00	19,986,300	
北陸電気工業	34,000	143.00	4,862,000	
ニチコン	27,000	1,081.00	29,187,000	
日本ケミコン	50,000	486.00	24,300,000	
K O A	10,800	971.00	10,486,800	
市光工業	24,000	188.00	4,512,000	
小糸製作所	43,000	1,864.00	80,152,000	
ミツバ	16,000	1,756.00	28,096,000	

スター精密	15,000	962.00	14,430,000	
大日本スクリーン製造	88,000	538.00	47,344,000	
キャノン電子	7,900	1,810.00	14,299,000	
キャノン	496,200	3,130.00	1,553,106,000	
リコー	257,000	1,131.00	290,667,000	
MUTOHホールディングス	12,000	492.00	5,904,000	
東京エレクトロン	72,000	5,260.00	378,720,000	
トヨタ紡織	29,900	1,313.00	39,258,700	
鬼怒川ゴム工業	16,000	598.00	9,568,000	
ユニプレス	15,100	2,079.00	31,392,900	
豊田自動織機	77,900	4,230.00	329,517,000	
モリタホールディングス	15,000	757.00	11,355,000	
三櫻工業	10,800	722.00	7,797,600	
デンソー	211,400	4,580.00	968,212,000	
東海理化電機製作所	20,000	2,076.00	41,520,000	
三井造船	331,000	201.00	66,531,000	
佐世保重工業	56,000	101.00	5,656,000	
川崎重工業	666,000	425.00	283,050,000	
名村造船所	7,400	1,300.00	9,620,000	
サノヤスホールディングス	4,600	204.00	938,400	
日本車輛製造	31,000	581.00	18,011,000	
ニチュ三菱フォークリフト	11,000	501.00	5,511,000	
近畿車輛	15,000	330.00	4,950,000	
日産自動車	1,081,100	984.00	1,063,802,400	
いすゞ自動車	496,000	646.00	320,416,000	
トヨタ自動車	1,099,400	6,270.00	6,893,238,000	
日野自動車	107,000	1,444.00	154,508,000	
三菱自動車工業	217,800	1,084.00	236,095,200	
エフテック	3,000	1,653.00	4,959,000	
GMB	600	1,193.00	715,800	
武蔵精密工業	9,100	2,506.00	22,804,600	
日産車体	29,000	1,709.00	49,561,000	
新明和工業	35,000	764.00	26,740,000	
極東開発工業	15,900	1,263.00	20,081,700	
日信工業	17,400	1,862.00	32,398,800	
トピー工業	64,000	217.00	13,888,000	
ティラド	29,000	320.00	9,280,000	
曙ブレーキ工業	39,700	453.00	17,984,100	
タチエス	11,500	1,487.00	17,100,500	

N O K	41,400	1,528.00	63,259,200	
フタバ産業	26,100	406.00	10,596,600	
カヤバ工業	65,000	634.00	41,210,000	
シロキ工業	19,000	222.00	4,218,000	
大同メタル工業	12,000	1,010.00	12,120,000	
プレス工業	36,000	433.00	15,588,000	
カルソニックカンセイ	58,000	525.00	30,450,000	
太平洋工業	17,400	727.00	12,649,800	
ケーヒン	17,700	1,577.00	27,912,900	
河西工業	10,000	601.00	6,010,000	
アイシン精機	78,300	4,185.00	327,685,500	
富士機工	10,000	306.00	3,060,000	
マツダ	1,355,000	437.00	592,135,000	
ダイハツ工業	91,000	1,900.00	172,900,000	
今仙電機製作所	6,300	1,412.00	8,895,600	
本田技研工業	722,000	3,735.00	2,696,670,000	
スズキ	178,900	2,352.00	420,772,800	
富士重工業	270,000	2,710.00	731,700,000	
ヤマハ発動機	130,100	1,434.00	186,563,400	
ショーワ	20,200	1,318.00	26,623,600	
T B K	9,000	549.00	4,941,000	
エクセディ	11,600	2,411.00	27,967,600	
豊田合成	24,200	2,416.00	58,467,200	
愛三工業	8,900	972.00	8,650,800	
ヨロズ	6,300	1,949.00	12,278,700	
エフ・シー・シー	14,000	2,262.00	31,668,000	
シマノ	37,000	8,770.00	324,490,000	
タカタ	15,500	2,470.00	38,285,000	
テイ・エス テック	18,100	3,860.00	69,866,000	
日本電産トーソク	4,100	997.00	4,087,700	
テルモ	65,600	5,030.00	329,968,000	
クリエートメディック	2,900	916.00	2,656,400	
日機装	30,000	1,033.00	30,990,000	
島津製作所	102,000	930.00	94,860,000	
J M S	14,000	321.00	4,494,000	
ショットモリテックス	1,900	284.00	539,600	
長野計器	6,100	727.00	4,434,700	
ブイ・テクノロジー	18	279,600.00	5,032,800	
東京計器	27,000	291.00	7,857,000	

愛知時計電機	10,000	289.00	2,890,000	
東京精密	15,400	1,798.00	27,689,200	
マニー	2,600	3,385.00	8,801,000	
ニコン	159,800	1,713.00	273,737,400	
トプコン	19,700	1,524.00	30,022,800	
オリンパス	113,200	2,983.00	337,675,600	
理研計器	7,000	783.00	5,481,000	
タムロン	6,600	2,166.00	14,295,600	
H O Y A	208,100	2,319.00	482,583,900	
ノーリツ鋼機	7,700	656.00	5,051,200	
エー・アンド・デイ	7,800	586.00	4,570,800	
日本電産コバル	6,800	981.00	6,670,800	
シチズンホールディングス	96,600	688.00	66,460,800	
リズム時計工業	39,000	147.00	5,733,000	
大研医器	2,100	1,842.00	3,868,200	
松風	4,200	885.00	3,717,000	
セイコーホールディングス	55,000	418.00	22,990,000	
ニプロ	45,600	946.00	43,137,600	
パラマウントベッドホールディングス	7,400	3,075.00	22,755,000	
S H O - B I	2,600	422.00	1,097,200	
前田工織	6,800	1,283.00	8,724,400	
永大産業	12,000	507.00	6,084,000	
ダンロップスポーツ	4,700	1,243.00	5,842,100	
バンダイナムコホールディングス	88,500	1,835.00	162,397,500	
共立印刷	14,000	256.00	3,584,000	
フランスベッドホールディングス	54,000	205.00	11,070,000	
パイロットコーポレーション	7,500	3,705.00	27,787,500	
トッパン・フォームズ	15,300	958.00	14,657,400	
フジシールインターナショナル	10,400	2,971.00	30,898,400	
タカラトミー	28,900	453.00	13,091,700	
廣濟堂	7,300	539.00	3,934,700	
タカノ	3,900	468.00	1,825,200	
プロネクス	10,200	604.00	6,160,800	
ホクシン	8,700	185.00	1,609,500	
ウッドワン	16,000	284.00	4,544,000	
大建工業	35,000	280.00	9,800,000	
凸版印刷	242,000	791.00	191,422,000	
大日本印刷	261,000	1,038.00	270,918,000	
図書印刷	17,000	267.00	4,539,000	

共同印刷	28,000	286.00	8,008,000	
日本写真印刷	13,400	1,645.00	22,043,000	
光村印刷	8,000	266.00	2,128,000	
宝印刷	5,200	697.00	3,624,400	
アシックス	79,700	1,692.00	134,852,400	
ツツミ	4,300	2,572.00	11,059,600	
ローランド	7,900	1,025.00	8,097,500	
小松ウオール工業	3,400	1,895.00	6,443,000	
ヤマハ	62,900	1,400.00	88,060,000	
河合楽器製作所	32,000	194.00	6,208,000	
クリナップ	8,800	862.00	7,585,600	
ビジョン	12,900	4,820.00	62,178,000	
兼松日産農林	13,000	169.00	2,197,000	
キングジム	7,200	702.00	5,054,400	
リンテック	18,300	2,088.00	38,210,400	
イトーキ	18,900	512.00	9,676,800	
任天堂	48,900	11,130.00	544,257,000	
三菱鉛筆	7,100	2,350.00	16,685,000	
タカラスタンダード	39,000	791.00	30,849,000	
コクヨ	44,500	764.00	33,998,000	
ナカバヤシ	18,000	216.00	3,888,000	
グロープライド	41,000	144.00	5,904,000	
岡村製作所	33,000	675.00	22,275,000	
美津濃	42,000	588.00	24,696,000	
アデランス	10,700	1,416.00	15,151,200	
東京電力	725,900	611.00	443,524,900	
中部電力	261,800	1,346.00	352,382,800	
関西電力	349,200	1,260.00	439,992,000	
中国電力	118,300	1,560.00	184,548,000	
北陸電力	83,800	1,434.00	120,169,200	
東北電力	213,800	1,206.00	257,842,800	
四国電力	77,100	1,667.00	128,525,700	
九州電力	189,000	1,401.00	264,789,000	
北海道電力	80,100	1,323.00	105,972,300	
沖縄電力	5,100	3,390.00	17,289,000	
電源開発	53,100	3,200.00	169,920,000	
東京瓦斯	1,003,000	538.00	539,614,000	
大阪瓦斯	830,000	418.00	346,940,000	
東邦瓦斯	218,000	514.00	112,052,000	

北海道瓦斯	15,000	262.00	3,930,000	
西部瓦斯	96,000	239.00	22,944,000	
静岡瓦斯	22,300	668.00	14,896,400	
東武鉄道	486,000	518.00	251,748,000	
相鉄ホールディングス	137,000	377.00	51,649,000	
東京急行電鉄	504,000	700.00	352,800,000	
京浜急行電鉄	220,000	928.00	204,160,000	
小田急電鉄	274,000	975.00	267,150,000	
京王電鉄	239,000	704.00	168,256,000	
京成電鉄	128,000	1,022.00	130,816,000	
富士急行	23,000	822.00	18,906,000	
新京成電鉄	11,000	390.00	4,290,000	
東日本旅客鉄道	157,400	8,440.00	1,328,456,000	
西日本旅客鉄道	73,800	4,205.00	310,329,000	
東海旅客鉄道	71,200	12,580.00	895,696,000	
鴻池運輸	3,400	1,629.00	5,538,600	
西日本鉄道	111,000	383.00	42,513,000	
ハマキョウレックス	2,400	2,823.00	6,775,200	
サカイ引越センター	1,600	2,872.00	4,595,200	
近畿日本鉄道	850,000	366.00	311,100,000	
阪急阪神ホールディングス	541,000	545.00	294,845,000	
南海電気鉄道	178,000	371.00	66,038,000	
京阪電気鉄道	192,000	400.00	76,800,000	
神戸電鉄	14,000	383.00	5,362,000	
名糖運輸	3,500	644.00	2,254,000	
名古屋鉄道	299,000	288.00	86,112,000	
山陽電気鉄道	18,000	428.00	7,704,000	
日本通運	339,000	492.00	166,788,000	
ヤマトホールディングス	159,400	2,212.00	352,592,800	
山九	104,000	324.00	33,696,000	
丸運	4,600	254.00	1,168,400	
丸全昭和運輸	29,000	339.00	9,831,000	
センコー	34,000	494.00	16,796,000	
トナミホールディングス	18,000	211.00	3,798,000	
日本梱包運輸倉庫	26,100	1,718.00	44,839,800	
日本石油輸送	10,000	220.00	2,200,000	
福山通運	52,000	639.00	33,228,000	
セイノーホールディングス	66,000	1,000.00	66,000,000	
神奈川中央交通	10,000	530.00	5,300,000	

日立物流	14,900	1,366.00	20,353,400	
日本郵船	679,000	310.00	210,490,000	
商船三井	418,000	443.00	185,174,000	
川崎汽船	382,000	230.00	87,860,000	
N S ユナイテッド海運	37,000	261.00	9,657,000	
乾汽船	10,900	394.00	4,294,600	
飯野海運	40,500	635.00	25,717,500	
共栄タンカー	17,000	251.00	4,267,000	
日本航空	96,400	5,940.00	572,616,000	
A N A ホールディングス	1,682,000	214.00	359,948,000	
パスコ	8,000	409.00	3,272,000	
トランコム	2,300	2,933.00	6,745,900	
日新	32,000	281.00	8,992,000	
三菱倉庫	61,000	1,481.00	90,341,000	
三井倉庫	40,000	547.00	21,880,000	
住友倉庫	57,000	610.00	34,770,000	
澁澤倉庫	22,000	460.00	10,120,000	
東陽倉庫	14,000	272.00	3,808,000	
日本トランスシティ	20,000	345.00	6,900,000	
ケイヒン	16,000	187.00	2,992,000	
中央倉庫	3,100	1,004.00	3,112,400	
安田倉庫	6,700	1,192.00	7,986,400	
東洋埠頭	25,000	295.00	7,375,000	
宇徳	6,900	325.00	2,242,500	
上組	95,000	834.00	79,230,000	
サンリツ	2,200	531.00	1,168,200	
キムラユニティー	1,900	995.00	1,890,500	
キューソー流通システム	2,700	1,020.00	2,754,000	
郵船ロジスティクス	6,700	1,077.00	7,215,900	
近鉄エクスプレス	7,700	3,525.00	27,142,500	
東海運	4,600	280.00	1,288,000	
エーアイティー	1,400	1,436.00	2,010,400	
N E C ネットエスアイ	7,900	2,375.00	18,762,500	
システナ	9,000	755.00	6,795,000	
デジタルアーツ	3,100	996.00	3,087,600	
新日鉄住金ソリューションズ	5,600	1,932.00	10,819,200	
コア	3,200	777.00	2,486,400	
ソフトクリエイトホールディングス	2,800	753.00	2,108,400	
デジタルハーツ	1,600	2,013.00	3,220,800	

ITホールディングス	28,000	1,239.00	34,692,000	
ネオス	1,700	1,400.00	2,380,000	
電算システム	1,900	1,148.00	2,181,200	
グリー	43,900	765.00	33,583,500	
コーエーテクモホールディングス	16,700	1,059.00	17,685,300	
三菱総合研究所	3,300	2,136.00	7,048,800	
ボルテージ	1,200	887.00	1,064,400	
電算	500	1,898.00	949,000	
ヒト・コミュニケーションズ	900	1,438.00	1,294,200	
ブレインパッド	700	1,317.00	921,900	
K L a b	5,700	868.00	4,947,600	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	2,794.00	5,029,200	
ネクソン	70,000	1,196.00	83,720,000	
アイスタイル	2,400	553.00	1,327,200	
エイチーム	800	2,676.00	2,140,800	
ブロードリーフ	8,300	2,133.00	17,703,900	
ダウンゴ	7,600	1,887.00	14,341,200	
ベリサーブ	500	1,870.00	935,000	
マクロミル	13,500	593.00	8,005,500	
ティーガイア	10,500	1,014.00	10,647,000	
テクマトリックス	2,500	587.00	1,467,500	
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	2,672.00	8,550,400	
ザッパラス	47	71,100.00	3,341,700	
インターネットイニシアティブ	11,000	2,827.00	31,097,000	
ビットアイル	6,400	838.00	5,363,200	
S R Aホールディングス	4,100	1,116.00	4,575,600	
朝日ネット	7,000	437.00	3,059,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,000	2,400.00	4,800,000	
フェイス	2,910	1,198.00	3,486,180	
野村総合研究所	47,800	3,410.00	162,998,000	
サイバネットシステム	7,000	350.00	2,450,000	
インテージ	5,000	1,251.00	6,255,000	
ソースネクスト	4,200	898.00	3,771,600	
クレスコ	1,900	767.00	1,457,300	
フジ・メディア・ホールディングス	81,700	2,158.00	176,308,600	
オービック	29,100	3,165.00	92,101,500	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	1,700	790.00	1,343,000	
ヤフー	611,400	557.00	340,549,800	
トレンドマイクロ	37,300	3,655.00	136,331,500	



日本オラクル	16,900	3,660.00	61,854,000	
アルファシステムズ	2,800	1,224.00	3,427,200	
フューチャーアーキテクト	10,200	591.00	6,028,200	
シーエーシー	5,200	872.00	4,534,400	
ソフトバンク・テクノロジー	2,000	1,607.00	3,214,000	
トーセ	2,100	712.00	1,495,200	
オービックビジネスコンサルタント	5,400	3,565.00	19,251,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	10,000	3,490.00	34,900,000	
アイティフォー	9,400	400.00	3,760,000	
東計電算	1,500	1,400.00	2,100,000	
エクスネット	800	1,370.00	1,096,000	
大塚商会	7,600	12,520.00	95,152,000	
サイボウズ	127	29,420.00	3,736,340	
ソフトブレイン	11,700	135.00	1,579,500	
アグレックス	2,300	852.00	1,959,600	
電通国際情報サービス	5,200	1,061.00	5,517,200	
E Mシステムズ	1,300	2,011.00	2,614,300	
ウェザーニューズ	2,200	2,296.00	5,051,200	
C I J	7,900	398.00	3,144,200	
WOWOW	2,600	3,445.00	8,957,000	
ネットワンシステムズ	30,800	743.00	22,884,400	
アルゴグラフィックス	3,100	1,736.00	5,381,600	
マーベラスAQL	12,900	536.00	6,914,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	15,600	2,860.00	44,616,000	
日本ユニシス	23,300	845.00	19,688,500	
兼松エレクトロニクス	5,300	1,277.00	6,768,100	
東京放送ホールディングス	45,600	1,333.00	60,784,800	
日本テレビホールディングス	77,100	1,819.00	140,244,900	
テレビ朝日	21,400	2,280.00	48,792,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	73,300	511.00	37,456,300	
テレビ東京ホールディングス	6,100	1,728.00	10,540,800	
アイ・ティー・シーネットワーク	7,500	934.00	7,005,000	
日本電信電話	355,600	5,080.00	1,806,448,000	
K D D I	238,300	5,040.00	1,201,032,000	
光通信	7,900	6,170.00	48,743,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	695,900	1,592.00	1,107,872,800	
G M Oインターネット	28,200	1,276.00	35,983,200	
学研ホールディングス	28,000	303.00	8,484,000	
ゼンリン	11,200	1,102.00	12,342,400	

昭文社	5,100	607.00	3,095,700	
KADOKAWA	7,300	3,465.00	25,294,500	
インプレスホールディングス	7,100	130.00	923,000	
アイネット	3,700	712.00	2,634,400	
松竹	56,000	962.00	53,872,000	
東宝	60,300	2,046.00	123,373,800	
東映	35,000	593.00	20,755,000	
AOI Pro.	3,900	636.00	2,480,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	52,200	3,305.00	172,521,000	
DTS	8,100	1,554.00	12,587,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,700	1,555.00	47,738,500	
シーイーシー	5,500	617.00	3,393,500	
カブコン	16,200	1,888.00	30,585,600	
ジャステック	5,400	769.00	4,152,600	
SCSK	20,100	2,360.00	47,436,000	
日本システムウエア	3,200	414.00	1,324,800	
アイネス	11,500	605.00	6,957,500	
TKC	7,100	1,695.00	12,034,500	
富士ソフト	11,700	1,857.00	21,726,900	
NSD	16,700	1,103.00	18,420,100	
コナミ	38,100	2,266.00	86,334,600	
福井コンピュータホールディングス	1,200	753.00	903,600	
JBCCHホールディングス	7,100	976.00	6,929,600	
ミロク情報サービス	5,500	455.00	2,502,500	
ソフトバンク	409,100	6,790.00	2,777,789,000	
ハウスイ	7,000	136.00	952,000	
高千穂交易	3,600	950.00	3,420,000	
伊藤忠食品	2,100	3,280.00	6,888,000	
エレマテック	4,000	1,348.00	5,392,000	
JALUX	2,400	1,167.00	2,800,800	
あらた	19,000	360.00	6,840,000	
トーメンデバイス	1,300	1,642.00	2,134,600	
東京エレクトロン デバイス	1,700	1,593.00	2,708,100	
双日	532,100	192.00	102,163,200	
アルフレッサ ホールディングス	21,900	5,060.00	110,814,000	
横浜冷凍	21,000	809.00	16,989,000	
山下医科器械	700	1,675.00	1,172,500	
ラサ商事	3,700	448.00	1,657,600	
アルコニックス	2,400	2,071.00	4,970,400	

神戸物産	600	2,390.00	1,434,000	
あい ホールディングス	15,100	1,169.00	17,651,900	
ダイワボウホールディングス	77,000	181.00	13,937,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,900	745.00	11,845,500	
八洲電機	6,200	418.00	2,591,600	
U K C ホールディングス	5,000	1,841.00	9,205,000	
T O K A I ホールディングス	33,100	349.00	11,551,900	
ミタチ産業	2,100	429.00	900,900	
シップヘルスケアホールディングス	12,100	3,825.00	46,282,500	
富士興産	3,100	592.00	1,835,200	
協栄産業	10,000	195.00	1,950,000	
小野建	7,400	1,209.00	8,946,600	
佐鳥電機	6,300	555.00	3,496,500	
エコートレーディング	2,100	791.00	1,661,100	
伯東	5,200	947.00	4,924,400	
コンドーテック	6,900	713.00	4,919,700	
中山福	4,900	758.00	3,714,200	
ナガイレーベン	11,200	1,593.00	17,841,600	
三菱食品	9,300	2,690.00	25,017,000	
松田産業	6,200	1,403.00	8,698,600	
メディパルホールディングス	84,500	1,211.00	102,329,500	
アドヴァン	4,300	1,198.00	5,151,400	
S P K	2,000	1,813.00	3,626,000	
アズワン	5,500	2,025.00	11,137,500	
スズデン	2,800	532.00	1,489,600	
尾家産業	2,800	817.00	2,287,600	
シモジマ	5,200	1,010.00	5,252,000	
ドウシシャ	9,000	1,404.00	12,636,000	
高速	5,100	947.00	4,829,700	
黒田電気	11,300	1,310.00	14,803,000	
丸文	7,600	437.00	3,321,200	
ハピネット	5,200	754.00	3,920,800	
トーメンエレクトロニクス	4,300	1,087.00	4,674,100	
エクセル	3,700	1,141.00	4,221,700	
マルカキカイ	2,800	1,514.00	4,239,200	
ガリバーインターナショナル	28,500	587.00	16,729,500	
日本エム・ディ・エム	7,900	266.00	2,101,400	
進和	5,000	1,107.00	5,535,000	
エスケイジャパン	2,200	284.00	624,800	

ダイトエレクトロン	4,000	397.00	1,588,000	
シークス	5,400	1,291.00	6,971,400	
田中商事	2,900	582.00	1,687,800	
オーハシテクニカ	4,600	820.00	3,772,000	
マクニカ	4,300	2,609.00	11,218,700	
白銅	2,800	795.00	2,226,000	
伊藤忠商事	673,800	1,202.00	809,907,600	
丸紅	693,000	772.00	534,996,000	
高島	16,000	284.00	4,544,000	
ヨンドシーホールディングス	6,500	1,360.00	8,840,000	
長瀬産業	47,800	1,247.00	59,606,600	
蝶理	5,400	1,115.00	6,021,000	
豊田通商	94,100	2,564.00	241,272,400	
三共生興	14,500	342.00	4,959,000	
兼松	180,000	133.00	23,940,000	
ツカモトコーポレーション	14,000	190.00	2,660,000	
三井物産	729,000	1,426.00	1,039,554,000	
日本紙パルプ商事	44,000	325.00	14,300,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,600	2,200.00	56,320,000	
カメイ	10,100	746.00	7,534,600	
東都水産	15,000	228.00	3,420,000	
OUGホールディングス	7,000	188.00	1,316,000	
スターゼン	28,000	276.00	7,728,000	
山善	32,500	637.00	20,702,500	
椿本興業	10,000	271.00	2,710,000	
住友商事	498,500	1,322.00	659,017,000	
内田洋行	20,000	278.00	5,560,000	
三菱商事	659,000	1,986.00	1,308,774,000	
第一実業	19,000	431.00	8,189,000	
キャノンマーケティングジャパン	24,100	1,304.00	31,426,400	
西華産業	29,000	242.00	7,018,000	
佐藤商事	7,600	588.00	4,468,800	
菱洋エレクトロ	10,000	885.00	8,850,000	
東京産業	8,500	328.00	2,788,000	
ユアサ商事	86,000	198.00	17,028,000	
神鋼商事	21,000	211.00	4,431,000	
小林産業	3,500	314.00	1,099,000	
阪和興業	84,000	464.00	38,976,000	
カナデン	8,000	648.00	5,184,000	

菱電商事	12,000	680.00	8,160,000	
フルサト工業	4,300	999.00	4,295,700	
岩谷産業	94,000	396.00	37,224,000	
すてきナイスグループ	33,000	255.00	8,415,000	
昭光通商	27,000	153.00	4,131,000	
ニチモウ	12,000	191.00	2,292,000	
極東貿易	10,000	204.00	2,040,000	
イワキ	13,000	206.00	2,678,000	
三愛石油	20,000	425.00	8,500,000	
稲畑産業	20,800	945.00	19,656,000	
G S Iクレオス	23,000	151.00	3,473,000	
明和産業	6,800	328.00	2,230,400	
ワキタ	7,000	1,296.00	9,072,000	
東邦ホールディングス	27,100	1,790.00	48,509,000	
サンゲツ	15,000	2,593.00	38,895,000	
ミツウロコグループホールディングス	13,700	481.00	6,589,700	
シナネン	18,000	383.00	6,894,000	
伊藤忠エネクス	18,700	510.00	9,537,000	
サンリオ	21,300	6,030.00	128,439,000	
サンワテクノス	4,200	962.00	4,040,400	
リョーサン	13,800	1,793.00	24,743,400	
新光商事	9,300	840.00	7,812,000	
トーホー	18,000	353.00	6,354,000	
三信電気	12,100	610.00	7,381,000	
東陽テクニカ	11,600	1,238.00	14,360,800	
モスフードサービス	11,100	1,935.00	21,478,500	
加賀電子	8,400	839.00	7,047,600	
ソーダニッカ	9,000	411.00	3,699,000	
立花エレテック	5,200	1,054.00	5,480,800	
P a l t a c	10,000	1,354.00	13,540,000	
ヤマタネ	39,000	192.00	7,488,000	
丸紅建材リース	7,000	205.00	1,435,000	
日鐵商事	7,000	340.00	2,380,000	
トラスコ中山	9,700	2,008.00	19,477,600	
オートボックスセブン	29,700	1,504.00	44,668,800	
加藤産業	12,200	2,101.00	25,632,200	
イノテック	7,400	454.00	3,359,600	
イエローハット	8,000	1,839.00	14,712,000	
富士エレクトロニクス	4,400	1,293.00	5,689,200	

J Kホールディングス	7,100	606.00	4,302,600	
日伝	3,800	2,309.00	8,774,200	
北沢産業	6,500	179.00	1,163,500	
杉本商事	4,600	898.00	4,130,800	
因幡電機産業	11,300	2,946.00	33,289,800	
住金物産	44,000	349.00	15,356,000	
バイテック	2,000	713.00	1,426,000	
ミスミグループ本社	31,400	2,845.00	89,333,000	
江守商事	2,000	1,367.00	2,734,000	
アルテック	4,100	312.00	1,279,200	
タキヒヨー	13,000	418.00	5,434,000	
スズケン	32,500	3,230.00	104,975,000	
ジェコス	5,900	720.00	4,248,000	
ローソン	32,000	7,690.00	246,080,000	
サンエー	6,400	2,765.00	17,696,000	
キリン堂	3,000	653.00	1,959,000	
ダイユーエイト	1,700	633.00	1,076,100	
カワチ薬品	5,900	1,945.00	11,475,500	
エービーシー・マート	10,000	4,785.00	47,850,000	
ハードオフコーポレーション	4,100	761.00	3,120,100	
アスクル	7,200	2,277.00	16,394,400	
ゲオホールディングス	14,500	918.00	13,311,000	
アダストリアホールディングス	7,800	4,670.00	36,426,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	11,000	353.00	3,883,000	
くらコーポレーション	5,000	1,633.00	8,165,000	
キャンドウ	4,000	1,718.00	6,872,000	
パル	4,900	2,456.00	12,034,400	
エディオン	36,500	491.00	17,921,500	
サーラコーポレーション	7,300	523.00	3,817,900	
あみやき亭	1,500	2,942.00	4,413,000	
ひらまつ	8,700	666.00	5,794,200	
ゲンキー	700	2,065.00	1,445,500	
大黒天物産	1,700	2,846.00	4,838,200	
ハニーズ	6,680	1,071.00	7,154,280	
アルペン	6,500	2,038.00	13,247,000	
クオール	4,300	552.00	2,373,600	
ジェイアイエヌ	4,300	3,690.00	15,867,000	
ビックカメラ	321	46,450.00	14,910,450	
D C Mホールディングス	41,700	696.00	29,023,200	

MonotaRO	13,000	2,871.00	37,323,000	
J・フロントリテイリング	199,000	794.00	158,006,000	
ドトール・日レスホールディングス	14,800	1,722.00	25,485,600	
マツモトキヨシホールディングス	14,500	3,175.00	46,037,500	
ブロンコビリー	1,300	1,920.00	2,496,000	
スタートトゥデイ	23,400	2,765.00	64,701,000	
物語コーポレーション	1,200	4,465.00	5,358,000	
ココカラファイン	8,800	3,125.00	27,500,000	
三越伊勢丹ホールディングス	167,900	1,454.00	244,126,600	
ウエルシアホールディングス	3,000	5,190.00	15,570,000	
クリエイトSDホールディングス	3,600	3,590.00	12,924,000	
丸善CHIホールディングス	4,900	292.00	1,430,800	
ブックオフコーポレーション	4,700	672.00	3,158,400	
あさひ	4,900	1,662.00	8,143,800	
日本調剤	1,070	2,686.00	2,874,020	
コスモス薬品	4,300	12,910.00	55,513,000	
一六堂	1,100	505.00	555,500	
セブン&アイ・ホールディングス	353,300	3,580.00	1,264,814,000	
ツルハホールディングス	8,300	8,660.00	71,878,000	
サンマルクホールディングス	2,700	4,960.00	13,392,000	
フェリシモ	2,400	1,107.00	2,656,800	
トリドール	7,300	971.00	7,088,300	
クスリのアオキ	1,200	6,410.00	7,692,000	
メディカルシステムネットワーク	6,200	424.00	2,628,800	
総合メディカル	2,000	3,765.00	7,530,000	
はるやま商事	3,500	628.00	2,198,000	
カップ・クリエイトホールディングス	6,200	1,880.00	11,656,000	
ライトオン	6,300	930.00	5,859,000	
良品計画	9,000	8,870.00	79,830,000	
三城ホールディングス	10,400	481.00	5,002,400	
コナカ	10,800	928.00	10,022,400	
ハウスオブローゼ	900	1,324.00	1,191,600	
G-7ホールディングス	2,500	797.00	1,992,500	
イオン北海道	6,900	558.00	3,850,200	
コジマ	12,500	288.00	3,600,000	
ヒマラヤ	2,000	1,372.00	2,744,000	
コーナン商事	11,100	1,077.00	11,954,700	
エコス	2,900	601.00	1,742,900	
ワタミ	10,000	1,652.00	16,520,000	

マルシェ	2,100	834.00	1,751,400	
ドン・キホーテ	24,900	6,150.00	153,135,000	
西松屋チェーン	16,700	789.00	13,176,300	
ゼンショーホールディングス	32,200	1,139.00	36,675,800	
幸楽苑	5,200	1,216.00	6,323,200	
ハークスレイ	2,400	769.00	1,845,600	
サイゼリヤ	12,500	1,317.00	16,462,500	
ポプラ	3,400	567.00	1,927,800	
ユナイテッドアローズ	9,000	4,130.00	37,170,000	
ハイデイ日高	4,400	2,180.00	9,592,000	
京都きもの友禅	5,600	1,096.00	6,137,600	
コロワイド	28,000	1,006.00	28,168,000	
壱番屋	3,400	4,100.00	13,940,000	
トップカルチャー	3,100	496.00	1,537,600	
P L A N T	1,600	966.00	1,545,600	
スギホールディングス	13,500	4,210.00	56,835,000	
スクロール	11,000	282.00	3,102,000	
ファミリーマート	26,000	4,245.00	110,370,000	
木曽路	10,300	1,858.00	19,137,400	
サトレストランシステムズ	4,900	650.00	3,185,000	
千趣会	15,200	884.00	13,436,800	
タカキュー	6,500	332.00	2,158,000	
ケーヨー	14,300	469.00	6,706,700	
上新電機	18,000	843.00	15,174,000	
日本瓦斯	11,600	1,185.00	13,746,000	
ベスト電器	26,400	157.00	4,144,800	
マルエツ	18,000	320.00	5,760,000	
ロイヤルホールディングス	14,100	1,562.00	22,024,200	
東天紅	6,000	194.00	1,164,000	
いなげや	9,400	1,012.00	9,512,800	
島忠	19,100	2,434.00	46,489,400	
チヨダ	10,000	2,087.00	20,870,000	
ライフコーポレーション	5,400	1,300.00	7,020,000	
カスミ	17,400	618.00	10,753,200	
リンガーハット	7,600	1,408.00	10,700,800	
M r M a x	8,500	328.00	2,788,000	
テンアライド	6,400	324.00	2,073,600	
A O K Iホールディングス	7,300	3,455.00	25,221,500	
オークワ	13,000	908.00	11,804,000	



コメリ	13,000	2,410.00	31,330,000	
青山商事	23,300	2,676.00	62,350,800	
しまむら	9,800	9,770.00	95,746,000	
C F S コーポレーション	5,700	393.00	2,240,100	
はせがわ	2,600	717.00	1,864,200	
高島屋	114,000	919.00	104,766,000	
松屋	17,800	1,262.00	22,463,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	55,000	812.00	44,660,000	
近鉄百貨店	21,000	347.00	7,287,000	
ニッセンホールディングス	16,900	324.00	5,475,600	
パルコ	16,200	988.00	16,005,600	
丸井グループ	110,400	919.00	101,457,600	
原信ナルスホールディングス	4,700	1,751.00	8,229,700	
ダイエー	48,850	295.00	14,410,750	
イズミヤ	33,000	455.00	15,015,000	
イオン	308,700	1,351.00	417,053,700	
ユニーグループ・ホールディングス	81,600	633.00	51,652,800	
イズミ	21,200	2,860.00	60,632,000	
東武ストア	11,000	260.00	2,860,000	
平和堂	17,400	1,528.00	26,587,200	
フジ	9,400	1,760.00	16,544,000	
ヤオコー	4,300	3,565.00	15,329,500	
ゼビオ	11,500	2,214.00	25,461,000	
ケーズホールディングス	21,100	2,687.00	56,695,700	
O l y m p i c グループ	5,000	739.00	3,695,000	
日産東京販売ホールディングス	12,000	304.00	3,648,000	
アインファーマシーズ	5,100	4,165.00	21,241,500	
元気寿司	2,600	1,259.00	3,273,400	
ヤマダ電機	385,300	290.00	111,737,000	
アークランドサカモト	5,500	1,468.00	8,074,000	
ニトリホールディングス	16,750	9,000.00	150,750,000	
グルメ杵屋	6,000	694.00	4,164,000	
愛眼	6,700	279.00	1,869,300	
吉野家ホールディングス	22,900	1,150.00	26,335,000	
松屋フーズ	4,100	1,555.00	6,375,500	
サガミチェーン	10,000	885.00	8,850,000	
関西スーパーマーケット	3,800	867.00	3,294,600	
王将フードサービス	2,500	3,285.00	8,212,500	
プレナス	9,400	1,891.00	17,775,400	

ミニストップ	6,300	1,530.00	9,639,000	
アークス	14,400	1,822.00	26,236,800	
パロー	18,200	1,487.00	27,063,400	
藤久	700	1,647.00	1,152,900	
ベルク	4,200	1,786.00	7,501,200	
大庄	4,000	1,330.00	5,320,000	
ファーストリテイリング	19,700	36,850.00	725,945,000	
サンドラッグ	16,100	4,900.00	78,890,000	
東京デリカ	3,700	1,596.00	5,905,200	
ヤマザワ	2,200	1,509.00	3,319,800	
やまや	1,700	1,492.00	2,536,400	
ベルーナ	21,100	501.00	10,571,100	
島根銀行	1,900	1,290.00	2,451,000	
じもとホールディングス	60,600	211.00	12,786,600	
新生銀行	731,000	238.00	173,978,000	
あおぞら銀行	307,000	291.00	89,337,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,398,000	627.00	4,011,546,000	
りそなホールディングス	802,800	502.00	403,005,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,659,000	485.00	804,615,000	
三井住友フィナンシャルグループ	638,700	4,745.00	3,030,631,500	
第四銀行	108,000	354.00	38,232,000	
北越銀行	85,000	218.00	18,530,000	
西日本シティ銀行	296,000	267.00	79,032,000	
千葉銀行	326,000	716.00	233,416,000	
横浜銀行	522,000	561.00	292,842,000	
常陽銀行	315,000	527.00	166,005,000	
群馬銀行	189,000	574.00	108,486,000	
武蔵野銀行	13,500	3,585.00	48,397,500	
千葉興業銀行	16,200	784.00	12,700,800	
筑波銀行	35,100	355.00	12,460,500	
東京都民銀行	16,000	1,130.00	18,080,000	
七十七銀行	132,000	483.00	63,756,000	
青森銀行	62,000	261.00	16,182,000	
秋田銀行	58,000	265.00	15,370,000	
山形銀行	51,000	435.00	22,185,000	
岩手銀行	6,100	4,730.00	28,853,000	
東邦銀行	70,000	302.00	21,140,000	
東北銀行	43,000	147.00	6,321,000	
みちのく銀行	42,000	198.00	8,316,000	

ふくおかフィナンシャルグループ	343,000	443.00	151,949,000	
静岡銀行	247,000	1,116.00	275,652,000	
十六銀行	106,000	386.00	40,916,000	
スルガ銀行	82,000	1,687.00	138,334,000	
八十二銀行	156,000	610.00	95,160,000	
山梨中央銀行	50,000	408.00	20,400,000	
大垣共立銀行	113,000	283.00	31,979,000	
福井銀行	73,000	217.00	15,841,000	
北國銀行	95,000	373.00	35,435,000	
清水銀行	2,900	2,871.00	8,325,900	
滋賀銀行	79,000	557.00	44,003,000	
南都銀行	82,000	395.00	32,390,000	
百五銀行	76,000	404.00	30,704,000	
京都銀行	151,000	862.00	130,162,000	
三重銀行	35,000	203.00	7,105,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	575,000	206.00	118,450,000	
広島銀行	249,000	418.00	104,082,000	
山陰合同銀行	49,000	762.00	37,338,000	
中国銀行	63,000	1,380.00	86,940,000	
鳥取銀行	27,000	187.00	5,049,000	
伊予銀行	90,000	1,028.00	92,520,000	
百十四銀行	93,000	390.00	36,270,000	
四国銀行	61,000	226.00	13,786,000	
阿波銀行	69,000	531.00	36,639,000	
鹿児島銀行	59,000	670.00	39,530,000	
大分銀行	50,000	323.00	16,150,000	
宮崎銀行	56,000	301.00	16,856,000	
肥後銀行	69,000	575.00	39,675,000	
佐賀銀行	51,000	207.00	10,557,000	
十八銀行	53,000	232.00	12,296,000	
沖縄銀行	6,300	3,915.00	24,664,500	
琉球銀行	17,400	1,230.00	21,402,000	
八千代銀行	4,300	2,946.00	12,667,800	
セブン銀行	284,800	328.00	93,414,400	
みずほフィナンシャルグループ	10,930,800	213.00	2,328,260,400	
紀陽ホールディングス	340,000	136.00	46,240,000	
山口フィナンシャルグループ	84,000	964.00	80,976,000	
長野銀行	29,000	175.00	5,075,000	
名古屋銀行	76,000	376.00	28,576,000	

北洋銀行	127,200	413.00	52,533,600	
愛知銀行	3,100	4,695.00	14,554,500	
第三銀行	48,000	160.00	7,680,000	
中京銀行	35,000	177.00	6,195,000	
東日本銀行	37,000	233.00	8,621,000	
大光銀行	30,000	225.00	6,750,000	
愛媛銀行	50,000	240.00	12,000,000	
トマト銀行	33,000	178.00	5,874,000	
みなと銀行	76,000	167.00	12,692,000	
京葉銀行	70,000	516.00	36,120,000	
関西アーバン銀行	118,000	109.00	12,862,000	
栃木銀行	42,000	377.00	15,834,000	
北日本銀行	2,500	2,344.00	5,860,000	
東和銀行	97,000	91.00	8,827,000	
福島銀行	104,000	87.00	9,048,000	
大東銀行	54,000	96.00	5,184,000	
トモニホールディングス	64,800	386.00	25,012,800	
フィデアホールディングス	48,600	200.00	9,720,000	
池田泉州ホールディングス	69,700	506.00	35,268,200	
F P G	6,700	1,125.00	7,537,500	
S B Iホールディングス	108,400	1,266.00	137,234,400	
ジャフコ	11,800	4,700.00	55,460,000	
大和証券グループ本社	837,000	880.00	736,560,000	
野村ホールディングス	1,727,200	765.00	1,321,308,000	
岡三証券グループ	72,000	903.00	65,016,000	
丸三証券	27,100	821.00	22,249,100	
東洋証券	33,000	354.00	11,682,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	96,900	819.00	79,361,100	
水戸証券	27,000	528.00	14,256,000	
いちよし証券	19,200	1,442.00	27,686,400	
松井証券	50,100	1,082.00	54,208,200	
だいこう証券ビジネス	5,400	683.00	3,688,200	
マネックスグループ	92,100	412.00	37,945,200	
カブドットコム証券	34,000	540.00	18,360,000	
極東証券	11,500	1,738.00	19,987,000	
岩井コスモホールディングス	8,800	1,466.00	12,900,800	
マネーパートナーズグループ	9,400	292.00	2,744,800	
N K S Jホールディングス	187,600	2,521.00	472,939,600	

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	252,400	2,560.00	646,144,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	80,900	1,798.00	145,458,200	
第一生命保険	451,700	1,400.00	632,380,000	
東京海上ホールディングス	327,200	3,205.00	1,048,676,000	
T & Dホールディングス	289,700	1,214.00	351,695,800	
全国保証	9,500	4,325.00	41,087,500	
クレディセゾン	75,300	2,659.00	200,222,700	
芙蓉総合リース	8,300	3,685.00	30,585,500	
興銀リース	15,400	2,555.00	39,347,000	
東京センチュリーリース	20,400	3,080.00	62,832,000	
日本証券金融	42,700	736.00	31,427,200	
ポケットカード	12,100	839.00	10,151,900	
リコーリース	6,200	2,741.00	16,994,200	
イオンフィナンシャルサービス	32,800	3,085.00	101,188,000	
アコム	184,100	369.00	67,932,900	
ジャックス	55,000	492.00	27,060,000	
オリエントコーポレーション	210,000	270.00	56,700,000	
日立キャピタル	18,500	2,365.00	43,752,500	
アプラスフィナンシャル	44,800	169.00	7,571,200	
オリックス	507,600	1,595.00	809,622,000	
三菱UFJリース	221,500	519.00	114,958,500	
日本取引所グループ	109,200	2,173.00	237,291,600	
イー・ギャランティ	4,500	2,088.00	9,396,000	
アサックス	1,500	1,680.00	2,520,000	
NECキャピタルソリューション	5,300	2,379.00	12,608,700	
日本駐車場開発	921	7,830.00	7,211,430	
ヒューリック	142,400	1,468.00	209,043,200	
東京建物不動産販売	4,400	501.00	2,204,400	
三栄建築設計	2,600	841.00	2,186,600	
野村不動産ホールディングス	40,600	2,415.00	98,049,000	
常和ホールディングス	1,900	2,912.00	5,532,800	
フージャースホールディングス	11,300	855.00	9,661,500	
パーク24	44,100	1,745.00	76,954,500	
三井不動産	398,000	3,295.00	1,311,410,000	
三菱地所	591,000	2,896.00	1,711,536,000	
平和不動産	16,000	1,804.00	28,864,000	
東京建物	173,000	898.00	155,354,000	
ダイビル	21,800	1,146.00	24,982,800	

東急不動産	186,000	1,017.00	189,162,000	
京阪神ビルディング	12,800	553.00	7,078,400	
住友不動産	202,000	4,655.00	940,310,000	
大京	130,000	313.00	40,690,000	
テーオーシー	29,200	829.00	24,206,800	
東京楽天地	14,000	508.00	7,112,000	
レオパレス21	80,900	720.00	58,248,000	
フジ住宅	10,800	705.00	7,614,000	
空港施設	10,300	920.00	9,476,000	
明和地所	4,100	442.00	1,812,200	
住友不動産販売	6,060	3,230.00	19,573,800	
ゴールドクレスト	6,700	2,658.00	17,808,600	
東栄住宅	5,800	2,307.00	13,380,600	
日本エスリード	3,700	1,147.00	4,243,900	
東急リパブル	9,000	2,145.00	19,305,000	
飯田産業	9,500	1,998.00	18,981,000	
日神不動産	5,100	686.00	3,498,600	
アーネストワン	14,000	2,310.00	32,340,000	
タカラレーベン	35,200	336.00	11,827,200	
サンヨーハウジング名古屋	4,400	1,125.00	4,950,000	
イオンモール	47,900	2,914.00	139,580,600	
タクトホーム	43	217,000.00	9,331,000	
ファースト住建	1,400	1,549.00	2,168,600	
トーセイ	11,600	857.00	9,941,200	
穴吹興産	4,000	340.00	1,360,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	52,500	1,287.00	67,567,500	
サンフロンティア不動産	7,900	1,263.00	9,977,700	
ランドビジネス	5,700	490.00	2,793,000	
グランディハウス	5,700	357.00	2,034,900	
日本空港ビルデング	29,200	2,269.00	66,254,800	
日本工営	30,000	426.00	12,780,000	
ネクスト	4,200	2,302.00	9,668,400	
日本M&Aセンター	4,600	7,520.00	34,592,000	
ノバレーゼ	2,400	685.00	1,644,000	
アコーディア・ゴルフ	39,300	1,211.00	47,592,300	
タケエイ	3,900	1,618.00	6,310,200	
パソナグループ	89	86,800.00	7,725,200	
リンクアンドモチベーション	59	31,550.00	1,861,450	
GCAサヴィアン	5,400	985.00	5,319,000	

エス・エム・エス	5,000	1,613.00	8,065,000	
テンプホールディングス	13,500	2,478.00	33,453,000	
リニカル	2,600	1,365.00	3,549,000	
クックパッド	5,300	3,665.00	19,424,500	
エスクリ	3,100	919.00	2,848,900	
アイ・ケイ・ケイ	2,100	815.00	1,711,500	
学情	3,000	733.00	2,199,000	
スタジオアリス	3,700	1,288.00	4,765,600	
シミックホールディングス	3,500	1,342.00	4,697,000	
NECフィールドディング	7,300	1,150.00	8,395,000	
総合警備保障	32,600	1,963.00	63,993,800	
カカクコム	48,200	2,289.00	110,329,800	
ルネサンス	4,100	769.00	3,152,900	
ツクイ	11,000	1,196.00	13,156,000	
総合臨床ホールディングス	3,100	676.00	2,095,600	
キャリアデザインセンター	26	114,200.00	2,969,200	
エムスリー	211	271,700.00	57,328,700	
ベストブライダル	5,400	733.00	3,958,200	
日本ERI	1,700	1,261.00	2,143,700	
アウトソーシング	3,700	1,133.00	4,192,100	
ディー・エヌ・エー	44,100	1,998.00	88,111,800	
博報堂DYホールディングス	124,000	730.00	90,520,000	
ぐるなび	6,300	1,781.00	11,220,300	
一休	56	163,100.00	9,133,600	
ジャパンベストレスキューシステム	67	77,700.00	5,205,900	
ジェイコムホールディングス	1,600	837.00	1,339,200	
PGMホールディングス	12,700	963.00	12,230,100	
バリューコマース	6,000	1,161.00	6,966,000	
J Pホールディングス	14,500	517.00	7,496,500	
イーピーエス	97	95,900.00	9,302,300	
アミューズ	2,800	2,007.00	5,619,600	
ドリームインキュベータ	31	159,000.00	4,929,000	
ケネディクス	106,300	520.00	55,276,000	
電通	83,700	3,730.00	312,201,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,850	2,328.00	8,962,800	
ぴあ	2,700	1,763.00	4,760,100	
イオンファンタジー	2,900	1,334.00	3,868,600	
ネクシィーズ	3,400	405.00	1,377,000	
みらかホールディングス	23,500	4,380.00	102,930,000	

アルプス技研	3,700	1,028.00	3,803,600	
サニックス	13,000	1,264.00	16,432,000	
ダイオーズ	1,700	707.00	1,201,900	
日本空調サービス	2,300	908.00	2,088,400	
オリエンタルランド	26,600	16,220.00	431,452,000	
ダスキン	24,200	1,966.00	47,577,200	
明光ネットワークジャパン	8,900	1,240.00	11,036,000	
ファルコSDホールディングス	4,600	1,368.00	6,292,800	
秀英予備校	3,500	344.00	1,204,000	
田谷	1,400	769.00	1,076,600	
ラウンドワン	28,900	567.00	16,386,300	
リゾートトラスト	15,200	3,520.00	53,504,000	
ビー・エム・エル	5,300	3,215.00	17,039,500	
ワタベウェディング	2,700	736.00	1,987,200	
もしもしホットライン	14,800	1,146.00	16,960,800	
東急コミュニティ	2,300	4,844.00	11,141,200	
リソー教育	10,100	770.00	7,777,000	
早稲田アカデミー	1,100	749.00	823,900	
ユー・エス・エス	99,900	1,421.00	141,957,900	
東京個別指導学院	4,600	215.00	989,000	
テー・オー・ダブリュー	3,000	580.00	1,740,000	
セントラルスポーツ	2,800	1,552.00	4,345,600	
フルキャストホールディングス	8,400	300.00	2,520,000	
リゾートソリューション	8,000	231.00	1,848,000	
リブセンス	2,200	5,150.00	11,330,000	
リロ・ホールディング	3,100	4,385.00	13,593,500	
エイチ・アイ・エス	7,300	5,740.00	41,902,000	
共立メンテナンス	4,400	4,025.00	17,710,000	
イチネンホールディングス	10,300	688.00	7,086,400	
建設技術研究所	5,400	823.00	4,444,200	
スペース	4,400	985.00	4,334,000	
燦ホールディングス	2,000	1,393.00	2,786,000	
スバル興業	7,000	360.00	2,520,000	
東京テアトル	34,000	170.00	5,780,000	
よみうりランド	19,000	910.00	17,290,000	
東京都競馬	69,000	475.00	32,775,000	
カナモト	11,000	2,672.00	29,392,000	
東京ドーム	67,000	767.00	51,389,000	
西尾レントオール	2,800	2,739.00	7,669,200	



トランス・コスモス	11,700	1,722.00	20,147,400	
乃村工藝社	19,000	972.00	18,468,000	
藤田観光	23,000	451.00	10,373,000	
日本管財	3,300	1,764.00	5,821,200	
トーカイ	4,000	2,637.00	10,548,000	
白洋舎	12,000	236.00	2,832,000	
セコム	93,000	6,140.00	571,020,000	
セントラル警備保障	4,000	939.00	3,756,000	
丹青社	9,000	671.00	6,039,000	
メイテック	13,200	2,828.00	37,329,600	
アサツー ディ・ケイ	15,900	2,661.00	42,309,900	
応用地質	8,600	1,746.00	15,015,600	
船井総合研究所	9,200	772.00	7,102,400	
進学会	4,400	384.00	1,689,600	
ベネッセホールディングス	27,200	3,570.00	97,104,000	
イオンディライト	8,700	1,887.00	16,416,900	
ナック	4,000	1,604.00	6,416,000	
ニチイ学館	17,500	982.00	17,185,000	
ダイセキ	13,200	1,807.00	23,852,400	
ステップ	2,700	885.00	2,389,500	
合計	134,317,398	-	142,069,740,440	

#### B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等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。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

#### 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

- (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13期中間計算期間(平成25年10月1日から平成26年3月31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・オープン】 中間財務諸表  
(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第13期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		21,791,622
親投資信託受益証券		4,040,970,778
未収入金		7,466,299
未収利息		17
流動資産合計		4,070,228,716
資産合計		4,070,228,716
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		16,497,072
未払受託者報酬		1,034,611
未払委託者報酬		11,380,690
その他未払費用		103,402
流動負債合計		29,015,775
負債合計		29,015,775
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		3,076,828,269
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		964,384,672
(分配準備積立金)		616,414,456
元本等合計		4,041,212,941
純資産合計		4,041,212,941
負債純資産合計		4,070,228,716

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 (自 平成25年10月 1日 至 平成26年 3月31日)
<b>営業収益</b>	
受取利息	3,390
有価証券売買等損益	70,070,299
営業収益合計	70,073,689
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	1,034,611
委託者報酬	11,380,690
その他費用	103,402
営業費用合計	12,518,703
営業利益又は営業損失( )	57,554,986
経常利益又は経常損失( )	57,554,986
中間純利益又は中間純損失( )	57,554,986
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( )	14,007,417
期首剰余金又は期首欠損金( )	861,671,120
剰余金増加額又は欠損金減少額	200,001,982
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	200,001,982
剰余金減少額又は欠損金増加額	140,835,999
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	140,835,999
中間剰余金又は中間欠損金( )	964,384,672

## (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13期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)
1. 期首元本額	2,935,771,322円
期中追加設定元本額	616,736,050円
期中一部解約元本額	475,679,103円
2. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	3,076,828,269口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3134円 (13,134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

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## &lt; 参考 &gt;

「DC日本株式インデックス・オープン」は、「国内株式インデックス マザーファンド」の受益証券を主要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」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成26年3月31日現在(以下、「計算日」といいます。)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。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,283,346,327
株式	138,851,990,500
派生商品評価勘定	71,840,300
未収入金	17,174,000
未収配当金	1,343,627,254
未収利息	1,850
差入委託証拠金	125,475,000
流動資産合計	142,693,455,231
資産合計	142,693,455,231
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,425,000
前受金	31,362,000
未払金	726,470,430
未払解約金	226,685,489
流動負債合計	989,942,919
負債合計	989,942,919
純資産の部	
元本等	
元本	142,374,924,908
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	671,412,596
元本等合計	141,703,512,312
純資産合計	141,703,512,312
負債純資産合計	142,693,455,231

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 3月31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	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 原則として、株式の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の計上基準 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)

	平成26年 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	149,271,308,678円
中間計算期間中の追加設定元本額	15,766,906,582円
中間計算期間中の一部解約元本額	22,663,290,352円
計算日の元本額	142,374,924,908円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,942,613,461円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,738,394,963円
SBI資産設計オープン(分配型)	20,902,852円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,162,162,435円
世界経済インデックスファンド	289,040,727円
マイセレクション25	64,108,253円
マイセレクション50	102,247,911円
マイセレクション75	114,082,921円
日本株式インデックス・オープン	16,845,767,969円

DCマイセレクション25	5,017,556,915円
DCマイセレクション50	16,367,388,900円
DCマイセレクション75	15,220,349,582円
DC日本株式インデックス・オープン	4,060,053,028円
DCマイセレクションS25	1,785,961,287円
DCマイセレクションS50	5,604,384,601円
DCマイセレクションS75	3,678,608,008円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,822,107,647円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	12,502,448円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	444,298,151円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	457,098,594円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	219,521,967円
DC世界経済インデックスファンド	257,297,285円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	385,840,993円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	144,151,973円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	303,888,129円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	167,410,361円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	1,782,224,664円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24,393,202円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	890,092,629円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,221,049,503円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,216,559,941円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,592,570,374円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,891,121,251円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,756,657,218円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,552,950,570円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,858,681,426円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2,511,494,684円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,053,826,389円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,392,859,209円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,132,069,270円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,498,218,851円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	120,150,550円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,685,782,326円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,426,806,742円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,437,745円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,234,053円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,900,522円



2. 計算日における受益権総数	142,374,924,908口
3. 「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)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 671,412,596円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9953円 (9,953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

	平成26年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

平成26年 3月31日現在

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	2,784,694,700	-	2,851,110,000	66,415,300
	合計	2,784,694,700	-	2,851,110,000	66,415,300

(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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成26年4月30日現在）

資産総額	3,897,615,219 円
負債総額	5,463,843 円
純資産総額( - )	3,892,151,376 円
発行済口数	3,068,193,616 口
1口当たり純資産額( / )	1.2685 円
1万口当たり純資産額	12,685 円

(参考情報)

国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	137,412,645,222 円
負債総額	626,819,682 円
純資産総額( - )	136,785,825,540 円
発行済口数	142,213,828,456 口
1口当たり純資産額( / )	0.9618 円
1万口当たり純資産額	9,618 円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （イ）名義書換

該当事項はありません。

##### （ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### （ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

##### （二）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

###### 受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

###### 受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)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および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### 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または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

###### 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

###### 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また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指定販売会社の名義で記載また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。

###### 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたが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（平成26年4月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2) 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社取締役に3名以上、監査役に2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、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、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。

監査役の任期は、選任後4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。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、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、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、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、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発送します。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、取締役及び監査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委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

###### [ 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実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

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）からファンドマネー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せています。

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リスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）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。

さらに、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・評価します。この監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成26年6月30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。

平成26年4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	371	4,892,631
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	371	4,892,631

### 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。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「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、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		4,826,115		8,192,444
前払費用		30,184		81,751
未収委託者報酬		944,716		2,210,605
未収運用受託報酬		26,998		31,051
未収入金		75,514		676
一年以内返還予定保証金		187,128		-
繰延税金資産		69,857		61,743
その他		31,325		19,263
流動資産合計		6,191,840		10,597,535
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	3,525	1	79,281
器具備品	1	14,970	1	103,209
建設仮勘定		62,454		-
有形固定資産合計		80,949		182,491
無形固定資産				
ソフトウェア		60,130		168,561
ソフトウェア仮勘定		12,151		-
その他無形固定資産		928		1,770
無形固定資産合計		73,209		170,332
投資その他の資産				
投資有価証券		43,194		47,112
長期前払費用		357		-
長期貸付金		-		31,838
会員権		-		25,000
その他の投資		165		633
貸倒引当金		-		31,838
投資その他の資産合計		43,717		72,746
固定資産合計		197,876		425,570
資産合計		6,389,717		11,023,105



（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	-	350,000
資本剰余金合計	-	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	56,500	59,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	7,821,113	19,128,296
運用受託報酬	98,179	94,659
営業収益合計	7,919,292	19,222,955
営業費用		
支払手数料	3,715,816	9,030,246
広告宣伝費	61,165	73,287
公告費	2,451	2,244
調査費	1,023,870	4,132,154
調査費	86,225	207,030
委託調査費	936,024	3,922,394
図書費	1,620	2,729
営業雑経費	610,455	1,294,879
通信費	10,764	21,905
印刷費	121,287	330,735
協会費	10,136	21,939
諸会費	803	757
情報機器関連費	436,328	874,151
その他営業雑経費	31,135	45,391
営業費用合計	5,413,759	14,532,812
一般管理費		
給料	1,276,685	2,259,238
役員報酬	35,160	78,205
給料・手当	1,048,061	1,967,177
賞与	193,464	213,855
退職給付費用	66,790	64,787
福利費	152,149	190,716
交際費	1,012	879
旅費交通費	25,687	45,160
租税公課	16,148	25,420
不動産賃借料	238,033	129,096
寄付金	2,832	-
減価償却費	55,540	129,966
敷金償却	2,804	-
諸経費	81,858	1 257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213
営業利益	585,991	1,586,929

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
<b>株主資本</b>		
<b>資本金</b>		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
<b>その他資本剰余金</b>		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000
<b>利益剰余金</b>		
<b>利益準備金</b>		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
<b>その他利益剰余金</b>		
<b>別途積立金</b>		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
<b>繰越利益剰余金</b>		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
<b>利益剰余金合計</b>		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

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。）

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

#### (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。

### 3．引当金の計上基準

#### (1)貸倒引当金

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

#### (2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

#### (3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期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、当期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。

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。



## 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 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
	建 物	84,592	千円	23,594
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

## （損益計算書関係）

## 1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
	諸経費		千円	97,199

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24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）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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	-

(注) (1)普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2)普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23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（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24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

平成25年6月28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通り提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

（リ・ス取引関係）

該当事項はありません。

## （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、資金運用については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、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きわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

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

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、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、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

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、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）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。

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（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)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。

(4)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。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

(有価証券関係)

## 1. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,030	1,952	77
小計	2,030	1,952	77
合計	39,345	47,112	7,766

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

## 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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

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

## （持分法損益等）

該当事項はありません。



（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

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 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

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24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 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-

(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りません。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25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 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-

(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りません。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

## (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（自平成23年4月1日至平成24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	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25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	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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（平成24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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成25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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## （企業結合等関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

## 1．企業結合の概要

## (1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

## 結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## (2)企業結合日

平成24年4月1日

## (3)企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## (4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5)その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

## 2．実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

## （ 1株当たり情報）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末

(平成25年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	73,320
器具備品	1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070



（単位：千円）

第28期中間会計期間末 （平成25年9月30日）	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

## 中間損益計算書

（単位：千円）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
営業収益	
委託者報酬	11,222,467
運用受託報酬	36,913
営業収益合計	11,259,380
営業費用	8,307,878
一般管理費	1 1,553,438
営業利益	1,398,063
営業外収益	2 8,577
営業外費用	9,483
経常利益	1,397,157
税引前中間純利益	1,397,157
法人税、住民税及び事業税	577,514
法人税等調整額	55,190
法人税等合計	522,324
中間純利益	874,833

## 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
純資産合計	
当期首残高	8,546,410
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	841,585
当中間期末残高	9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間  
(自 平成25年4月1日  
至 平成25年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## 有価証券

## その他有価証券

## 時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税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。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 29,556千円
	器具備品 251,697千円
	計 281,253千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## （中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 23,080千円
	無形固定資産 33,012千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 4,063千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月28日

## （リ - ス取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

## （金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	-
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	58,285	58,285	-
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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。

## (3)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。

## (4)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。

## （有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	14,024	13,494	529
小計	14,024	13,494	529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（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）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

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

（関連情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,535,927千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (イ) 定款の変更

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。

##### (ロ) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年6月30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】

## (イ) 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（平成25年9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。

## (ロ) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年9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】

## (イ) 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。

## (ロ) 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】

## (イ) 受託会社

該当事項はありません。

## (ロ) 販売会社

該当事項はありません。

## (参考) 再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成25年9月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピー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。）を掲載し、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

平成25年11月29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 山田信之 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・オープンの平成24年10月2日から平成25年9月30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・オープンの平成25年9月30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

- 
1. 上記は、当社が、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. 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成26年5月30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 山田 信之 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・オープンの平成25年10月1日から平成26年3月31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・オープンの平成26年3月31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（平成25年10月1日から平成26年3月31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

1. 上記は、当社が、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. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年6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 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤浩之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

---

上記は、当社が、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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 白川 芳樹 印  
業務執行社員  
指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 浩之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

上記は、当社が、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。