

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年9月11日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C 日本株式インデックスファンドA
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンドA

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

平成30年 9月12日から平成31年 3月 8日までとします。

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

れます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

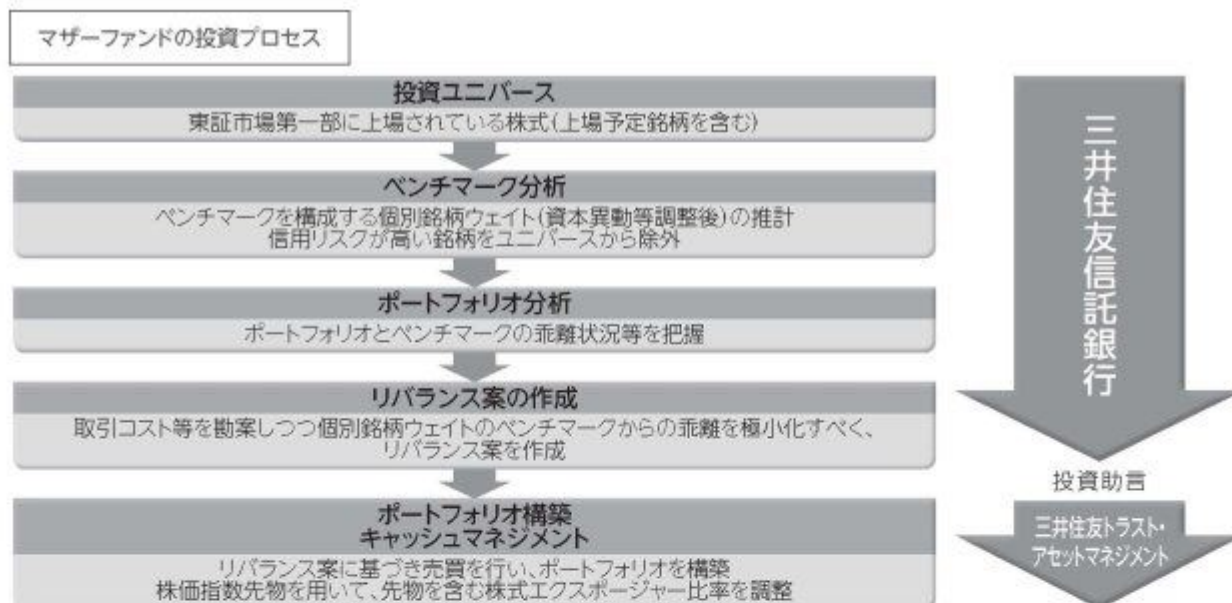
東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）^(注)とは

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

(注) TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

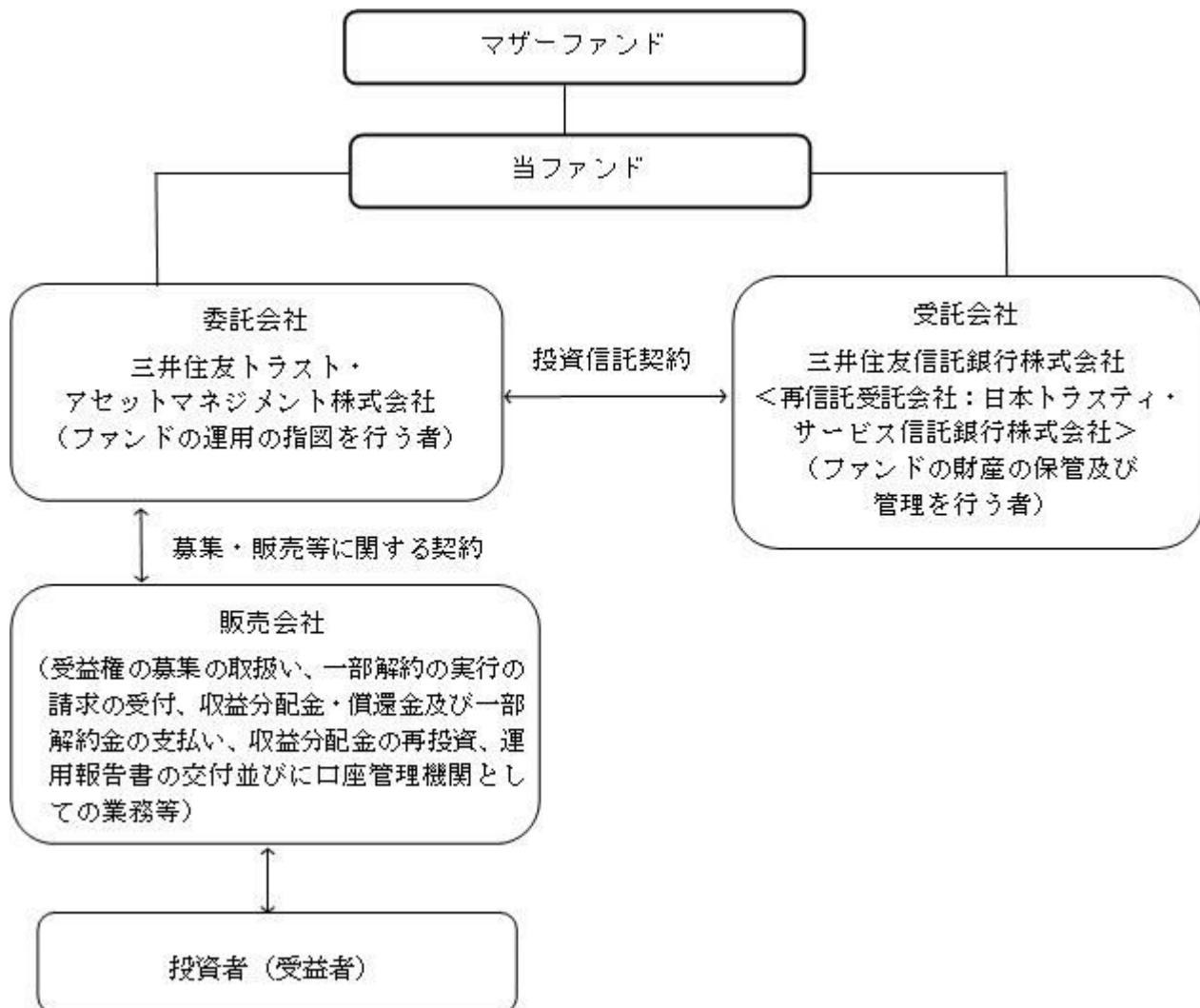
(2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月11日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
当ファンドの名称を中央三井DC日本株式インデックスファンドAからDC日本株式インデックスファンドAに変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成30年 6月29日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

- 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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

D．約束手形（上記A．に掲げるものに該当するものを除きます。）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

A．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

A．株券又は新株引受権証券

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

J．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

P．オプションを表示する証券又は証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

Q．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

T．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

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

「公社債」といい、上記M.の証券及び上記N.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

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

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

B. 金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

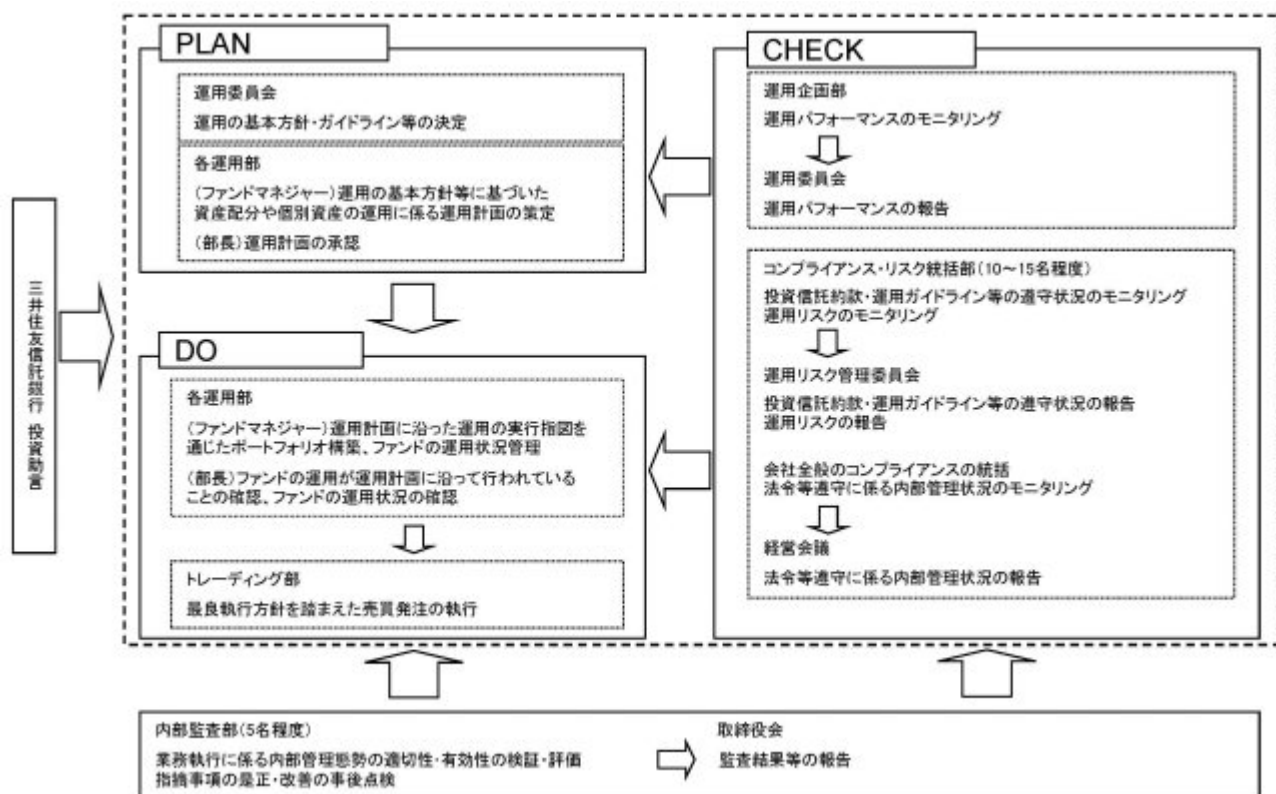
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

等に係る業務規則を定めています。

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

（４）【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

I．信用取引の運用指図

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有していない公社債又は、下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q．再投資の指図
- 委託会社は、上記P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

5．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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。

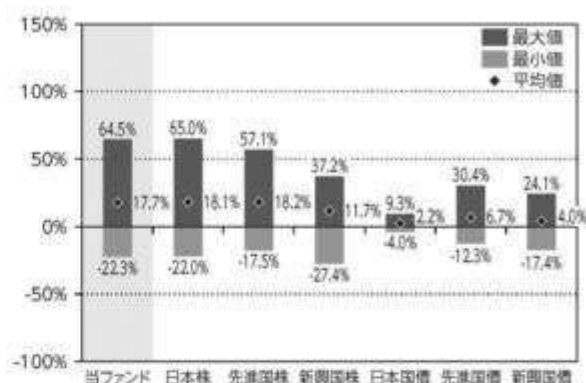
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2013年7月～2018年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{※3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レディバシファイド(円ベース)^{※6}

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

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

※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.4212%（税抜 0.39%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2376%（税抜 0.22%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.1296%（税抜 0.12%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054%（税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、平成30年 6月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2018年 6月29日現在の状況について記載してあります。

【D C日本株式インデックスファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,149,135,572	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,072,660	0.05
合計(純資産総額)		2,150,208,232	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,190,854,753	1.8627	2,218,242,513	1.8047	2,149,135,572	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期計算期間末 (2008年12月10日)	1,033,304,713	1,033,304,713	10,321	10,321
第7期計算期間末 (2009年12月10日)	1,204,086,539	1,204,086,539	10,971	10,971
第8期計算期間末 (2010年12月10日)	1,201,314,433	1,201,314,433	11,341	11,341
第9期計算期間末 (2011年12月12日)	1,089,966,022	1,089,966,022	9,711	9,711
第10期計算期間末 (2012年12月10日)	1,172,924,685	1,172,924,685	10,460	10,460
第11期計算期間末 (2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末 (2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末 (2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末 (2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末 (2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
2017年 6月末日	2,011,500,178		23,109	
7月末日	2,015,566,710		23,203	
8月末日	2,011,559,250		23,185	
9月末日	2,075,295,407		24,185	
10月末日	2,163,087,926		25,498	
11月末日	2,175,919,275		25,874	
12月末日	2,225,130,261		26,264	
2018年 1月末日	2,270,845,972		26,534	

2月末日	2,224,553,960		25,546	
3月末日	2,155,325,371		25,017	
4月末日	2,237,931,364		25,903	
5月末日	2,191,144,264		25,472	
6月末日	2,150,208,232		25,255	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2007年12月11日～2008年12月10日	0
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	0
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	0
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	0
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	0
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	0
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2007年12月11日～2008年12月10日	45.6
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	6.3
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	3.4
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	14.4
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	7.7
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期中間計算期間	2017年12月12日～2018年 6月11日	0.5

(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6期計算期間	2007年12月11日～2008年12月10日	295,481,661	204,831,194	1,001,134,546
第7期計算期間	2008年12月11日～2009年12月10日	217,735,038	121,325,019	1,097,544,565
第8期計算期間	2009年12月11日～2010年12月10日	219,646,942	257,914,603	1,059,276,904
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	222,832,492	159,705,810	1,122,403,586
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	232,065,601	233,152,933	1,121,316,254
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期中間計算期間	2017年12月12日～2018年 6月11日	84,767,312	74,079,318	854,654,896

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	230,340,442,860	98.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,280,933,824	1.40
合計(純資産総額)		233,621,376,684	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,236,035,000	1.39

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,132,800	7,670.34	8,688,961,850	7,170.00	8,122,176,000	3.48
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,433,900	875.70	5,634,172,006	631.10	4,060,434,290	1.74
日本	株式	ソニー	電気機器	623,800	5,569.68	3,474,372,260	5,664.00	3,533,203,200	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	656,200	5,237.65	3,436,947,524	5,036.00	3,304,623,200	1.41
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	414,000	9,254.90	3,831,530,706	7,973.00	3,300,822,000	1.41
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	695,600	5,247.95	3,650,474,917	4,306.00	2,995,253,600	1.28
日本	株式	キーエンス	電気機器	45,700	71,402.67	3,263,102,278	62,560.00	2,858,992,000	1.22
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	838,500	3,973.23	3,331,554,617	3,253.00	2,727,640,500	1.17
日本	株式	KDDI	情報・通信業	805,800	2,756.21	2,220,958,890	3,031.00	2,442,379,800	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,487,900	214.50	2,678,775,965	186.50	2,328,993,350	1.00
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	686,900	2,797.88	1,921,868,141	3,066.00	2,106,035,400	0.90
日本	株式	任天堂	その他製品	57,400	48,353.74	2,775,504,950	36,200.00	2,077,880,000	0.89
日本	株式	三菱商事	卸売業	644,000	3,166.80	2,039,420,002	3,078.00	1,982,232,000	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	88,500	31,853.91	2,819,071,833	22,005.00	1,947,442,500	0.83
日本	株式	花王	化学	229,100	7,696.92	1,763,365,679	8,450.00	1,935,895,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	83,400	20,820.46	1,736,426,571	22,960.00	1,914,864,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	112,200	17,809.63	1,998,241,284	16,625.00	1,865,325,000	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	384,700	4,576.37	1,760,531,440	4,831.00	1,858,485,700	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	656,600	2,718.83	1,785,186,044	2,822.50	1,853,253,500	0.79
日本	株式	キヤノン	電気機器	501,600	4,350.31	2,182,119,747	3,631.00	1,821,309,600	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	97,800	16,167.24	1,581,156,541	18,620.00	1,821,036,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	346,200	5,322.47	1,842,639,946	5,193.00	1,797,816,600	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	578,600	3,641.77	2,107,133,382	3,095.00	1,790,767,000	0.77
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	167,400	11,405.27	1,909,242,976	10,615.00	1,776,951,000	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,237,000	930.47	2,081,478,370	781.60	1,748,439,200	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	127,200	13,871.53	1,764,458,760	13,270.00	1,687,944,000	0.72
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	343,300	6,469.34	2,220,927,712	4,678.00	1,605,957,400	0.69
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,064,500	1,697.89	1,807,411,842	1,493.50	1,589,830,750	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	160,800	12,471.13	2,005,359,099	9,873.00	1,587,578,400	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	916,400	1,400.90	1,283,789,148	1,689.00	1,547,799,600	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.29

建設業	3.13	
食料品	4.43	
繊維製品	0.64	
パルプ・紙	0.27	
化学	7.31	
医薬品	4.68	
石油・石炭製品	0.75	
ゴム製品	0.81	
ガラス・土石製品	0.99	
鉄鋼	1.00	
非鉄金属	0.84	
金属製品	0.62	
機械	5.08	
電気機器	13.44	
輸送用機器	8.49	
精密機器	1.71	
その他製品	2.06	
電気・ガス業	1.74	
陸運業	4.32	
海運業	0.19	
空運業	0.57	
倉庫・運輸関連業	0.18	
情報・通信業	7.40	
卸売業	4.73	
小売業	4.97	
銀行業	6.56	
証券、商品先物取引業	0.91	
保険業	2.23	
その他金融業	1.20	
不動産業	2.40	
サービス業	4.56	
	小計	98.60
合計		98.60

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	187円		3,287,158,360	3,236,035,000	1.39

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2002年12月11日

作成基準日：2018年6月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額 25,255円

純資産総額 21.50億円

※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	2013年12月	2014年12月	2015年12月	2016年12月	2017年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

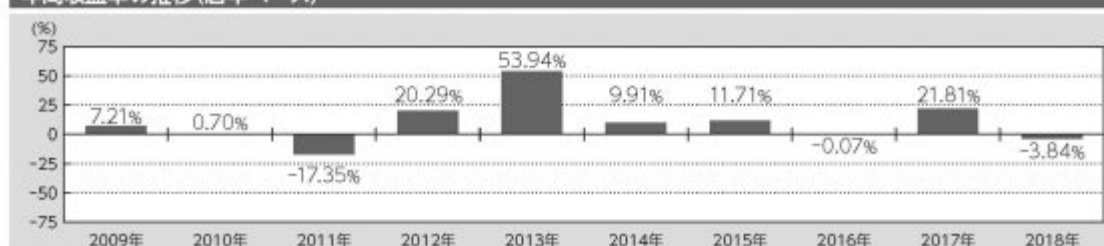
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.7%
ソニー	日本	株式	電気機器	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.4%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.3%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.2%
本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	1.2%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.0%
みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.0%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2018年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づき、振り込まれることとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解

約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成14年12月11日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

（2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(平成28年12月13日から平成29年12月11日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成28年12月12日現在)	第15期 (平成29年12月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,031,217	6,068,824
親投資信託受益証券	2,061,237,529	2,208,061,471
未収入金	4,203,570	2,484,508
流動資産合計	2,070,472,316	2,216,614,803
資産合計	2,070,472,316	2,216,614,803
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,259,279	3,115,228
未払受託者報酬	496,605	556,337
未払委託者報酬	3,376,853	3,783,049
未払利息	13	9
その他未払費用	15	-
流動負債合計	9,132,765	7,454,623
負債合計	9,132,765	7,454,623
純資産の部		
元本等		
元本	949,060,361	843,966,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,112,279,190	1,365,193,278
(分配準備積立金)	432,316,008	657,754,032
元本等合計	2,061,339,551	2,209,160,180
純資産合計	2,061,339,551	2,209,160,180
負債純資産合計	2,070,472,316	2,216,614,803

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成27年12月11日 至 平成28年12月12日	自	平成28年12月13日 至 平成29年12月11日
営業収益				
受取利息		228		2
有価証券売買等損益		33,772,849		393,874,843
営業収益合計		33,773,077		393,874,845
営業費用				
支払利息		1,559		2,756
受託者報酬		993,172		1,094,508
委託者報酬		6,753,471		7,442,601
その他費用		261		13
営業費用合計		7,748,463		8,539,878
営業利益又は営業損失（ ）		26,024,614		385,334,967
経常利益又は経常損失（ ）		26,024,614		385,334,967
当期純利益又は当期純損失（ ）		26,024,614		385,334,967
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（ ）		43,464,164		35,175,935
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,061,533,513		1,112,279,190
剰余金増加額又は欠損金減少額		202,511,222		260,803,259
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		202,511,222		260,803,259
剰余金減少額又は欠損金増加額		221,254,323		358,048,203
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		221,254,323		358,048,203
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,112,279,190		1,365,193,278

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は平成28年12月13日から平成29年12月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (平成28年12月12日現在)	第15期 (平成29年12月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	949,060,361口	843,966,902口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1720円 (21,720円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6176円 (26,176円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 平成27年12月11日 至 平成28年12月12日			第15期 自 平成28年12月13日 至 平成29年12月11日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	35,307,839円	費用控除後の配当等収益額	A	39,230,451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	34,180,939円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	310,928,581円
収益調整金額	C	1,097,589,724円	収益調整金額	C	1,054,412,586円
分配準備積立金額	D	362,827,230円	分配準備積立金額	D	307,595,000円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,529,905,732円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,712,166,618円
当ファンドの期末残存口数	F	949,060,361口	当ファンドの期末残存口数	F	843,966,902口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	16,120円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	20,287円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第15期 自 平成28年12月13日 至 平成29年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第15期 (平成29年12月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 平成27年12月11日 至 平成28年12月12日	自 平成28年12月13日 至 平成29年12月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	926,517,389円	949,060,361円
期中追加設定元本額	221,175,855円	199,865,073円
期中一部解約元本額	198,632,883円	304,958,532円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (平成28年12月12日現在)	第15期 (平成29年12月11日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	69,901,907	367,744,765
合計	69,901,907	367,744,765

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,183,122,473	2,208,061,471	
合計		1,183,122,473	2,208,061,471	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	平成29年12月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,397,434,008
株式	241,692,895,700
派生商品評価勘定	53,699,000
未収入金	63,072,240
未収配当金	54,248,946
差入委託証拠金	74,013,600
流動資産合計	244,335,363,494
資産合計	244,335,363,494
負債の部	
流動負債	
前受金	53,720,600
未払解約金	125,602,008
未払利息	3,674
その他未払費用	105
流動負債合計	179,326,387
負債合計	179,326,387
純資産の部	
元本等	
元本	130,824,852,131
剰余金	
剰余金又は欠損金()	113,331,184,976

	平成29年12月11日現在
項目	金額（円）
元本等合計	244,156,037,107
純資産合計	244,156,037,107
負債純資産合計	244,335,363,494

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年12月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成29年12月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,824,852,131口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8663円 (1万口当たり純資産額) (18,663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29年12月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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。

2.金融商品の時価等に関する事項

	平成29年12月11日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成29年12月11日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成29年12月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年12月13日
期首元本額	149,845,711,512円
期中追加設定元本額	8,387,956,664円
期中一部解約元本額	27,408,816,045円
期末元本額	130,824,852,131円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	815,076,193円
DC日本株式インデックスファンド	344,457,337円
DC日本株式インデックスファンドL	51,208,975,479円
DC日本株式インデックスファンドA	1,183,122,473円
DCバランスファンド30	1,828,432,801円
DCバランスファンド50	2,800,828,535円
DCバランスファンド70	1,436,257,619円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	642,343,865円
日本株式インデックスe	1,903,239,319円
インデックスコレクション（国内株式）	10,113,654,339円

区分	平成29年12月11日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,749,086,665円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,281,223,841円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,017,655,914円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,286,837,089円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,395,043,596円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,574,427,930円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	252,901,039円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	2,290,632,990円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	160,047,464円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	817,938,674円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	35,466,342円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	946,508,201円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,636,113,270円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	757,466,814円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,716,908,657円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,069,014,702円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	1,210,184,935円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,920,595,467円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	53,452,679円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	564,325,067円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	106,085,284円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,069,426,604円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	91,629,857円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	89,174,183円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	45,329,220円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,288,712,071円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,090,904,526円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	32,549,239円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	505,643,170円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	8,046,535,502円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	152,499,698円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	75,142,493円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	13,470,087円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	199,168,182円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,172,956円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	189,763円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年12月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	38,875,154,857
合計	38,875,154,857

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成29年12月11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	2,318,056,000	-	2,371,755,000	53,699,000
合計		2,318,056,000	-	2,371,755,000	53,699,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,100	3,975.00	16,297,500	
日本水産	117,800	599.00	70,562,200	
マルハニチロ	19,800	3,425.00	67,815,000	
カネコ種苗	3,600	1,768.00	6,364,800	
サカタのタネ	15,400	3,925.00	60,445,000	
ホクト	10,600	2,052.00	21,751,200	
ホクリヨウ	1,500	1,179.00	1,768,500	
住石ホールディングス	27,300	148.00	4,040,400	
日鉄鉱業	2,900	7,360.00	21,344,000	
三井松島産業	5,300	1,491.00	7,902,300	
国際石油開発帝石	508,800	1,296.50	659,659,200	
日本海洋掘削	3,600	2,202.00	7,927,200	
石油資源開発	16,600	2,701.00	44,836,600	
K&Oエナジーグループ	6,200	1,857.00	11,513,400	
ショーボンドホールディングス	9,900	7,820.00	77,418,000	
ミライト・ホールディングス	32,200	1,534.00	49,394,800	

タマホーム	7,800	725.00	5,655,000
サンヨーホームズ	1,800	838.00	1,508,400
ファーストコーポレーション	2,300	1,312.00	3,017,600
ベステラ	1,500	2,120.00	3,180,000
インベスターズクラウド	1,800	6,990.00	12,582,000
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,431.00	3,434,400
安藤・間	80,600	923.00	74,393,800
東急建設	40,300	1,149.00	46,304,700
コムシスホールディングス	36,800	3,065.00	112,792,000
ミサワホーム	8,800	1,023.00	9,002,400
ピーアールホールディングス	10,400	435.00	4,524,000
高松コンストラクショングループ	6,800	3,030.00	20,604,000
東建コーポレーション	3,900	14,750.00	57,525,000
ソネック	1,300	826.00	1,073,800
ヤマウラ	5,000	889.00	4,445,000
大成建設	106,400	6,050.00	643,720,000
大林組	313,800	1,381.00	433,357,800
清水建設	320,100	1,237.00	395,963,700
飛鳥建設	95,400	162.00	15,454,800
長谷工コーポレーション	122,100	1,773.00	216,483,300
松井建設	11,600	968.00	11,228,800
銭高組	1,500	6,330.00	9,495,000
鹿島建設	460,000	1,139.00	523,940,000
不動テトラ	79,600	190.00	15,124,000
大末建設	3,400	1,171.00	3,981,400
鉄建建設	6,400	3,365.00	21,536,000
西松建設	24,200	3,220.00	77,924,000
三井住友建設	74,900	627.00	46,962,300
大豊建設	38,000	571.00	21,698,000
前田建設工業	74,700	1,634.00	122,059,800
佐田建設	6,900	449.00	3,098,100
ナカノフドー建設	8,100	617.00	4,997,700
奥村組	17,200	4,580.00	78,776,000
東鉄工業	12,600	3,695.00	46,557,000
イチケン	1,900	2,427.00	4,611,300
浅沼組	37,000	418.00	15,466,000
戸田建設	122,000	875.00	106,750,000
熊谷組	16,400	3,135.00	51,414,000
青木あすなろ建設	6,900	1,010.00	6,969,000
北野建設	22,000	412.00	9,064,000
植木組	1,300	2,750.00	3,575,000
三井ホーム	14,000	706.00	9,884,000

矢作建設工業	14,200	979.00	13,901,800
ピーエス三菱	12,500	907.00	11,337,500
日本ハウスホールディングス	20,000	647.00	12,940,000
大東建託	37,900	22,785.00	863,551,500
新日本建設	12,500	982.00	12,275,000
N I P P O	24,000	2,642.00	63,408,000
東亜道路工業	2,100	4,355.00	9,145,500
前田道路	33,000	2,676.00	88,308,000
日本道路	2,800	6,780.00	18,984,000
東亜建設工業	8,400	3,055.00	25,662,000
若築建設	5,600	1,740.00	9,744,000
東洋建設	32,800	632.00	20,729,600
五洋建設	124,400	872.00	108,476,800
世紀東急工業	14,100	623.00	8,784,300
福田組	3,400	7,030.00	23,902,000
住友林業	66,900	1,997.00	133,599,300
日本基礎技術	11,600	422.00	4,895,200
日成ビルド工業	15,500	1,430.00	22,165,000
巴コーポレーション	13,100	669.00	8,763,900
大和ハウス工業	309,100	4,299.00	1,328,820,900
ライト工業	20,100	1,321.00	26,552,100
積水ハウス	340,500	2,076.50	707,048,250
日特建設	8,900	740.00	6,586,000
北陸電気工事	5,800	1,095.00	6,351,000
ユアテック	16,500	965.00	15,922,500
西部電気工業	1,700	2,930.00	4,981,000
四電工	1,600	2,977.00	4,763,200
中電工	13,500	3,220.00	43,470,000
関電工	41,700	1,125.00	46,912,500
きんでん	69,600	1,873.00	130,360,800
東京エネシス	11,900	1,288.00	15,327,200
トーエネック	2,900	3,250.00	9,425,000
住友電設	8,300	2,402.00	19,936,600
日本電設工業	16,100	2,394.00	38,543,400
協和エクシオ	37,600	2,634.00	99,038,400
新日本空調	8,100	1,538.00	12,457,800
N D S	1,600	4,315.00	6,904,000
九電工	20,600	5,330.00	109,798,000
三機工業	22,200	1,377.00	30,569,400
日揮	90,200	2,004.00	180,760,800
中外炉工業	3,200	2,267.00	7,254,400
ヤマト	8,700	860.00	7,482,000

太平電業	7,100	2,653.00	18,836,300
高砂熱学工業	28,800	2,052.00	59,097,600
三晃金属工業	1,200	4,165.00	4,998,000
朝日工業社	2,200	3,420.00	7,524,000
明星工業	18,900	812.00	15,346,800
大気社	13,900	3,695.00	51,360,500
ダイダン	7,000	3,060.00	21,420,000
日比谷総合設備	11,700	2,310.00	27,027,000
東芝プラントシステム	22,700	2,138.00	48,532,600
OSJBホールディングス	46,200	328.00	15,153,600
東洋エンジニアリング	12,400	1,247.00	15,462,800
千代田化工建設	68,000	743.00	50,524,000
新興プランテック	20,100	1,185.00	23,818,500
日本製粉	31,100	1,713.00	53,274,300
日清製粉グループ本社	114,700	2,289.00	262,548,300
日東富士製粉	700	4,685.00	3,279,500
昭和産業	8,600	2,883.00	24,793,800
鳥越製粉	8,300	1,044.00	8,665,200
中部飼料	11,400	2,405.00	27,417,000
フィード・ワン	63,000	280.00	17,640,000
東洋精糖	1,600	1,207.00	1,931,200
日本甜菜製糖	5,300	2,732.00	14,479,600
三井製糖	7,400	4,585.00	33,929,000
塩水港精糖	11,200	267.00	2,990,400
日新製糖	4,400	2,188.00	9,627,200
森永製菓	22,000	5,730.00	126,060,000
中村屋	2,400	5,060.00	12,144,000
江崎グリコ	26,200	5,760.00	150,912,000
名糖産業	4,500	1,565.00	7,042,500
不二家	6,000	2,831.00	16,986,000
山崎製パン	76,600	2,234.00	171,124,400
第一屋製パン	1,600	1,262.00	2,019,200
モロゾフ	1,600	7,770.00	12,432,000
亀田製菓	5,800	5,480.00	31,784,000
寿スピリッツ	9,000	5,770.00	51,930,000
カルビー	42,700	3,905.00	166,743,500
森永乳業	18,800	4,875.00	91,650,000
六甲バター	4,700	2,876.00	13,517,200
ヤクルト本社	56,100	8,660.00	485,826,000
明治ホールディングス	62,000	10,150.00	629,300,000
雪印メグミルク	22,600	3,245.00	73,337,000
プリマハム	66,000	854.00	56,364,000

日本ハム	81,000	2,753.00	222,993,000
林兼産業	3,400	903.00	3,070,200
丸大食品	50,000	504.00	25,200,000
S Foods	6,500	5,070.00	32,955,000
伊藤ハム米久ホールディングス	60,400	1,018.00	61,487,200
サッポロホールディングス	34,300	3,590.00	123,137,000
アサヒグループホールディングス	196,300	5,743.00	1,127,350,900
キリンホールディングス	450,500	2,863.00	1,289,781,500
宝ホールディングス	75,700	1,293.00	97,880,100
オエノンホールディングス	26,600	380.00	10,108,000
養命酒製造	2,900	2,485.00	7,206,500
コカ・コーラボトラーズジャパン	65,800	4,320.00	284,256,000
サントリー食品インターナショナル	71,700	5,090.00	364,953,000
ダイドーグループホールディングス	4,800	5,880.00	28,224,000
伊藤園	31,000	4,445.00	137,795,000
キーコーヒー	9,200	2,147.00	19,752,400
ユニカフェ	2,800	1,319.00	3,693,200
ジャパンフーズ	1,300	1,460.00	1,898,000
日清オイリオグループ	11,100	3,490.00	38,739,000
不二製油グループ本社	25,400	3,330.00	84,582,000
かどや製油	1,000	6,920.00	6,920,000
J - オイルミルズ	4,900	4,005.00	19,624,500
キッコーマン	73,200	4,690.00	343,308,000
味の素	215,500	2,181.50	470,113,250
キューピー	53,000	2,998.00	158,894,000
ハウス食品グループ本社	35,800	3,845.00	137,651,000
カゴメ	37,500	4,230.00	158,625,000
焼津水産化学工業	4,500	1,224.00	5,508,000
アリアケジャパン	8,600	10,480.00	90,128,000
ピエトロ	1,200	1,704.00	2,044,800
エバラ食品工業	2,000	2,112.00	4,224,000
ニチレイ	44,600	3,245.00	144,727,000
東洋水産	51,400	4,845.00	249,033,000
イトアンド	1,300	4,110.00	5,343,000
大冷	1,000	2,031.00	2,031,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	6,330.00	1,899,000
日清食品ホールディングス	40,900	8,310.00	339,879,000
永谷園ホールディングス	10,000	1,410.00	14,100,000
一正蒲鉾	3,600	1,291.00	4,647,600
フジッコ	10,100	2,565.00	25,906,500
ロック・フィールド	10,100	2,018.00	20,381,800
日本たばこ産業	579,900	3,730.00	2,163,027,000

ケンコーマヨネーズ	6,200	3,490.00	21,638,000
わらべや日洋ホールディングス	6,100	3,130.00	19,093,000
なとり	5,200	2,060.00	10,712,000
イフジ産業	1,600	801.00	1,281,600
北の達人コーポレーション	9,000	1,160.00	10,440,000
ユーグレナ	36,200	1,061.00	38,408,200
ミヨシ油脂	3,600	1,548.00	5,572,800
理研ビタミン	3,500	4,555.00	15,942,500
片倉工業	11,300	1,344.00	15,187,200
ゲンゼ	7,300	5,790.00	42,267,000
東洋紡	36,200	2,085.00	75,477,000
ユニチカ	28,600	847.00	24,224,200
富士紡ホールディングス	5,500	3,600.00	19,800,000
倉敷紡績	99,000	347.00	34,353,000
シキボウ	4,900	1,443.00	7,070,700
日本毛織	27,700	1,044.00	28,918,800
トーア紡コーポレーション	4,100	640.00	2,624,000
ダイドーリミテッド	11,200	443.00	4,961,600
帝国繊維	10,300	2,214.00	22,804,200
帝人	80,000	2,492.00	199,360,000
東レ	709,600	1,066.50	756,788,400
サカイオーベックス	2,500	2,631.00	6,577,500
住江織物	2,700	3,060.00	8,262,000
日本フェルト	5,400	509.00	2,748,600
イチカワ	7,000	358.00	2,506,000
日東製網	1,100	1,824.00	2,006,400
アツギ	6,700	1,314.00	8,803,800
ダイニック	3,700	1,144.00	4,232,800
セーレン	22,500	2,068.00	46,530,000
ソトー	3,900	1,143.00	4,457,700
東海染工	1,600	1,430.00	2,288,000
小松精練	15,300	922.00	14,106,600
ワコールホールディングス	27,100	3,620.00	98,102,000
ホギメディカル	6,200	8,320.00	51,584,000
レナウン	26,400	186.00	4,910,400
クラウディアホールディングス	2,800	590.00	1,652,000
T S Iホールディングス	37,200	853.00	31,731,600
三陽商会	5,200	2,258.00	11,741,600
オンワードホールディングス	59,000	959.00	56,581,000
ルック	17,000	396.00	6,732,000
ゴールドウイン	2,800	8,340.00	23,352,000
デサント	22,500	1,866.00	41,985,000

キング	5,200	681.00	3,541,200
ヤマトインターナショナル	7,100	448.00	3,180,800
特種東海製紙	5,700	4,055.00	23,113,500
王子ホールディングス	412,000	706.00	290,872,000
日本製紙	43,800	2,133.00	93,425,400
三菱製紙	13,900	734.00	10,202,600
北越紀州製紙	54,600	642.00	35,053,200
中越パルプ工業	3,900	2,079.00	8,108,100
巴川製紙所	15,000	294.00	4,410,000
大王製紙	39,000	1,464.00	57,096,000
阿波製紙	2,400	744.00	1,785,600
レンゴー	94,300	748.00	70,536,400
トーモク	5,600	2,097.00	11,743,200
ザ・パック	6,900	3,750.00	25,875,000
クラレ	164,600	2,156.00	354,877,600
旭化成	610,000	1,432.00	873,520,000
共和レザー	5,700	1,010.00	5,757,000
昭和電工	65,100	4,200.00	273,420,000
住友化学	720,000	790.00	568,800,000
住友精化	4,100	6,330.00	25,953,000
日産化学工業	56,900	4,625.00	263,162,500
ラサ工業	3,500	2,214.00	7,749,000
クレハ	8,200	7,520.00	61,664,000
多木化学	1,300	5,670.00	7,371,000
テイカ	7,500	2,920.00	21,900,000
石原産業	17,600	2,018.00	35,516,800
片倉コープアグリ	2,400	1,450.00	3,480,000
日東エフシー	5,800	808.00	4,686,400
日本曹達	68,000	740.00	50,320,000
東ソー	141,400	2,528.00	357,459,200
トクヤマ	28,400	3,425.00	97,270,000
セントラル硝子	19,900	2,403.00	47,819,700
東亜合成	57,400	1,435.00	82,369,000
大阪ソーダ	8,700	2,891.00	25,151,700
関東電化工業	23,400	1,286.00	30,092,400
デンカ	35,900	4,285.00	153,831,500
信越化学工業	162,900	12,060.00	1,964,574,000
日本カーバイド工業	3,100	2,140.00	6,634,000
堺化学工業	6,700	2,543.00	17,038,100
エア・ウォーター	80,700	2,424.00	195,616,800
大陽日酸	75,300	1,576.00	118,672,800
日本化学工業	3,600	2,482.00	8,935,200

東邦アセチレン	1,400	1,640.00	2,296,000
日本パーカラライジング	50,000	1,867.00	93,350,000
高压ガス工業	14,500	935.00	13,557,500
チタン工業	1,100	2,543.00	2,797,300
四国化成工業	14,100	1,784.00	25,154,400
戸田工業	1,900	4,290.00	8,151,000
ステラ ケミファ	5,000	3,740.00	18,700,000
保土谷化学工業	3,200	6,500.00	20,800,000
日本触媒	15,400	8,010.00	123,354,000
大日精化工業	7,600	5,400.00	41,040,000
カネカ	132,000	1,003.00	132,396,000
三菱瓦斯化学	84,100	3,160.00	265,756,000
三井化学	88,900	3,620.00	321,818,000
J S R	98,300	2,313.00	227,367,900
東京応化工業	17,000	4,820.00	81,940,000
大阪有機化学工業	6,400	1,281.00	8,198,400
三菱ケミカルホールディングス	655,100	1,253.50	821,167,850
K Hネオケム	15,000	2,704.00	40,560,000
ダイセル	131,900	1,356.00	178,856,400
住友ベークライト	79,000	960.00	75,840,000
積水化学工業	203,200	2,276.00	462,483,200
日本ゼオン	82,500	1,582.00	130,515,000
アイカ工業	27,500	4,105.00	112,887,500
宇部興産	49,300	3,270.00	161,211,000
積水樹脂	15,100	2,277.00	34,382,700
タキロンシーアイ	20,000	789.00	15,780,000
旭有機材	5,700	1,820.00	10,374,000
日立化成	48,300	2,921.00	141,084,300
ニチバン	4,800	3,000.00	14,400,000
リケンテクノス	21,100	631.00	13,314,100
大倉工業	23,000	683.00	15,709,000
積水化成品工業	12,300	1,420.00	17,466,000
群栄化学工業	2,300	3,765.00	8,659,500
タイガースポリマー	4,900	823.00	4,032,700
ミライアル	3,300	2,000.00	6,600,000
ダイキアクシス	3,300	1,679.00	5,540,700
ダイキョーニシカワ	19,300	1,825.00	35,222,500
竹本容器	1,100	2,246.00	2,470,600
日本化薬	63,500	1,697.00	107,759,500
カーリットホールディングス	9,100	1,143.00	10,401,300
日本精化	8,100	1,159.00	9,387,900
扶桑化学工業	7,000	3,230.00	22,610,000

A D E K A	42,100	1,981.00	83,400,100
日油	37,800	3,015.00	113,967,000
ハリマ化成グループ	7,600	896.00	6,809,600
花王	229,600	7,733.00	1,775,496,800
第一工業製薬	19,000	807.00	15,333,000
日華化学	3,100	1,300.00	4,030,000
ニイタカ	1,500	1,849.00	2,773,500
三洋化成工業	6,200	5,900.00	36,580,000
有機合成薬品工業	6,600	296.00	1,953,600
大日本塗料	11,200	1,935.00	21,672,000
日本ペイントホールディングス	75,500	3,575.00	269,912,500
関西ペイント	102,800	2,963.00	304,596,400
神東塗料	7,500	270.00	2,025,000
中国塗料	28,000	976.00	27,328,000
日本特殊塗料	6,200	2,144.00	13,292,800
藤倉化成	12,300	694.00	8,536,200
太陽ホールディングス	7,500	5,060.00	37,950,000
D I C	38,600	4,310.00	166,366,000
サカタインクス	20,000	1,894.00	37,880,000
東洋インキS Cホールディングス	97,000	659.00	63,923,000
T & K T O K A	6,600	1,451.00	9,576,600
富士フイルムホールディングス	194,000	4,732.00	918,008,000
資生堂	174,000	5,514.00	959,436,000
ライオン	130,100	2,124.00	276,332,400
高砂香料工業	5,900	3,540.00	20,886,000
マンダム	18,200	3,800.00	69,160,000
ミルボン	6,200	8,010.00	49,662,000
ファンケル	22,700	3,335.00	75,704,500
コーセー	15,800	17,430.00	275,394,000
コタ	4,100	1,544.00	6,330,400
シーズ・ホールディングス	12,700	4,845.00	61,531,500
シーボン	1,100	3,695.00	4,064,500
ポーラ・オルビスホールディングス	39,900	4,165.00	166,183,500
ノエビアホールディングス	6,200	8,250.00	51,150,000
アジュバンコスメジャパン	2,100	1,017.00	2,135,700
エステー	6,700	2,913.00	19,517,100
アグロ カネショウ	3,800	1,950.00	7,410,000
コニシ	15,300	2,070.00	31,671,000
長谷川香料	12,400	2,328.00	28,867,200
星光P M C	5,400	1,194.00	6,447,600
小林製薬	26,200	7,200.00	188,640,000
荒川化学工業	8,400	2,328.00	19,555,200

メック	6,400	2,476.00	15,846,400
日本高純度化学	2,600	2,647.00	6,882,200
タカラバイオ	24,500	1,501.00	36,774,500
J C U	5,700	5,580.00	31,806,000
新田ゼラチン	6,500	798.00	5,187,000
O A T アグリオ	1,500	2,773.00	4,159,500
デクセリアルズ	24,000	1,423.00	34,152,000
アース製薬	7,000	5,800.00	40,600,000
北興化学工業	9,600	724.00	6,950,400
大成ラミック	2,900	3,150.00	9,135,000
クミアイ化学工業	42,500	847.00	35,997,500
日本農薬	24,400	684.00	16,689,600
アキレス	7,100	2,378.00	16,883,800
有沢製作所	15,600	1,247.00	19,453,200
日東電工	70,500	10,320.00	727,560,000
レック	5,600	2,865.00	16,044,000
きもと	16,100	313.00	5,039,300
藤森工業	7,800	3,770.00	29,406,000
前澤化成工業	6,400	1,241.00	7,942,400
J S P	5,500	3,880.00	21,340,000
エフピコ	7,700	6,130.00	47,201,000
天馬	7,300	2,103.00	15,351,900
信越ポリマー	19,200	1,225.00	23,520,000
東リ	23,400	423.00	9,898,200
ニフコ	17,200	7,400.00	127,280,000
日本バルカー工業	7,600	2,876.00	21,857,600
ユニ・チャーム	198,000	2,991.00	592,218,000
協和発酵キリン	117,000	2,129.00	249,093,000
武田薬品工業	344,000	6,180.00	2,125,920,000
アステラス製薬	959,700	1,436.00	1,378,129,200
大日本住友製薬	69,200	1,622.00	112,242,400
塩野義製薬	133,600	6,238.00	833,396,800
田辺三菱製薬	113,900	2,413.00	274,840,700
わかもと製薬	11,000	284.00	3,124,000
あすか製薬	10,600	2,074.00	21,984,400
日本新薬	24,400	7,930.00	193,492,000
バイオフェルミン製薬	1,600	3,075.00	4,920,000
中外製薬	97,400	5,930.00	577,582,000
科研製薬	16,900	5,770.00	97,513,000
エーザイ	111,800	6,673.00	746,041,400
ロート製薬	51,300	3,055.00	156,721,500
小野薬品工業	220,500	2,540.00	560,070,000

久光製薬	27,600	6,480.00	178,848,000
持田製薬	6,500	8,160.00	53,040,000
参天製薬	176,700	1,895.00	334,846,500
扶桑薬品工業	3,300	2,816.00	9,292,800
日本ケミファ	1,200	4,990.00	5,988,000
ツムラ	33,400	3,710.00	123,914,000
日医工	24,600	1,696.00	41,721,600
キッセイ薬品工業	17,300	3,165.00	54,754,500
生化学工業	18,100	1,685.00	30,498,500
栄研化学	7,600	5,300.00	40,280,000
日水製薬	3,900	1,556.00	6,068,400
鳥居薬品	5,800	3,070.00	17,806,000
JCRファーマ	6,600	4,835.00	31,911,000
東和薬品	4,500	5,980.00	26,910,000
富士製薬工業	3,200	4,265.00	13,648,000
沢井製薬	17,700	5,120.00	90,624,000
ゼリア新薬工業	20,000	2,169.00	43,380,000
第一三共	267,200	2,762.50	738,140,000
キョーリン製薬ホールディングス	26,100	2,122.00	55,384,200
大幸薬品	4,900	2,384.00	11,681,600
ダイト	5,800	3,345.00	19,401,000
大塚ホールディングス	194,100	4,946.00	960,018,600
大正製薬ホールディングス	20,900	8,890.00	185,801,000
ペプチドリーム	38,300	3,635.00	139,220,500
日本コークス工業	78,700	123.00	9,680,100
昭和シェル石油	87,400	1,534.00	134,071,600
ニチレキ	11,900	1,453.00	17,290,700
ユシロ化学工業	5,200	1,631.00	8,481,200
ビーピー・カストロール	4,000	2,304.00	9,216,000
富士石油	22,700	538.00	12,212,600
MORESCO	3,400	2,099.00	7,136,600
出光興産	78,400	4,075.00	319,480,000
JXTGホールディングス	1,490,400	676.30	1,007,957,520
コスモエネルギーホールディングス	27,000	3,590.00	96,930,000
横浜ゴム	54,100	2,593.00	140,281,300
東洋ゴム工業	55,300	2,309.00	127,687,700
ブリヂストン	330,000	5,127.00	1,691,910,000
住友ゴム工業	91,500	2,028.00	185,562,000
藤倉ゴム工業	8,200	952.00	7,806,400
オカモト	33,000	1,138.00	37,554,000
フコク	4,100	1,094.00	4,485,400
ニッタ	9,700	4,295.00	41,661,500

住友理工	18,100	1,178.00	21,321,800
三ツ星ベルト	23,000	1,467.00	33,741,000
バンドー化学	17,800	1,289.00	22,944,200
日東紡績	13,900	3,275.00	45,522,500
旭硝子	95,500	4,780.00	456,490,000
日本板硝子	44,000	1,006.00	44,264,000
石塚硝子	1,300	2,843.00	3,695,900
日本山村硝子	39,000	191.00	7,449,000
日本電気硝子	40,400	4,430.00	178,972,000
オハラ	3,700	2,958.00	10,944,600
住友大阪セメント	182,000	547.00	99,554,000
太平洋セメント	59,000	4,995.00	294,705,000
日本ヒューム	9,500	766.00	7,277,000
日本コンクリート工業	20,400	494.00	10,077,600
三谷セキサン	4,900	2,683.00	13,146,700
アジアパイルホールディングス	12,200	718.00	8,759,600
東海カーボン	84,900	1,208.00	102,559,200
日本カーボン	4,800	4,555.00	21,864,000
東洋炭素	6,100	3,430.00	20,923,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,500	5,880.00	32,340,000
TOTO	71,900	6,300.00	452,970,000
日本碍子	114,000	2,120.00	241,680,000
日本特殊陶業	80,200	2,569.00	206,033,800
MARUWA	3,200	7,410.00	23,712,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,315.00	8,287,500
黒崎播磨	1,900	4,715.00	8,958,500
ヨータイ	5,900	612.00	3,610,800
イソライト工業	4,900	1,086.00	5,321,400
東京窯業	12,200	412.00	5,026,400
ニッカトー	3,300	906.00	2,989,800
フジミインコーポレーテッド	8,400	2,479.00	20,823,600
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,406.00	2,812,000
ニチアス	51,000	1,470.00	74,970,000
ニチハ	14,100	4,335.00	61,123,500
新日鐵住金	413,300	2,858.50	1,181,418,050
神戸製鋼所	166,800	1,065.00	177,642,000
中山製鋼所	12,800	745.00	9,536,000
合同製鐵	5,000	2,236.00	11,180,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	249,400	2,749.00	685,600,600
日新製鋼	25,500	1,783.00	45,466,500
東京製鐵	49,500	1,063.00	52,618,500
共英製鋼	10,400	2,133.00	22,183,200

大和工業	19,600	3,270.00	64,092,000
東京鐵鋼	3,800	1,964.00	7,463,200
大阪製鐵	6,100	2,322.00	14,164,200
淀川製鋼所	13,500	3,425.00	46,237,500
東洋鋼鈹	23,400	467.00	10,927,800
丸一鋼管	32,700	3,215.00	105,130,500
モリ工業	3,000	3,535.00	10,605,000
大同特殊鋼	16,400	6,860.00	112,504,000
日本高周波鋼業	3,400	915.00	3,111,000
日本冶金工業	76,400	226.00	17,266,400
山陽特殊製鋼	10,700	2,871.00	30,719,700
愛知製鋼	5,200	4,550.00	23,660,000
日立金属	99,500	1,492.00	148,454,000
日本金属	2,300	2,530.00	5,819,000
大平洋金属	5,700	2,872.00	16,370,400
新日本電工	55,300	449.00	24,829,700
栗本鐵工所	4,700	2,335.00	10,974,500
虹技	1,400	2,125.00	2,975,000
日本鑄鉄管	10,000	178.00	1,780,000
三菱製鋼	6,800	2,696.00	18,332,800
日亜鋼業	13,500	327.00	4,414,500
日本精線	1,500	5,400.00	8,100,000
シンニッタン	7,200	766.00	5,515,200
新家工業	2,100	2,187.00	4,592,700
大紀アルミニウム工業所	15,400	774.00	11,919,600
日本輕金属ホールディングス	270,300	305.00	82,441,500
三井金属鋳業	25,000	6,050.00	151,250,000
東邦亜鉛	5,200	5,600.00	29,120,000
三菱マテリアル	60,600	3,735.00	226,341,000
住友金属鋳山	118,100	4,339.00	512,435,900
D O W A ホールディングス	23,400	4,250.00	99,450,000
古河機械金属	15,300	2,202.00	33,690,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,700	1,923.00	18,653,100
東邦チタニウム	16,700	1,053.00	17,585,100
U A C J	14,100	2,886.00	40,692,600
古河電気工業	30,800	5,690.00	175,252,000
住友電気工業	345,400	1,858.00	641,753,200
フジクラ	111,700	1,014.00	113,263,800
昭和電線ホールディングス	11,600	984.00	11,414,400
東京特殊電線	1,300	2,641.00	3,433,300
タツタ電線	18,500	881.00	16,298,500
沖電線	1,100	3,640.00	4,004,000

カナレ電気	1,600	2,560.00	4,096,000
平河ヒューテック	4,700	1,358.00	6,382,600
リョービ	11,400	3,010.00	34,314,000
アーレスティ	11,500	912.00	10,488,000
アサヒホールディングス	15,900	1,952.00	31,036,800
稲葉製作所	5,200	1,426.00	7,415,200
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,558.00	6,650,800
トーカロ	6,400	4,675.00	29,920,000
アルファC o	3,300	2,303.00	7,599,900
SUMCO	85,000	2,853.00	242,505,000
川田テクノロジーズ	1,900	6,210.00	11,799,000
RS Technologies	1,300	4,590.00	5,967,000
東洋製罐グループホールディングス	63,200	1,851.00	116,983,200
ホッカンホールディングス	24,000	454.00	10,896,000
コロナ	5,100	1,399.00	7,134,900
横河ブリッジホールディングス	17,200	2,548.00	43,825,600
駒井ハルテック	2,000	2,653.00	5,306,000
高田機工	800	3,285.00	2,628,000
三和ホールディングス	88,600	1,516.00	134,317,600
文化シャッター	27,200	1,095.00	29,784,000
三協立山	12,800	1,674.00	21,427,200
アルインコ	6,700	1,245.00	8,341,500
東洋シャッター	2,500	624.00	1,560,000
LIXILグループ	136,200	3,020.00	411,324,000
日本フィルコン	7,100	776.00	5,509,600
ノーリツ	20,600	2,164.00	44,578,400
長府製作所	10,400	2,655.00	27,612,000
リンナイ	16,500	10,040.00	165,660,000
ダイニチ工業	5,000	842.00	4,210,000
日東精工	12,800	677.00	8,665,600
三洋工業	1,100	2,168.00	2,384,800
岡部	18,700	1,057.00	19,765,900
ジーテクト	10,200	2,286.00	23,317,200
東プレ	17,200	3,240.00	55,728,000
高周波熱錬	17,800	1,205.00	21,449,000
東京製綱	6,600	1,629.00	10,751,400
サンコール	5,200	689.00	3,582,800
モリテック スチール	5,400	613.00	3,310,200
パイオラックス	13,700	3,295.00	45,141,500
エイチワン	6,800	1,764.00	11,995,200
日本発條	92,000	1,243.00	114,356,000
中央発條	1,100	3,765.00	4,141,500

アドバネクス	1,500	3,375.00	5,062,500
立川ブラインド工業	4,100	1,368.00	5,608,800
三益半導体工業	8,200	2,008.00	16,465,600
日本ドライケミカル	1,200	2,424.00	2,908,800
日本製鋼所	30,300	3,575.00	108,322,500
三浦工業	40,100	2,801.00	112,320,100
タクマ	31,500	1,629.00	51,313,500
ツガミ	25,000	1,215.00	30,375,000
オークマ	10,800	7,150.00	77,220,000
東芝機械	53,000	799.00	42,347,000
アマダホールディングス	142,800	1,520.00	217,056,000
アイダエンジニアリング	23,800	1,342.00	31,939,600
滝澤鉄工所	2,900	2,092.00	6,066,800
富士機械製造	27,700	2,111.00	58,474,700
牧野フライス製作所	46,000	1,105.00	50,830,000
オーエスジー	41,900	2,281.00	95,573,900
ダイジェット工業	1,300	1,892.00	2,459,600
旭ダイヤモンド工業	27,700	1,194.00	33,073,800
D M G 森精機	51,300	2,284.00	117,169,200
ソディック	20,100	1,436.00	28,863,600
ディスコ	12,500	25,380.00	317,250,000
日東工器	5,700	2,927.00	16,683,900
日進工具	2,400	2,528.00	6,067,200
パンチ工業	3,800	2,447.00	9,298,600
富士ダイス	3,500	1,104.00	3,864,000
豊和工業	5,300	1,790.00	9,487,000
O K K	3,800	1,280.00	4,864,000
東洋機械金属	7,200	894.00	6,436,800
島精機製作所	11,700	6,970.00	81,549,000
N C ホールディングス	3,000	825.00	2,475,000
フリュー	6,600	1,054.00	6,956,400
ヤマシンフィルタ	12,600	1,429.00	18,005,400
日阪製作所	13,300	1,230.00	16,359,000
やまびこ	17,900	1,690.00	30,251,000
平田機工	2,600	12,220.00	31,772,000
ペガサスミシン製造	8,600	772.00	6,639,200
ナプテスコ	50,900	4,455.00	226,759,500
三井海洋開発	9,800	2,657.00	26,038,600
レオン自動機	8,200	1,714.00	14,054,800
S M C	29,300	47,000.00	1,377,100,000
新川	7,500	1,010.00	7,575,000
ホソカワミクロン	3,500	7,850.00	27,475,000

ユニオンツール	4,200	4,415.00	18,543,000
オイレス工業	11,900	2,282.00	27,155,800
日精エー・エス・ピー機械	3,100	6,940.00	21,514,000
サトーホールディングス	12,200	3,365.00	41,053,000
技研製作所	4,700	3,070.00	14,429,000
日本エアーテック	3,200	943.00	3,017,600
日精樹脂工業	8,000	1,678.00	13,424,000
オカダアイヨン	2,700	2,132.00	5,756,400
ワイエイシイホールディングス	3,100	1,084.00	3,360,400
小松製作所	451,000	3,821.00	1,723,271,000
住友重機械工業	53,500	4,735.00	253,322,500
日立建機	43,800	3,915.00	171,477,000
日工	2,800	2,309.00	6,465,200
巴工業	4,000	2,108.00	8,432,000
井関農機	9,500	2,801.00	26,609,500
TOWA	7,300	2,089.00	15,249,700
丸山製作所	2,200	2,118.00	4,659,600
北川鉄工所	4,600	3,030.00	13,938,000
ローツェ	4,600	2,661.00	12,240,600
タカキタ	3,200	841.00	2,691,200
クボタ	504,000	2,115.50	1,066,212,000
荏原実業	2,900	2,001.00	5,802,900
三菱化工機	3,400	2,313.00	7,864,200
月島機械	18,800	1,290.00	24,252,000
帝国電機製作所	6,500	1,513.00	9,834,500
新東工業	22,400	1,414.00	31,673,600
澁谷工業	8,200	4,320.00	35,424,000
アイチ コーポレーション	16,600	810.00	13,446,000
小森コーポレーション	23,700	1,517.00	35,952,900
鶴見製作所	8,100	2,005.00	16,240,500
住友精密工業	15,000	375.00	5,625,000
酒井重工業	1,800	4,615.00	8,307,000
荏原製作所	38,400	4,290.00	164,736,000
石井鐵工所	1,600	1,728.00	2,764,800
西島製作所	9,800	1,145.00	11,221,000
北越工業	10,500	1,305.00	13,702,500
ダイキン工業	127,500	13,360.00	1,703,400,000
オルガノ	3,500	3,080.00	10,780,000
トーヨーカネツ	4,000	4,355.00	17,420,000
栗田工業	50,600	3,495.00	176,847,000
椿本チエイン	56,000	882.00	49,392,000
大同工業	3,800	1,681.00	6,387,800

木村化工機	8,400	574.00	4,821,600
アネスト岩田	15,700	1,200.00	18,840,000
ダイフク	47,200	6,010.00	283,672,000
サムコ	2,600	1,258.00	3,270,800
加藤製作所	4,500	3,110.00	13,995,000
油研工業	2,000	2,758.00	5,516,000
タダノ	45,300	1,830.00	82,899,000
フジテック	29,900	1,644.00	49,155,600
C K D	26,000	2,438.00	63,388,000
キトー	7,100	1,698.00	12,055,800
平和	28,900	1,989.00	57,482,100
理想科学工業	9,300	2,111.00	19,632,300
S A N K Y O	23,400	3,575.00	83,655,000
日本金銭機械	8,600	1,143.00	9,829,800
マースエンジニアリング	5,900	2,367.00	13,965,300
福島工業	5,800	5,220.00	30,276,000
オーイズミ	3,900	522.00	2,035,800
ダイコク電機	4,300	1,767.00	7,598,100
竹内製作所	15,600	2,460.00	38,376,000
アマノ	28,900	2,936.00	84,850,400
J U K I	13,900	1,918.00	26,660,200
サンデンホールディングス	11,400	2,142.00	24,418,800
蛇の目ミシン工業	8,500	841.00	7,148,500
マックス	14,400	1,596.00	22,982,400
グローリー	27,900	4,310.00	120,249,000
新晃工業	9,500	2,119.00	20,130,500
大和冷機工業	15,000	1,327.00	19,905,000
セガサミーホールディングス	92,600	1,398.00	129,454,800
日本ピストンリング	3,400	2,238.00	7,609,200
リケン	4,300	6,370.00	27,391,000
T P R	10,500	3,645.00	38,272,500
ツバキ・ナカシマ	9,300	2,540.00	23,622,000
ホシザキ	29,400	10,060.00	295,764,000
大豊工業	7,600	1,707.00	12,973,200
日本精工	191,800	1,668.00	319,922,400
N T N	216,100	538.00	116,261,800
ジェイテクト	99,500	1,909.00	189,945,500
不二越	87,000	715.00	62,205,000
日本トムソン	29,800	735.00	21,903,000
T H K	58,200	4,060.00	236,292,000
ユーシン精機	4,100	3,165.00	12,976,500
前澤給装工業	3,700	1,886.00	6,978,200

イーグル工業	11,500	1,960.00	22,540,000
前澤工業	6,200	424.00	2,628,800
日本ピラー工業	9,400	1,589.00	14,936,600
キット	41,600	842.00	35,027,200
マキタ	121,800	4,640.00	565,152,000
日立造船	74,700	584.00	43,624,800
三菱重工業	156,600	4,223.00	661,321,800
I H I	71,900	3,620.00	260,278,000
スター精密	15,000	1,857.00	27,855,000
日清紡ホールディングス	57,000	1,543.00	87,951,000
イビデン	57,200	1,743.00	99,699,600
コニカミノルタ	218,700	1,110.00	242,757,000
ブラザー工業	114,100	2,826.00	322,446,600
ミネベアミツミ	173,400	2,350.00	407,490,000
日立製作所	2,242,000	856.70	1,920,721,400
三菱電機	933,800	1,866.00	1,742,470,800
富士電機	281,000	809.00	227,329,000
東洋電機製造	4,000	1,852.00	7,408,000
安川電機	108,300	4,935.00	534,460,500
シンフォニアテクノロジー	60,000	432.00	25,920,000
明電舎	79,000	476.00	37,604,000
オリジン電気	2,700	1,720.00	4,644,000
山洋電気	4,500	7,970.00	35,865,000
デンヨー	8,600	1,951.00	16,778,600
東芝テック	67,000	698.00	46,766,000
芝浦メカトロニクス	14,000	443.00	6,202,000
マブチモーター	26,100	6,120.00	159,732,000
日本電産	112,400	15,835.00	1,779,854,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,400	2,709.00	9,210,600
東光高岳	4,800	1,855.00	8,904,000
ダブル・スコープ	13,600	2,240.00	30,464,000
ダイヘン	51,000	1,010.00	51,510,000
ヤーマン	11,900	2,134.00	25,394,600
JVCケンウッド	68,700	356.00	24,457,200
ミマキエンジニアリング	8,500	1,077.00	9,154,500
第一精工	4,400	3,030.00	13,332,000
日新電機	21,900	1,354.00	29,652,600
大崎電気工業	20,000	819.00	16,380,000
オムロン	99,300	6,540.00	649,422,000
日東工業	15,000	1,827.00	27,405,000
I D E C	11,900	2,589.00	30,809,100
不二電機工業	1,100	1,416.00	1,557,600

ジーエス・ユアサ コーポレーション	168,000	561.00	94,248,000
サクサホールディングス	2,400	2,027.00	4,864,800
メルコホールディングス	4,500	3,800.00	17,100,000
テクノメディカ	2,100	1,990.00	4,179,000
日本電気	120,800	3,040.00	367,232,000
富士通	960,000	825.00	792,000,000
沖電気工業	37,900	1,621.00	61,435,900
岩崎通信機	4,100	833.00	3,415,300
電気興業	5,300	2,922.00	15,486,600
サンケン電気	55,000	668.00	36,740,000
ナカヨ	1,800	1,977.00	3,558,600
アイホン	5,300	1,950.00	10,335,000
ルネサスエレクトロニクス	48,400	1,365.00	66,066,000
セイコーエプソン	139,000	2,746.00	381,694,000
ワコム	72,600	616.00	44,721,600
アルバック	15,700	7,380.00	115,866,000
アクセル	4,000	876.00	3,504,000
E I Z O	8,600	5,150.00	44,290,000
ジャパンディスプレイ	191,800	218.00	41,812,400
日本信号	25,800	1,200.00	30,960,000
京三製作所	22,000	642.00	14,124,000
能美防災	12,400	2,027.00	25,134,800
ホーチキ	6,800	2,435.00	16,558,000
エレコム	8,100	2,561.00	20,744,100
パナソニック	1,066,900	1,606.00	1,713,441,400
アンリツ	68,100	1,189.00	80,970,900
富士通ゼネラル	28,500	2,355.00	67,117,500
日立国際電気	18,200	3,120.00	56,784,000
ソニー	623,300	5,065.00	3,157,014,500
T D K	48,900	9,110.00	445,479,000
帝国通信工業	4,200	1,289.00	5,413,800
タムラ製作所	36,000	782.00	28,152,000
アルプス電気	80,500	3,280.00	264,040,000
池上通信機	30,000	180.00	5,400,000
パイオニア	155,600	214.00	33,298,400
日本電波工業	8,600	776.00	6,673,600
鈴木	3,700	1,133.00	4,192,100
日本トリム	2,000	5,500.00	11,000,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	3,140.00	15,072,000
フォスター電機	10,900	2,675.00	29,157,500
クラリオン	49,000	427.00	20,923,000
S M K	24,000	510.00	12,240,000

ヨコオ	6,100	1,491.00	9,095,100	
ホシデン	23,600	1,722.00	40,639,200	
ヒロセ電機	15,100	16,250.00	245,375,000	
日本航空電子工業	24,000	1,971.00	47,304,000	
TOA	10,000	1,402.00	14,020,000	
マクセルホールディングス	18,600	2,439.00	45,365,400	
古野電気	11,200	805.00	9,016,000	
ユニデンホールディングス	26,000	301.00	7,826,000	
アルパイン	22,300	2,359.00	52,605,700	
スミダコーポレーション	9,600	1,925.00	18,480,000	
アイコム	5,200	2,744.00	14,268,800	
リオン	4,000	2,309.00	9,236,000	
本多通信工業	7,400	1,089.00	8,058,600	
船井電機	9,400	858.00	8,065,200	
横河電機	93,500	2,125.00	198,687,500	
新電元工業	3,300	8,280.00	27,324,000	
アズビル	28,000	4,915.00	137,620,000	
東亜ディーケーケー	4,700	979.00	4,601,300	
日本光電工業	39,100	2,592.00	101,347,200	
チノー	3,200	1,706.00	5,459,200	
共和電業	10,600	465.00	4,929,000	
日本電子材料	3,700	583.00	2,157,100	
堀場製作所	18,500	6,870.00	127,095,000	
アドバンテスト	52,100	2,201.00	114,672,100	
小野測器	4,100	734.00	3,009,400	
エスペック	8,300	2,741.00	22,750,300	
キーエンス	45,800	63,510.00	2,908,758,000	
日置電機	4,900	2,800.00	13,720,000	
シスメックス	72,600	8,610.00	625,086,000	
日本マイクロニクス	16,300	1,144.00	18,647,200	
メガチップス	7,400	3,240.00	23,976,000	
OBARA GROUP	5,500	7,680.00	42,240,000	
澤藤電機	1,000	2,374.00	2,374,000	
コーセル	13,000	1,539.00	20,007,000	
イリソ電子工業	7,900	6,910.00	54,589,000	
新日本無線	5,700	967.00	5,511,900	
オブテックスグループ	7,600	5,010.00	38,076,000	
千代田インテグレ	4,500	2,842.00	12,789,000	
アイ・オー・データ機器	4,000	1,038.00	4,152,000	
レーザーテック	20,500	2,806.00	57,523,000	
スタンレー電気	71,600	4,505.00	322,558,000	
岩崎電気	3,700	1,689.00	6,249,300	

ウシオ電機	56,700	1,598.00	90,606,600
岡谷電機産業	5,200	515.00	2,678,000
ハリオス テクノ ホールディング	8,000	994.00	7,952,000
日本セラミック	9,500	3,025.00	28,737,500
遠藤照明	4,800	1,260.00	6,048,000
古河電池	6,800	1,049.00	7,133,200
双信電機	4,200	801.00	3,364,200
山一電機	6,800	2,086.00	14,184,800
図研	6,100	1,952.00	11,907,200
日本電子	34,000	621.00	21,114,000
カシオ計算機	75,100	1,673.00	125,642,300
ファナック	88,700	27,060.00	2,400,222,000
日本シイエムケイ	16,600	1,003.00	16,649,800
エンプラス	4,300	4,630.00	19,909,000
大真空	3,500	1,686.00	5,901,000
ローム	41,900	12,030.00	504,057,000
浜松ホトニクス	68,000	3,820.00	259,760,000
三井ハイテック	12,400	2,107.00	26,126,800
新光電気工業	35,400	876.00	31,010,400
京セラ	153,300	7,782.00	1,192,980,600
太陽誘電	42,000	1,778.00	74,676,000
村田製作所	98,000	15,050.00	1,474,900,000
ユーシン	13,900	767.00	10,661,300
双葉電子工業	15,300	2,306.00	35,281,800
北陸電気工業	3,800	1,749.00	6,646,200
ニチコン	29,500	1,459.00	43,040,500
日本ケミコン	7,600	3,715.00	28,234,000
K O A	13,000	2,210.00	28,730,000
市光工業	14,000	1,000.00	14,000,000
小糸製作所	56,000	7,860.00	440,160,000
ミツバ	17,300	1,543.00	26,693,900
S C R E E Nホールディングス	17,700	9,820.00	173,814,000
キャノン電子	8,600	2,500.00	21,500,000
キャノン	502,700	4,374.00	2,198,809,800
リコー	280,800	1,031.00	289,504,800
M U T O Hホールディングス	1,300	2,497.00	3,246,100
東京エレクトロン	62,300	21,230.00	1,322,629,000
トヨタ紡織	27,200	2,306.00	62,723,200
芦森工業	1,900	2,944.00	5,593,600
ユニプレス	18,000	2,993.00	53,874,000
豊田自動織機	75,600	6,960.00	526,176,000
モリタホールディングス	15,000	2,038.00	30,570,000

三櫻工業	11,800	851.00	10,041,800
デンソー	207,200	6,265.00	1,298,108,000
東海理化電機製作所	24,600	2,287.00	56,260,200
三井造船	34,200	1,643.00	56,190,600
川崎重工業	72,900	3,675.00	267,907,500
名村造船所	28,000	677.00	18,956,000
サノヤスホールディングス	11,300	291.00	3,288,300
三菱ロジスネクスト	11,900	937.00	11,150,300
近畿車輛	1,400	2,793.00	3,910,200
日産自動車	1,102,100	1,093.50	1,205,146,350
いすゞ自動車	271,000	1,779.00	482,109,000
トヨタ自動車	1,135,400	7,047.00	8,001,163,800
日野自動車	133,800	1,407.00	188,256,600
三菱自動車工業	346,600	814.00	282,132,400
エフテック	6,000	1,722.00	10,332,000
レシップホールディングス	3,300	929.00	3,065,700
G M B	1,500	2,273.00	3,409,500
ファルテック	1,600	1,446.00	2,313,600
武蔵精密工業	10,000	3,385.00	33,850,000
日産車体	37,100	1,156.00	42,887,600
新明和工業	41,300	1,061.00	43,819,300
極東開発工業	17,800	1,960.00	34,888,000
日信工業	19,000	2,154.00	40,926,000
トピー工業	7,700	3,450.00	26,565,000
ティラド	3,400	4,095.00	13,923,000
曙ブレーキ工業	43,400	334.00	14,495,600
タチエス	15,800	2,112.00	33,369,600
N O K	50,200	2,621.00	131,574,200
フタバ産業	28,600	1,024.00	29,286,400
K Y B	9,700	6,390.00	61,983,000
大同メタル工業	11,700	1,032.00	12,074,400
プレス工業	49,600	667.00	33,083,200
ミクニ	11,800	745.00	8,791,000
太平洋工業	19,400	1,605.00	31,137,000
ケーヒン	21,500	2,169.00	46,633,500
河西工業	11,500	1,800.00	20,700,000
アイシン精機	76,900	6,070.00	466,783,000
富士機工	9,700	739.00	7,168,300
マツダ	293,600	1,500.50	440,546,800
今仙電機製作所	8,700	1,352.00	11,762,400
本田技研工業	840,500	3,789.00	3,184,654,500
スズキ	185,200	6,472.00	1,198,614,400

S U B A R U	290,100	3,703.00	1,074,240,300
安永	4,500	2,645.00	11,902,500
ヤマハ発動機	132,100	3,585.00	473,578,500
ショーワ	24,200	1,385.00	33,517,000
T B K	11,100	533.00	5,916,300
エクセディ	11,300	3,445.00	38,928,500
豊田合成	33,900	2,806.00	95,123,400
愛三工業	16,400	1,253.00	20,549,200
盟和産業	1,400	1,300.00	1,820,000
ヨロズ	9,400	2,448.00	23,011,200
エフ・シー・シー	15,300	2,875.00	43,987,500
シマノ	37,600	15,840.00	595,584,000
テイ・エス テック	21,700	4,585.00	99,494,500
ジャムコ	4,700	2,831.00	13,305,700
テルモ	143,100	5,240.00	749,844,000
クリエートメディック	3,100	1,267.00	3,927,700
日機装	32,300	1,044.00	33,721,200
島津製作所	111,600	2,592.00	289,267,200
J M S	8,700	632.00	5,498,400
長野計器	7,400	1,282.00	9,486,800
ブイ・テクノロジー	2,200	18,300.00	40,260,000
東京計器	6,000	1,388.00	8,328,000
愛知時計電機	1,200	4,310.00	5,172,000
インターアクション	3,500	981.00	3,433,500
オーバル	9,200	305.00	2,806,000
東京精密	16,900	4,625.00	78,162,500
マニー	11,400	3,305.00	37,677,000
ニコン	162,700	2,331.00	379,253,700
トプコン	50,200	2,412.00	121,082,400
オリンパス	139,100	4,315.00	600,216,500
理研計器	8,900	2,484.00	22,107,600
タムロン	7,500	2,473.00	18,547,500
H O Y A	192,100	5,651.00	1,085,557,100
シード	1,000	4,690.00	4,690,000
ノーリツ鋼機	9,500	2,348.00	22,306,000
エー・アンド・デイ	8,600	743.00	6,389,800
シチズン時計	111,500	839.00	93,548,500
リズム時計工業	3,600	2,336.00	8,409,600
大研医器	8,400	770.00	6,468,000
メニコン	6,400	6,350.00	40,640,000
松風	4,600	1,458.00	6,706,800
セイコーホールディングス	14,400	3,270.00	47,088,000

ニプロ	64,700	1,560.00	100,932,000
中本パックス	900	3,545.00	3,190,500
スノーピーク	2,900	1,492.00	4,326,800
パラマウントベッドホールディングス	9,800	5,340.00	52,332,000
トランザクション	4,200	1,013.00	4,254,600
S H O - B I	3,100	434.00	1,345,400
ニホンフラッシュ	4,400	2,613.00	11,497,200
前田工織	9,300	2,090.00	19,437,000
永大産業	12,000	567.00	6,804,000
アートネイチャー	10,000	800.00	8,000,000
ダンロップスポーツ	5,900	1,588.00	9,369,200
バンダイナムコホールディングス	96,500	3,735.00	360,427,500
アイフィスジャパン	2,100	611.00	1,283,100
共立印刷	15,500	372.00	5,766,000
S H O E I	4,200	4,675.00	19,635,000
フランスベッドホールディングス	11,100	1,048.00	11,632,800
パイロットコーポレーション	16,300	5,390.00	87,857,000
萩原工業	5,200	1,944.00	10,108,800
トッパン・フォームズ	20,000	1,223.00	24,460,000
フジシールインターナショナル	20,900	3,855.00	80,569,500
タカラトミー	39,100	1,536.00	60,057,600
廣済堂	8,700	432.00	3,758,400
A s - m e エステール	2,700	1,135.00	3,064,500
アーク	39,300	130.00	5,109,000
タカノ	4,100	1,181.00	4,842,100
プロネクサス	8,700	1,399.00	12,171,300
ホクシン	6,600	201.00	1,326,600
ウッドワン	3,100	1,568.00	4,860,800
大建工業	7,300	2,861.00	20,885,300
凸版印刷	264,000	1,031.00	272,184,000
大日本印刷	122,200	2,477.00	302,689,400
図書印刷	6,300	998.00	6,287,400
共同印刷	2,900	3,665.00	10,628,500
N I S S H A	18,600	3,385.00	62,961,000
光村印刷	800	2,445.00	1,956,000
宝印刷	4,900	1,771.00	8,677,900
アシックス	92,800	1,650.00	153,120,000
ツツミ	2,900	2,131.00	6,179,900
小松ウオール工業	3,200	2,454.00	7,852,800
ヤマハ	62,900	4,130.00	259,777,000
河合楽器製作所	3,100	2,564.00	7,948,400
クリナップ	8,700	877.00	7,629,900

ピジョン	56,400	4,540.00	256,056,000
兼松サステック	700	2,127.00	1,488,900
キングジム	7,800	1,009.00	7,870,200
リンテック	22,200	3,110.00	69,042,000
イトーキ	19,700	841.00	16,567,700
任天堂	57,500	44,380.00	2,551,850,000
三菱鉛筆	15,400	2,427.00	37,375,800
タカラスタンダード	19,300	1,791.00	34,566,300
コクヨ	44,800	2,128.00	95,334,400
ナカバヤシ	9,200	727.00	6,688,400
グロープライド	4,200	2,000.00	8,400,000
岡村製作所	32,600	1,465.00	47,759,000
美津濃	9,200	3,350.00	30,820,000
東京電力ホールディングス	745,500	455.00	339,202,500
中部電力	285,700	1,408.50	402,408,450
関西電力	381,000	1,479.00	563,499,000
中国電力	129,100	1,233.00	159,180,300
北陸電力	91,500	970.00	88,755,000
東北電力	218,700	1,499.00	327,831,300
四国電力	84,100	1,509.00	126,906,900
九州電力	206,200	1,265.00	260,843,000
北海道電力	93,600	796.00	74,505,600
沖縄電力	15,100	2,919.00	44,076,900
電源開発	74,300	3,170.00	235,531,000
エフオン	4,600	1,515.00	6,969,000
イーレックス	14,700	1,055.00	15,508,500
東京瓦斯	199,200	2,638.00	525,489,600
大阪瓦斯	181,200	2,224.00	402,988,800
東邦瓦斯	46,300	3,140.00	145,382,000
北海道瓦斯	25,000	296.00	7,400,000
広島ガス	19,200	368.00	7,065,600
西部瓦斯	11,300	2,692.00	30,419,600
静岡ガス	26,500	962.00	25,493,000
メタウォーター	5,300	2,824.00	14,967,200
SBSホールディングス	9,200	1,016.00	9,347,200
東武鉄道	99,800	3,735.00	372,753,000
相鉄ホールディングス	29,900	2,987.00	89,311,300
東京急行電鉄	253,600	1,828.00	463,580,800
京浜急行電鉄	127,900	2,169.00	277,415,100
小田急電鉄	138,900	2,464.00	342,249,600
京王電鉄	52,200	5,200.00	271,440,000
京成電鉄	65,000	3,760.00	244,400,000

富士急行	12,700	3,255.00	41,338,500
新京成電鉄	2,400	2,115.00	5,076,000
東日本旅客鉄道	167,700	11,255.00	1,887,463,500
西日本旅客鉄道	84,300	8,413.00	709,215,900
東海旅客鉄道	83,600	21,155.00	1,768,558,000
西武ホールディングス	119,000	2,117.00	251,923,000
鴻池運輸	13,200	1,905.00	25,146,000
西日本鉄道	25,900	3,020.00	78,218,000
ハマキョウレックス	6,600	3,110.00	20,526,000
サカイ引越センター	4,900	5,680.00	27,832,000
近鉄グループホールディングス	88,400	4,475.00	395,590,000
阪急阪神ホールディングス	118,000	4,590.00	541,620,000
南海電気鉄道	41,900	2,844.00	119,163,600
京阪ホールディングス	39,400	3,335.00	131,399,000
神戸電鉄	2,100	3,905.00	8,200,500
名古屋鉄道	68,000	2,835.00	192,780,000
山陽電気鉄道	6,800	2,864.00	19,475,200
日本通運	34,700	7,350.00	255,045,000
ヤマトホールディングス	155,000	2,370.00	367,350,000
山九	22,700	4,815.00	109,300,500
丸運	5,000	334.00	1,670,000
丸全昭和運輸	31,000	508.00	15,748,000
センコーグループホールディングス	53,200	835.00	44,422,000
トナミホールディングス	2,100	5,630.00	11,823,000
ニッコンホールディングス	33,600	3,050.00	102,480,000
日本石油輸送	1,100	3,775.00	4,152,500
福山通運	12,900	4,130.00	53,277,000
セイノーホールディングス	66,200	1,844.00	122,072,800
神奈川中央交通	2,200	3,675.00	8,085,000
日立物流	19,400	2,975.00	57,715,000
丸和運輸機関	4,700	3,210.00	15,087,000
C & F ロジホールディングス	9,700	1,597.00	15,490,900
九州旅客鉄道	74,200	3,525.00	261,555,000
日本郵船	74,200	2,704.00	200,636,800
商船三井	56,200	3,655.00	205,411,000
川崎汽船	41,100	2,879.00	118,326,900
N S ユナイテッド海運	4,400	2,735.00	12,034,000
飯野海運	46,300	608.00	28,150,400
共栄タンカー	1,000	2,171.00	2,171,000
乾汽船	6,800	758.00	5,154,400
日本航空	164,100	4,295.00	704,809,500
A N A ホールディングス	173,300	4,678.00	810,697,400

パスコ	9,000	328.00	2,952,000	
トランコム	2,500	7,890.00	19,725,000	
日新	7,600	3,080.00	23,408,000	
三菱倉庫	30,600	3,045.00	93,177,000	
三井倉庫ホールディングス	51,000	371.00	18,921,000	
住友倉庫	61,000	818.00	49,898,000	
澁澤倉庫	4,900	2,034.00	9,966,600	
東陽倉庫	16,000	328.00	5,248,000	
日本トランスシティ	21,000	467.00	9,807,000	
ケイヒン	1,700	1,651.00	2,806,700	
中央倉庫	5,400	1,187.00	6,409,800	
川西倉庫	1,800	2,847.00	5,124,600	
安田倉庫	7,900	920.00	7,268,000	
東洋埠頭	2,700	1,854.00	5,005,800	
宇徳	7,600	536.00	4,073,600	
上組	55,700	2,621.00	145,989,700	
サンリツ	2,300	890.00	2,047,000	
キムラユニティー	2,400	1,187.00	2,848,800	
キューソー流通システム	2,600	3,190.00	8,294,000	
郵船ロジスティクス	8,600	1,501.00	12,908,600	
近鉄エクスプレス	16,700	2,344.00	39,144,800	
東海運	5,000	414.00	2,070,000	
エーアイティー	6,300	1,381.00	8,700,300	
内外トランスライン	3,100	1,991.00	6,172,100	
日本コンセプト	1,700	1,285.00	2,184,500	
NEC ネットエスアイ	10,200	2,878.00	29,355,600	
システナ	7,400	3,715.00	27,491,000	
デジタルアーツ	4,500	4,860.00	21,870,000	
新日鉄住金ソリューションズ	14,500	2,864.00	41,528,000	
キューブシステム	5,500	819.00	4,504,500	
コア	4,000	1,568.00	6,272,000	
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	1,544.00	6,948,000	
T I S	30,600	3,970.00	121,482,000	
ネオス	3,000	425.00	1,275,000	
電算システム	3,300	2,154.00	7,108,200	
グリー	56,300	748.00	42,112,400	
コーエーテクモホールディングス	15,700	2,281.00	35,811,700	
三菱総合研究所	4,000	3,750.00	15,000,000	
ボルテージ	1,800	1,086.00	1,954,800	
電算	1,100	2,451.00	2,696,100	
A G S	5,300	886.00	4,695,800	
ファインデックス	7,800	772.00	6,021,600	

ヒト・コミュニケーションズ	2,100	2,427.00	5,096,700
ブレインパッド	2,100	1,440.00	3,024,000
K L a b	17,700	1,845.00	32,656,500
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,700	1,925.00	12,897,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,086.00	1,737,600
ネクソン	102,400	3,200.00	327,680,000
アイスタイル	21,200	922.00	19,546,400
エムアップ	3,100	1,388.00	4,302,800
エイチーム	6,300	3,210.00	20,223,000
テクノスジャパン	8,400	974.00	8,181,600
コロプラ	29,700	1,196.00	35,521,200
モバイルクリエイト	7,800	405.00	3,159,000
ブロードリーフ	22,800	1,111.00	25,330,800
ハーツユナイテッドグループ	4,900	1,782.00	8,731,800
メディアドゥホールディングス	3,000	2,482.00	7,446,000
サイバーリンクス	1,500	1,365.00	2,047,500
フィックスターズ	1,600	5,580.00	8,928,000
VOYAGE GROUP	4,700	1,488.00	6,993,600
オブティム	1,600	2,562.00	4,099,200
セレス	2,900	1,817.00	5,269,300
ベリサーブ	1,200	3,870.00	4,644,000
ティーガイア	9,200	2,597.00	23,892,400
セック	1,000	2,524.00	2,524,000
日本アジアグループ	9,600	467.00	4,483,200
豆蔵ホールディングス	6,900	1,253.00	8,645,700
テクマトリックス	5,100	1,762.00	8,986,200
プロシップ	1,400	2,191.00	3,067,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	249,000	291.00	72,459,000
GMOペイメントゲートウェイ	6,500	8,370.00	54,405,000
ザッパラス	5,100	425.00	2,167,500
システムリサーチ	1,000	2,110.00	2,110,000
インターネットイニシアティブ	15,000	2,111.00	31,665,000
さくらインターネット	11,100	856.00	9,501,600
ヴィンクス	1,100	1,232.00	1,355,200
GMOクラウド	2,100	2,443.00	5,130,300
SRAホールディングス	4,900	3,565.00	17,468,500
Minor iソリューションズ	1,900	1,481.00	2,813,900
朝日ネット	8,600	532.00	4,575,200
アドソル日進	3,600	1,272.00	4,579,200
フリービット	7,000	900.00	6,300,000
コムチュア	4,700	2,824.00	13,272,800
サイバーコム	1,800	1,095.00	1,971,000

メディカル・データ・ビジョン	3,500	2,269.00	7,941,500
gumi	10,700	1,024.00	10,956,800
ショーケース・ティービー	1,800	1,600.00	2,880,000
モバイルファクトリー	1,800	1,356.00	2,440,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,400	1,968.00	2,755,200
P C Iホールディングス	1,600	3,060.00	4,896,000
パイプドHD	1,500	1,201.00	1,801,500
アイビーシー	1,100	1,211.00	1,332,100
オープンドア	1,200	6,500.00	7,800,000
アカツキ	1,800	7,220.00	12,996,000
L I N E	25,900	5,010.00	129,759,000
シンクロ・フード	800	1,899.00	1,519,200
オークネット	3,000	1,443.00	4,329,000
A O I T Y O H o l d i n g s	7,600	1,284.00	9,758,400
マクロミル	11,900	2,767.00	32,927,300
ソルクシーズ	3,700	830.00	3,071,000
フェイス	3,300	1,334.00	4,402,200
ハイマックス	1,300	1,680.00	2,184,000
野村総合研究所	61,300	5,150.00	315,695,000
サイバネットシステム	7,700	729.00	5,613,300
C Eホールディングス	2,800	823.00	2,304,400
日本システム技術	1,200	1,318.00	1,581,600
インテージホールディングス	10,600	1,382.00	14,649,200
東邦システムサイエンス	3,200	795.00	2,544,000
ソースネクスト	6,600	1,395.00	9,207,000
フォーカスシステムズ	5,400	894.00	4,827,600
クレスコ	2,100	4,825.00	10,132,500
フジ・メディア・ホールディングス	96,100	1,696.00	162,985,600
オービック	28,900	8,100.00	234,090,000
ジャストシステム	15,000	2,251.00	33,765,000
T D Cソフト	4,100	1,096.00	4,493,600
ヤフー	661,000	510.00	337,110,000
トレンドマイクロ	44,800	6,530.00	292,544,000
インフォメーション・ディベロプメント	3,000	1,357.00	4,071,000
日本オラクル	14,800	10,580.00	156,584,000
アルファシステムズ	3,100	2,423.00	7,511,300
フューチャー	12,600	1,266.00	15,951,600
C A C H o l d i n g s	7,000	1,070.00	7,490,000
ソフトバンク・テクノロジー	3,900	1,832.00	7,144,800
トーセ	2,500	2,055.00	5,137,500
オービックビジネスコンサルタント	4,700	6,060.00	28,482,000
伊藤忠テクノソリューションズ	20,900	4,795.00	100,215,500

アイティフォー	11,300	754.00	8,520,200
東計電算	1,700	3,390.00	5,763,000
エクスネット	1,600	910.00	1,456,000
大塚商会	27,600	8,490.00	234,324,000
サイボウズ	12,500	496.00	6,200,000
ソフトブレーン	7,600	413.00	3,138,800
電通国際情報サービス	5,700	2,426.00	13,828,200
デジタルガレージ	16,500	3,100.00	51,150,000
E Mシステムズ	3,200	2,512.00	8,038,400
ウェザーニューズ	3,100	3,420.00	10,602,000
C I J	8,000	710.00	5,680,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,792.00	1,792,000
日本エンタープライズ	10,000	244.00	2,440,000
WOWOW	4,400	3,335.00	14,674,000
スカラ	6,600	736.00	4,857,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	7,900	944.00	7,457,600
ネットワンシステムズ	37,500	1,687.00	63,262,500
システムソフト	22,800	141.00	3,214,800
アルゴグラフィックス	4,300	3,505.00	15,071,500
マーベラス	15,700	1,051.00	16,500,700
エイベックス	17,100	1,683.00	28,779,300
日本ユニシス	25,500	2,202.00	56,151,000
兼松エレクトロニクス	5,900	3,320.00	19,588,000
東京放送ホールディングス	55,300	2,767.00	153,015,100
日本テレビホールディングス	84,200	2,043.00	172,020,600
朝日放送	9,300	879.00	8,174,700
テレビ朝日ホールディングス	25,200	2,366.00	59,623,200
スカパーJ S A Tホールディングス	70,200	501.00	35,170,200
テレビ東京ホールディングス	7,600	2,485.00	18,886,000
日本BS放送	3,200	1,309.00	4,188,800
ビジョン	2,400	2,694.00	6,465,600
ワイヤレスゲート	4,400	1,362.00	5,992,800
コネクシオ	6,600	2,303.00	15,199,800
クロップス	2,100	1,044.00	2,192,400
日本電信電話	657,700	5,754.00	3,784,405,800
K D D I	825,200	3,235.00	2,669,522,000
光通信	11,100	16,130.00	179,043,000
N T T ドコモ	678,400	2,889.50	1,960,236,800
エムティーアイ	12,600	657.00	8,278,200
G M O インターネット	33,500	1,920.00	64,320,000
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	719.00	1,222,300
カドカワ	26,800	1,320.00	35,376,000

学研ホールディングス	3,100	4,280.00	13,268,000	
ゼンリン	11,100	3,810.00	42,291,000	
昭文社	4,400	765.00	3,366,000	
インプレスホールディングス	7,600	169.00	1,284,400	
アイネット	5,300	1,736.00	9,200,800	
松竹	6,100	18,890.00	115,229,000	
東宝	60,300	3,865.00	233,059,500	
東映	3,400	11,720.00	39,848,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	284,800	1,342.00	382,201,600	
ピー・シー・エー	1,400	1,755.00	2,457,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,675.00	2,847,500	
D T S	9,500	3,640.00	34,580,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	42,600	5,310.00	226,206,000	
シーイーシー	5,500	2,690.00	14,795,000	
カプコン	19,700	3,480.00	68,556,000	
アイ・エス・ピー	1,900	1,266.00	2,405,400	
ジャステック	5,400	1,267.00	6,841,800	
S C S K	21,900	5,120.00	112,128,000	
日本システムウエア	3,100	2,395.00	7,424,500	
アイネス	11,700	1,123.00	13,139,100	
T K C	8,600	3,985.00	34,271,000	
富士ソフト	12,700	3,545.00	45,021,500	
N S D	15,100	2,352.00	35,515,200	
コナミホールディングス	37,500	6,300.00	236,250,000	
福井コンピュータホールディングス	2,700	3,565.00	9,625,500	
J B C Cホールディングス	7,400	1,139.00	8,428,600	
ミロク情報サービス	8,100	2,987.00	24,194,700	
ソフトバンクグループ	414,900	9,483.00	3,934,496,700	
ハウスイ	700	1,203.00	842,100	
高千穂交易	3,600	1,165.00	4,194,000	
伊藤忠食品	2,300	6,250.00	14,375,000	
エレマテック	4,300	2,650.00	11,395,000	
J A L U X	2,600	2,822.00	7,337,200	
あらた	4,500	6,010.00	27,045,000	
トーメンデバイス	1,400	3,345.00	4,683,000	
東京エレクトロン デバイス	3,300	2,007.00	6,623,100	
フィールズ	7,100	1,233.00	8,754,300	
双日	544,300	325.00	176,897,500	
アルフレッサ ホールディングス	102,200	2,521.00	257,646,200	
横浜冷凍	21,700	1,189.00	25,801,300	
神栄	1,300	1,522.00	1,978,600	
ラサ商事	4,100	929.00	3,808,900	

ラクーン	5,900	818.00	4,826,200
アルコニックス	9,800	2,135.00	20,923,000
神戸物産	6,000	5,100.00	30,600,000
ペッパーフードサービス	4,900	6,100.00	29,890,000
あい ホールディングス	13,100	2,772.00	36,313,200
ディーブイエックス	3,300	1,363.00	4,497,900
ダイワボウホールディングス	7,800	4,560.00	35,568,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,100	2,401.00	41,057,100
ラクト・ジャパン	1,300	4,440.00	5,772,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,300	976.00	16,884,800
八洲電機	7,100	1,009.00	7,163,900
メディアスホールディングス	1,400	2,492.00	3,488,800
U K Cホールディングス	5,900	2,022.00	11,929,800
ジューテックホールディングス	2,100	1,335.00	2,803,500
大光	2,100	987.00	2,072,700
O C H Iホールディングス	2,700	1,445.00	3,901,500
T O K A Iホールディングス	48,600	879.00	42,719,400
大阪工機	1,400	1,156.00	1,618,400
三洋貿易	5,100	2,518.00	12,841,800
ビューティガレージ	1,200	2,227.00	2,672,400
ウイン・パートナーズ	6,700	1,328.00	8,897,600
ミタチ産業	2,100	1,512.00	3,175,200
シップヘルスケアホールディングス	19,200	3,605.00	69,216,000
明治電機工業	3,200	1,777.00	5,686,400
デリカフーズホールディングス	1,800	1,505.00	2,709,000
スターティア	2,100	1,071.00	2,249,100
コメダホールディングス	17,000	1,985.00	33,745,000
富士興産	3,600	578.00	2,080,800
協栄産業	1,100	2,150.00	2,365,000
小野建	8,000	2,011.00	16,088,000
佐島電機	6,800	1,022.00	6,949,600
エコートレーディング	2,100	692.00	1,453,200
伯東	5,600	1,883.00	10,544,800
コンドーテック	7,300	1,064.00	7,767,200
中山福	5,300	788.00	4,176,400
ナガイレーベン	12,200	2,700.00	32,940,000
三菱食品	10,100	3,455.00	34,895,500
松田産業	6,700	1,816.00	12,167,200
第一興商	13,700	5,430.00	74,391,000
メディバルホールディングス	92,200	2,201.00	202,932,200
S P K	2,000	3,210.00	6,420,000
萩原電気	3,100	3,330.00	10,323,000

アズワン	7,200	6,690.00	48,168,000
スズデン	3,200	1,662.00	5,318,400
尾家産業	2,700	1,294.00	3,493,800
シモジマ	5,600	1,198.00	6,708,800
ドウシシャ	9,800	2,291.00	22,451,800
小津産業	2,000	2,230.00	4,460,000
高速	5,500	1,265.00	6,957,500
たけびし	3,200	1,886.00	6,035,200
黒田電気	11,500	2,719.00	31,268,500
リックス	2,100	1,834.00	3,851,400
丸文	8,200	1,059.00	8,683,800
ハピネット	6,300	1,941.00	12,228,300
橋本総業ホールディングス	1,900	1,748.00	3,321,200
日本ライフライン	13,100	4,450.00	58,295,000
エクセル	3,700	2,561.00	9,475,700
マルカキカイ	3,000	2,172.00	6,516,000
I D O M	27,900	845.00	23,575,500
日本エム・ディ・エム	6,200	887.00	5,499,400
進和	5,400	2,623.00	14,164,200
エスケイジャパン	2,300	468.00	1,076,400
ダイトロン	4,200	2,420.00	10,164,000
シークス	5,900	4,735.00	27,936,500
田中商事	2,800	790.00	2,212,000
オーハシテクニカ	5,200	1,706.00	8,871,200
白銅	3,300	2,243.00	7,401,900
伊藤忠商事	675,000	1,948.50	1,315,237,500
丸紅	755,800	749.50	566,472,100
高島	1,600	2,183.00	3,492,800
長瀬産業	55,400	2,007.00	111,187,800
蝶理	5,900	2,085.00	12,301,500
豊田通商	102,700	4,365.00	448,285,500
三共生興	15,700	480.00	7,536,000
兼松	39,200	1,398.00	54,801,600
ツカモトコーポレーション	1,700	1,301.00	2,211,700
三井物産	781,300	1,703.00	1,330,553,900
日本紙パルプ商事	4,800	4,210.00	20,208,000
日立ハイテクノロジーズ	32,000	4,725.00	151,200,000
カメイ	12,000	1,826.00	21,912,000
東都水産	1,400	2,011.00	2,815,400
O U G ホールディングス	1,500	2,688.00	4,032,000
スターゼン	3,600	5,380.00	19,368,000
山善	35,900	1,291.00	46,346,900

椿本興業	2,100	2,771.00	5,819,100
住友商事	580,200	1,840.00	1,067,568,000
内田洋行	4,200	3,230.00	13,566,000
三菱商事	645,400	2,914.50	1,881,018,300
第一実業	4,200	3,405.00	14,301,000
キャノンマーケティングジャパン	26,300	2,960.00	77,848,000
西華産業	5,700	2,750.00	15,675,000
佐藤商事	8,200	1,253.00	10,274,600
菱洋エレクトロ	8,600	1,912.00	16,443,200
東京産業	9,200	522.00	4,802,400
ユアサ商事	8,700	3,990.00	34,713,000
神鋼商事	2,100	2,930.00	6,153,000
小林産業	6,200	392.00	2,430,400
阪和興業	17,200	4,565.00	78,518,000
正栄食品工業	5,100	4,885.00	24,913,500
カナデン	8,800	1,400.00	12,320,000
菱電商事	6,600	1,742.00	11,497,200
フルサト工業	5,100	1,845.00	9,409,500
岩谷産業	20,400	3,500.00	71,400,000
すてきナイスグループ	3,900	1,551.00	6,048,900
昭光通商	32,000	123.00	3,936,000
ニチモウ	1,400	1,948.00	2,727,200
極東貿易	13,000	449.00	5,837,000
イワキ	13,000	477.00	6,201,000
三愛石油	24,700	1,558.00	38,482,600
稲畑産業	22,100	1,689.00	37,326,900
G S Iクレオス	2,500	1,641.00	4,102,500
明和産業	8,500	465.00	3,952,500
ワキタ	19,600	1,298.00	25,440,800
東邦ホールディングス	27,200	2,401.00	65,307,200
サンゲツ	31,100	2,051.00	63,786,100
ミツウロコグループホールディングス	13,400	809.00	10,840,600
シナネンホールディングス	4,400	2,539.00	11,171,600
伊藤忠エネクス	20,400	1,104.00	22,521,600
サンリオ	25,800	1,872.00	48,297,600
サンワテクノス	5,500	2,129.00	11,709,500
リョーサン	11,600	4,165.00	48,314,000
新光商事	10,100	1,958.00	19,775,800
トーホー	4,200	2,757.00	11,579,400
三信電気	8,500	1,757.00	14,934,500
東陽テクニカ	10,600	976.00	10,345,600
モスフードサービス	12,100	3,430.00	41,503,000

加賀電子	8,300	3,190.00	26,477,000
ソーダニッカ	9,500	590.00	5,605,000
立花エレテック	6,200	1,922.00	11,916,400
フォーバル	4,100	813.00	3,333,300
PALTAC	12,900	4,960.00	63,984,000
三谷産業	10,000	425.00	4,250,000
西本Wismettacホールディングス	1,900	4,010.00	7,619,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,665.00	1,332,000
ヤマタネ	4,600	2,252.00	10,359,200
丸紅建材リース	9,000	238.00	2,142,000
日鉄住金物産	7,200	6,050.00	43,560,000
トラスコ中山	19,100	3,210.00	61,311,000
オートバックスセブン	36,600	2,140.00	78,324,000
モリト	7,400	1,059.00	7,836,600
加藤産業	14,400	4,110.00	59,184,000
イノテック	7,900	1,146.00	9,053,400
イエローハット	8,700	3,295.00	28,666,500
J Kホールディングス	9,300	995.00	9,253,500
日伝	7,600	2,307.00	17,533,200
北沢産業	7,700	290.00	2,233,000
杉本商事	5,000	1,729.00	8,645,000
因幡電機産業	12,100	5,080.00	61,468,000
バイテックホールディングス	4,200	1,718.00	7,215,600
ミスミグループ本社	106,800	3,310.00	353,508,000
アルテック	7,900	399.00	3,152,100
タキヒヨー	3,100	2,391.00	7,412,100
蔵王産業	1,500	1,852.00	2,778,000
スズケン	42,000	4,545.00	190,890,000
ジェコス	6,400	1,403.00	8,979,200
ルネサスイーストン	8,500	714.00	6,069,000
ローソン	23,300	7,850.00	182,905,000
サンエー	7,000	5,410.00	37,870,000
カワチ薬品	7,200	2,817.00	20,282,400
エービーシー・マート	16,800	6,410.00	107,688,000
ハードオフコーポレーション	4,200	1,250.00	5,250,000
アスクル	9,700	3,250.00	31,525,000
ゲオホールディングス	16,900	2,229.00	37,670,100
アダストリア	14,200	2,541.00	36,082,200
ジーフット	5,700	779.00	4,440,300
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,200	734.00	880,800
くらコーポレーション	5,400	5,470.00	29,538,000
キャンドウ	4,500	1,805.00	8,122,500

パルグループホールディングス	4,700	3,535.00	16,614,500
エディオン	35,800	1,329.00	47,578,200
サーラコーポレーション	16,000	698.00	11,168,000
ワッツ	3,800	1,195.00	4,541,000
ハローズ	3,500	2,678.00	9,373,000
あみやき亭	2,000	5,070.00	10,140,000
ひらまつ	12,900	570.00	7,353,000
ゲンキー	4,000	4,010.00	16,040,000
大黒天物産	2,200	5,260.00	11,572,000
ハニーズホールディングス	9,000	1,165.00	10,485,000
ファーマライズホールディングス	2,300	608.00	1,398,400
アルペン	7,100	2,433.00	17,274,300
クオール	9,600	2,229.00	21,398,400
ジーンズ	6,300	5,780.00	36,414,000
ビックカメラ	53,100	1,603.00	85,119,300
D C Mホールディングス	49,700	1,093.00	54,322,100
MonotaRO	32,700	3,295.00	107,746,500
東京一番フーズ	2,500	609.00	1,522,500
DDホールディングス	2,000	4,725.00	9,450,000
きちり	2,600	813.00	2,113,800
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,701.00	20,797,700
J.フロント リテイリング	109,900	1,972.00	216,722,800
ドトール・日レスホールディングス	16,200	2,766.00	44,809,200
マツモトキヨシホールディングス	19,000	9,420.00	178,980,000
ブロンコビリー	4,900	3,470.00	17,003,000
スタートトゥデイ	90,400	3,550.00	320,920,000
トレジャー・ファクトリー	2,800	995.00	2,786,000
物語コーポレーション	2,600	9,810.00	25,506,000
ココカラファイン	9,600	7,300.00	70,080,000
三越伊勢丹ホールディングス	172,100	1,373.00	236,293,300
Hamee	2,900	1,752.00	5,080,800
ウエルシアホールディングス	24,300	5,040.00	122,472,000
クリエイトSDホールディングス	13,600	2,963.00	40,296,800
丸善CHIホールディングス	10,700	348.00	3,723,600
ミサワ	1,900	509.00	967,100
ティーライフ	1,300	1,370.00	1,781,000
エー・ピーカンパニー	1,900	905.00	1,719,500
チムニー	2,900	2,867.00	8,314,300
シュッピン	2,800	3,195.00	8,946,000
ネクステージ	9,900	840.00	8,316,000
ジョイフル本田	15,000	3,415.00	51,225,000
鳥貴族	3,400	3,540.00	12,036,000

キリン堂ホールディングス	3,400	2,026.00	6,888,400	
ホットランド	5,400	1,539.00	8,310,600	
すかいらーく	57,100	1,667.00	95,185,700	
綿半ホールディングス	3,500	2,943.00	10,300,500	
ヨシックス	1,500	3,460.00	5,190,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,700	1,186.00	36,410,200	
ブックオフコーポレーション	5,200	821.00	4,269,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	1,051.00	4,098,900	
B E E N O S	1,500	1,814.00	2,721,000	
あさひ	7,000	1,382.00	9,674,000	
日本調剤	3,300	3,620.00	11,946,000	
コスモス薬品	4,600	24,990.00	114,954,000	
トーエル	4,600	1,080.00	4,968,000	
一六堂	2,300	511.00	1,175,300	
オンリー	1,500	944.00	1,416,000	
セブン&アイ・ホールディングス	385,500	4,696.00	1,810,308,000	
薬王堂	4,100	3,505.00	14,370,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	24,800	1,283.00	31,818,400	
ツルハホールディングス	18,500	16,410.00	303,585,000	
サンマルクホールディングス	6,700	3,045.00	20,401,500	
フェリシモ	2,400	1,390.00	3,336,000	
トリドールホールディングス	11,400	3,945.00	44,973,000	
T O K Y O B A S E	1,800	4,930.00	8,874,000	
サツドラホールディングス	1,300	2,012.00	2,615,600	
ダイユー・リックホールディングス	4,400	1,186.00	5,218,400	
パロックジャパンリミテッド	7,500	964.00	7,230,000	
クスリのアオキホールディングス	7,300	6,910.00	50,443,000	
スシローグローバルホールディングス	8,400	4,310.00	36,204,000	
L I X I L ビバ	8,800	1,949.00	17,151,200	
メディカルシステムネットワーク	10,600	698.00	7,398,800	
総合メディカル	4,000	5,870.00	23,480,000	
はるやまホールディングス	4,400	1,027.00	4,518,800	
ノジマ	16,200	2,646.00	42,865,200	
カップ・クリエイト	11,500	1,281.00	14,731,500	
ライトオン	7,900	908.00	7,173,200	
良品計画	12,200	36,550.00	445,910,000	
三城ホールディングス	11,700	477.00	5,580,900	
アドヴァン	9,500	1,067.00	10,136,500	
アルビス	2,100	4,180.00	8,778,000	
コナカ	12,000	628.00	7,536,000	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,817.00	2,180,400	

G - 7ホールディングス	2,800	2,664.00	7,459,200
イオン北海道	9,400	727.00	6,833,800
コジマ	16,200	381.00	6,172,200
ヒマラヤ	2,600	1,092.00	2,839,200
コーナン商事	13,100	2,446.00	32,042,600
エコス	3,800	1,224.00	4,651,200
マルシェ	2,600	800.00	2,080,000
ドンキホーテホールディングス	59,600	5,770.00	343,892,000
西松屋チェーン	20,300	1,371.00	27,831,300
ゼンショーホールディングス	47,800	1,954.00	93,401,200
幸楽苑ホールディングス	5,900	1,800.00	10,620,000
ハークスレイ	2,400	1,196.00	2,870,400
サイゼリヤ	13,700	3,810.00	52,197,000
V Tホールディングス	31,400	567.00	17,803,800
魚力	2,700	1,178.00	3,180,600
ポブラ	2,400	713.00	1,711,200
フジ・コーポレーション	1,700	2,242.00	3,811,400
ユナイテッドアローズ	11,400	4,550.00	51,870,000
ハイデイ日高	10,100	3,630.00	36,663,000
京都きもの友禅	6,000	802.00	4,812,000
コロワイド	30,600	2,173.00	66,493,800
ピーシーデポコーポレーション	13,900	858.00	11,926,200
壱番屋	6,500	4,485.00	29,152,500
トップカルチャー	3,600	502.00	1,807,200
P L A N T	2,200	1,369.00	3,011,800
スギホールディングス	20,200	5,840.00	117,968,000
ヴィア・ホールディングス	8,100	751.00	6,083,100
スクロール	14,400	491.00	7,070,400
ヨンドシーホールディングス	9,400	2,969.00	27,908,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	29,400	7,750.00	227,850,000
木曽路	11,300	2,756.00	31,142,800
S R Sホールディングス	11,000	938.00	10,318,000
千趣会	16,700	680.00	11,356,000
タカキュー	7,700	228.00	1,755,600
ケーヨー	17,200	738.00	12,693,600
上新電機	10,900	4,160.00	45,344,000
日本瓦斯	16,900	3,965.00	67,008,500
ロイヤルホールディングス	16,400	3,210.00	52,644,000
いなげや	10,300	1,855.00	19,106,500
島忠	22,300	3,360.00	74,928,000
チヨダ	10,900	3,035.00	33,081,500
ライフコーポレーション	7,000	3,120.00	21,840,000

リンガーハット	11,400	2,565.00	29,241,000
MrMaxHD	11,700	847.00	9,909,900
テンアライド	8,500	499.00	4,241,500
AOKIホールディングス	18,500	1,716.00	31,746,000
オークワ	13,000	1,164.00	15,132,000
コメリ	14,200	3,235.00	45,937,000
青山商事	17,700	4,305.00	76,198,500
しまむら	10,700	13,550.00	144,985,000
はせがわ	5,200	504.00	2,620,800
高島屋	144,000	1,137.00	163,728,000
松屋	18,600	1,428.00	26,560,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	43,600	2,217.00	96,661,200
近鉄百貨店	3,600	3,920.00	14,112,000
パルコ	8,900	1,559.00	13,875,100
丸井グループ	88,100	2,016.00	177,609,600
アクシアル リテイリング	7,700	4,215.00	32,455,500
イオン	354,000	1,903.50	673,839,000
イズミ	16,600	6,760.00	112,216,000
東武ストア	1,100	3,005.00	3,305,500
平和堂	18,700	2,526.00	47,236,200
フジ	11,000	2,447.00	26,917,000
ヤオコー	10,500	5,470.00	57,435,000
ゼビオホールディングス	12,600	2,158.00	27,190,800
ケーズホールディングス	39,000	3,030.00	118,170,000
Olympicグループ	5,700	590.00	3,363,000
日産東京販売ホールディングス	13,900	406.00	5,643,400
アインホールディングス	13,100	7,400.00	96,940,000
元気寿司	2,400	4,065.00	9,756,000
ヤマダ電機	308,500	635.00	195,897,500
アークランドサカモト	15,700	1,893.00	29,720,100
ニトリホールディングス	36,500	17,725.00	646,962,500
グルメ杵屋	7,000	1,145.00	8,015,000
愛眼	7,300	575.00	4,197,500
ケーユーホールディングス	4,900	1,257.00	6,159,300
吉野家ホールディングス	30,300	1,919.00	58,145,700
松屋フーズ	4,500	4,250.00	19,125,000
サガミチェーン	12,400	1,409.00	17,471,600
関西スーパーマーケット	7,100	1,284.00	9,116,400
王将フードサービス	6,800	5,150.00	35,020,000
プレナス	10,400	2,413.00	25,095,200
ミニストップ	6,900	2,423.00	16,718,700
アークス	17,300	2,634.00	45,568,200

パローホールディングス	21,400	2,680.00	57,352,000	
藤久	800	1,743.00	1,394,400	
ベルク	4,100	6,590.00	27,019,000	
大庄	5,000	1,732.00	8,660,000	
ファーストリテイリング	15,400	44,630.00	687,302,000	
サンドラッグ	39,000	5,360.00	209,040,000	
サクスパー ホールディングス	8,800	1,387.00	12,205,600	
ヤマザワ	2,000	1,739.00	3,478,000	
やまや	1,900	3,085.00	5,861,500	
ペルーナ	22,700	1,321.00	29,986,700	
島根銀行	1,900	1,358.00	2,580,200	
じもとホールディングス	62,100	190.00	11,799,000	
めぶきフィナンシャルグループ	478,600	461.00	220,634,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	12,400	3,055.00	37,882,000	
九州フィナンシャルグループ	151,100	673.00	101,690,300	
ゆうちょ銀行	260,900	1,447.00	377,522,300	
富山第一銀行	23,400	518.00	12,121,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	560,000	664.00	371,840,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,500	1,306.00	81,625,000	
新生銀行	79,700	1,866.00	148,720,200	
あおぞら銀行	54,900	4,440.00	243,756,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,507,500	794.90	5,172,811,750	
りそなホールディングス	1,010,800	614.20	620,833,360	
三井住友トラスト・ホールディングス	181,100	4,273.00	773,840,300	
三井住友フィナンシャルグループ	697,200	4,733.00	3,299,847,600	
第四銀行	11,300	4,990.00	56,387,000	
北越銀行	9,200	2,512.00	23,110,400	
千葉銀行	330,000	906.00	298,980,000	
群馬銀行	187,100	677.00	126,666,700	
武蔵野銀行	14,700	3,625.00	53,287,500	
千葉興業銀行	25,300	587.00	14,851,100	
筑波銀行	38,200	389.00	14,859,800	
七十七銀行	28,900	2,740.00	79,186,000	
青森銀行	7,100	3,520.00	24,992,000	
秋田銀行	5,900	3,085.00	18,201,500	
山形銀行	10,400	2,495.00	25,948,000	
岩手銀行	6,400	4,500.00	28,800,000	
東邦銀行	82,400	403.00	33,207,200	
東北銀行	4,700	1,529.00	7,186,300	
みちのく銀行	5,900	1,814.00	10,702,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	374,000	605.00	226,270,000	
静岡銀行	243,000	1,118.00	271,674,000	

十六銀行	12,400	3,360.00	41,664,000
スルガ銀行	94,200	2,370.00	223,254,000
八十二銀行	166,700	647.00	107,854,900
山梨中央銀行	57,000	483.00	27,531,000
大垣共立銀行	14,600	2,859.00	41,741,400
福井銀行	7,900	2,747.00	21,701,300
北國銀行	10,400	4,430.00	46,072,000
清水銀行	3,100	3,265.00	10,121,500
富山銀行	1,800	4,240.00	7,632,000
滋賀銀行	87,000	587.00	51,069,000
南都銀行	10,800	3,090.00	33,372,000
百五銀行	88,400	530.00	46,852,000
京都銀行	35,200	5,940.00	209,088,000
紀陽銀行	34,700	1,832.00	63,570,400
三重銀行	4,100	2,592.00	10,627,200
ほくほくフィナンシャルグループ	61,300	1,736.00	106,416,800
広島銀行	136,000	895.00	121,720,000
山陰合同銀行	54,600	1,032.00	56,347,200
中国銀行	63,700	1,520.00	96,824,000
鳥取銀行	2,900	1,798.00	5,214,200
伊予銀行	131,400	908.00	119,311,200
百十四銀行	98,000	368.00	36,064,000
四国銀行	14,100	1,566.00	22,080,600
阿波銀行	74,000	698.00	51,652,000
大分銀行	5,300	4,445.00	23,558,500
宮崎銀行	6,100	3,665.00	22,356,500
佐賀銀行	5,600	2,574.00	14,414,400
十八銀行	57,000	299.00	17,043,000
沖縄銀行	9,000	4,410.00	39,690,000
琉球銀行	17,900	1,627.00	29,123,300
セブン銀行	345,500	383.00	132,326,500
みずほフィナンシャルグループ	12,514,400	203.30	2,544,177,520
高知銀行	3,300	1,318.00	4,349,400
山口フィナンシャルグループ	86,000	1,359.00	116,874,000
長野銀行	3,000	1,956.00	5,868,000
名古屋銀行	7,400	4,350.00	32,190,000
北洋銀行	138,800	366.00	50,800,800
愛知銀行	3,100	5,360.00	16,616,000
第三銀行	5,200	1,854.00	9,640,800
中京銀行	3,800	2,326.00	8,838,800
大光銀行	3,200	2,485.00	7,952,000
愛媛銀行	12,700	1,366.00	17,348,200

トマト銀行	3,600	1,554.00	5,594,400
みなと銀行	8,400	2,110.00	17,724,000
京葉銀行	81,000	518.00	41,958,000
関西アーバン銀行	12,900	1,457.00	18,795,300
栃木銀行	47,700	482.00	22,991,400
北日本銀行	2,900	3,060.00	8,874,000
東和銀行	16,200	1,394.00	22,582,800
福島銀行	8,700	940.00	8,178,000
大東銀行	4,400	1,671.00	7,352,400
トモニホールディングス	76,000	594.00	45,144,000
フィデアホールディングス	89,400	198.00	17,701,200
池田泉州ホールディングス	97,800	409.00	40,000,200
F P G	33,100	1,387.00	45,909,700
S B Iホールディングス	104,300	2,166.00	225,913,800
ジャフコ	13,200	6,220.00	82,104,000
大和証券グループ本社	789,000	696.00	549,144,000
野村ホールディングス	1,662,800	663.50	1,103,267,800
岡三証券グループ	79,000	689.00	54,431,000
丸三証券	29,500	1,036.00	30,562,000
東洋証券	34,000	315.00	10,710,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	106,100	709.00	75,224,900
光世証券	2,300	1,508.00	3,468,400
水戸証券	29,000	413.00	11,977,000
いちよし証券	19,500	1,272.00	24,804,000
松井証券	45,300	959.00	43,442,700
だいこう証券ビジネス	4,700	701.00	3,294,700
マネックスグループ	98,300	328.00	32,242,400
カブドットコム証券	59,500	338.00	20,111,000
極東証券	12,500	1,649.00	20,612,500
岩井コスモホールディングス	9,600	1,418.00	13,612,800
藍澤證券	17,500	748.00	13,090,000
マネーパートナーズグループ	12,200	451.00	5,502,200
かんぽ生命保険	34,800	2,640.00	91,872,000
S O M P Oホールディングス	180,600	4,438.00	801,502,800
アニコム ホールディングス	6,300	3,380.00	21,294,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	240,800	3,663.00	882,050,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	75,700	1,954.00	147,917,800
第一生命ホールディングス	521,000	2,350.50	1,224,610,500
東京海上ホールディングス	347,000	5,078.00	1,762,066,000
T & Dホールディングス	284,900	1,922.00	547,577,800
アドバンスクリエイト	2,200	1,951.00	4,292,200
全国保証	26,000	5,000.00	130,000,000

クレディセゾン	69,900	2,108.00	147,349,200
アクリーティブ	5,000	392.00	1,960,000
芙蓉総合リース	10,500	7,360.00	77,280,000
興銀リース	17,300	2,835.00	49,045,500
東京センチュリー	18,500	5,220.00	96,570,000
日本証券金融	37,700	615.00	23,185,500
アイフル	154,600	400.00	61,840,000
リコーリース	7,200	3,850.00	27,720,000
イオンフィナンシャルサービス	65,400	2,501.00	163,565,400
アコム	185,100	476.00	88,107,600
ジャックス	11,200	2,550.00	28,560,000
オリエントコーポレーション	199,300	181.00	36,073,300
日立キャピタル	25,300	2,759.00	69,802,700
アプラスフィナンシャル	44,200	107.00	4,729,400
オリックス	614,300	1,901.00	1,167,784,300
三菱UFJリース	233,800	668.00	156,178,400
日本取引所グループ	270,600	2,001.00	541,470,600
イー・ギャランティ	2,400	3,205.00	7,692,000
アサックス	1,300	1,874.00	2,436,200
NECキャピタルソリューション	3,700	2,235.00	8,269,500
いちご	131,600	431.00	56,719,600
日本駐車場開発	111,200	181.00	20,127,200
ヒューリック	192,300	1,245.00	239,413,500
三栄建築設計	3,700	2,592.00	9,590,400
スター・マイカ	3,400	1,675.00	5,695,000
野村不動産ホールディングス	61,300	2,574.00	157,786,200
三重交通グループホールディングス	18,800	484.00	9,099,200
サムティ	7,800	1,632.00	12,729,600
ディア・ライフ	9,300	655.00	6,091,500
コーセーアールイー	1,600	1,297.00	2,075,200
エー・ディー・ワークス	123,300	40.00	4,932,000
日本商業開発	5,200	1,710.00	8,892,000
プレサンスコーポレーション	12,600	1,476.00	18,597,600
ユニゾホールディングス	10,800	2,988.00	32,270,400
THEグローバル社	4,400	794.00	3,493,600
日本管理センター	6,100	1,515.00	9,241,500
サンセイランディック	2,700	1,027.00	2,772,900
エストラスト	1,300	1,227.00	1,595,100
フージャースホールディングス	11,900	1,233.00	14,672,700
オープンハウス	15,000	5,540.00	83,100,000
東急不動産ホールディングス	223,000	818.00	182,414,000
飯田グループホールディングス	76,900	2,119.00	162,951,100

ムゲンエステート	5,700	1,162.00	6,623,400
ファーストブラザーズ	2,600	1,057.00	2,748,200
ハウストゥ	1,500	2,247.00	3,370,500
シーアールイー	1,500	1,565.00	2,347,500
ケイアイスター不動産	3,300	2,735.00	9,025,500
パーク24	51,100	2,858.00	146,043,800
パラカ	3,000	2,446.00	7,338,000
三井不動産	459,900	2,550.00	1,172,745,000
三菱地所	685,600	1,998.00	1,369,828,800
平和不動産	16,300	2,105.00	34,311,500
東京建物	100,700	1,590.00	160,113,000
ダイビル	23,800	1,260.00	29,988,000
京阪神ビルディング	15,300	860.00	13,158,000
住友不動産	221,000	3,760.00	830,960,000
大京	14,700	2,205.00	32,413,500
テオーシー	31,800	957.00	30,432,600
東京楽天地	1,500	5,950.00	8,925,000
レオパレス21	114,100	928.00	105,884,800
スターツコーポレーション	12,500	2,830.00	35,375,000
フジ住宅	11,800	857.00	10,112,600
空港施設	9,600	658.00	6,316,800
明和地所	5,100	863.00	4,401,300
ゴールドクレスト	7,300	2,279.00	16,636,700
日本エスリード	3,600	2,467.00	8,881,200
日神不動産	12,300	924.00	11,365,200
日本エスコン	16,300	692.00	11,279,600
タカラレーベン	43,200	498.00	21,513,600
サンヨーハウジング名古屋	4,800	1,197.00	5,745,600
イオンモール	59,400	2,151.00	127,769,400
ファースト住建	3,500	1,783.00	6,240,500
トーセイ	11,200	1,097.00	12,286,400
穴吹興産	1,000	3,005.00	3,005,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	57,300	1,261.00	72,255,300
サンフロンティア不動産	9,900	1,541.00	15,255,900
エフ・ジェー・ネクスト	7,100	1,017.00	7,220,700
インテリックス	2,900	1,104.00	3,201,600
ランドビジネス	5,400	318.00	1,717,200
グランディハウス	8,100	575.00	4,657,500
日本空港ビルデング	27,000	4,245.00	114,615,000
日本工営	6,000	3,670.00	22,020,000
LIFULL	31,100	1,034.00	32,157,400
ジェイエイシーリクルートメント	7,200	2,174.00	15,652,800

日本M&Aセンター	30,900	5,590.00	172,731,000	
メンバーズ	2,400	720.00	1,728,000	
中広	1,100	759.00	834,900	
タケエイ	9,400	1,301.00	12,229,400	
トラスト・テック	4,000	3,475.00	13,900,000	
コシダカホールディングス	4,700	5,140.00	24,158,000	
パソナグループ	7,300	1,888.00	13,782,400	
CDS	2,500	1,352.00	3,380,000	
リンクアンドモチベーション	16,500	860.00	14,190,000	
GCA	10,200	1,116.00	11,383,200	
エス・エム・エス	17,700	3,685.00	65,224,500	
パーソルホールディングス	82,400	2,712.00	223,468,800	
リニカル	5,800	1,592.00	9,233,600	
クックパッド	28,200	624.00	17,596,800	
エスクリ	3,200	1,110.00	3,552,000	
アイ・ケイ・ケイ	5,400	889.00	4,800,600	
学情	4,100	1,692.00	6,937,200	
スタジオアリス	4,500	2,772.00	12,474,000	
シミックホールディングス	5,000	1,788.00	8,940,000	
NJS	2,300	1,551.00	3,567,300	
総合警備保障	35,500	6,130.00	217,615,000	
カカクコム	68,600	1,773.00	121,627,800	
アイロムグループ	3,000	1,624.00	4,872,000	
セントケア・ホールディング	3,900	823.00	3,209,700	
サイネックス	1,500	891.00	1,336,500	
ルネサンス	4,400	1,914.00	8,421,600	
ディップ	12,600	3,005.00	37,863,000	
オプトホールディング	6,300	1,296.00	8,164,800	
ツクイ	21,100	1,013.00	21,374,300	
キャリアデザインセンター	2,100	2,456.00	5,157,600	
エムスリー	93,900	3,775.00	354,472,500	
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	664.00	4,847,200	
プラス	600	1,162.00	697,200	
アウトソーシング	26,700	2,012.00	53,720,400	
ウェルネット	7,400	1,209.00	8,946,600	
ワールドホールディングス	3,000	3,095.00	9,285,000	
ディー・エヌ・エー	48,200	2,409.00	116,113,800	
博報堂DYホールディングス	124,100	1,515.00	188,011,500	
ぐるなび	14,200	1,358.00	19,283,600	
エスアールジータカミヤ	10,700	652.00	6,976,400	
ジャパンベストレスキューシステム	11,100	607.00	6,737,700	
ファンコミュニケーションズ	25,000	964.00	24,100,000	

ライク	3,600	2,347.00	8,449,200
ビジネス・ブレイクスルー	4,400	477.00	2,098,800
WDBホールディングス	4,100	3,465.00	14,206,500
ティア	4,800	1,038.00	4,982,400
CDG	900	1,909.00	1,718,100
バリューコマース	8,200	772.00	6,330,400
インフォマート	45,300	647.00	29,309,100
JPホールディングス	28,400	352.00	9,996,800
EPSホールディングス	13,500	2,481.00	33,493,500
レッグス	2,300	916.00	2,106,800
プレステージ・インターナショナル	18,600	1,378.00	25,630,800
アミューズ	6,000	3,150.00	18,900,000
ドリームインキュベータ	3,000	2,300.00	6,900,000
クイック	5,600	1,821.00	10,197,600
TAC	5,800	362.00	2,099,600
ケネディクス	123,900	746.00	92,429,400
電通	108,700	4,960.00	539,152,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,252.00	5,383,600
ぴあ	3,000	6,750.00	20,250,000
イオンファンタジー	2,900	4,780.00	13,862,000
シーティーエス	9,200	842.00	7,746,400
ネクシィーズグループ	3,600	1,850.00	6,660,000
みらかホールディングス	26,600	4,810.00	127,946,000
アルプス技研	3,900	3,845.00	14,995,500
ダイオーズ	1,800	1,390.00	2,502,000
日本空調サービス	9,500	801.00	7,609,500
オリエンタルランド	105,500	10,670.00	1,125,685,000
ダスキン	24,100	2,952.00	71,143,200
明光ネットワークジャパン	11,400	1,344.00	15,321,600
ファルコホールディングス	4,700	1,731.00	8,135,700
ラウンドワン	27,800	1,796.00	49,928,800
リゾートトラスト	37,800	2,427.00	91,740,600
ビー・エム・エル	11,500	2,787.00	32,050,500
ワタベウェディング	1,600	635.00	1,016,000
りらいあコミュニケーションズ	14,200	1,274.00	18,090,800
リソー教育	15,300	859.00	13,142,700
早稲田アカデミー	1,300	1,710.00	2,223,000
ユー・エス・エス	109,000	2,427.00	264,543,000
東京個別指導学院	3,300	1,105.00	3,646,500
サイバーエージェント	58,700	4,150.00	243,605,000
楽天	457,600	1,137.50	520,520,000
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,146.00	5,386,200

テー・オー・ダブリュー	7,900	962.00	7,599,800
セントラルスポーツ	3,400	4,295.00	14,603,000
フルキャストホールディングス	7,900	2,230.00	17,617,000
リソルホールディングス	1,000	3,995.00	3,995,000
テクノプロ・ホールディングス	15,900	5,710.00	90,789,000
アトラ	1,700	693.00	1,178,100
インターワークス	2,100	1,137.00	2,387,700
K e e P e r 技研	3,000	1,270.00	3,810,000
ファーストロジック	700	2,538.00	1,776,600
三機サービス	1,100	1,345.00	1,479,500
デザインワン・ジャパン	1,900	1,364.00	2,591,600
イー・ガーディアン	4,600	2,365.00	10,879,000
リブセンス	6,000	499.00	2,994,000
ジャパンマテリアル	8,200	3,545.00	29,069,000
ベクトル	10,800	1,648.00	17,798,400
ウチヤマホールディングス	4,600	557.00	2,562,200
ライクキッズネクスト	1,000	2,701.00	2,701,000
キャリアリンク	3,100	568.00	1,760,800
I B J	6,700	1,098.00	7,356,600
アサンテ	3,300	1,959.00	6,464,700
N・フィールド	5,100	1,478.00	7,537,800
バリューHR	1,000	5,190.00	5,190,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	7,010.00	12,618,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,186.00	4,506,800
E R Iホールディングス	2,600	937.00	2,436,200
アビスト	1,300	5,390.00	7,007,000
ウィルグループ	3,900	1,635.00	6,376,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,400	596.00	7,390,400
日本ビューホテル	2,100	1,384.00	2,906,400
リクルートホールディングス	688,500	2,705.50	1,862,736,750
エラン	2,300	1,314.00	3,022,200
土木管理総合試験所	2,800	829.00	2,321,200
日本郵政	506,500	1,285.00	650,852,500
ベルシステム24ホールディングス	15,000	1,448.00	21,720,000
鎌倉新書	1,300	2,000.00	2,600,000
一蔵	1,200	1,107.00	1,328,400
L I T A L I C O	1,600	2,109.00	3,374,400
グローバルグループ	1,000	1,954.00	1,954,000
エボラブルアジア	1,900	2,200.00	4,180,000
ストライク	900	5,120.00	4,608,000
ソラスト	5,400	2,725.00	14,715,000
インソース	1,100	2,842.00	3,126,200

リログループ	48,800	2,964.00	144,643,200	
東祥	5,600	3,510.00	19,656,000	
エイチ・アイ・エス	13,900	3,985.00	55,391,500	
ラックランド	1,800	2,260.00	4,068,000	
共立メンテナンス	15,900	4,355.00	69,244,500	
イチネンホールディングス	10,100	1,607.00	16,230,700	
建設技術研究所	6,300	1,216.00	7,660,800	
スペース	5,300	1,796.00	9,518,800	
燦ホールディングス	2,200	3,360.00	7,392,000	
スバル興業	600	7,600.00	4,560,000	
東京テアトル	3,800	1,518.00	5,768,400	
タナベ経営	1,800	1,660.00	2,988,000	
ナガワ	1,800	4,890.00	8,802,000	
よみうりランド	2,000	5,030.00	10,060,000	
東京都競馬	6,700	3,855.00	25,828,500	
カナモト	13,600	3,580.00	48,688,000	
東京ドーム	36,300	1,116.00	40,510,800	
西尾レントオール	7,900	3,785.00	29,901,500	
トランス・コスモス	10,000	2,747.00	27,470,000	
乃村工藝社	20,900	2,572.00	53,754,800	
藤田観光	3,600	3,615.00	13,014,000	
KNT - CTホールディングス	5,500	1,686.00	9,273,000	
日本管財	9,600	1,992.00	19,123,200	
トーカイ	4,300	4,965.00	21,349,500	
白洋舎	1,000	4,085.00	4,085,000	
セコム	94,700	8,573.00	811,863,100	
セントラル警備保障	4,400	2,077.00	9,138,800	
丹青社	18,300	1,301.00	23,808,300	
メイテック	10,500	5,760.00	60,480,000	
応用地質	10,100	1,494.00	15,089,400	
船井総研ホールディングス	12,400	3,725.00	46,190,000	
進学会ホールディングス	4,300	705.00	3,031,500	
オオバ	7,800	511.00	3,985,800	
いであ	1,900	1,172.00	2,226,800	
学究社	2,500	1,604.00	4,010,000	
ベネッセホールディングス	32,700	4,155.00	135,868,500	
イオンディライト	11,000	4,180.00	45,980,000	
ナック	6,100	970.00	5,917,000	
ニチイ学館	17,000	1,470.00	24,990,000	
ダイセキ	15,700	3,025.00	47,492,500	
ステップ	3,300	1,742.00	5,748,600	
合計	112,300,300		241,692,895,700	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期中間計算期間(2017年12月12日から2018年6月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 (2017年12月11日現在)	第16期中間計算期間 (2018年6月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	118,788
コール・ローン	6,068,824	7,343,022
親投資信託受益証券	2,208,061,471	2,224,737,754
未収入金	2,484,508	3,638,548
流動資産合計	2,216,614,803	2,235,838,112
資産合計	2,216,614,803	2,235,838,112
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,115,228	5,347,819
未払受託者報酬	556,337	595,264
未払委託者報酬	3,783,049	4,047,702
未払利息	9	19
その他未払費用	-	72
流動負債合計	7,454,623	9,990,876
負債合計	7,454,623	9,990,876
純資産の部		
元本等		
元本	843,966,902	854,654,896
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,365,193,278	1,371,192,340
(分配準備積立金)	657,754,032	603,607,805
元本等合計	2,209,160,180	2,225,847,236
純資産合計	2,209,160,180	2,225,847,236
負債純資産合計	2,216,614,803	2,235,838,112

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自 2016年12月13日 至 2017年 6月12日	第16期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	101,538,556	7,269,428
営業収益合計	101,538,556	7,269,428
営業費用		
支払利息	1,257	1,564
受託者報酬	538,171	595,264
委託者報酬	3,659,552	4,047,702
その他費用	12	103
営業費用合計	4,198,992	4,644,633
営業利益又は営業損失（ ）	97,339,564	11,914,061
経常利益又は経常損失（ ）	97,339,564	11,914,061
中間純利益又は中間純損失（ ）	97,339,564	11,914,061
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（ ）	5,578,648	3,542,265
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,112,279,190	1,365,193,278
剰余金増加額又は欠損金減少額	128,020,166	133,761,952
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	128,020,166	133,761,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	206,568,977	119,391,094
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	206,568,977	119,391,094
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,125,491,295	1,371,192,340

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期中間計算期間は2017年12月12日から2018年 6月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2017年12月11日現在)	第16期中間計算期間 (2018年 6月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	843,966,902口	854,654,896口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6176円 (26,176円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6044円 (26,044円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第16期中間計算期間 (2018年 6月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第16期中間計算期間 (2018年 6月11日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第15期 自 2016年12月13日 至 2017年12月11日	第16期中間計算期間 自 2017年12月12日 至 2018年 6月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	949,060,361円	843,966,902円
期中追加設定元本額	199,865,073円	84,767,312円
期中一部解約元本額	304,958,532円	74,079,318円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2018年 6月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	41,446,663
コール・ローン	2,562,085,073
株式	236,593,974,450
派生商品評価勘定	46,196,820
未収入金	3,478,900
未収配当金	1,610,948,383
差入委託証拠金	115,672,700
流動資産合計	240,973,802,989
資産合計	240,973,802,989
負債の部	
流動負債	
前受金	46,203,300
未払解約金	216,576,383
未払利息	6,789
その他未払費用	40,492
流動負債合計	262,826,964
負債合計	262,826,964
純資産の部	
元本等	
元本	129,367,405,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	111,343,570,475
元本等合計	240,710,976,025
純資産合計	240,710,976,025
負債純資産合計	240,973,802,989

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2018年 6月11日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2018年 6月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	129,367,405,550口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8607円 (1万口当たり純資産額) (18,607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

	2018年 6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2018年 6月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2017年12月12日
期首元本額	130,824,852,131円
期中追加設定元本額	5,779,257,023円
期中一部解約元本額	7,236,703,604円
期末元本額	129,367,405,550円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	805,215,124円
D C日本株式インデックスファンド	354,257,194円
D C日本株式インデックスファンドL	53,118,821,339円
D C日本株式インデックスファンドA	1,195,645,593円
D Cバランスファンド30	1,868,790,355円
D Cバランスファンド50	2,863,049,423円
D Cバランスファンド70	1,493,459,270円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	619,055,559円
日本株式インデックスe	1,894,468,953円
インデックスコレクション（国内株式）	10,639,449,398円
インデックスコレクション（バランス株式30）	5,018,561,874円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,395,851,249円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,124,585,898円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,215,276,000円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,372,685,185円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,218,943,814円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	190,668,723円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,791,498,017円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	138,335,864円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	761,187,893円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	16,656,820円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	893,597,544円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,459,050,881円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	676,465,169円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,594,191,465円

区分	2018年 6月11日現在
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	991,904,917円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	446,311,534円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,818,618,123円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	51,126,790円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	331,816,697円
V A バランス株式 4 0（適格機関投資家専用）	23,957,334円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,906,391,666円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	85,479,400円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	85,516,363円
バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	41,026,694円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	1,232,409,186円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	1,038,465,656円
バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用）	28,815,495円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	464,064,055円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	7,686,409,668円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	139,594,615円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	69,979,946円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	11,407,810円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	189,235,796円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	4,928,526円
世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	176,675円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年 6月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,721,208,180	-	3,767,405,000	46,196,820
合計		3,721,208,180	-	3,767,405,000	46,196,820

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドA】

【純資産額計算書】

(2018年 6月29日現在)

資産総額	2,150,671,213円
負債総額	462,981円
純資産総額（ - ）	2,150,208,232円
発行済口数	851,390,322口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5255円
（1万口当たり純資産額）	（25,255円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2018年 6月29日現在)

資産総額	235,159,771,205円
負債総額	1,538,394,521円
純資産総額（ - ）	233,621,376,684円
発行済口数	129,450,796,204口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8047円
（1万口当たり純資産額）	（18,047円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成30年 6月29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

会社が取締役3名以上、監査役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、会長1名及び副社長、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發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役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コンプライアンス・リスク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（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）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。

委託会社の機構は平成30年 9月11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30年6月29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	497	9,568,189
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	227,348
単位型公社債投資信託	0	0
合計	564	9,795,537

3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けておりま

す。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,260,630	23,973,152
前払費用	143,622	157,614
未収委託者報酬	5,252,944	5,373,307
繰延税金資産	61,677	94,211
その他	5,474	9,842
流動資産合計	25,724,348	29,608,128
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 47,993	1 36,782
器具備品	1 73,765	1 79,655
その他	1 2,830	1 1,912
有形固定資産合計	124,589	118,350
無形固定資産		
ソフトウェア	221,499	210,679
その他	6,656	4,377
無形固定資産合計	228,156	215,056
投資その他の資産		
投資有価証券	71,153	42,802
長期前払費用	9,828	7,810
長期貸付金	19,838	17,088
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	137,359	154,422
その他	145	70
貸倒引当金	19,838	17,088
投資その他の資産合計	243,485	230,105
固定資産合計	596,231	563,512
資産合計	26,320,580	30,171,641

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863

その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
固定負債		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	71,500	74,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,134	182
評価・換算差額等合計	1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178
営業収益合計	30,245,448	29,206,178
営業費用		
支払手数料	12,880,325	12,544,178

広告宣伝費	95,688	175,296
公告費	3,094	-
調査費	6,239,223	6,008,380
調査費	360,520	396,842
委託調査費	5,876,937	5,609,496
図書費	1,766	2,041
営業雑経費	1,460,885	1,474,361
通信費	24,920	33,158
印刷費	370,785	368,414
協会費	30,665	36,616
諸会費	105	105
情報機器関連費	943,725	942,093
その他営業雑経費	90,684	93,973
営業費用合計	20,679,217	20,202,216
一般管理費		
給料	1,874,710	2,006,157
役員報酬	89,520	84,130
給料・手当	1,526,244	1,649,268
賞与	258,946	272,758
退職給付費用	76,106	84,944
福利費	221,018	239,702
交際費	5,612	5,831
旅費交通費	61,961	73,807
租税公課	106,691	102,158
不動産賃借料	113,697	124,629
減価償却費	134,710	119,300
業務委託費	1 486,690	1 484,841
諸経費	223,685	246,326
一般管理費合計	3,304,885	3,487,699
営業利益	6,261,346	5,516,262

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136
収益分配金	129	116
投資有価証券売却益	307	499
貸倒引当金戻入	3,000	2,750
その他	1,591	4,351
営業外収益合計	9,697	9,854
営業外費用		
長期前払費用償却	1 4,644	1 -
投資有価証券売却損	604	2,224
固定資産除却損	-	7,891

その他	0	1,182
営業外費用合計	5,249	11,298
経常利益	6,265,794	5,514,818
特別損失		
統合関連費用	-	51,569
特別損失合計	-	51,569
税引前当期純利益	6,265,794	5,463,248
法人税、住民税及び事業税	1,889,846	1,739,837
法人税等調整額	45,558	50,178
法人税等合計	1,935,405	1,689,659
当期純利益	4,330,389	3,773,589

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			

剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

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。

未適用の会計基準等

・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）

・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
建 物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
そ の 他	1,759	"	2,677	"

計	362,567	〃	392,342	〃
---	---------	---	---------	---

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	〃	-	〃

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29年6月30日

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

平成30年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30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30年3月31日	平成30年6月29日

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、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29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	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

(*) 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30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	23,973,152	23,973,152	-
（2）未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
（4）未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
（5）未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-

（*）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、並びに（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、並びに（5）未払法人税等

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

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

（単位：千円）

区分	平成29年3月31日	平成30年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

1．其他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの			
その他	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

当事業年度（平成30年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

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

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28年4月1日 至 平成29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
12,699	307	604

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
62,968	499	2,224

（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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付債務	437,197	496,696
(2) 退職給付引当金	437,197	496,696

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付費用	76,106	84,944

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

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29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	"	5,232	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	"	32,511	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	"	152,088	"
その他	6,972	"	23,674	"
繰延税金資産 合計	205,870	"	255,547	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
その他	-	"	80	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,913	"
繰延税金資産の純額	199,037	"	248,633	"

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

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

(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

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,568,158千円

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

(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

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

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28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	----------	----	----------

兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(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29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-

普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 9月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成30年3月末日現在）

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

（2）販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成30年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成30年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論

見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年 6月 1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第32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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年2月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの平成28年12月13日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの平成29年12月11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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2017年12月12日から2018年6月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2018年6月11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（2017年12月12日から2018年6月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。