

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年12月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンドL
【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L

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2020年12月29日から2021年 6月30日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所所有価証券の売買また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およ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付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

う。

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

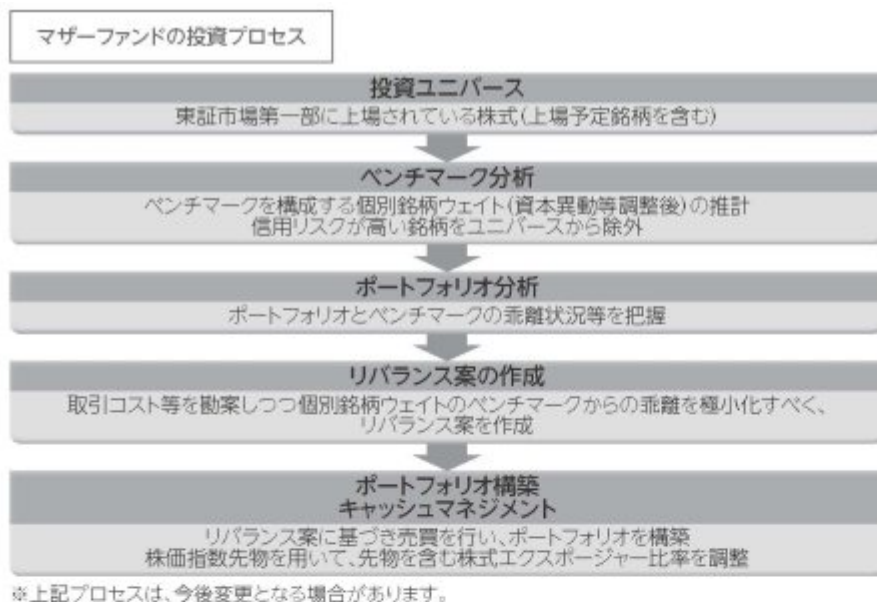
東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）^(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。



ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年10月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（５）＜約款に定める投資制限＞J．、K．及びL．に定めるものに限ります。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、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」（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦

通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

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

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

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。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

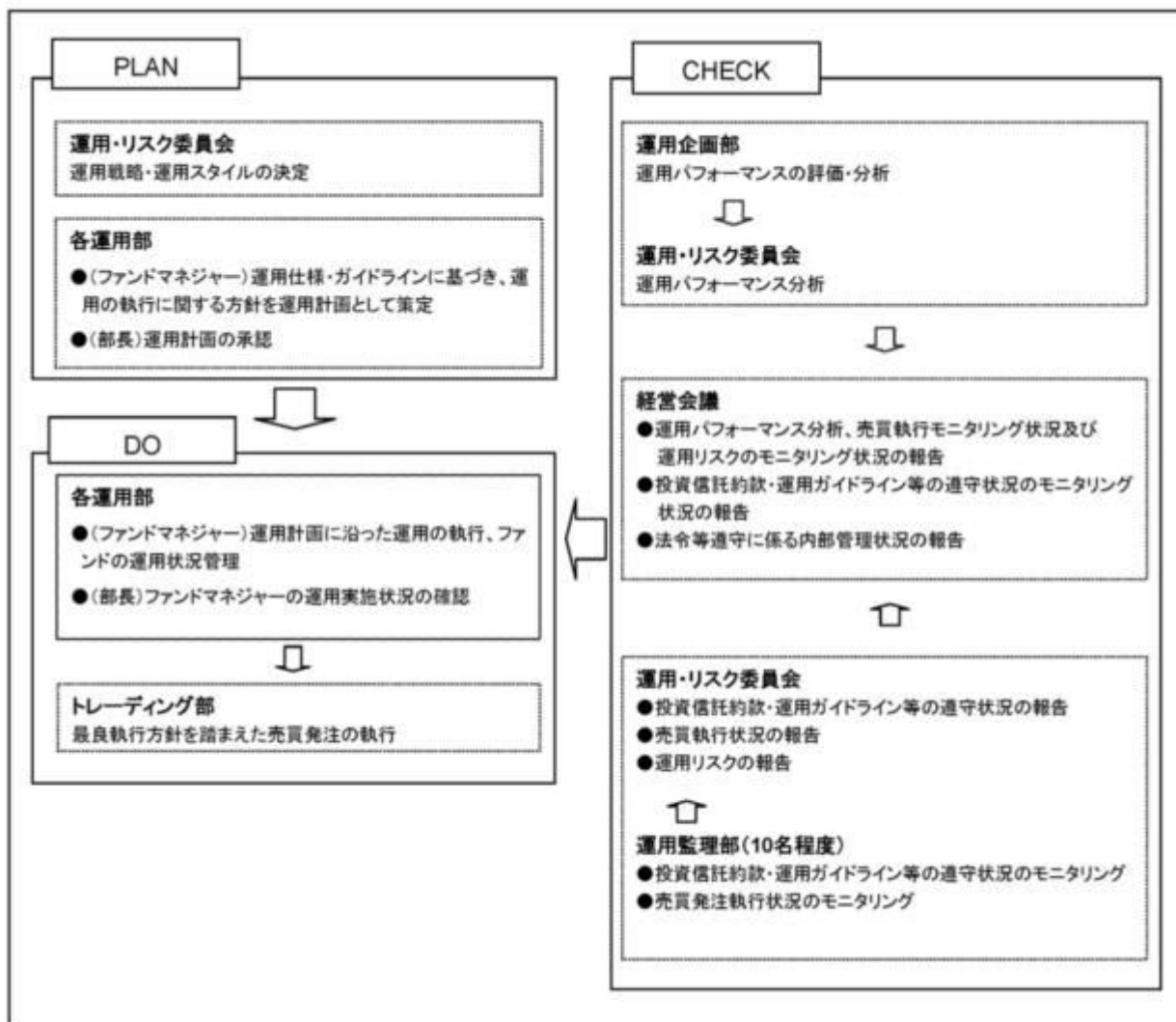
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は3月31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、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債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

において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

Q．再投資の指図

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

R．資金の借入れ

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

S．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

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

【参考情報】

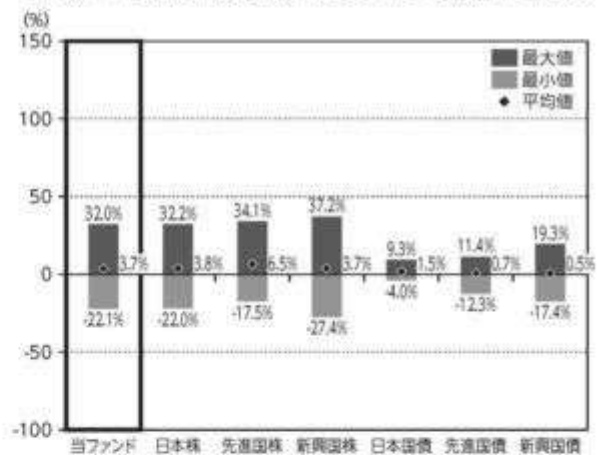
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2015年11月～2020年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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。算出方法は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み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・サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの発券、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、誤漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morganグローバル・ディバーシファイド・エマージング・マーケット・グロ・バ・D・インデックス(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.209%（税抜 0.19%）（ ）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 0.1045% （税抜 0.095%）	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 0.0715% （税抜 0.065%）	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 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年10月30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、2020年10月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドL】

（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	94,442,261,657	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		48,191,826	0.05
合計(純資産総額)		94,490,453,483	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	54,096,839,075	1.5430	83,471,422,693	1.7458	94,442,261,657	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9期計算期間末	(2011年 3月31日)	32,618,291,529	32,618,291,529	9,279	9,279
第10期計算期間末	(2012年 4月 2日)	36,891,288,373	36,891,288,373	9,334	9,334
第11期計算期間末	(2013年 4月 1日)	47,541,549,876	47,541,549,876	11,141	11,141
第12期計算期間末	(2014年 3月31日)	56,643,451,778	56,643,451,778	13,652	13,652
第13期計算期間末	(2015年 3月31日)	73,026,107,098	73,026,107,098	17,815	17,815
第14期計算期間末	(2016年 3月31日)	69,315,595,697	69,315,595,697	15,862	15,862
第15期計算期間末	(2017年 3月31日)	79,513,820,774	79,513,820,774	18,169	18,169
第16期計算期間末	(2018年 4月 2日)	94,197,935,571	94,197,935,571	20,938	20,938
第17期計算期間末	(2019年 4月 1日)	93,580,494,253	93,580,494,253	20,237	20,237
第18期計算期間末	(2020年 3月31日)	82,302,972,845	82,302,972,845	18,017	18,017
	2019年10月末日	97,009,703,347		21,110	
	11月末日	98,635,351,205		21,519	
	12月末日	99,962,688,763		21,826	
	2020年 1月末日	97,802,626,445		21,356	
	2月末日	87,296,368,582		19,160	
	3月末日	82,302,972,845		18,017	
	4月末日	85,968,762,633		18,795	
	5月末日	92,738,112,212		20,070	

6月末日	92,544,475,777		20,035
7月末日	88,658,332,163		19,226
8月末日	95,735,859,573		20,792
9月末日	97,221,040,879		21,057
10月末日	94,490,453,483		20,457

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第9期計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	0
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	0
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	0
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	0
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	0
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	0
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第9期計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	9.4
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0.6
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	19.4
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	22.5
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	30.5
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	11.0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	14.5
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	15.2
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	3.3
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	11.0
第19期中間計算期間	2020年 4月 1日～2020年 9月30日	16.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第9期計算期間	2010年 4月 1日～2011年 3月31日	7,917,962,462	3,950,250,803	35,153,609,197
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	8,098,197,566	3,730,095,100	39,521,711,663
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	9,677,054,316	6,526,059,313	42,672,706,666
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	12,128,505,388	13,309,747,403	41,491,464,651
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	9,661,910,614	10,162,747,005	40,990,628,260
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	12,364,658,702	9,655,862,890	43,699,424,072
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	8,332,373,769	8,267,206,141	43,764,591,700
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	9,068,541,994	7,843,419,871	44,989,713,823
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	7,404,869,734	6,151,695,641	46,242,887,916
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	7,667,675,777	8,228,600,168	45,681,963,525
第19期中間計算期間	2020年 4月 1日～2020年 9月30日	4,138,757,000	3,649,915,899	46,170,804,626

(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	240,945,140,010	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,678,213,078	1.90
合計(純資産総額)		245,623,353,088	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	4,608,890,000	1.88

(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	1,216,600	7,739.83	9,416,277,178	6,803.00	8,276,529,800	3.37
日本	株式	ソニー	電気機器	683,100	7,857.84	5,367,690,504	8,674.00	5,925,209,400	2.41
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	849,000	4,842.21	4,111,036,290	6,793.00	5,767,257,000	2.35
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,800	39,541.36	3,906,686,368	47,250.00	4,668,300,000	1.90
日本	株式	任天堂	その他製品	66,900	43,053.27	2,880,263,763	56,980.00	3,811,962,000	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,430,400	2,815.45	4,027,219,680	2,196.00	3,141,158,400	1.28
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,356,700	571.46	4,204,059,782	410.20	3,017,718,340	1.23
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	765,200	3,098.34	2,370,849,768	3,887.00	2,974,332,400	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	746,400	4,277.20	3,192,502,080	3,970.00	2,963,208,000	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	907,200	4,344.54	3,941,366,688	3,239.00	2,938,420,800	1.20
日本	株式	日本電産	電気機器	262,500	7,738.93	2,031,469,125	10,500.00	2,756,250,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	138,900	16,138.49	2,241,636,261	19,480.00	2,705,772,000	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	936,000	2,478.16	2,319,557,760	2,748.00	2,572,128,000	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	216,300	10,950.66	2,368,627,758	11,800.00	2,552,340,000	1.04
日本	株式	信越化学工業	化学	183,400	12,618.50	2,314,232,900	13,890.00	2,547,426,000	1.04
日本	株式	村田製作所	電気機器	320,400	6,643.24	2,128,494,096	7,267.00	2,328,346,800	0.95
日本	株式	ファナック	電気機器	102,500	20,360.80	2,086,982,000	22,050.00	2,260,125,000	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	780,100	3,260.86	2,543,796,886	2,792.50	2,178,429,250	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	743,800	3,886.96	2,891,120,848	2,881.00	2,142,887,800	0.87
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	858,500	2,993.73	2,570,117,205	2,435.00	2,090,447,500	0.85
日本	株式	花王	化学	261,100	9,110.14	2,378,657,554	7,420.00	1,937,362,000	0.79
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,200	24,864.07	1,720,593,644	27,900.00	1,930,680,000	0.79
日本	株式	S M C	機械	34,200	52,298.60	1,788,612,120	55,300.00	1,891,260,000	0.77
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	751,100	2,566.95	1,928,036,145	2,500.00	1,877,750,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,461,300	1,635.30	2,389,663,890	1,281.50	1,872,655,950	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	524,000	4,447.40	2,330,437,600	3,502.00	1,835,048,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	380,200	6,028.28	2,291,952,056	4,659.00	1,771,351,800	0.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	704,100	2,861.39	2,014,704,699	2,325.50	1,637,384,550	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,800	15,265.84	1,691,455,072	14,585.00	1,616,018,000	0.66
日本	株式	エムスリー	サービス業	229,800	3,256.31	748,300,038	7,027.00	1,614,804,600	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。

□ 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	0.10
		鉱業	0.14

建設業	2.34	
食料品	3.56	
繊維製品	0.47	
パルプ・紙	0.20	
化学	7.31	
医薬品	5.74	
石油・石炭製品	0.38	
ゴム製品	0.55	
ガラス・土石製品	0.78	
鉄鋼	0.55	
非鉄金属	0.65	
金属製品	0.59	
機械	5.42	
電気機器	15.88	
輸送用機器	7.00	
精密機器	2.65	
その他製品	2.73	
電気・ガス業	1.37	
陸運業	3.43	
海運業	0.16	
空運業	0.31	
倉庫・運輸関連業	0.18	
情報・通信業	10.31	
卸売業	4.46	
小売業	4.92	
銀行業	4.65	
証券、商品先物取引業	0.76	
保険業	1.93	
その他金融業	1.07	
不動産業	1.89	
サービス業	5.63	
	小計	98.10
合計		98.10

(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	293	円	4,767,106,850	4,608,890,000	1.88

(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4月1日
作成基準日：2020年10月30日

基準価額・純資産の推移

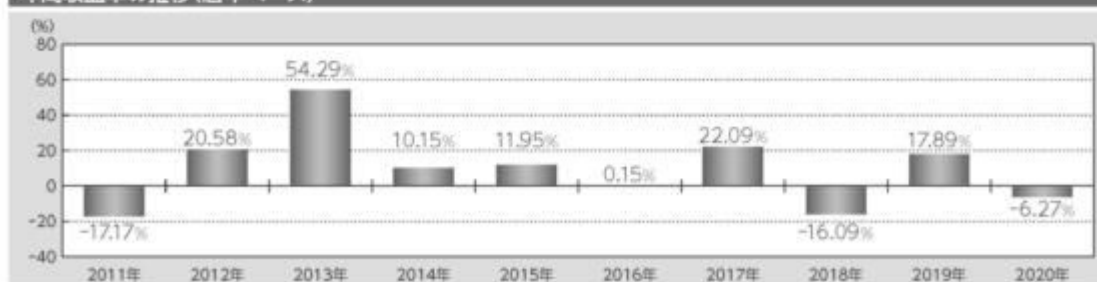

※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.4%
ソニー	日本	株式	電気機器	2.4%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.3%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.3%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.2%
NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	1.2%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.2%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）


※2020年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2002年 4月 1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4月1日から翌年3月31日までとすることを原則とします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2019年4月2日から2020年3月31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L】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2019年 4月 1日現在)	第18期 (2020年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	6,289,763	-
コール・ローン	203,791,977	502,687,731
親投資信託受益証券	93,534,397,925	82,260,885,286
未収入金	38,860,870	23,785,650
流動資産合計	93,783,340,535	82,787,358,667
資産合計	93,783,340,535	82,787,358,667
負債の部		
流動負債		
未払解約金	109,808,441	385,934,818
未払受託者報酬	14,689,984	15,544,689
未払委託者報酬	78,346,490	82,904,964
未払利息	549	1,351
その他未払費用	818	-
流動負債合計	202,846,282	484,385,822
負債合計	202,846,282	484,385,822
純資産の部		
元本等		
元本	46,242,887,916	45,681,963,525
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	47,337,606,337	36,621,009,320
(分配準備積立金)	24,441,998,418	22,562,544,559
元本等合計	93,580,494,253	82,302,972,845
純資産合計	93,580,494,253	82,302,972,845
負債純資産合計	93,783,340,535	82,787,358,667

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2018年 4月 3日	自	2019年 4月 2日
	至	2019年 4月 1日	至	2020年 3月31日
営業収益				
受取利息		40		274
有価証券売買等損益		2,974,591,318		9,823,056,730
営業収益合計		2,974,591,278		9,823,056,456
営業費用				
支払利息		149,520		111,671
受託者報酬		30,444,733		30,162,449
委託者報酬		162,371,767		160,866,318
その他費用		12,986		436
営業費用合計		192,979,006		191,140,874
営業利益又は営業損失（ ）		3,167,570,284		10,014,197,330
経常利益又は経常損失（ ）		3,167,570,284		10,014,197,330
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,167,570,284		10,014,197,330
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（ ）		156,127,640		221,419,749
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		49,208,221,748		47,337,606,337
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,853,034,671		7,459,997,802
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,853,034,671		7,459,997,802
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,712,207,438		8,383,817,238
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,712,207,438		8,383,817,238
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		47,337,606,337		36,621,009,320

(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4月1日から翌年3月31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18期計算期間は2019年 4月 2日から2020年 3月31日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2019年 4月 1日現在)	第18期 (2020年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,242,887,916口	45,681,963,525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) 2.0237円 (20,237円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8017円 (18,017円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日			第18期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31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	2,019,085,190円	費用控除後の配当等収益額	A	2,115,894,418円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	56,774,467,334円	収益調整金額	C	59,857,556,822円
分配準備積立金額	D	22,422,913,228円	分配準備積立金額	D	20,446,650,141円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	81,216,465,752円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,420,101,381円
当ファンドの期末残存口数	F	46,242,887,916口	当ファンドの期末残存口数	F	45,681,963,525口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	17,563円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	18,042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18期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第18期 (2020年 3月31日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期	第18期
	自 2018年 4月 3日 至 2019年 4月 1日	自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	44,989,713,823円	46,242,887,916円
期中追加設定元本額	7,404,869,734円	7,667,675,777円
期中一部解約元本額	6,151,695,641円	8,228,600,168円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17期	第18期
	(2019年 4月 1日現在)	(2020年 3月31日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	2,803,098,464	9,727,535,827
合計	2,803,098,464	9,727,535,827

（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	53,565,725,914	82,260,885,286	
合計		53,565,725,914	82,260,885,286	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年 3月31日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,534,991,911
株式	217,516,606,270
派生商品評価勘定	136,961,400
未収入金	117,354,400
未収配当金	2,885,537,216
差入委託証拠金	406,094,800
流動資産合計	223,597,545,997
資産合計	223,597,545,997
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	112,307,000
前受金	24,681,900
未払金	20,429,800
未払解約金	133,009,520
未払利息	6,813
流動負債合計	290,435,033
負債合計	290,435,033
純資産の部	
元本等	
元本	145,410,304,747
剰余金	

	2020年 3月31日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	77,896,806,217
元本等合計	223,307,110,964
純資産合計	223,307,110,964
負債純資産合計	223,597,545,997

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 3月31日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 3月31日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	145,410,304,747口
2. 1口当たり純資産額	1.5357円

2020年 3月31日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (15,357円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2020年 3月31日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月31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

	2020年 3月31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> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 4月 2日
期首元本額	131,963,715,591円
期中追加設定元本額	29,909,123,002円
期中一部解約元本額	16,462,533,846円
期末元本額	145,410,304,747円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	714,076,592円
D C日本株式インデックスファンド	317,703,380円
D C日本株式インデックスファンドL	53,565,725,914円
D C日本株式インデックスファンドA	1,074,776,087円
D Cバランスファンド3 0	2,694,160,946円
D Cバランスファンド5 0	3,709,628,652円
D Cバランスファンド7 0	1,930,942,371円

区分	2020年 3月31日現在
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	607,391,888円
日本株式インデックスe	1,659,062,950円
インデックスコレクション（国内株式）	18,346,592,317円
インデックスコレクション（バランス株式30）	14,547,976,264円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,431,747,646円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,713,648,920円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,520,131,099円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,265,005,989円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,392,280,852円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	103,984,919円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	1,045,869,356円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	119,744,576円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	482,731,830円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	5,147,848円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	797,804,158円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,277,846,239円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	666,577,341円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,007,574,447円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	853,289,050円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	140,818,913円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,740,881,201円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	47,195,146円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	214,837,496円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,829,809,249円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	83,221,030円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	81,482,413円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	42,915,889円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,032,620,052円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	479,997,217円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	7,453,324,234円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	139,125,923円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	68,120,924円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	13,156,902円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	189,004,946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）	2,371,581円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 3月31日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	49,860,646,654

合計	49,860,646,654
----	----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2020年 3月31日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,573,288,100	-	5,597,970,000	24,681,900
合計		5,573,288,100	-	5,597,970,000	24,681,900

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	2,545.00	13,234,000	
日本水産	149,600	478.00	71,508,800	
マルハニチロ	21,600	2,258.00	48,772,800	
カネコ種苗	4,500	1,335.00	6,007,500	
サカタのタネ	17,800	3,280.00	58,384,000	
ホクト	11,400	1,885.00	21,489,000	
ホクリヨウ	2,300	611.00	1,405,300	
住石ホールディングス	30,200	116.00	3,503,200	
日鉄鉱業	3,400	4,235.00	14,399,000	
三井松島ホールディングス	5,800	879.00	5,098,200	
国際石油開発帝石	600,000	608.80	365,280,000	
石油資源開発	19,500	1,777.00	34,651,500	
K&Oエナジーグループ	7,300	1,496.00	10,920,800	
ヒノキヤグループ	3,700	1,466.00	5,424,200	
ショーボンドホールディングス	23,300	4,320.00	100,656,000	
ミライト・ホールディングス	44,400	1,347.00	59,806,800	

タマホーム	8,100	1,221.00	9,890,100
サンヨーホームズ	1,300	609.00	791,700
日本アクア	5,900	637.00	3,758,300
ファーストコーポレーション	4,600	449.00	2,065,400
ベステラ	2,600	911.00	2,368,600
TATERU	30,800	109.00	3,357,200
キャンディル	1,300	417.00	542,100
スペースバリューホールディングス	18,200	373.00	6,788,600
ダイセキ環境ソリューション	2,900	814.00	2,360,600
第一カッター興業	1,800	1,617.00	2,910,600
明豊ファシリティワークス	3,600	469.00	1,688,400
安藤・間	89,100	689.00	61,389,900
東急建設	43,800	569.00	24,922,200
コムシスホールディングス	53,000	2,783.00	147,499,000
ビーアールホールディングス	16,300	505.00	8,231,500
高松コンストラクショングループ	9,300	2,321.00	21,585,300
東建コーポレーション	4,600	7,990.00	36,754,000
ソネック	1,500	703.00	1,054,500
ヤマウラ	6,500	811.00	5,271,500
大成建設	115,200	3,305.00	380,736,000
大林組	345,400	926.00	319,840,400
清水建設	350,500	845.00	296,172,500
飛鳥建設	9,900	1,003.00	9,929,700
長谷工コーポレーション	133,700	1,157.00	154,690,900
松井建設	13,600	665.00	9,044,000
銭高組	1,500	3,270.00	4,905,000
鹿島建設	271,200	1,109.00	300,760,800
不動テトラ	9,000	1,283.00	11,547,000
大末建設	4,000	764.00	3,056,000
鉄建建設	7,500	2,348.00	17,610,000
西松建設	26,600	2,071.00	55,088,600
三井住友建設	83,400	477.00	39,781,800
大豊建設	7,800	2,264.00	17,659,200
前田建設工業	86,500	797.00	68,940,500
佐田建設	7,400	326.00	2,412,400
ナカノフドー建設	9,400	363.00	3,412,200
奥村組	18,700	2,248.00	42,037,600
東鉄工業	14,800	2,917.00	43,171,600
イチケン	2,500	1,203.00	3,007,500
富士ピー・エス	5,100	530.00	2,703,000
浅沼組	3,900	3,775.00	14,722,500
戸田建設	143,400	629.00	90,198,600

熊谷組	16,000	2,501.00	40,016,000
北野建設	2,100	2,535.00	5,323,500
植木組	1,500	2,550.00	3,825,000
矢作建設工業	15,300	783.00	11,979,900
ピーエス三菱	11,400	513.00	5,848,200
日本ハウスホールディングス	23,600	293.00	6,914,800
大東建託	41,400	10,065.00	416,691,000
新日本建設	14,700	825.00	12,127,500
N I P P O	28,600	2,380.00	68,068,000
東亜道路工業	2,100	3,000.00	6,300,000
前田道路	30,500	2,021.00	61,640,500
日本道路	3,300	6,870.00	22,671,000
東亜建設工業	10,800	1,444.00	15,595,200
日本国土開発	25,200	531.00	13,381,200
若築建設	6,200	1,210.00	7,502,000
東洋建設	38,700	438.00	16,950,600
五洋建設	136,900	569.00	77,896,100
世紀東急工業	16,600	816.00	13,545,600
福田組	4,000	4,230.00	16,920,000
住友林業	87,500	1,385.00	121,187,500
日本基礎技術	11,600	368.00	4,268,800
巴コーポレーション	15,300	332.00	5,079,600
大和ハウス工業	341,700	2,677.50	914,901,750
ライト工業	19,800	1,227.00	24,294,600
積水ハウス	377,900	1,784.50	674,362,550
日特建設	9,000	738.00	6,642,000
北陸電気工事	6,000	910.00	5,460,000
ユアテック	19,800	615.00	12,177,000
四電工	1,900	2,478.00	4,708,200
中電工	13,900	2,201.00	30,593,900
関電工	49,100	861.00	42,275,100
きんでん	82,000	1,595.00	130,790,000
東京エネシス	11,500	822.00	9,453,000
トーエネック	3,500	3,180.00	11,130,000
住友電設	9,700	2,223.00	21,563,100
日本電設工業	18,900	2,107.00	39,822,300
協和エクシオ	52,400	2,406.00	126,074,400
新日本空調	9,100	2,163.00	19,683,300
九電工	24,200	2,923.00	70,736,600
三機工業	24,900	1,211.00	30,153,900
日揮ホールディングス	106,300	868.00	92,268,400
中外炉工業	3,700	1,468.00	5,431,600

ヤマト	11,000	636.00	6,996,000
太平電業	8,300	2,319.00	19,247,700
高砂熱学工業	30,000	1,661.00	49,830,000
三晃金属工業	1,500	2,022.00	3,033,000
朝日工業社	2,300	3,195.00	7,348,500
明星工業	22,300	734.00	16,368,200
大気社	16,800	3,130.00	52,584,000
ダイダン	8,300	2,906.00	24,119,800
日比谷総合設備	11,100	1,938.00	21,511,800
フィル・カンパニー	1,500	2,706.00	4,059,000
OSJBホールディングス	54,500	239.00	13,025,500
東洋エンジニアリング	14,500	324.00	4,698,000
レイズネクスト	18,500	1,225.00	22,662,500
日本製粉	32,300	1,687.00	54,490,100
日清製粉グループ本社	124,900	1,802.00	225,069,800
日東富士製粉	800	5,780.00	4,624,000
昭和産業	10,100	3,210.00	32,421,000
鳥越製粉	9,800	869.00	8,516,200
中部飼料	13,500	1,445.00	19,507,500
フィード・ワン	74,200	151.00	11,204,200
東洋精糖	1,900	1,173.00	2,228,700
日本甜菜製糖	5,800	1,719.00	9,970,200
三井製糖	9,700	2,077.00	20,146,900
塩水港精糖	12,000	195.00	2,340,000
日新製糖	5,200	1,998.00	10,389,600
森永製菓	25,900	4,420.00	114,478,000
中村屋	2,900	3,910.00	11,339,000
江崎グリコ	32,800	4,540.00	148,912,000
名糖産業	5,300	1,339.00	7,096,700
井村屋グループ	4,700	1,805.00	8,483,500
不二家	6,200	2,062.00	12,784,400
山崎製パン	82,900	2,257.00	187,105,300
第一屋製パン	1,900	921.00	1,749,900
モロゾフ	1,900	5,190.00	9,861,000
亀田製菓	6,300	4,945.00	31,153,500
寿スピリッツ	10,600	4,865.00	51,569,000
カルビー	50,400	2,921.00	147,218,400
森永乳業	20,400	4,180.00	85,272,000
六甲バター	7,300	1,369.00	9,993,700
ヤクルト本社	76,000	6,390.00	485,640,000
明治ホールディングス	73,100	7,680.00	561,408,000
雪印メグミルク	26,600	2,456.00	65,329,600

プリマハム	17,300	2,453.00	42,436,900
日本ハム	42,200	3,765.00	158,883,000
林兼産業	3,700	559.00	2,068,300
丸大食品	11,800	1,955.00	23,069,000
S Foods	8,800	2,236.00	19,676,800
柿安本店	3,800	2,293.00	8,713,400
伊藤ハム米久ホールディングス	71,200	637.00	45,354,400
サッポロホールディングス	37,700	1,993.00	75,136,100
アサヒグループホールディングス	231,500	3,510.00	812,565,000
キリンホールディングス	468,800	2,137.50	1,002,060,000
宝ホールディングス	81,900	810.00	66,339,000
オエノンホールディングス	29,200	393.00	11,475,600
養命酒製造	3,400	1,960.00	6,664,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,600	2,219.00	172,194,400
サントリー食品インターナショナル	74,000	4,085.00	302,290,000
ダイトーグループホールディングス	5,700	3,655.00	20,833,500
伊藤園	33,600	5,720.00	192,192,000
キーコーヒー	10,900	2,298.00	25,048,200
ユニカフェ	2,800	848.00	2,374,400
ジャパンフーズ	1,600	1,133.00	1,812,800
日清オイリオグループ	14,200	3,650.00	51,830,000
不二製油グループ本社	26,900	2,608.00	70,155,200
かどや製油	1,200	3,665.00	4,398,000
J - オイルミルズ	5,700	4,570.00	26,049,000
キッコーマン	79,600	4,605.00	366,558,000
味の素	244,100	2,010.50	490,763,050
キューピー	61,500	2,161.00	132,901,500
ハウス食品グループ本社	41,300	3,525.00	145,582,500
カゴメ	41,900	2,805.00	117,529,500
焼津水産化学工業	5,400	957.00	5,167,800
アリアケジャパン	10,100	6,820.00	68,882,000
ピエトロ	1,400	1,550.00	2,170,000
エバラ食品工業	2,700	2,160.00	5,832,000
やまみ	700	1,712.00	1,198,400
ニチレイ	52,600	3,055.00	160,693,000
東洋水産	56,900	5,220.00	297,018,000
イトアンド	3,800	1,730.00	6,574,000
大冷	1,400	1,772.00	2,480,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,100	916.00	5,587,600
日清食品ホールディングス	47,000	9,000.00	423,000,000
永谷園ホールディングス	5,400	2,210.00	11,934,000
一正蒲鉾	4,300	960.00	4,128,000

フジッコ	12,000	1,947.00	23,364,000
ロック・フィールド	11,900	1,467.00	17,457,300
日本たばこ産業	638,300	1,996.00	1,274,046,800
ケンコーマヨネーズ	6,200	2,037.00	12,629,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,753.00	12,621,600
なとり	6,200	1,714.00	10,626,800
イフジ産業	1,900	788.00	1,497,200
ピクルスコーポレーション	2,400	2,159.00	5,181,600
北の達人コーポレーション	38,600	532.00	20,535,200
ユーグレナ	47,100	693.00	32,640,300
ミヨシ油脂	4,200	1,103.00	4,632,600
理研ビタミン	10,400	2,191.00	22,786,400
片倉工業	16,000	1,062.00	16,992,000
ゲンゼ	8,000	3,630.00	29,040,000
東洋紡	42,900	1,143.00	49,034,700
ユニチカ	33,000	270.00	8,910,000
富士紡ホールディングス	5,300	2,884.00	15,285,200
倉敷紡績	10,900	2,589.00	28,220,100
シキボウ	5,700	979.00	5,580,300
日本毛織	35,900	938.00	33,674,200
トーア紡コーポレーション	4,300	463.00	1,990,900
帝国繊維	12,300	2,100.00	25,830,000
帝人	88,200	1,830.00	161,406,000
東レ	781,700	469.00	366,617,300
サカイオーベックス	3,100	1,900.00	5,890,000
住江織物	3,000	1,701.00	5,103,000
日本フェルト	6,900	437.00	3,015,300
イチカワ	1,800	1,378.00	2,480,400
日東製網	1,200	1,500.00	1,800,000
アツギ	9,200	626.00	5,759,200
ダイニック	4,100	769.00	3,152,900
セーレン	26,800	1,300.00	34,840,000
ソトー	4,500	949.00	4,270,500
東海染工	1,600	1,153.00	1,844,800
小松マテーレ	18,000	735.00	13,230,000
ワコールホールディングス	28,200	2,347.00	66,185,400
ホギメディカル	12,400	3,365.00	41,726,000
クラウディアホールディングス	3,200	421.00	1,347,200
T S Iホールディングス	36,600	396.00	14,493,600
マツオカコーポレーション	3,200	1,682.00	5,382,400
ワールド	15,400	1,507.00	23,207,800
三陽商会	5,700	1,349.00	7,689,300

ナイガイ	4,400	427.00	1,878,800
オンワードホールディングス	65,200	475.00	30,970,000
ルックホールディングス	3,900	761.00	2,967,900
ゴールドウイン	19,600	6,020.00	117,992,000
デサント	21,200	1,270.00	26,924,000
キング	5,500	538.00	2,959,000
ヤマトインターナショナル	7,100	280.00	1,988,000
特種東海製紙	6,900	4,275.00	29,497,500
王子ホールディングス	450,900	579.00	261,071,100
日本製紙	47,700	1,539.00	73,410,300
三菱製紙	12,200	353.00	4,306,600
北越コーポレーション	71,600	404.00	28,926,400
中越パルプ工業	4,600	1,382.00	6,357,200
巴川製紙所	3,200	760.00	2,432,000
大王製紙	47,300	1,453.00	68,726,900
阿波製紙	2,800	439.00	1,229,200
レンゴー	102,000	842.00	85,884,000
トモク	6,600	1,526.00	10,071,600
ザ・パック	8,200	3,620.00	29,684,000
クラレ	169,900	1,092.00	185,530,800
旭化成	715,000	764.80	546,832,000
共和レザー	5,900	717.00	4,230,300
昭和電工	76,800	2,237.00	171,801,600
住友化学	792,500	321.00	254,392,500
住友精化	4,800	2,658.00	12,758,400
日産化学	60,300	3,940.00	237,582,000
ラサ工業	3,800	1,335.00	5,073,000
クレハ	9,200	4,405.00	40,526,000
多木化学	3,200	3,760.00	12,032,000
テイカ	7,900	1,437.00	11,352,300
石原産業	19,300	552.00	10,653,600
片倉コープアグリ	2,800	1,106.00	3,096,800
日本曹達	16,000	2,697.00	43,152,000
東ソー	166,700	1,230.00	205,041,000
トクヤマ	31,100	2,092.00	65,061,200
セントラル硝子	22,000	1,882.00	41,404,000
東亜合成	67,700	940.00	63,638,000
大阪ソーダ	11,000	2,574.00	28,314,000
関東電化工業	25,600	775.00	19,840,000
デンカ	39,400	2,277.00	89,713,800
信越化学工業	185,200	10,730.00	1,987,196,000
日本カーバイド工業	3,700	1,001.00	3,703,700

堺化学工業	7,000	1,797.00	12,579,000
第一稀元素化学工業	11,700	752.00	8,798,400
エア・ウォーター	100,300	1,486.00	149,045,800
大陽日酸	103,700	1,601.00	166,023,700
日本化学工業	3,400	2,220.00	7,548,000
東邦アセチレン	1,600	1,221.00	1,953,600
日本パーカラライジング	54,400	1,120.00	60,928,000
高压ガス工業	17,100	722.00	12,346,200
チタン工業	1,300	1,623.00	2,109,900
四国化成工業	16,600	993.00	16,483,800
戸田工業	2,500	1,215.00	3,037,500
ステラ ケミファ	5,900	2,425.00	14,307,500
保土谷化学工業	4,000	3,080.00	12,320,000
日本触媒	16,700	4,950.00	82,665,000
大日精化工業	9,500	2,359.00	22,410,500
カネカ	27,900	2,590.00	72,261,000
三菱瓦斯化学	100,300	1,176.00	117,952,800
三井化学	97,900	2,051.00	200,792,900
J S R	100,500	1,993.00	200,296,500
東京応化工業	18,500	4,145.00	76,682,500
大阪有機化学工業	10,000	1,502.00	15,020,000
三菱ケミカルホールディングス	721,100	642.80	463,523,080
K Hネオケム	19,000	1,521.00	28,899,000
ダイセル	147,600	789.00	116,456,400
住友ベークライト	17,000	2,295.00	39,015,000
積水化学工業	231,900	1,433.00	332,312,700
日本ゼオン	97,300	814.00	79,202,200
アイカ工業	32,400	3,095.00	100,278,000
宇部興産	54,500	1,657.00	90,306,500
積水樹脂	19,400	1,990.00	38,606,000
タキロンシーアイ	23,300	599.00	13,956,700
旭有機材	6,100	1,395.00	8,509,500
日立化成	49,900	4,590.00	229,041,000
ニチバン	5,700	1,496.00	8,527,200
リケンテクノス	27,100	385.00	10,433,500
大倉工業	5,100	1,577.00	8,042,700
積水化成成品工業	14,500	560.00	8,120,000
群栄化学工業	2,500	2,448.00	6,120,000
タイガースポリマー	5,700	453.00	2,582,100
ミライアル	3,800	935.00	3,553,000
ダイキアクシス	3,800	740.00	2,812,000
ダイキョーニシカワ	22,700	494.00	11,213,800

竹本容器	3,900	629.00	2,453,100
森六ホールディングス	5,800	1,497.00	8,682,600
日本化薬	66,800	995.00	66,466,000
カーリットホールディングス	11,500	466.00	5,359,000
日本精化	8,700	1,495.00	13,006,500
扶桑化学工業	10,900	3,035.00	33,081,500
トリケミカル研究所	2,400	7,330.00	17,592,000
A D E K A	49,600	1,351.00	67,009,600
日油	40,600	3,430.00	139,258,000
新日本理化	17,800	155.00	2,759,000
ハリマ化成グループ	8,900	1,123.00	9,994,700
花王	263,700	8,830.00	2,328,471,000
第一工業製薬	4,000	3,750.00	15,000,000
石原ケミカル	2,900	1,929.00	5,594,100
日華化学	3,600	850.00	3,060,000
ニイタカ	1,700	3,005.00	5,108,500
三洋化成工業	6,400	3,955.00	25,312,000
有機合成薬品工業	8,300	250.00	2,075,000
大日本塗料	12,200	795.00	9,699,000
日本ペイントホールディングス	89,000	5,660.00	503,740,000
関西ペイント	121,200	2,058.00	249,429,600
神東塗料	8,500	145.00	1,232,500
中国塗料	30,700	879.00	26,985,300
日本特殊塗料	8,100	791.00	6,407,100
藤倉化成	14,500	488.00	7,076,000
太陽ホールディングス	7,900	4,070.00	32,153,000
D I C	45,600	2,393.00	109,120,800
サカタインクス	23,500	909.00	21,361,500
東洋インキＳＣホールディングス	22,800	2,045.00	46,626,000
T & K T O K A	8,400	710.00	5,964,000
富士フイルムホールディングス	211,200	5,439.00	1,148,716,800
資生堂	218,800	6,382.00	1,396,381,600
ライオン	143,200	2,313.00	331,221,600
高砂香料工業	6,900	2,017.00	13,917,300
マンダム	24,800	2,071.00	51,360,800
ミルボン	14,700	5,450.00	80,115,000
ファンケル	44,600	2,427.00	108,244,200
コーセー	20,700	13,330.00	275,931,000
コタ	6,380	1,233.00	7,866,540
シーボン	1,400	2,036.00	2,850,400
ポーラ・オルビスホールディングス	47,000	1,995.00	93,765,000
ノエビアホールディングス	10,500	5,520.00	57,960,000

アジュバンコスメジャパン	2,500	924.00	2,310,000	
エステー	7,100	1,601.00	11,367,100	
アグロ カネショウ	3,400	1,520.00	5,168,000	
コニシ	18,100	1,432.00	25,919,200	
長谷川香料	14,600	2,037.00	29,740,200	
星光PMC	6,300	635.00	4,000,500	
小林製薬	30,900	10,000.00	309,000,000	
荒川化学工業	9,900	1,203.00	11,909,700	
メック	7,500	1,503.00	11,272,500	
日本高純度化学	3,000	2,393.00	7,179,000	
タカラバイオ	28,800	2,231.00	64,252,800	
JCU	13,300	2,253.00	29,964,900	
新田ゼラチン	6,900	591.00	4,077,900	
OATアグリオ	1,900	964.00	1,831,600	
デクセリアルズ	28,400	698.00	19,823,200	
アース製薬	8,300	5,730.00	47,559,000	
北興化学工業	11,300	559.00	6,316,700	
大成ラミック	3,600	2,522.00	9,079,200	
クミアイ化学工業	45,500	837.00	38,083,500	
日本農薬	19,600	418.00	8,192,800	
アキレス	7,600	1,753.00	13,322,800	
有沢製作所	17,400	802.00	13,954,800	
日東電工	76,000	4,825.00	366,700,000	
レック	11,700	1,085.00	12,694,500	
三光合成	12,600	260.00	3,276,000	
きもと	18,700	133.00	2,487,100	
藤森工業	9,900	2,925.00	28,957,500	
前澤化成工業	7,000	996.00	6,972,000	
未来工業	5,900	2,000.00	11,800,000	
ウェーブロックホールディングス	3,800	505.00	1,919,000	
JSP	6,400	1,398.00	8,947,200	
エフピコ	12,100	7,170.00	86,757,000	
天馬	7,300	1,612.00	11,767,600	
信越ポリマー	19,800	844.00	16,711,200	
東リ	27,400	260.00	7,124,000	
ニフコ	40,400	1,940.00	78,376,000	
バルカー	8,900	1,750.00	15,575,000	
ユニ・チャーム	212,300	4,051.00	860,027,300	
ショーエイコーポレーション	1,200	675.00	810,000	
協和キリン	110,800	2,422.00	268,357,600	
武田薬品工業	916,300	3,308.00	3,031,120,400	
アステラス製薬	955,000	1,671.00	1,595,805,000	

大日本住友製薬	81,600	1,403.00	114,484,800	
塩野義製薬	140,800	5,317.00	748,633,600	
わかもと製薬	13,100	230.00	3,013,000	
あすか製薬	12,500	1,098.00	13,725,000	
日本新薬	28,800	8,480.00	244,224,000	
バイオフェルミン製薬	1,900	2,359.00	4,482,100	
中外製薬	114,800	12,500.00	1,435,000,000	
科研製薬	18,900	5,030.00	95,067,000	
エーザイ	131,800	7,931.00	1,045,305,800	
ロート製薬	56,500	2,960.00	167,240,000	
小野薬品工業	252,900	2,486.00	628,709,400	
久光製薬	29,100	5,040.00	146,664,000	
持田製薬	15,300	4,170.00	63,801,000	
参天製薬	205,200	1,858.00	381,261,600	
扶桑薬品工業	3,900	2,093.00	8,162,700	
日本ケミファ	1,500	2,475.00	3,712,500	
ツムラ	34,100	2,752.00	93,843,200	
日医工	31,200	1,427.00	44,522,400	
キッセイ薬品工業	19,500	2,781.00	54,229,500	
生化学工業	21,400	1,128.00	24,139,200	
栄研化学	19,400	1,971.00	38,237,400	
日水製薬	4,600	1,227.00	5,644,200	
鳥居薬品	6,900	2,699.00	18,623,100	
JCRファーマ	7,800	9,420.00	73,476,000	
東和薬品	14,100	2,267.00	31,964,700	
富士製薬工業	7,500	1,213.00	9,097,500	
沢井製薬	22,600	5,770.00	130,402,000	
ゼリア新薬工業	20,000	2,088.00	41,760,000	
第一三共	315,200	7,434.00	2,343,196,800	
キョーリン製薬ホールディングス	24,300	2,198.00	53,411,400	
大幸薬品	13,200	1,556.00	20,539,200	
ダイト	6,600	2,950.00	19,470,000	
大塚ホールディングス	209,800	4,231.00	887,663,800	
大正製薬ホールディングス	23,300	6,640.00	154,712,000	
ペプチドリーム	55,700	3,770.00	209,989,000	
日本コークス工業	93,000	61.00	5,673,000	
ニチレキ	13,000	1,300.00	16,900,000	
ユシロ化学工業	6,200	1,181.00	7,322,200	
ビーピー・カストロール	3,900	1,143.00	4,457,700	
富士石油	29,400	189.00	5,556,600	
MORESCO	4,000	856.00	3,424,000	
出光興産	123,900	2,478.00	307,024,200	

J X T Gホールディングス	1,656,800	370.20	613,347,360
コスモエネルギーホールディングス	31,900	1,521.00	48,519,900
横浜ゴム	63,800	1,343.00	85,683,400
TOYO TIRE	63,200	1,240.00	78,368,000
ブリヂストン	317,300	3,323.00	1,054,387,900
住友ゴム工業	98,900	1,019.00	100,779,100
藤倉コンポジット	9,600	354.00	3,398,400
オカモト	6,700	3,880.00	25,996,000
フコク	4,800	618.00	2,966,400
ニッタ	12,400	2,115.00	26,226,000
住友理工	21,300	585.00	12,460,500
三ツ星ベルト	14,500	1,221.00	17,704,500
バンドー化学	19,400	629.00	12,202,600
日東紡績	16,400	4,775.00	78,310,000
A G C	108,900	2,659.00	289,565,100
日本板硝子	52,700	333.00	17,549,100
石塚硝子	2,000	1,981.00	3,962,000
日本山村硝子	4,600	852.00	3,919,200
日本電気硝子	44,300	1,448.00	64,146,400
オハラ	4,400	872.00	3,836,800
住友大阪セメント	20,900	3,240.00	67,716,000
太平洋セメント	69,600	1,850.00	128,760,000
日本ヒューム	11,100	624.00	6,926,400
日本コンクリート工業	23,800	268.00	6,378,400
三谷セキサン	5,100	4,585.00	23,383,500
アジアパイルホールディングス	15,700	402.00	6,311,400
東海カーボン	115,400	892.00	102,936,800
日本カーボン	5,700	3,215.00	18,325,500
東洋炭素	6,500	1,399.00	9,093,500
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	3,440.00	20,984,000
T O T O	78,700	3,595.00	282,926,500
日本碍子	134,400	1,417.00	190,444,800
日本特殊陶業	85,700	1,522.00	130,435,400
M A R U W A	4,200	6,590.00	27,678,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,215.00	6,423,500
黒崎播磨	2,200	4,085.00	8,987,000
ヨータイ	8,800	630.00	5,544,000
イソライト工業	5,700	444.00	2,530,800
東京窯業	14,100	282.00	3,976,200
ニッカトー	5,000	584.00	2,920,000
フジミインコーポレーテッド	9,800	2,688.00	26,342,400
クニミネ工業	4,500	914.00	4,113,000

エーアンドエーマテリアル	1,900	1,161.00	2,205,900
ニチアス	30,200	2,024.00	61,124,800
ニチハ	15,300	2,048.00	31,334,400
日本製鉄	487,500	925.40	451,132,500
神戸製鋼所	199,500	334.00	66,633,000
中山製鋼所	15,200	402.00	6,110,400
合同製鐵	5,900	2,102.00	12,401,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	294,200	703.00	206,822,600
東京製鐵	53,100	676.00	35,895,600
共英製鋼	12,300	1,247.00	15,338,100
大和工業	23,200	1,854.00	43,012,800
東京鐵鋼	4,500	1,180.00	5,310,000
大阪製鐵	5,800	1,154.00	6,693,200
淀川製鋼所	14,700	1,767.00	25,974,900
丸一鋼管	35,400	2,599.00	92,004,600
モリ工業	3,300	2,494.00	8,230,200
大同特殊鋼	17,800	3,480.00	61,944,000
日本高周波鋼業	4,200	370.00	1,554,000
日本冶金工業	9,000	1,683.00	15,147,000
山陽特殊製鋼	7,600	968.00	7,356,800
愛知製鋼	6,100	3,145.00	19,184,500
日立金属	117,400	1,139.00	133,718,600
日本金属	2,500	601.00	1,502,500
大平洋金属	7,400	1,570.00	11,618,000
新日本電工	70,500	150.00	10,575,000
栗本鐵工所	5,400	1,895.00	10,233,000
虹技	1,700	995.00	1,691,500
三菱製鋼	8,100	796.00	6,447,600
日亜鋼業	16,100	282.00	4,540,200
日本精線	1,800	2,962.00	5,331,600
エンビプロ・ホールディングス	4,700	545.00	2,561,500
シンニッタン	17,100	224.00	3,830,400
新家工業	2,500	1,054.00	2,635,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	578.00	10,404,000
日本軽金属ホールディングス	276,000	169.00	46,644,000
三井金属鉱業	29,400	1,807.00	53,125,800
東邦亜鉛	5,600	1,200.00	6,720,000
三菱マテリアル	72,000	2,215.00	159,480,000
住友金属鉱山	139,200	2,218.00	308,745,600
D O W Aホールディングス	27,600	2,829.00	78,080,400
古河機械金属	19,400	1,060.00	20,564,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,400	935.00	10,659,000

東邦チタニウム	19,600	647.00	12,681,200
U A C J	16,600	1,553.00	25,779,800
C Kサンエツ	2,300	2,940.00	6,762,000
古河電気工業	33,900	1,965.00	66,613,500
住友電気工業	407,300	1,138.00	463,507,400
フジクラ	131,800	313.00	41,253,400
昭和電線ホールディングス	12,600	1,010.00	12,726,000
東京特殊電線	1,700	2,418.00	4,110,600
タツタ電線	21,700	460.00	9,982,000
カナレ電気	1,900	1,604.00	3,047,600
平河ヒューテック	4,100	882.00	3,616,200
リヨービ	13,500	1,327.00	17,914,500
アーレスティ	14,500	354.00	5,133,000
アサヒホールディングス	19,100	2,263.00	43,223,300
稲葉製作所	6,100	1,276.00	7,783,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,620.00	5,346,000
トーカロ	30,300	1,019.00	30,875,700
アルファC o	3,800	912.00	3,465,600
S U M C O	130,400	1,393.00	181,647,200
川田テクノロジーズ	2,200	5,410.00	11,902,000
R S T e c h n o l o g i e s	3,100	2,119.00	6,568,900
信和	4,700	732.00	3,440,400
東洋製罐グループホールディングス	69,400	1,234.00	85,639,600
ホッカンホールディングス	6,000	1,543.00	9,258,000
コロナ	6,000	960.00	5,760,000
横河ブリッジホールディングス	20,300	1,968.00	39,950,400
駒井ハルテック	2,000	1,494.00	2,988,000
高田機工	1,000	2,246.00	2,246,000
三和ホールディングス	104,500	844.00	88,198,000
文化シャッター	32,100	785.00	25,198,500
三協立山	14,500	1,038.00	15,051,000
アルインコ	7,900	931.00	7,354,900
東洋シャッター	2,600	677.00	1,760,200
L I X I L グループ	160,700	1,345.00	216,141,500
日本フィルコン	8,300	481.00	3,992,300
ノーリツ	22,600	1,177.00	26,600,200
長府製作所	11,100	2,545.00	28,249,500
リンナイ	21,200	7,650.00	162,180,000
ダイニチ工業	5,900	609.00	3,593,100
日東精工	15,000	526.00	7,890,000
三洋工業	1,400	1,698.00	2,377,200
岡部	22,100	723.00	15,978,300

ジーテクト	13,500	1,105.00	14,917,500
東プレ	20,300	1,200.00	24,360,000
高周波熱錬	21,000	704.00	14,784,000
東京製綱	7,800	617.00	4,812,600
サンコール	6,100	419.00	2,555,900
モリテック スチール	8,500	262.00	2,227,000
パイオラックス	16,100	1,519.00	24,455,900
エイチワン	10,700	498.00	5,328,600
日本発條	116,800	708.00	82,694,400
中央発條	1,300	2,584.00	3,359,200
アドバネクス	1,600	1,395.00	2,232,000
立川ブラインド工業	4,800	1,085.00	5,208,000
三益半導体工業	9,300	1,769.00	16,451,700
日本ドライケミカル	2,700	1,384.00	3,736,800
日本製鋼所	33,100	1,308.00	43,294,800
三浦工業	47,100	3,855.00	181,570,500
タクマ	37,000	1,202.00	44,474,000
ツガミ	22,700	754.00	17,115,800
オークマ	12,700	3,485.00	44,259,500
東芝機械	12,300	2,146.00	26,395,800
アマダホールディングス	138,500	853.00	118,140,500
アイダエンジニアリング	28,600	691.00	19,762,600
滝澤鉄工所	3,400	1,088.00	3,699,200
F U J I	46,900	1,650.00	77,385,000
牧野フライス製作所	12,800	2,853.00	36,518,400
オーエスジー	50,400	1,447.00	72,928,800
ダイジェット工業	1,300	1,243.00	1,615,900
旭ダイヤモンド工業	28,700	463.00	13,288,100
D M G 森精機	69,000	902.00	62,238,000
ソディック	25,700	648.00	16,653,600
ディスコ	14,800	21,360.00	316,128,000
日東工器	6,000	1,707.00	10,242,000
日進工具	3,200	2,434.00	7,788,800
パンチ工業	10,000	409.00	4,090,000
富士ダイス	4,900	604.00	2,959,600
豊和工業	6,100	623.00	3,800,300
O K K	4,600	457.00	2,102,200
東洋機械金属	7,900	407.00	3,215,300
津田駒工業	2,200	798.00	1,755,600
エンシュウ	2,700	909.00	2,454,300
島精機製作所	17,600	1,429.00	25,150,400
オプトラン	12,200	2,572.00	31,378,400

NCホールディングス	3,400	598.00	2,033,200
イワキポンプ	5,300	858.00	4,547,400
フリュー	10,700	824.00	8,816,800
ヤマシンフィルタ	23,800	713.00	16,969,400
日阪製作所	13,500	738.00	9,963,000
やまびこ	21,200	812.00	17,214,400
平田機工	5,200	4,605.00	23,946,000
ペガサスミシン製造	11,200	353.00	3,953,600
マルマエ	4,600	718.00	3,302,800
タツモ	5,100	1,049.00	5,349,900
ナプテスコ	64,200	2,495.00	160,179,000
三井海洋開発	11,600	1,307.00	15,161,200
レオン自動機	10,700	1,193.00	12,765,100
S M C	34,600	45,750.00	1,582,950,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,600	746.00	7,161,600
ホソカワミクロン	3,800	4,785.00	18,183,000
ユニオンツール	4,100	2,533.00	10,385,300
オイレス工業	14,100	1,368.00	19,288,800
日精エー・エス・ビー機械	3,700	3,140.00	11,618,000
サトーホールディングス	15,600	2,122.00	33,103,200
技研製作所	9,600	3,535.00	33,936,000
日本エアーテック	3,500	967.00	3,384,500
カワタ	3,300	700.00	2,310,000
日精樹脂工業	9,200	925.00	8,510,000
オカダアイヨン	3,500	841.00	2,943,500
ワイエイシイホールディングス	4,700	413.00	1,941,100
小松製作所	498,900	1,778.50	887,293,650
住友重機械工業	63,100	1,951.00	123,108,100
日立建機	44,200	2,189.00	96,753,800
日工	15,200	609.00	9,256,800
巴工業	4,700	2,062.00	9,691,400
井関農機	11,100	1,141.00	12,665,100
T O W A	11,200	746.00	8,355,200
丸山製作所	2,500	1,121.00	2,802,500
北川鉄工所	5,000	1,543.00	7,715,000
ローツェ	4,800	3,105.00	14,904,000
タカキタ	4,000	546.00	2,184,000
クボタ	584,400	1,381.50	807,348,600
荏原実業	2,800	2,181.00	6,106,800
三菱化工機	3,800	1,604.00	6,095,200
月島機械	20,300	1,355.00	27,506,500
帝国電機製作所	9,100	1,313.00	11,948,300

新東工業	26,200	753.00	19,728,600	
澁谷工業	9,700	2,542.00	24,657,400	
アイチ コーポレーション	19,100	685.00	13,083,500	
小森コーポレーション	28,000	737.00	20,636,000	
鶴見製作所	8,600	1,941.00	16,692,600	
住友精密工業	1,700	2,216.00	3,767,200	
日本ギア工業	3,500	243.00	850,500	
酒井重工業	2,100	2,420.00	5,082,000	
荏原製作所	45,600	2,057.00	93,799,200	
石井鐵工所	1,500	2,142.00	3,213,000	
西島製作所	11,200	764.00	8,556,800	
北越工業	11,400	1,083.00	12,346,200	
ダイキン工業	140,300	13,170.00	1,847,751,000	
オルガノ	4,000	5,480.00	21,920,000	
トーヨーカネツ	4,800	1,955.00	9,384,000	
栗田工業	59,600	2,498.00	148,880,800	
椿本チエイン	15,700	2,460.00	38,622,000	
大同工業	5,300	694.00	3,678,200	
木村化工機	9,300	437.00	4,064,100	
アネスト岩田	17,200	996.00	17,131,200	
ダイフク	56,300	6,850.00	385,655,000	
サムコ	3,100	1,555.00	4,820,500	
加藤製作所	6,100	1,182.00	7,210,200	
油研工業	1,900	1,422.00	2,701,800	
タダノ	53,200	774.00	41,176,800	
フジテック	40,100	1,391.00	55,779,100	
C K D	30,700	1,480.00	45,436,000	
キトー	8,400	997.00	8,374,800	
平和	30,700	2,021.00	62,044,700	
理想科学工業	9,800	1,633.00	16,003,400	
S A N K Y O	24,500	3,145.00	77,052,500	
日本金銭機械	12,300	541.00	6,654,300	
マースグループホールディングス	7,000	1,715.00	12,005,000	
フクシマガリレイ	6,800	3,400.00	23,120,000	
オーイズミ	4,800	356.00	1,708,800	
ダイコク電機	5,100	1,228.00	6,262,800	
竹内製作所	18,500	1,348.00	24,938,000	
アマノ	28,900	2,387.00	68,984,300	
J U K I	15,300	551.00	8,430,300	
蛇の目マシン工業	10,300	292.00	3,007,600	
マックス	16,800	1,665.00	27,972,000	
グローリー	28,300	2,490.00	70,467,000	

新晃工業	10,300	1,396.00	14,378,800
大和冷機工業	16,000	944.00	15,104,000
セガサミーホールディングス	109,300	1,315.00	143,729,500
日本ピストンリング	4,100	1,130.00	4,633,000
リケン	5,100	2,757.00	14,060,700
T P R	14,900	1,152.00	17,164,800
ツバキ・ナカシマ	22,600	676.00	15,277,600
ホシザキ	32,200	8,110.00	261,142,000
大豊工業	9,100	538.00	4,895,800
日本精工	207,400	694.00	143,935,600
N T N	255,200	189.00	48,232,800
ジェイテクト	105,700	735.00	77,689,500
不二越	10,200	2,921.00	29,794,200
日本トムソン	32,900	369.00	12,140,100
T H K	64,100	2,212.00	141,789,200
ユーシン精機	8,600	673.00	5,787,800
前澤給装工業	4,000	1,916.00	7,664,000
イーグル工業	13,700	678.00	9,288,600
前澤工業	7,500	315.00	2,362,500
日本ピラー工業	11,200	1,258.00	14,089,600
キッツ	44,700	653.00	29,189,100
マキタ	143,600	3,315.00	476,034,000
日立造船	87,500	348.00	30,450,000
三菱重工業	184,600	2,732.50	504,419,500
I H I	79,400	1,262.00	100,202,800
スター精密	17,000	1,091.00	18,547,000
日清紡ホールディングス	73,500	721.00	52,993,500
イビデン	67,600	2,371.00	160,279,600
コニカミノルタ	241,400	439.00	105,974,600
ブラザー工業	134,700	1,654.00	222,793,800
ミネベアミツミ	204,700	1,614.00	330,385,800
日立製作所	529,200	3,143.00	1,663,275,600
三菱電機	1,101,400	1,335.00	1,470,369,000
富士電機	66,400	2,449.00	162,613,600
東洋電機製造	4,200	1,126.00	4,729,200
安川電機	118,600	2,976.00	352,953,600
シンフォニアテクノロジー	14,300	960.00	13,728,000
明電舎	20,300	1,622.00	32,926,600
オリジン	3,000	1,419.00	4,257,000
山洋電気	5,400	4,355.00	23,517,000
デンヨー	9,400	1,925.00	18,095,000
東芝テック	13,800	3,400.00	46,920,000

芝浦メカトロニクス	2,100	2,383.00	5,004,300
マブチモーター	30,600	3,220.00	98,532,000
日本電産	265,200	5,607.00	1,486,976,400
トレックス・セミコンダクター	6,700	1,023.00	6,854,100
東光高岳	6,500	950.00	6,175,000
ダイヘン	12,100	2,906.00	35,162,600
ヤーマン	18,600	668.00	12,424,800
JVCケンウッド	91,500	195.00	17,842,500
ミマキエンジニアリング	10,900	413.00	4,501,700
第一精工	4,700	1,928.00	9,061,600
日新電機	25,900	926.00	23,983,400
大崎電気工業	22,100	534.00	11,801,400
オムロン	98,700	5,630.00	555,681,000
日東工業	16,200	1,729.00	28,009,800
I D E C	16,000	1,370.00	21,920,000
正興電機製作所	3,200	924.00	2,956,800
不二電機工業	1,800	1,105.00	1,989,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	37,000	1,454.00	53,798,000
サクサホールディングス	2,600	1,511.00	3,928,600
メルコホールディングス	4,000	2,183.00	8,732,000
テクノメディカ	2,700	1,874.00	5,059,800
日本電気	133,600	3,945.00	527,052,000
富士通	106,200	9,755.00	1,035,981,000
沖電気工業	44,800	1,014.00	45,427,200
岩崎通信機	4,800	822.00	3,945,600
電気興業	5,300	2,495.00	13,223,500
サンケン電気	12,100	2,103.00	25,446,300
ナカヨ	2,200	1,450.00	3,190,000
アイホン	6,300	1,441.00	9,078,300
ルネサスエレクトロニクス	527,200	389.00	205,080,800
セイコーエプソン	136,700	1,170.00	159,939,000
ワコム	75,200	318.00	23,913,600
アルバック	20,300	2,590.00	52,577,000
アクセル	5,200	637.00	3,312,400
E I Z O	8,600	3,150.00	27,090,000
日本信号	28,100	1,055.00	29,645,500
京三製作所	26,000	466.00	12,116,000
能美防災	14,800	2,002.00	29,629,600
ホーチキ	8,300	1,366.00	11,337,800
星和電機	6,300	539.00	3,395,700
エレコム	12,300	3,765.00	46,309,500
パナソニック	1,258,400	825.00	1,038,180,000

シャープ	127,500	1,135.00	144,712,500
アンリツ	71,000	2,006.00	142,426,000
富士通ゼネラル	29,900	1,953.00	58,394,700
ソニー	696,500	6,421.00	4,472,226,500
T D K	53,200	8,380.00	445,816,000
帝国通信工業	5,200	1,187.00	6,172,400
タムラ製作所	37,000	396.00	14,652,000
アルプスアルパイン	97,800	1,049.00	102,592,200
池上通信機	3,500	838.00	2,933,000
鈴木	6,400	692.00	4,428,800
日本トリム	1,600	2,844.00	4,550,400
ローランド ディー . ジー .	6,300	1,165.00	7,339,500
フォスター電機	11,600	1,112.00	12,899,200
S M K	2,900	2,307.00	6,690,300
ヨコオ	7,300	2,162.00	15,782,600
ホシデン	30,600	756.00	23,133,600
ヒロセ電機	17,100	11,200.00	191,520,000
日本航空電子工業	25,300	1,301.00	32,915,300
T O A	11,900	805.00	9,579,500
マクセルホールディングス	24,100	1,064.00	25,642,400
古野電気	14,600	843.00	12,307,800
ユニデンホールディングス	3,100	1,822.00	5,648,200
スミダコーポレーション	8,900	662.00	5,891,800
アイコム	6,100	2,555.00	15,585,500
リオン	4,800	2,263.00	10,862,400
本多通信工業	10,300	379.00	3,903,700
横河電機	101,100	1,303.00	131,733,300
新電元工業	3,900	2,329.00	9,083,100
アズビル	69,500	2,804.00	194,878,000
東亜ディーケーケー	5,800	903.00	5,237,400
日本光電工業	45,600	4,060.00	185,136,000
チノー	3,900	1,226.00	4,781,400
共和電業	11,800	410.00	4,838,000
日本電子材料	4,500	813.00	3,658,500
堀場製作所	21,800	5,380.00	117,284,000
アドバンテスト	81,900	4,340.00	355,446,000
小野測器	5,600	511.00	2,861,600
エスペック	10,000	1,642.00	16,420,000
キーエンス	99,800	34,830.00	3,476,034,000
日置電機	5,900	3,075.00	18,142,500
シスメックス	78,700	7,846.00	617,480,200
日本マイクロニクス	19,600	781.00	15,307,600

メガチップス	10,500	1,555.00	16,327,500
O B A R A G R O U P	5,800	2,320.00	13,456,000
澤藤電機	1,600	1,292.00	2,067,200
原田工業	5,600	830.00	4,648,000
コーセル	15,000	987.00	14,805,000
イリソ電子工業	9,400	3,190.00	29,986,000
オブテックスグループ	18,400	1,000.00	18,400,000
千代田インテグレ	5,300	1,604.00	8,501,200
アイ・オー・データ機器	4,500	803.00	3,613,500
レーザーテック	48,400	5,060.00	244,904,000
スタンレー電気	77,600	2,132.00	165,443,200
岩崎電気	4,600	1,276.00	5,869,600
ウシオ電機	64,300	1,033.00	66,421,900
岡谷電機産業	10,100	314.00	3,171,400
ハリオス テクノ ホールディング	11,500	316.00	3,634,000
エノモト	3,700	828.00	3,063,600
日本セラミック	11,400	1,846.00	21,044,400
遠藤照明	6,200	584.00	3,620,800
古河電池	8,500	545.00	4,632,500
双信電機	6,600	353.00	2,329,800
山一電機	8,200	1,386.00	11,365,200
図研	7,300	2,306.00	16,833,800
日本電子	21,900	2,637.00	57,750,300
カシオ計算機	97,500	1,517.00	147,907,500
ファナック	104,700	14,655.00	1,534,378,500
日本シイエムケイ	26,700	445.00	11,881,500
エンプラス	5,800	2,120.00	12,296,000
大真空	4,300	1,485.00	6,385,500
ローム	49,000	5,930.00	290,570,000
浜松ホトニクス	79,100	4,420.00	349,622,000
三井ハイテック	12,500	1,127.00	14,087,500
新光電気工業	37,400	1,036.00	38,746,400
京セラ	155,000	6,408.00	993,240,000
太陽誘電	49,100	2,861.00	140,475,100
村田製作所	323,600	5,472.00	1,770,739,200
双葉電子工業	17,700	1,053.00	18,638,100
北陸電気工業	4,900	893.00	4,375,700
ニチコン	37,900	676.00	25,620,400
日本ケミコン	8,400	1,189.00	9,987,600
K O A	17,000	892.00	15,164,000
市光工業	17,200	481.00	8,273,200
小糸製作所	66,100	3,655.00	241,595,500

ミツバ	21,000	420.00	8,820,000
S C R E E Nホールディングス	19,100	4,000.00	76,400,000
キヤノン電子	11,800	1,595.00	18,821,000
キヤノン	592,900	2,359.00	1,398,651,100
リコー	280,300	794.00	222,558,200
象印マホービン	32,500	1,481.00	48,132,500
M U T O Hホールディングス	1,800	1,418.00	2,552,400
東京エレクトロン	69,900	20,355.00	1,422,814,500
トヨタ紡織	32,100	1,287.00	41,312,700
芦森工業	2,300	876.00	2,014,800
ユニプレス	21,400	964.00	20,629,600
豊田自動織機	89,100	5,180.00	461,538,000
モリタホールディングス	19,300	1,663.00	32,095,900
三櫻工業	14,000	684.00	9,576,000
デンソー	242,500	3,491.00	846,567,500
東海理化電機製作所	29,000	1,346.00	39,034,000
三井E & Sホールディングス	39,800	521.00	20,735,800
川崎重工業	85,700	1,569.00	134,463,300
名村造船所	35,400	204.00	7,221,600
日本車輛製造	4,000	2,745.00	10,980,000
三菱ロジスネクスト	14,600	874.00	12,760,400
近畿車輛	1,700	1,059.00	1,800,300
日産自動車	1,298,900	356.60	463,187,740
いすゞ自動車	319,100	715.30	228,252,230
トヨタ自動車	1,228,900	6,501.00	7,989,078,900
日野自動車	137,500	581.00	79,887,500
三菱自動車工業	407,700	306.00	124,756,200
エフテック	7,800	426.00	3,322,800
レシップホールディングス	4,300	433.00	1,861,900
G M B	2,000	565.00	1,130,000
ファルテック	2,000	648.00	1,296,000
武蔵精密工業	24,600	834.00	20,516,400
日産車体	21,500	939.00	20,188,500
新明和工業	29,700	1,126.00	33,442,200
極東開発工業	20,500	1,183.00	24,251,500
日信工業	22,400	2,204.00	49,369,600
トピー工業	9,100	1,376.00	12,521,600
ティラド	4,000	1,242.00	4,968,000
曙ブレーキ工業	60,500	155.00	9,377,500
タチエス	18,100	980.00	17,738,000
N O K	59,200	1,193.00	70,625,600
フタバ産業	30,700	457.00	14,029,900

K Y B	12,300	2,069.00	25,448,700
大同メタル工業	21,200	538.00	11,405,600
プレス工業	54,800	242.00	13,261,600
ミクニ	14,200	244.00	3,464,800
太平洋工業	23,100	941.00	21,737,100
ケーヒン	25,300	2,525.00	63,882,500
河西工業	14,900	528.00	7,867,200
アイシン精機	90,700	2,664.00	241,624,800
マツダ	324,100	572.00	185,385,200
今仙電機製作所	10,300	651.00	6,705,300
本田技研工業	867,200	2,430.00	2,107,296,000
スズキ	218,300	2,584.50	564,196,350
S U B A R U	341,900	2,073.50	708,929,650
安永	5,400	991.00	5,351,400
ヤマハ発動機	143,600	1,307.00	187,685,200
ショーワ	26,000	2,252.00	58,552,000
T B K	13,200	467.00	6,164,400
エクセディ	15,000	1,599.00	23,985,000
豊田合成	35,600	1,854.00	66,002,400
愛三工業	17,300	505.00	8,736,500
盟和産業	1,700	898.00	1,526,600
日本プラスト	8,700	437.00	3,801,900
ヨロズ	10,300	1,056.00	10,876,800
エフ・シー・シー	18,000	1,579.00	28,422,000
シマノ	41,200	15,440.00	636,128,000
テイ・エス テック	25,600	2,558.00	65,484,800
ジャムコ	5,600	701.00	3,925,600
テルモ	311,700	3,720.00	1,159,524,000
クリエートメディック	3,700	1,118.00	4,136,600
日機装	33,100	806.00	26,678,600
日本エム・ディ・エム	6,400	1,635.00	10,464,000
島津製作所	131,600	2,845.00	374,402,000
J M S	9,300	874.00	8,128,200
長野計器	8,000	804.00	6,432,000
ブイ・テクノロジー	5,200	3,130.00	16,276,000
東京計器	7,000	695.00	4,865,000
愛知時計電機	1,500	4,090.00	6,135,000
インターアクション	5,900	2,173.00	12,820,700
オーバル	9,900	215.00	2,128,500
東京精密	20,000	3,080.00	61,600,000
マニー	43,900	2,649.00	116,291,100
ニコン	178,200	998.00	177,843,600

トプコン	55,500	802.00	44,511,000
オリンパス	609,400	1,562.00	951,882,800
理研計器	9,700	2,042.00	19,807,400
タムロン	8,900	1,813.00	16,135,700
H O Y A	219,900	9,200.00	2,023,080,000
シード	4,700	814.00	3,825,800
ノーリツ鋼機	7,500	928.00	6,960,000
エー・アンド・デイ	10,100	641.00	6,474,100
朝日インテック	93,500	2,672.00	249,832,000
シチズン時計	129,100	384.00	49,574,400
リズム時計工業	3,500	649.00	2,271,500
大研医器	7,700	657.00	5,058,900
メニコン	15,600	4,825.00	75,270,000
シンシア	1,300	390.00	507,000
松風	5,000	1,761.00	8,805,000
セイコーホールディングス	15,600	1,744.00	27,206,400
ニプロ	76,200	1,271.00	96,850,200
中本パックス	2,800	1,292.00	3,617,600
スノーピーク	5,500	704.00	3,872,000
パラマウントベッドホールディングス	11,600	4,475.00	51,910,000
トランザクション	7,000	815.00	5,705,000
粧美堂	3,200	333.00	1,065,600
ニホンフラッシュ	10,200	950.00	9,690,000
前田工織	12,100	2,049.00	24,792,900
永大産業	14,400	276.00	3,974,400
アートネイチャー	11,800	643.00	7,587,400
バンダイナムコホールディングス	113,900	5,241.00	596,949,900
アイフィスジャパン	2,800	715.00	2,002,000
共立印刷	18,400	153.00	2,815,200
S H O E I	10,600	2,269.00	24,051,400
フランスベッドホールディングス	15,600	913.00	14,242,800
パイロットコーポレーション	18,000	3,595.00	64,710,000
萩原工業	6,100	1,411.00	8,607,100
トッパン・フォームズ	23,600	963.00	22,726,800
フジシールインターナショナル	24,700	1,912.00	47,226,400
タカラトミー	49,400	762.00	37,642,800
廣濟堂	7,700	709.00	5,459,300
エステールホールディングス	2,900	612.00	1,774,800
アーケ	42,000	73.00	3,066,000
タカノ	4,300	759.00	3,263,700
プロネクサス	9,500	1,042.00	9,899,000
ホクシン	6,800	114.00	775,200

ウッドワン	3,700	1,025.00	3,792,500
大建工業	7,400	1,696.00	12,550,400
凸版印刷	155,500	1,656.00	257,508,000
大日本印刷	144,100	2,301.00	331,574,100
共同印刷	3,400	2,715.00	9,231,000
N I S S H A	22,600	718.00	16,226,800
光村印刷	1,000	1,401.00	1,401,000
TAKARA & COMPANY	5,300	1,677.00	8,888,100
アシックス	90,900	999.00	90,809,100
ツツミ	3,400	1,729.00	5,878,600
小松ウオール工業	3,400	1,964.00	6,677,600
ヤマハ	65,500	4,215.00	276,082,500
河合楽器製作所	3,400	2,418.00	8,221,200
クリナップ	10,200	535.00	5,457,000
ピジョン	66,600	4,145.00	276,057,000
オリバー	2,300	3,235.00	7,440,500
兼松サステック	700	1,433.00	1,003,100
キングジム	9,200	833.00	7,663,600
リンテック	26,200	2,274.00	59,578,800
イトーキ	23,400	319.00	7,464,600
任天堂	67,500	41,610.00	2,808,675,000
三菱鉛筆	18,100	1,421.00	25,720,100
タカラスタANDARD	22,800	1,658.00	37,802,400
コクヨ	52,800	1,512.00	79,833,600
ナカバヤシ	10,800	539.00	5,821,200
グローブライド	4,900	1,871.00	9,167,900
オカムラ	38,400	865.00	33,216,000
美津濃	10,000	1,871.00	18,710,000
東京電力ホールディングス	879,200	377.00	331,458,400
中部電力	336,900	1,524.50	513,604,050
関西電力	417,300	1,203.50	502,220,550
中国電力	158,900	1,508.00	239,621,200
北陸電力	100,700	757.00	76,229,900
東北電力	275,100	1,041.00	286,379,100
四国電力	99,200	854.00	84,716,800
九州電力	227,000	869.00	197,263,000
北海道電力	103,100	468.00	48,250,800
沖縄電力	20,400	1,980.00	40,392,000
電源開発	87,600	2,178.00	190,792,800
エフオン	5,900	459.00	2,708,100
イーレックス	15,700	1,231.00	19,326,700
レノバ	18,400	920.00	16,928,000

東京瓦斯	211,800	2,556.00	541,360,800
大阪瓦斯	213,700	2,036.00	435,093,200
東邦瓦斯	54,200	4,900.00	265,580,000
北海道瓦斯	5,900	1,545.00	9,115,500
広島ガス	22,700	358.00	8,126,600
西部瓦斯	12,400	2,611.00	32,376,400
静岡ガス	31,300	878.00	27,481,400
メタウォーター	5,300	3,865.00	20,484,500
SBSホールディングス	9,500	1,749.00	16,615,500
東武鉄道	116,200	3,770.00	438,074,000
相鉄ホールディングス	35,200	2,773.00	97,609,600
東急	277,800	1,700.00	472,260,000
京浜急行電鉄	141,400	1,817.00	256,923,800
小田急電鉄	163,800	2,372.00	388,533,600
京王電鉄	57,100	6,390.00	364,869,000
京成電鉄	76,600	3,120.00	238,992,000
富士急行	15,000	2,787.00	41,805,000
新京成電鉄	2,800	2,184.00	6,115,200
東日本旅客鉄道	193,800	8,176.00	1,584,508,800
西日本旅客鉄道	98,100	7,396.00	725,547,600
東海旅客鉄道	91,600	17,320.00	1,586,512,000
西武ホールディングス	147,800	1,188.00	175,586,400
鴻池運輸	17,500	1,158.00	20,265,000
西日本鉄道	30,500	2,657.00	81,038,500
ハマキョウレックス	8,500	2,632.00	22,372,000
サカイ引越センター	5,800	5,740.00	33,292,000
近鉄グループホールディングス	104,300	5,000.00	521,500,000
阪急阪神ホールディングス	139,100	3,635.00	505,628,500
南海電気鉄道	49,400	2,460.00	121,524,000
京阪ホールディングス	46,400	4,800.00	222,720,000
神戸電鉄	2,500	3,830.00	9,575,000
名古屋鉄道	85,800	3,030.00	259,974,000
山陽電気鉄道	7,400	2,008.00	14,859,200
日本通運	36,900	5,290.00	195,201,000
ヤマトホールディングス	182,800	1,697.00	310,211,600
山九	29,000	4,035.00	117,015,000
丸運	5,900	230.00	1,357,000
丸全昭和運輸	8,500	2,389.00	20,306,500
センコーグループホールディングス	57,500	838.00	48,185,000
トナミホールディングス	2,500	4,850.00	12,125,000
ニッコンホールディングス	37,300	2,117.00	78,964,100
日本石油輸送	1,100	2,664.00	2,930,400

福山通運	13,300	3,865.00	51,404,500
セイノーホールディングス	78,100	1,173.00	91,611,300
エスライン	3,100	851.00	2,638,100
神奈川中央交通	2,600	3,985.00	10,361,000
日立物流	19,100	2,349.00	44,865,900
丸和運輸機関	11,000	2,445.00	26,895,000
C & F ロジホールディングス	10,500	1,240.00	13,020,000
九州旅客鉄道	91,400	3,100.00	283,340,000
S Gホールディングス	109,500	2,573.00	281,743,500
日本郵船	87,800	1,286.00	112,910,800
商船三井	66,400	1,747.00	116,000,800
川崎汽船	32,100	812.00	26,065,200
N S ユナイテッド海運	6,200	1,387.00	8,599,400
飯野海運	51,600	310.00	15,996,000
共栄タンカー	2,700	836.00	2,257,200
乾汽船	6,000	1,245.00	7,470,000
日本航空	187,800	1,990.00	373,722,000
A N Aホールディングス	190,700	2,639.00	503,257,300
パスコ	2,000	1,494.00	2,988,000
ランコム	2,900	7,060.00	20,474,000
日新	9,000	1,599.00	14,391,000
三菱倉庫	33,100	2,182.00	72,224,200
三井倉庫ホールディングス	11,900	1,399.00	16,648,100
住友倉庫	38,400	1,183.00	45,427,200
澁澤倉庫	5,700	2,026.00	11,548,200
東陽倉庫	18,800	348.00	6,542,400
日本トランスシティ	23,000	466.00	10,718,000
ケイヒン	2,000	1,129.00	2,258,000
中央倉庫	6,400	1,205.00	7,712,000
川西倉庫	1,900	918.00	1,744,200
安田倉庫	8,600	844.00	7,258,400
ファイズホールディングス	2,200	899.00	1,977,800
東洋埠頭	3,200	1,301.00	4,163,200
宇徳	8,900	533.00	4,743,700
上組	59,700	1,828.00	109,131,600
サンリツ	2,500	537.00	1,342,500
キムラユニティー	2,800	971.00	2,718,800
キューソー流通システム	2,600	1,597.00	4,152,200
近鉄エクスプレス	22,200	1,587.00	35,231,400
東海運	5,900	251.00	1,480,900
エーアイティー	7,400	730.00	5,402,000
内外トランスライン	3,700	1,162.00	4,299,400

日本コンセプト	3,300	1,366.00	4,507,800
NEC ネットエスアイ	10,300	4,400.00	45,320,000
クロスキャット	3,100	768.00	2,380,800
システナ	38,700	1,466.00	56,734,200
デジタルアーツ	5,400	4,670.00	25,218,000
日鉄ソリューションズ	16,300	2,632.00	42,901,600
キューブシステム	6,100	592.00	3,611,200
エイジア	2,100	1,178.00	2,473,800
コア	4,800	1,186.00	5,692,800
ソリトンシステムズ	5,000	1,205.00	6,025,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,800	1,659.00	7,963,200
T I S	108,300	1,787.00	193,532,100
ネオス	4,300	513.00	2,205,900
電算システム	4,200	2,145.00	9,009,000
グリー	72,000	417.00	30,024,000
コーエーテクモホールディングス	22,200	2,785.00	61,827,000
三菱総合研究所	4,700	3,290.00	15,463,000
電算	1,300	2,007.00	2,609,100
A G S	6,500	801.00	5,206,500
ファインデックス	9,400	679.00	6,382,600
ブレインパッド	2,800	4,240.00	11,872,000
K L a b	20,900	678.00	14,170,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	773.00	10,280,900
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,216.00	2,067,200
ネクソン	301,400	1,765.00	531,971,000
アイスタイル	31,200	207.00	6,458,400
エムアップ	3,200	2,125.00	6,800,000
エイチーム	7,800	601.00	4,687,800
エニグモ	8,000	827.00	6,616,000
テクノスジャパン	9,000	340.00	3,060,000
コロプラ	35,700	796.00	28,417,200
ブロードリーフ	54,100	470.00	25,427,000
クロス・マーケティンググループ	5,600	267.00	1,495,200
デジタルハーツホールディングス	6,000	731.00	4,386,000
システム情報	5,800	605.00	3,509,000
メディアドゥホールディングス	3,500	3,025.00	10,587,500
じげん	27,500	264.00	7,260,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,200	622.00	1,368,400
サイバーリンクス	1,900	917.00	1,742,300
フィックスターズ	11,700	1,023.00	11,969,100
C A R T A H O L D I N G S	5,500	820.00	4,510,000
オブティム	5,800	2,003.00	11,617,400

セレス	3,800	685.00	2,603,000
S H I F T	2,900	7,020.00	20,358,000
ティーガイア	9,700	2,048.00	19,865,600
セック	1,700	2,715.00	4,615,500
日本アジアグループ	11,400	246.00	2,804,400
テクマトリックス	7,700	2,209.00	17,009,300
プロシップ	3,300	1,070.00	3,531,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,200	1,512.00	39,614,400
GMOペイメントゲートウェイ	17,800	7,580.00	134,924,000
ザッパラス	6,000	304.00	1,824,000
システムリサーチ	3,000	1,387.00	4,161,000
インターネットイニシアティブ	16,000	3,545.00	56,720,000
さくらインターネット	12,100	466.00	5,638,600
ヴィンクス	3,300	696.00	2,296,800
GMOクラウド	2,100	1,666.00	3,498,600
SRAホールディングス	5,800	2,137.00	12,394,600
システムインテグレータ	3,800	605.00	2,299,000
朝日ネット	8,000	715.00	5,720,000
e B A S E	13,200	735.00	9,702,000
アバント	8,000	769.00	6,152,000
アドソル日進	3,900	2,163.00	8,435,700
フリービット	6,400	645.00	4,128,000
コムチュア	12,200	2,200.00	26,840,000
サイバーコム	2,100	1,685.00	3,538,500
アステリア	7,300	314.00	2,292,200
アイル	4,000	1,285.00	5,140,000
マークラインズ	5,500	1,621.00	8,915,500
メディカル・データ・ビジョン	8,600	657.00	5,650,200
ショーケース	3,100	427.00	1,323,700
モバイルファクトリー	2,600	1,058.00	2,750,800
テラスカイ	4,000	2,558.00	10,232,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,256.00	5,903,200
PCIホールディングス	4,600	897.00	4,126,200
パイプドHD	1,600	1,138.00	1,820,800
アイビーシー	2,200	780.00	1,716,000
ネオジャパン	2,300	1,030.00	2,369,000
P R T I M E S	1,000	1,647.00	1,647,000
ランドコンピュータ	1,900	970.00	1,843,000
ダブルスタンダード	1,400	4,085.00	5,719,000
オープンドア	5,600	738.00	4,132,800
マイネット	3,500	641.00	2,243,500
アカツキ	3,900	3,615.00	14,098,500

ベネフィットジャパン	1,000	1,221.00	1,221,000	
Ubicomホールディングス	2,600	1,390.00	3,614,000	
LINE	24,800	5,210.00	129,208,000	
カナミックネットワーク	7,000	523.00	3,661,000	
ノムラシステムコーポレーション	3,000	344.00	1,032,000	
チェンジ	2,200	2,763.00	6,078,600	
シンクロ・フード	5,600	203.00	1,136,800	
オークネット	6,900	1,318.00	9,094,200	
セグエグループ	2,100	785.00	1,648,500	
エイトレッド	1,500	1,237.00	1,855,500	
AOI TYO Holdings	11,400	432.00	4,924,800	
マクロミル	22,400	623.00	13,955,200	
ビーグリー	2,300	1,367.00	3,144,100	
オロ	2,900	2,642.00	7,661,800	
ユーザーローカル	900	2,372.00	2,134,800	
テモナ	1,900	561.00	1,065,900	
ニーズウェル	1,700	521.00	885,700	
サインポスト	1,800	1,248.00	2,246,400	
ソルクシーズ	5,000	540.00	2,700,000	
フェイス	4,100	582.00	2,386,200	
プロトコーポレーション	9,900	857.00	8,484,300	
ハイマックス	1,400	1,895.00	2,653,000	
野村総合研究所	153,300	2,288.00	350,750,400	
サイバネットシステム	8,100	560.00	4,536,000	
CEホールディングス	6,700	424.00	2,840,800	
日本システム技術	2,000	1,010.00	2,020,000	
インテージホールディングス	13,700	802.00	10,987,400	
東邦システムサイエンス	3,100	910.00	2,821,000	
ソースネクスト	52,100	292.00	15,213,200	
インフォコム	11,900	2,467.00	29,357,300	
HEROZ	1,200	2,710.00	3,252,000	
ラクスル	5,800	2,350.00	13,630,000	
FIG	12,800	230.00	2,944,000	
システムサポート	1,000	2,322.00	2,322,000	
イーソル	4,100	974.00	3,993,400	
アルテリア・ネットワークス	12,100	1,834.00	22,191,400	
東海ソフト	900	1,160.00	1,044,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	923.00	2,492,100	
フォーカスシステムズ	7,000	676.00	4,732,000	
クレスコ	6,700	1,424.00	9,540,800	
フジ・メディア・ホールディングス	104,300	1,077.00	112,331,100	
オービック	37,500	14,160.00	531,000,000	

ジャストシステム	17,600	4,915.00	86,504,000
TDCソフト	9,800	795.00	7,791,000
Zホールディングス	1,484,700	348.00	516,675,600
トレンドマイクロ	48,100	5,340.00	256,854,000
IDホールディングス	4,300	1,399.00	6,015,700
日本オラクル	21,900	9,440.00	206,736,000
アルファシステムズ	3,400	2,885.00	9,809,000
フューチャー	13,200	1,397.00	18,440,400
CAC Holdings	7,200	978.00	7,041,600
SBテクノロジー	4,000	2,130.00	8,520,000
トーセ	3,200	719.00	2,300,800
オービックビジネスコンサルタント	11,100	4,380.00	48,618,000
伊藤忠テクノソリューションズ	49,300	3,085.00	152,090,500
アイティフォー	13,400	566.00	7,584,400
東計電算	1,700	3,765.00	6,400,500
エクスネット	1,900	907.00	1,723,300
大塚商会	58,500	4,620.00	270,270,000
サイボウズ	12,800	1,907.00	24,409,600
ソフトブレーン	6,900	377.00	2,601,300
電通国際情報サービス	6,700	3,925.00	26,297,500
ACCESS	10,300	890.00	9,167,000
デジタルガレージ	19,500	3,455.00	67,372,500
EMシステムズ	15,400	902.00	13,890,800
ウェザーニューズ	3,700	3,535.00	13,079,500
CIJ	8,000	747.00	5,976,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	2,372.00	3,083,600
日本エンタープライズ	12,100	205.00	2,480,500
WOWOW	5,300	2,400.00	12,720,000
スカラ	7,700	422.00	3,249,400
インテリジェント ウェイブ	5,200	496.00	2,579,200
IMAGICA GROUP	9,900	353.00	3,494,700
ネットワンシステムズ	41,300	2,248.00	92,842,400
システムソフト	28,700	66.00	1,894,200
アルゴグラフィックス	9,200	3,545.00	32,614,000
マーベラス	16,900	534.00	9,024,600
エイベックス	18,800	851.00	15,998,800
日本ユニシス	33,800	2,893.00	97,783,400
兼松エレクトロニクス	5,900	3,400.00	20,060,000
東京放送ホールディングス	65,900	1,504.00	99,113,600
日本テレビホールディングス	90,400	1,205.00	108,932,000
朝日放送グループホールディングス	11,000	691.00	7,601,000
テレビ朝日ホールディングス	29,800	1,632.00	48,633,600

スカパーJ S A Tホールディングス	71,600	384.00	27,494,400
テレビ東京ホールディングス	9,000	2,404.00	21,636,000
日本BS放送	3,900	1,015.00	3,958,500
ビジョン	10,300	669.00	6,890,700
スマートバリュー	3,400	837.00	2,845,800
ワイヤレスゲート	5,700	388.00	2,211,600
コネクシオ	6,300	1,355.00	8,536,500
クロップス	2,400	467.00	1,120,800
日本電信電話	1,444,700	2,575.50	3,720,824,850
K D D I	805,500	3,190.00	2,569,545,000
ソフトバンク	982,300	1,374.50	1,350,171,350
光通信	11,200	18,130.00	203,056,000
N T T ドコモ	798,400	3,377.00	2,696,196,800
エムティーアイ	10,900	546.00	5,951,400
G M O インターネット	42,700	1,816.00	77,543,200
ファイバーゲート	2,800	1,012.00	2,833,600
アйдママーケティングコミュニケーション	3,800	363.00	1,379,400
K A D O K A W A	29,300	1,363.00	39,935,900
学研ホールディングス	14,800	1,846.00	27,320,800
ゼンリン	21,800	1,057.00	23,042,600
昭文社	5,600	374.00	2,094,400
インプレスホールディングス	8,900	129.00	1,148,100
アイネット	5,700	1,324.00	7,546,800
松竹	7,200	12,120.00	87,264,000
東宝	63,800	3,300.00	210,540,000
東映	4,100	13,560.00	55,596,000
エヌ・ティ・ティ・データ	287,900	1,040.00	299,416,000
ピー・シー・エー	1,500	3,065.00	4,597,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,680.00	5,092,000
D T S	24,300	1,880.00	45,684,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,100	4,825.00	222,432,500
シーイーシー	11,700	1,370.00	16,029,000
カブコン	51,000	3,390.00	172,890,000
アイ・エス・ビー	2,200	1,404.00	3,088,800
ジャステック	7,100	981.00	6,965,100
S C S K	25,000	4,815.00	120,375,000
日本システムウエア	3,700	1,739.00	6,434,300
アイネス	10,800	1,354.00	14,623,200
T K C	9,200	4,855.00	44,666,000
富士ソフト	13,900	3,475.00	48,302,500
N S D	34,900	1,440.00	50,256,000
コナミホールディングス	39,300	3,315.00	130,279,500

福井コンピュータホールディングス	4,400	2,174.00	9,565,600	
J B C Cホールディングス	7,400	1,675.00	12,395,000	
ミロク情報サービス	9,600	2,381.00	22,857,600	
ソフトバンクグループ	857,600	3,788.00	3,248,588,800	
ハウスイ	900	714.00	642,600	
高千穂交易	4,200	958.00	4,023,600	
伊藤忠食品	2,700	4,365.00	11,785,500	
エレマテック	10,200	769.00	7,843,800	
J A L U X	3,100	1,508.00	4,674,800	
あらた	8,600	4,625.00	39,775,000	
トーメンデバイス	1,600	3,245.00	5,192,000	
東京エレクトロン デバイス	3,900	2,251.00	8,778,900	
フィールズ	8,300	284.00	2,357,200	
双日	599,100	254.00	152,171,400	
アルフレッサ ホールディングス	120,600	2,014.00	242,888,400	
横浜冷凍	30,400	924.00	28,089,600	
ラサ商事	5,800	817.00	4,738,600	
ラクーンホールディングス	5,000	510.00	2,550,000	
アルコニックス	11,500	1,079.00	12,408,500	
神戸物産	37,400	4,260.00	159,324,000	
あい ホールディングス	15,500	1,333.00	20,661,500	
ディーブイエックス	3,900	909.00	3,545,100	
ダイワボウホールディングス	9,200	5,190.00	47,748,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,900	1,341.00	34,731,900	
ラクト・ジャパン	4,000	3,330.00	13,320,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,400	1,097.00	22,378,800	
八洲電機	8,400	821.00	6,896,400	
メディアスホールディングス	6,200	836.00	5,183,200	
レスターホールディングス	11,300	1,514.00	17,108,200	
ジューテックホールディングス	2,500	972.00	2,430,000	
大光	4,600	595.00	2,737,000	
O C H Iホールディングス	3,200	1,512.00	4,838,400	
T O K A Iホールディングス	57,300	937.00	53,690,100	
黒谷	2,500	342.00	855,000	
C o m i n i x	1,900	684.00	1,299,600	
三洋貿易	10,900	826.00	9,003,400	
ビューティガレージ	1,800	1,203.00	2,165,400	
ウイン・パートナーズ	7,800	980.00	7,644,000	
ミタチ産業	3,300	540.00	1,782,000	
シップヘルスケアホールディングス	17,400	4,425.00	76,995,000	
明治電機工業	3,400	1,372.00	4,664,800	
デリカフーズホールディングス	3,800	661.00	2,511,800	

スターティアホールディングス	2,500	474.00	1,185,000	
コメダホールディングス	23,600	1,662.00	39,223,200	
ピーバンドットコム	800	755.00	604,000	
アセンテック	900	2,948.00	2,653,200	
富士興産	3,300	371.00	1,224,300	
協栄産業	1,200	1,084.00	1,300,800	
小野建	9,700	1,135.00	11,009,500	
南陽	2,400	1,257.00	3,016,800	
佐島電機	7,700	887.00	6,829,900	
エコートレーディング	2,500	500.00	1,250,000	
伯東	6,600	967.00	6,382,200	
コンドーテック	8,400	929.00	7,803,600	
中山福	6,300	467.00	2,942,100	
ナガイレーベン	15,700	2,653.00	41,652,100	
三菱食品	11,900	2,779.00	33,070,100	
松田産業	7,900	1,268.00	10,017,200	
第一興商	16,200	2,881.00	46,672,200	
メディバルホールディングス	117,100	2,018.00	236,307,800	
S P K	4,600	1,257.00	5,782,200	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,197.00	8,788,000	
アズワン	7,100	9,520.00	67,592,000	
スズデン	3,800	1,109.00	4,214,200	
尾家産業	3,200	1,490.00	4,768,000	
シモジマ	6,700	1,214.00	8,133,800	
ドウシシャ	10,200	1,280.00	13,056,000	
小津産業	2,400	1,699.00	4,077,600	
高速	6,500	1,213.00	7,884,500	
たけびし	3,800	1,321.00	5,019,800	
リックス	2,500	1,574.00	3,935,000	
丸文	9,600	476.00	4,569,600	
ハビネット	9,100	1,096.00	9,973,600	
橋本総業ホールディングス	2,200	1,811.00	3,984,200	
日本ライフライン	32,100	1,362.00	43,720,200	
タカショー	5,300	433.00	2,294,900	
マルカ	3,800	1,882.00	7,151,600	
I D O M	29,300	393.00	11,514,900	
進和	6,400	1,736.00	11,110,400	
エスケイジャパン	2,400	276.00	662,400	
ダイトロン	4,600	1,486.00	6,835,600	
シークス	13,800	868.00	11,978,400	
田中商事	3,400	650.00	2,210,000	
オーハシテクニカ	6,100	1,332.00	8,125,200	

白銅	3,900	1,286.00	5,015,400
伊藤忠商事	758,700	2,242.50	1,701,384,750
丸紅	1,129,100	539.00	608,584,900
高島	1,700	1,456.00	2,475,200
長瀬産業	61,000	1,279.00	78,019,000
蝶理	6,900	1,537.00	10,605,300
豊田通商	121,100	2,546.00	308,320,600
三共生興	16,500	493.00	8,134,500
兼松	40,500	1,109.00	44,914,500
ツカモトコーポレーション	1,900	1,054.00	2,002,600
三井物産	953,400	1,503.50	1,433,436,900
日本紙パルプ商事	6,200	3,770.00	23,374,000
日立ハイテク	37,700	7,980.00	300,846,000
カメイ	14,200	1,015.00	14,413,000
東都水産	1,400	2,594.00	3,631,600
OUGホールディングス	1,700	2,679.00	4,554,300
スターゼン	4,000	4,440.00	17,760,000
山善	42,400	901.00	38,202,400
椿本興業	2,000	3,600.00	7,200,000
住友商事	684,400	1,239.00	847,971,600
内田洋行	4,600	3,525.00	16,215,000
三菱商事	761,200	2,291.50	1,744,289,800
第一実業	5,300	3,440.00	18,232,000
キャノンマーケティングジャパン	31,000	2,144.00	66,464,000
西華産業	6,200	1,084.00	6,720,800
佐藤商事	9,000	840.00	7,560,000
菱洋エレクトロ	11,000	2,059.00	22,649,000
東京産業	9,800	487.00	4,772,600
ユアサ商事	10,300	2,858.00	29,437,400
神鋼商事	2,700	1,885.00	5,089,500
小林産業	6,600	269.00	1,775,400
阪和興業	20,300	1,682.00	34,144,600
正栄食品工業	7,000	3,960.00	27,720,000
カナデン	8,800	1,252.00	11,017,600
菱電商事	7,800	1,297.00	10,116,600
フルサト工業	6,000	1,442.00	8,652,000
岩谷産業	24,100	3,610.00	87,001,000
ナイス	4,600	920.00	4,232,000
昭光通商	3,500	613.00	2,145,500
ニチモウ	1,700	1,628.00	2,767,600
極東貿易	3,100	1,295.00	4,014,500
イワキ	14,300	431.00	6,163,300

三愛石油	26,700	1,129.00	30,144,300
稲畑産業	23,900	1,180.00	28,202,000
G S I クレオス	2,700	992.00	2,678,400
明和産業	10,000	498.00	4,980,000
クワザワ	3,900	473.00	1,844,700
ワキタ	23,100	988.00	22,822,800
東邦ホールディングス	34,800	2,267.00	78,891,600
サンゲツ	29,600	1,605.00	47,508,000
ミツウロコグループホールディングス	16,000	1,136.00	18,176,000
シナネンホールディングス	4,500	2,618.00	11,781,000
伊藤忠エネクス	24,000	844.00	20,256,000
サンリオ	30,500	1,437.00	43,828,500
サンワテクノス	7,700	815.00	6,275,500
リョーサン	12,000	2,389.00	28,668,000
新光商事	17,000	890.00	15,130,000
トーホー	4,900	1,681.00	8,236,900
三信電気	5,800	1,395.00	8,091,000
東陽テクニカ	12,500	971.00	12,137,500
モスフードサービス	14,200	2,506.00	35,585,200
加賀電子	10,800	1,702.00	18,381,600
ソーダニッカ	11,200	595.00	6,664,000
立花エレテック	8,000	1,448.00	11,584,000
フォーバル	4,800	1,133.00	5,438,400
P A L T A C	17,400	5,390.00	93,786,000
三谷産業	14,300	318.00	4,547,400
西本Wismettacホールディングス	2,000	2,014.00	4,028,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,759.00	1,759,000
国際紙パルプ商事	25,800	255.00	6,579,000
ヤマタネ	5,500	1,108.00	6,094,000
丸紅建材リース	1,100	1,493.00	1,642,300
日鉄物産	7,700	3,650.00	28,105,000
泉州電業	3,300	2,418.00	7,979,400
トラスコ中山	22,600	2,342.00	52,929,200
オートバックスセブン	40,300	1,246.00	50,213,800
モリト	7,900	737.00	5,822,300
加藤産業	17,000	3,405.00	57,885,000
北恵	2,100	715.00	1,501,500
イノテック	6,500	860.00	5,590,000
イエローハット	20,500	1,503.00	30,811,500
J Kホールディングス	9,800	689.00	6,752,200
日伝	9,800	2,125.00	20,825,000
北沢産業	8,200	281.00	2,304,200

杉本商事	5,900	1,769.00	10,437,100
因幡電機産業	30,900	2,302.00	71,131,800
東テク	3,600	1,875.00	6,750,000
ミスミグループ本社	135,900	2,355.00	320,044,500
アルテック	8,700	183.00	1,592,100
タキヒヨー	3,300	1,539.00	5,078,700
蔵王産業	2,100	1,362.00	2,860,200
スズケン	45,900	3,935.00	180,616,500
ジェコス	7,500	784.00	5,880,000
グローセル	10,900	385.00	4,196,500
ローソン	27,500	5,930.00	163,075,000
サンエー	9,100	4,505.00	40,995,500
カワチ薬品	8,500	2,372.00	20,162,000
エービーシー・マート	17,000	5,410.00	91,970,000
ハードオフコーポレーション	4,500	642.00	2,889,000
アスクル	11,400	3,200.00	36,480,000
ゲオホールディングス	19,600	1,308.00	25,636,800
アダストリア	15,100	1,224.00	18,482,400
ジーフット	6,900	436.00	3,008,400
くら寿司	5,700	4,030.00	22,971,000
キャンドウ	5,200	1,680.00	8,736,000
パルグループホールディングス	11,200	1,315.00	14,728,000
エディオン	49,900	893.00	44,560,700
サーラコーポレーション	22,300	557.00	12,421,100
ワッツ	5,100	589.00	3,003,900
ハローズ	4,100	2,727.00	11,180,700
フジオフードシステム	9,300	1,346.00	12,517,800
あみやき亭	2,400	2,984.00	7,161,600
ひらまつ	19,900	159.00	3,164,100
大黒天物産	2,700	3,060.00	8,262,000
ハニーズホールディングス	9,700	1,084.00	10,514,800
ファーマライズホールディングス	2,900	672.00	1,948,800
アルペン	8,400	1,605.00	13,482,000
ハブ	3,300	620.00	2,046,000
クオールホールディングス	16,100	1,325.00	21,332,500
ジズホールディングス	5,800	5,930.00	34,394,000
ビックカメラ	64,500	875.00	56,437,500
D C Mホールディングス	58,800	997.00	58,623,600
Monotaro	77,200	2,868.00	221,409,600
東京一番フーズ	3,100	483.00	1,497,300
DDホールディングス	4,300	798.00	3,431,400
きちりホールディングス	3,200	521.00	1,667,200

アークランドサービスホールディングス	8,000	1,447.00	11,576,000
J.フロント リテイリング	129,700	898.00	116,470,600
ドトール・日レスホールディングス	17,400	1,639.00	28,518,600
マツモトキヨシホールディングス	44,900	3,930.00	176,457,000
ブロンコビリー	5,700	2,177.00	12,408,900
Z O Z O	74,700	1,451.00	108,389,700
トレジャー・ファクトリー	3,400	602.00	2,046,800
物語コーポレーション	2,900	6,230.00	18,067,000
ココカラファイン	11,400	5,610.00	63,954,000
三越伊勢丹ホールディングス	189,800	630.00	119,574,000
H a m e e	4,000	1,007.00	4,028,000
ウエルシアホールディングス	32,300	7,550.00	243,865,000
クリエイティブSDホールディングス	18,300	2,706.00	49,519,800
丸善C H Iホールディングス	12,700	370.00	4,699,000
ティーライフ	1,600	894.00	1,430,400
エー・ピーカンパニー	2,300	423.00	972,900
チムニー	3,400	1,633.00	5,552,200
シュッピン	7,600	635.00	4,826,000
ネクステージ	15,700	707.00	11,099,900
ジョイフル本田	31,900	1,246.00	39,747,400
鳥貴族	3,700	1,618.00	5,986,600
麒麟堂ホールディングス	4,300	1,731.00	7,443,300
ホットランド	7,400	944.00	6,985,600
すかいらーくホールディングス	121,600	1,602.00	194,803,200
S F Pホールディングス	4,700	1,384.00	6,504,800
綿半ホールディングス	4,200	1,588.00	6,669,600
ヨシックス	1,800	1,829.00	3,292,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,700	961.00	30,463,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	463.00	2,453,900
B E E N O S	4,200	801.00	3,364,200
あさひ	8,200	1,122.00	9,200,400
日本調剤	6,600	1,655.00	10,923,000
コスモス薬品	4,800	25,780.00	123,744,000
トーエル	5,500	801.00	4,405,500
オンリー	2,100	608.00	1,276,800
セブン&アイ・ホールディングス	424,400	3,576.00	1,517,654,400
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	58,500	631.00	36,913,500
ツルハホールディングス	23,600	14,260.00	336,536,000
サンマルクホールディングス	8,600	1,732.00	14,895,200
フェリシモ	2,600	953.00	2,477,800
トリドールホールディングス	27,000	1,157.00	31,239,000

TOKYO BASE	10,200	233.00	2,376,600
ウイルプラスホールディングス	1,800	510.00	918,000
JMホールディングス	5,500	2,205.00	12,127,500
サツドラホールディングス	1,700	1,908.00	3,243,600
アレンザホールディングス	5,600	713.00	3,992,800
串カツ田中ホールディングス	1,800	1,128.00	2,030,400
パロックジャパンリミテッド	7,700	627.00	4,827,900
クスリのアオキホールディングス	9,700	8,980.00	87,106,000
力の源ホールディングス	5,100	608.00	3,100,800
スシログローバルホールディングス	47,600	1,591.00	75,731,600
LIXILピバ	10,800	1,836.00	19,828,800
メディカルシステムネットワーク	10,800	430.00	4,644,000
はるやまホールディングス	5,300	741.00	3,927,300
ノジマ	19,400	1,783.00	34,590,200
カップ・クリエイト	15,200	1,334.00	20,276,800
ライトオン	8,100	505.00	4,090,500
良品計画	144,100	1,214.00	174,937,400
三城ホールディングス	12,100	248.00	3,000,800
アドヴァン	16,700	1,089.00	18,186,300
アルビス	4,200	2,065.00	8,673,000
コナカ	13,200	293.00	3,867,600
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,608.00	2,251,200
G-7ホールディングス	6,500	2,320.00	15,080,000
イオン北海道	14,500	738.00	10,701,000
コジマ	19,000	341.00	6,479,000
ヒマラヤ	4,000	729.00	2,916,000
コーナン商事	15,500	2,188.00	33,914,000
エコス	4,100	1,664.00	6,822,400
ワタミ	13,000	932.00	12,116,000
マルシェ	3,100	535.00	1,658,500
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	238,400	2,049.00	488,481,600
西松屋チェーン	24,000	746.00	17,904,000
ゼンショーホールディングス	52,000	2,061.00	107,172,000
幸楽苑ホールディングス	7,000	1,364.00	9,548,000
ハークスレイ	2,400	1,089.00	2,613,600
サイゼリヤ	17,900	2,049.00	36,677,100
VTホールディングス	45,400	293.00	13,302,200
魚力	3,100	1,509.00	4,677,900
フジ・コーポレーション	3,000	1,868.00	5,604,000
ユナイテッドアローズ	11,400	1,625.00	18,525,000
ハイデイ日高	15,800	1,521.00	24,031,800
京都きもの友禅	7,500	245.00	1,837,500

コロワイド	36,100	1,635.00	59,023,500
ピーシーデポコーポレーション	14,800	429.00	6,349,200
壱番屋	7,700	4,475.00	34,457,500
P L A N T	3,100	459.00	1,422,900
スギホールディングス	21,700	5,770.00	125,209,000
薬王堂ホールディングス	4,800	2,416.00	11,596,800
スクロール	17,100	289.00	4,941,900
ヨンドシーホールディングス	11,100	1,943.00	21,567,300
ファミリーマート	86,700	1,938.00	168,024,600
木曽路	14,200	2,400.00	34,080,000
S R Sホールディングス	12,900	903.00	11,648,700
タカキュー	9,500	135.00	1,282,500
ケーヨー	22,500	494.00	11,115,000
上新電機	12,800	2,078.00	26,598,400
日本瓦斯	17,200	3,575.00	61,490,000
ロイヤルホールディングス	19,000	1,759.00	33,421,000
いなげや	13,500	1,583.00	21,370,500
島忠	20,400	2,662.00	54,304,800
チヨダ	11,500	1,164.00	13,386,000
ライフコーポレーション	8,300	2,983.00	24,758,900
リンガーハット	13,400	2,066.00	27,684,400
M r M a x H D	15,300	337.00	5,156,100
テンアライド	10,000	387.00	3,870,000
A O K Iホールディングス	21,900	726.00	15,899,400
オークワ	17,100	1,736.00	29,685,600
コメリ	16,800	1,936.00	32,524,800
青山商事	22,500	928.00	20,880,000
しまむら	12,600	6,520.00	82,152,000
はせがわ	6,100	411.00	2,507,100
高島屋	79,100	973.00	76,964,300
松屋	22,100	613.00	13,547,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,500	791.00	40,736,500
近鉄百貨店	4,200	2,514.00	10,558,800
丸井グループ	99,500	1,815.00	180,592,500
アクシアル リテイリング	9,000	3,980.00	35,820,000
イオン	417,500	2,399.00	1,001,582,500
イズミ	22,100	2,980.00	65,858,000
平和堂	22,100	1,904.00	42,078,400
フジ	13,200	1,798.00	23,733,600
ヤオコー	12,300	6,670.00	82,041,000
ゼビオホールディングス	13,300	892.00	11,863,600
ケーブホールディングス	104,800	1,023.00	107,210,400

Olympicグループ	5,900	620.00	3,658,000
日産東京販売ホールディングス	16,600	215.00	3,569,000
シルバーライフ	1,200	1,981.00	2,377,200
Genky DrugStores	5,200	2,065.00	10,738,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,000	554.00	1,108,000
ブックオフグループホールディングス	6,300	803.00	5,058,900
アインホールディングス	13,300	6,350.00	84,455,000
元気寿司	2,800	2,218.00	6,210,400
ヤマダ電機	330,800	431.00	142,574,800
アークランドサカモト	17,100	975.00	16,672,500
ニトリホールディングス	47,000	14,580.00	685,260,000
グルメ杵屋	7,900	979.00	7,734,100
愛眼	8,600	211.00	1,814,600
ケーユーホールディングス	5,800	850.00	4,930,000
吉野家ホールディングス	35,700	2,081.00	74,291,700
松屋フーズホールディングス	5,300	3,945.00	20,908,500
サガミホールディングス	14,600	1,210.00	17,666,000
関西スーパーマーケット	9,200	1,020.00	9,384,000
王将フードサービス	8,000	5,780.00	46,240,000
プレナス	12,200	1,844.00	22,496,800
ミニストップ	8,100	1,456.00	11,793,600
アークス	22,300	1,948.00	43,440,400
パローホールディングス	24,100	1,923.00	46,344,300
ベルク	5,400	5,740.00	30,996,000
大庄	5,900	1,080.00	6,372,000
ファーストリテイリング	14,500	44,190.00	640,755,000
サンドラッグ	40,800	3,460.00	141,168,000
サックスパーホールディングス	9,400	613.00	5,762,200
ヤマザワ	2,600	1,578.00	4,102,800
やまや	2,300	2,013.00	4,629,900
ベルーナ	23,600	481.00	11,351,600
島根銀行	2,100	444.00	932,400
じもとホールディングス	73,400	91.00	6,679,400
めぶきフィナンシャルグループ	564,400	220.00	124,168,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,700	1,141.00	16,772,700
九州フィナンシャルグループ	178,300	413.00	73,637,900
ゆうちょ銀行	307,700	997.00	306,776,900
富山第一銀行	25,900	294.00	7,614,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	638,900	315.00	201,253,500
西日本フィナンシャルホールディングス	74,100	610.00	45,201,000
関西みらいフィナンシャルグループ	63,800	389.00	24,818,200
三十三フィナンシャルグループ	10,100	1,492.00	15,069,200

第四北越フィナンシャルグループ	18,900	2,363.00	44,660,700
新生銀行	79,700	1,442.00	114,927,400
あおぞら銀行	64,700	2,062.00	133,411,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,430,700	403.00	2,994,572,100
りそなホールディングス	1,192,100	325.20	387,670,920
三井住友トラスト・ホールディングス	205,300	3,124.00	641,357,200
三井住友フィナンシャルグループ	751,300	2,623.00	1,970,659,900
千葉銀行	362,500	473.00	171,462,500
群馬銀行	213,500	328.00	70,028,000
武蔵野銀行	16,200	1,376.00	22,291,200
千葉興業銀行	29,800	253.00	7,539,400
筑波銀行	45,200	170.00	7,684,000
七十七銀行	36,700	1,399.00	51,343,300
青森銀行	8,400	2,616.00	21,974,400
秋田銀行	7,000	1,554.00	10,878,000
山形銀行	12,200	1,339.00	16,335,800
岩手銀行	7,100	2,678.00	19,013,800
東邦銀行	97,100	270.00	26,217,000
東北銀行	5,200	873.00	4,539,600
みちのく銀行	7,000	1,193.00	8,351,000
ふくおかフィナンシャルグループ	91,500	1,431.00	130,936,500
静岡銀行	269,000	657.00	176,733,000
十六銀行	13,600	1,885.00	25,636,000
スルガ銀行	111,100	354.00	39,329,400
八十二銀行	262,100	391.00	102,481,100
山梨中央銀行	12,600	736.00	9,273,600
大垣共立銀行	21,500	2,175.00	46,762,500
福井銀行	9,300	1,516.00	14,098,800
北國銀行	11,200	3,370.00	37,744,000
清水銀行	4,500	1,847.00	8,311,500
富山銀行	2,100	1,861.00	3,908,100
滋賀銀行	21,800	2,568.00	55,982,400
南都銀行	18,100	2,230.00	40,363,000
百五銀行	97,800	302.00	29,535,600
京都銀行	38,900	3,440.00	133,816,000
紀陽銀行	38,500	1,596.00	61,446,000
ほくほくフィナンシャルグループ	72,300	968.00	69,986,400
広島銀行	160,400	451.00	72,340,400
山陰合同銀行	64,400	547.00	35,226,800
中国銀行	93,500	963.00	90,040,500
鳥取銀行	3,700	1,121.00	4,147,700
伊予銀行	155,000	547.00	84,785,000

百十四銀行	11,500	1,961.00	22,551,500
四国銀行	16,500	853.00	14,074,500
阿波銀行	17,700	2,282.00	40,391,400
大分銀行	6,200	1,907.00	11,823,400
宮崎銀行	7,200	2,385.00	17,172,000
佐賀銀行	6,600	1,148.00	7,576,800
沖縄銀行	9,900	3,155.00	31,234,500
琉球銀行	25,100	1,060.00	26,606,000
セブン銀行	362,900	279.00	101,249,100
みずほフィナンシャルグループ	14,760,500	123.60	1,824,397,800
高知銀行	3,900	634.00	2,472,600
山口フィナンシャルグループ	135,600	612.00	82,987,200
長野銀行	3,600	1,124.00	4,046,400
名古屋銀行	8,800	2,614.00	23,003,200
北洋銀行	163,700	204.00	33,394,800
愛知銀行	3,900	3,175.00	12,382,500
中京銀行	4,500	2,169.00	9,760,500
大光銀行	3,700	1,447.00	5,353,900
愛媛銀行	15,200	1,173.00	17,829,600
トマト銀行	4,200	1,046.00	4,393,200
京葉銀行	46,300	534.00	24,724,200
栃木銀行	52,500	155.00	8,137,500
北日本銀行	3,400	1,966.00	6,684,400
東和銀行	19,100	629.00	12,013,900
福島銀行	10,200	159.00	1,621,800
大東銀行	5,600	569.00	3,186,400
トモニホールディングス	84,000	359.00	30,156,000
フィデアホールディングス	105,500	102.00	10,761,000
池田泉州ホールディングス	124,900	163.00	20,358,700
F P G	33,700	546.00	18,400,200
マーキュリアインベストメント	5,000	541.00	2,705,000
S B I ホールディングス	121,400	1,578.00	191,569,200
ジャフコ	16,700	2,816.00	47,027,200
大和証券グループ本社	871,900	419.20	365,500,480
野村ホールディングス	1,911,600	457.80	875,130,480
岡三証券グループ	92,900	342.00	31,771,800
丸三証券	32,500	453.00	14,722,500
東洋証券	39,700	132.00	5,240,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,200	246.00	30,799,200
光世証券	2,800	524.00	1,467,200
水戸証券	32,100	190.00	6,099,000
いちよし証券	20,500	446.00	9,143,000

松井証券	62,200	793.00	49,324,600
だいこう証券ビジネス	5,500	544.00	2,992,000
マネックスグループ	82,600	171.00	14,124,600
極東証券	14,700	582.00	8,555,400
岩井コスモホールディングス	10,400	941.00	9,786,400
藍澤証券	19,600	754.00	14,778,400
マネーパートナーズグループ	12,100	186.00	2,250,600
スパークス・グループ	38,200	166.00	6,341,200
かんぽ生命保険	38,500	1,341.00	51,628,500
S O M P Oホールディングス	204,200	3,343.00	682,640,600
アニコム ホールディングス	9,000	3,585.00	32,265,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	284,000	3,025.00	859,100,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	89,300	1,827.00	163,151,100
第一生命ホールディングス	614,700	1,295.50	796,343,850
東京海上ホールディングス	388,400	4,950.00	1,922,580,000
T & Dホールディングス	324,700	884.00	287,034,800
アドバンスクリエイト	2,500	1,680.00	4,200,000
全国保証	30,600	3,395.00	103,887,000
ジェイリース	3,000	233.00	699,000
イントラスト	3,800	530.00	2,014,000
日本モーゲージサービス	2,200	1,750.00	3,850,000
C a s a	3,800	920.00	3,496,000
アルヒ	17,300	1,225.00	21,192,500
プレミアグループ	5,900	1,621.00	9,563,900
クレディセゾン	76,100	1,256.00	95,581,600
芙蓉総合リース	11,400	5,480.00	62,472,000
みずほリース	16,800	2,107.00	35,397,600
東京センチュリー	21,900	3,385.00	74,131,500
日本証券金融	47,900	493.00	23,614,700
アイフル	165,700	242.00	40,099,400
リコーリース	8,500	2,843.00	24,165,500
イオンフィナンシャルサービス	66,500	1,158.00	77,007,000
アコム	218,300	439.00	95,833,700
ジャックス	12,000	1,834.00	22,008,000
オリエントコーポレーション	293,800	121.00	35,549,800
日立キャピタル	25,600	2,037.00	52,147,200
アプラスフィナンシャル	52,100	60.00	3,126,000
オリックス	679,400	1,300.50	883,559,700
三菱UFJリース	275,700	532.00	146,672,400
九州リースサービス	5,300	444.00	2,353,200
日本取引所グループ	311,800	1,906.00	594,290,800
イー・ギャランティ	11,600	1,581.00	18,339,600

アサックス	5,600	585.00	3,276,000
NECキャピタルソリューション	4,400	1,840.00	8,096,000
いちご	143,700	250.00	35,925,000
日本駐車場開発	129,300	135.00	17,455,500
スター・マイカ・ホールディングス	6,800	1,471.00	10,002,800
ヒューリック	233,300	1,098.00	256,163,400
三栄建築設計	5,500	1,189.00	6,539,500
野村不動産ホールディングス	66,700	1,755.00	117,058,500
三重交通グループホールディングス	24,800	509.00	12,623,200
サムティ	16,500	1,203.00	19,849,500
ディア・ライフ	17,300	388.00	6,712,400
エー・ディー・ワークス	201,500	20.00	4,030,000
日本商業開発	7,900	1,338.00	10,570,200
ユニゾホールディングス	16,500	5,970.00	98,505,000
ハウスコム	2,600	1,186.00	3,083,600
日本管理センター	8,500	1,065.00	9,052,500
サンセイランディック	5,300	642.00	3,402,600
エストラスト	1,500	540.00	810,000
フージャースホールディングス	21,600	597.00	12,895,200
オープンハウス	32,200	2,225.00	71,645,000
東急不動産ホールディングス	298,100	518.00	154,415,800
飯田グループホールディングス	91,600	1,497.00	137,125,200
イーランド	3,800	615.00	2,337,000
ムゲンエステート	10,700	420.00	4,494,000
ハウズドゥ	5,700	705.00	4,018,500
シーアールイー	4,200	1,075.00	4,515,000
ケイアイスター不動産	4,500	1,127.00	5,071,500
グッドコムアセット	3,800	1,247.00	4,738,600
ジェイ・エス・ビー	1,500	4,330.00	6,495,000
テンポイノベーション	4,500	654.00	2,943,000
パーク24	59,100	1,591.00	94,028,100
パラカ	3,700	1,673.00	6,190,100
三井不動産	536,500	1,870.50	1,003,523,250
三菱地所	762,000	1,595.00	1,215,390,000
平和不動産	20,400	2,799.00	57,099,600
東京建物	115,800	1,147.00	132,822,600
ダイビル	29,500	892.00	26,314,000
京阪神ビルディング	18,800	1,336.00	25,116,800
住友不動産	244,700	2,635.00	644,784,500
テーオーシー	23,800	587.00	13,970,600
東京楽天地	2,100	4,070.00	8,547,000
スターツコーポレーション	15,500	2,005.00	31,077,500

フジ住宅	15,200	514.00	7,812,800
空港施設	14,200	402.00	5,708,400
明和地所	8,500	479.00	4,071,500
ゴールドクレスト	9,500	1,624.00	15,428,000
エスリード	5,200	1,396.00	7,259,200
日神グループホールディングス	19,500	395.00	7,702,500
日本エスコン	22,000	596.00	13,112,000
タカラレーベン	53,500	349.00	18,671,500
A V A N T I A	8,500	588.00	4,998,000
イオンモール	55,500	1,363.00	75,646,500
毎日コムネット	4,700	785.00	3,689,500
ファースト住建	6,300	988.00	6,224,400
カチタス	27,800	1,735.00	48,233,000
トーセイ	16,400	931.00	15,268,400
穴吹興産	3,400	1,374.00	4,671,600
サンフロンティア不動産	16,600	820.00	13,612,000
エフ・ジェー・ネクスト	11,200	818.00	9,161,600
インテリックス	6,000	490.00	2,940,000
ランドビジネス	4,600	254.00	1,168,400
日本社宅サービス	4,200	882.00	3,704,400
グランディハウス	12,000	359.00	4,308,000
日本空港ビルデング	35,000	4,175.00	146,125,000
日本工営	7,100	2,938.00	20,859,800
L I F U L L	37,000	304.00	11,248,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,100	1,016.00	7,213,600
日本M&Aセンター	79,500	2,955.00	234,922,500
メンバーズ	3,200	1,352.00	4,326,400
中広	1,300	430.00	559,000
UTグループ	12,500	1,110.00	13,875,000
アイティメディア	3,300	750.00	2,475,000
タケエイ	10,200	779.00	7,945,800
E・Jホールディングス	1,900	1,296.00	2,462,400
ビーネックスグループ	13,300	511.00	6,796,300
コシダカホールディングス	25,600	367.00	9,395,200
アルトナー	2,700	627.00	1,692,900
パソナグループ	12,400	860.00	10,664,000
C D S	2,700	1,135.00	3,064,500
リンクアンドモチベーション	23,500	306.00	7,191,000
G C A	12,800	563.00	7,206,400
エス・エム・エス	32,800	2,093.00	68,650,400
サニーサイドアップグループ	2,900	577.00	1,673,300
パーソルホールディングス	105,300	1,086.00	114,355,800

リニカル	5,200	817.00	4,248,400
クックパッド	37,100	300.00	11,130,000
エスクリ	3,500	368.00	1,288,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	624.00	3,307,200
学情	3,800	1,296.00	4,924,800
スタジオアリス	5,400	1,476.00	7,970,400
シミックホールディングス	5,900	1,437.00	8,478,300
エプロ	1,800	827.00	1,488,600
N J S	2,400	1,645.00	3,948,000
総合警備保障	41,900	5,260.00	220,394,000
カカクコム	78,800	1,985.00	156,418,000
アイロムグループ	3,700	1,302.00	4,817,400
セントケア・ホールディング	7,000	379.00	2,653,000
サイネックス	1,900	591.00	1,122,900
ルネサンス	5,900	1,007.00	5,941,300
ディップ	14,900	1,738.00	25,896,200
オプトホールディング	5,800	1,377.00	7,986,600
ツクイ	25,000	413.00	10,325,000
キャリアデザインセンター	2,800	761.00	2,130,800
ベネフィット・ワン	28,800	1,410.00	40,608,000
エムスリー	232,100	3,195.00	741,559,500
ツカダ・グローバルホールディング	7,000	340.00	2,380,000
プラス	1,400	418.00	585,200
アウトソーシング	60,400	470.00	28,388,000
ウェルネット	10,800	472.00	5,097,600
ワールドホールディングス	3,600	1,229.00	4,424,400
ディー・エヌ・エー	51,600	1,182.00	60,991,200
博報堂DYホールディングス	146,500	1,090.00	159,685,000
ぐるなび	18,500	555.00	10,267,500
タカミヤ	11,400	421.00	4,799,400
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	610.00	4,331,000
ファンコミュニケーションズ	29,200	415.00	12,118,000
ライク	4,100	1,403.00	5,752,300
ビジネス・ブレークスルー	4,700	342.00	1,607,400
エスプール	20,400	550.00	11,220,000
WDBホールディングス	4,800	2,107.00	10,113,600
ティア	6,300	504.00	3,175,200
C D G	1,200	1,382.00	1,658,400
バリューコマース	6,000	1,780.00	10,680,000
インフォマート	115,500	711.00	82,120,500
J Pホールディングス	33,400	259.00	8,650,600
エコナックホールディングス	20,000	85.00	1,700,000

E P Sホールディングス	15,900	1,129.00	17,951,100
レッグス	2,700	846.00	2,284,200
プレステージ・インターナショナル	39,500	829.00	32,745,500
アミューズ	5,800	2,274.00	13,189,200
ドリームインキュベータ	3,300	976.00	3,220,800
クイック	6,600	984.00	6,494,400
T A C	6,900	160.00	1,104,000
ケネディクス	98,300	410.00	40,303,000
電通グループ	108,500	2,087.00	226,439,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	558.00	2,343,600
ぴあ	3,100	2,230.00	6,913,000
イオンファンタジー	4,100	1,456.00	5,969,600
シーティーエス	12,000	548.00	6,576,000
ネクシィーズグループ	3,800	976.00	3,708,800
みらかホールディングス	29,500	2,278.00	67,201,000
アルプス技研	9,400	1,458.00	13,705,200
ダイオーズ	2,200	1,030.00	2,266,000
日本空調サービス	11,200	676.00	7,571,200
オリエンタルランド	111,900	13,820.00	1,546,458,000
ダスキン	27,100	2,841.00	76,991,100
明光ネットワークジャパン	12,500	762.00	9,525,000
ファルコホールディングス	5,800	1,771.00	10,271,800
ラウンドワン	29,500	562.00	16,579,000
リゾートトラスト	48,300	1,056.00	51,004,800
ビー・エム・エル	13,600	2,906.00	39,521,600
ワタベウェディング	2,000	349.00	698,000
りらいあコミュニケーションズ	19,100	1,045.00	19,959,500
リソー教育	48,400	286.00	13,842,400
早稲田アカデミー	3,500	912.00	3,192,000
ユー・エス・エス	117,900	1,486.00	175,199,400
東京個別指導学院	3,900	455.00	1,774,500
サイバーエージェント	60,500	4,190.00	253,495,000
楽天	490,700	820.00	402,374,000
クリーク・アンド・リバー社	5,500	750.00	4,125,000
テー・オー・ダブリュー	18,000	271.00	4,878,000
山田コンサルティンググループ	5,200	953.00	4,955,600
セントラルスポーツ	4,000	2,292.00	9,168,000
フルキャストホールディングス	10,600	1,236.00	13,101,600
エン・ジャパン	18,700	2,022.00	37,811,400
リソルホールディングス	1,200	3,375.00	4,050,000
テクノプロ・ホールディングス	21,000	5,070.00	106,470,000
アトラ	2,900	212.00	614,800

インターワークス	2,200	385.00	847,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,300	5,800.00	24,940,000
K e e P e r 技研	3,900	1,416.00	5,522,400
ファーストロジック	2,600	581.00	1,510,600
三機サービス	2,200	984.00	2,164,800
G u n o s y	7,100	865.00	6,141,500
デザインワン・ジャパン	2,600	173.00	449,800
イー・ガーディアン	5,400	1,559.00	8,418,600
リブセンス	7,200	251.00	1,807,200
ジャパンマテリアル	32,400	1,419.00	45,975,600
ベクトル	13,200	651.00	8,593,200
ウチヤマホールディングス	5,500	321.00	1,765,500
チャーム・ケア・コーポレーション	9,100	764.00	6,952,400
ライクキッズ	2,300	488.00	1,122,400
キャリアリンク	3,700	380.00	1,406,000
I B J	7,300	495.00	3,613,500
アサンテ	4,300	1,522.00	6,544,600
N・フィールド	7,500	375.00	2,812,500
バリューHR	4,200	1,363.00	5,724,600
M&Aキャピタルパートナーズ	7,500	2,573.00	19,297,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,336.00	5,477,600
E R Iホールディングス	3,100	610.00	1,891,000
アビスト	1,700	1,752.00	2,978,400
シグマクシス	7,300	1,243.00	9,073,900
ウィルグループ	7,000	566.00	3,962,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	15,200	153.00	2,325,600
リクルートホールディングス	753,900	2,796.00	2,107,904,400
エラン	6,300	1,445.00	9,103,500
土木管理総合試験所	4,900	335.00	1,641,500
ネットマーケティング	3,800	551.00	2,093,800
日本郵政	862,700	845.70	729,585,390
ベルシステム24ホールディングス	17,700	1,127.00	19,947,900
鎌倉新書	8,000	1,062.00	8,496,000
S M N	1,800	589.00	1,060,200
一蔵	1,300	387.00	503,100
L I T A L I C O	3,700	2,094.00	7,747,800
グローバルキッズCOMPANY	1,700	500.00	850,000
エアトリ	4,800	718.00	3,446,400
アトラエ	2,800	2,578.00	7,218,400
ストライク	4,000	3,520.00	14,080,000
ソラスト	29,100	1,004.00	29,216,400
セラク	3,400	676.00	2,298,400

インソース	5,200	2,422.00	12,594,400
ペイカレント・コンサルティング	6,400	5,060.00	32,384,000
Orchestra Holdings	2,300	762.00	1,752,600
アイモバイル	3,500	536.00	1,876,000
キャリアインデックス	4,600	275.00	1,265,000
MS - Japan	3,500	634.00	2,219,000
船場	1,800	889.00	1,600,200
グレイステクノロジー	4,800	2,555.00	12,264,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	11,100	2,482.00	27,550,200
フルテック	1,600	1,260.00	2,016,000
グリーンズ	3,900	378.00	1,474,200
ツナググループ・ホールディングス	1,500	348.00	522,000
GameWith	2,500	447.00	1,117,500
ソウルドアウト	1,700	1,938.00	3,294,600
MS&Consulting	1,600	488.00	780,800
ミダック	1,100	904.00	994,400
日総工産	7,100	437.00	3,102,700
キュービーネットホールディングス	6,200	1,611.00	9,988,200
RPAホールディングス	6,100	750.00	4,575,000
スプリックス	3,700	641.00	2,371,700
マネジメントソリューションズ	3,300	885.00	2,920,500
and factory	1,100	1,104.00	1,214,400
カーブスホールディングス	26,200	513.00	13,440,600
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	602.00	3,311,000
リログループ	57,600	2,267.00	130,579,200
東祥	6,600	993.00	6,553,800
エイチ・アイ・エス	16,500	1,413.00	23,314,500
ラックランド	2,500	1,556.00	3,890,000
共立メンテナンス	17,500	2,384.00	41,720,000
イチネンホールディングス	11,900	1,148.00	13,661,200
建設技術研究所	7,300	1,675.00	12,227,500
スペース	6,900	1,091.00	7,527,900
長大	4,000	793.00	3,172,000
燦ホールディングス	4,700	1,193.00	5,607,100
スバル興業	700	7,820.00	5,474,000
東京テアトル	4,200	1,141.00	4,792,200
タナベ経営	2,100	1,240.00	2,604,000
ナガワ	3,400	6,870.00	23,358,000
よみうりランド	2,300	3,290.00	7,567,000
東京都競馬	6,900	2,795.00	19,285,500
カナモト	17,300	2,103.00	36,381,900
東京ドーム	42,700	724.00	30,914,800

西尾レントオール	10,700	2,267.00	24,256,900	
トランス・コスモス	10,100	1,914.00	19,331,400	
乃村工藝社	45,200	820.00	37,064,000	
藤田観光	4,700	1,559.00	7,327,300	
KNT-CTホールディングス	6,500	724.00	4,706,000	
日本管財	11,300	1,769.00	19,989,700	
トーカイ	10,200	2,937.00	29,957,400	
白洋舎	1,200	2,682.00	3,218,400	
セコム	111,700	8,974.00	1,002,395,800	
セントラル警備保障	5,100	3,900.00	19,890,000	
丹青社	20,000	728.00	14,560,000	
メイテック	13,000	4,300.00	55,900,000	
応用地質	11,400	1,229.00	14,010,600	
船井総研ホールディングス	21,800	2,147.00	46,804,600	
進学会ホールディングス	4,300	443.00	1,904,900	
オオバ	8,000	507.00	4,056,000	
いであ	2,000	1,371.00	2,742,000	
学究社	3,200	1,156.00	3,699,200	
ベネッセホールディングス	35,100	2,751.00	96,560,100	
イオンディライト	13,000	3,305.00	42,965,000	
ナック	5,900	788.00	4,649,200	
ニチイ学館	15,100	1,034.00	15,613,400	
ダイセキ	17,700	2,300.00	40,710,000	
ステップ	3,900	1,435.00	5,596,500	
合計	129,261,980		217,516,606,270	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	29,800	-	
	合計	29,800	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期中間計算期間(2020年4月1日から2020年9月30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L】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2020年 3月31日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	502,687,731	273,186,298
親投資信託受益証券	82,260,885,286	97,171,454,786
未収入金	23,785,650	-
流動資産合計	82,787,358,667	97,444,641,084
資産合計	82,787,358,667	97,444,641,084
負債の部		
流動負債		
未払解約金	385,934,818	128,357,142
未払受託者報酬	15,544,689	15,038,286
未払委託者報酬	82,904,964	80,204,146
未払利息	1,351	631
流動負債合計	484,385,822	223,600,205
負債合計	484,385,822	223,600,205
純資産の部		
元本等		
元本	45,681,963,525	46,170,804,626
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	36,621,009,320	51,050,236,253
(分配準備積立金)	22,562,544,559	20,847,319,775
元本等合計	82,302,972,845	97,221,040,879
純資産合計	82,302,972,845	97,221,040,879
負債純資産合計	82,787,358,667	97,444,641,084

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 2019年 4月 2日 至 2019年10月 1日	第19期中間計算期間 自 2020年 4月 1日 至 2020年 9月30日
営業収益		
受取利息	64	850
有価証券売買等損益	432,050,996	14,008,869,968
営業収益合計	432,051,060	14,008,870,818
営業費用		
支払利息	57,135	52,620
受託者報酬	14,617,760	15,038,286
委託者報酬	77,961,354	80,204,146
その他費用	419	411
営業費用合計	92,636,668	95,295,463
営業利益又は営業損失（ ）	339,414,392	13,913,575,355
経常利益又は経常損失（ ）	339,414,392	13,913,575,355
中間純利益又は中間純損失（ ）	339,414,392	13,913,575,355
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（ ）	169,418,712	600,417,359
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	47,337,606,337	36,621,009,320
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,934,100,503	4,051,139,867
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,934,100,503	4,051,139,867
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,239,468,379	2,935,070,930
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,239,468,379	2,935,070,930
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	47,541,071,565	51,050,236,253

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第18期 (2020年 3月31日現在)	第19期中間計算期間 (2020年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	45,681,963,525口	46,170,804,626口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8017円 (18,017円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1057円 (21,057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19期中間計算期間 (2020年 9月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第19期中間計算期間 (2020年 9月30日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第18期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日	第19期中間計算期間 自 2020年 4月 1日 至 2020年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	46,242,887,916円	45,681,963,525円
期中追加設定元本額	7,667,675,777円	4,138,757,000円
期中一部解約元本額	8,228,600,168円	3,649,915,899円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,354,676,899
株式	248,290,802,475

	2020年 9月30日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	21,203,950
未収入金	60,247,914
未収配当金	2,160,144,308
前払金	17,732,400
差入委託証拠金	120,444,000
流動資産合計	253,025,251,946
資産合計	253,025,251,946
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,942,950
未払解約金	53,691,924
未払利息	5,440
流動負債合計	92,640,314
負債合計	92,640,314
純資産の部	
元本等	
元本	140,778,653,363
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,153,958,269
元本等合計	252,932,611,632
純資産合計	252,932,611,632
負債純資産合計	253,025,251,946

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2020年 9月30日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,778,653,363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 1.7967円 (1万口当たり純資産額) (17,967円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2020年 9月30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	2020年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 4月 1日
期首元本額	145,410,304,747円
期中追加設定元本額	5,470,638,521円
期中一部解約元本額	10,102,289,905円
期末元本額	140,778,653,363円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	668,849,400円
D C 日本株式インデックスファンド	315,756,328円
D C 日本株式インデックスファンド L	54,083,294,254円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,027,625,902円
D C バランスファンド 3 0	2,361,339,812円
D C バランスファンド 5 0	3,590,370,472円
D C バランスファンド 7 0	1,940,792,943円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	611,129,725円
日本株式インデックス e	1,624,657,166円
インデックスコレクション（国内株式）	18,949,899,768円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	13,062,968,937円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,436,540,851円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,887,980,723円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,616,697,262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）	2,832,188,492円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,329,535,410円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	73,782,225円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	863,565,130円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	99,436,046円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	277,349,567円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	2,676,847円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	729,342,436円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,062,422,687円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	571,329,238円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	9,535,600,920円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	838,130,122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）	122,502,650円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,532,491,721円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	39,572,619円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	189,503,988円

区分	2020年 9月30日現在
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	2,470,463,367円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	73,104,880円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	75,714,457円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	33,919,214円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	843,764,010円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	377,544,140円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	6,279,543,218円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	119,002,264円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	49,884,939円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	11,571,949円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	163,978,246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)	2,829,038円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2020年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,504,112,400	-	4,486,380,000	17,732,400
合計		4,504,112,400	-	4,486,380,000	17,732,400

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドL】

【純資産額計算書】

(2020年10月30日現在)

資産総額	94,687,269,275円
負債総額	196,815,792円
純資産総額（ - ）	94,490,453,483円
発行済口数	46,189,164,370口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0457円
（1万口当たり純資産額）	（20,457円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2020年10月30日現在)

資産総額	246,008,827,454円
負債総額	385,474,366円
純資産総額（ - ）	245,623,353,088円
発行済口数	140,690,481,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7458円
（1万口当たり純資産額）	（17,458円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2020年10月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2020年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年10月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	525	13,242,450
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	81	298,985
単位型公社債投資信託	39	270,690
合計	645	13,812,125

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

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

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2020年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

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

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

3. 確定拠出制度

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

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

吸収分割

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年12月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称： 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年5月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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Lの2019年4月2日から2020年3月31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。

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Lの2020年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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Lの2020年4月1日から2020年9月30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。

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Lの2020年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年4月1日から2020年9月30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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。