

【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】	2021年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンドA
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンドA

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2021年 3月11日から2021年 9月10日までとします。

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

れます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとし、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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。
属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で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 (<https://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 >

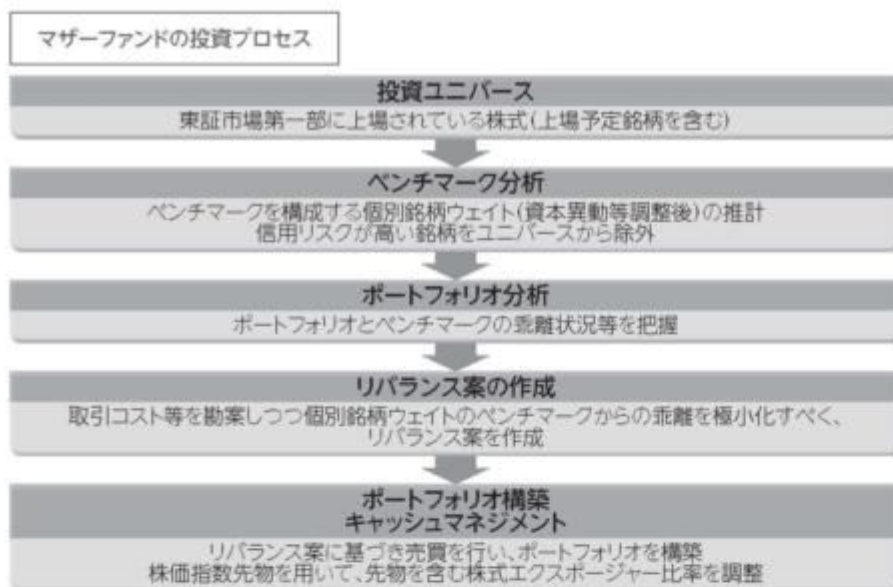
東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

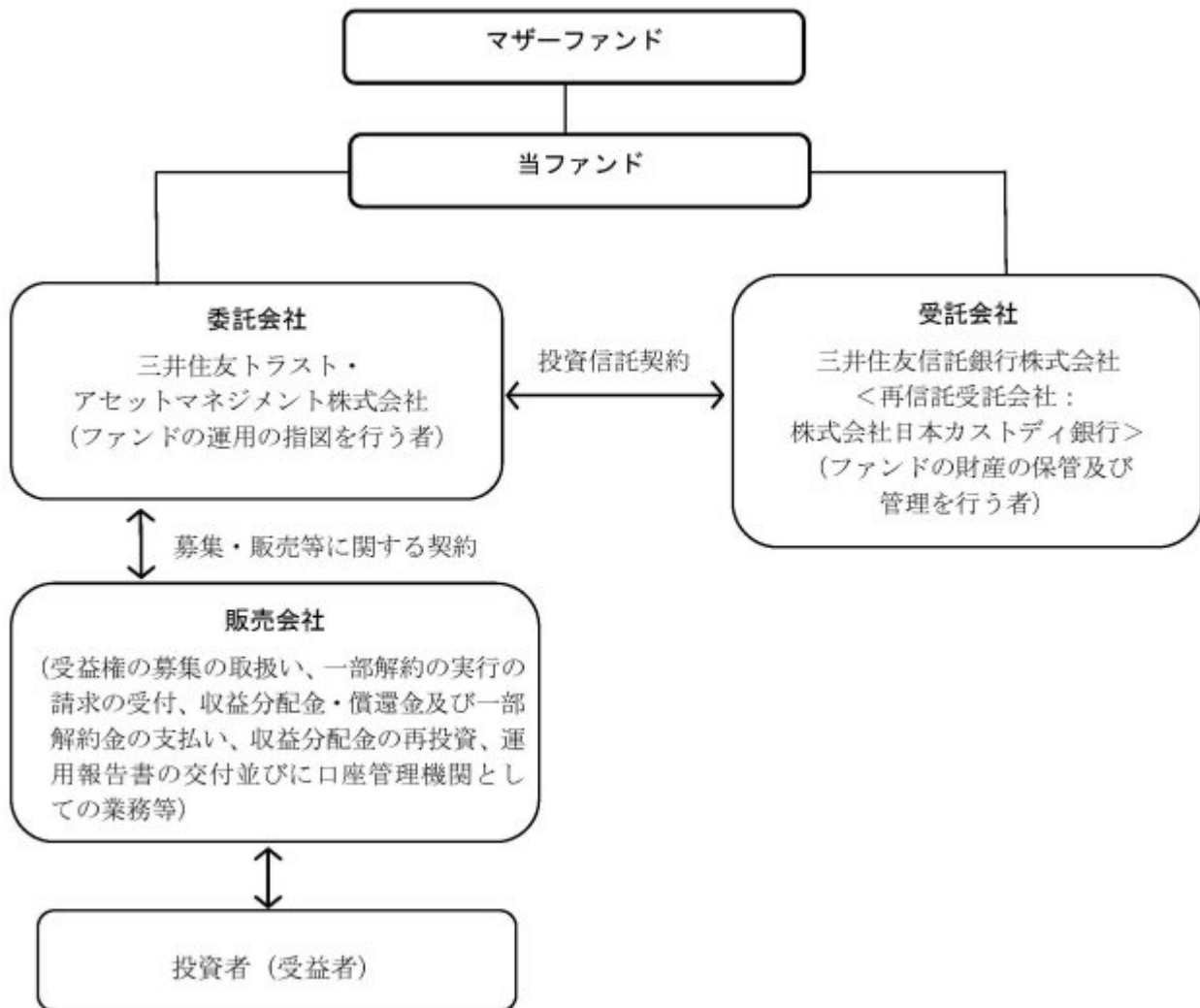
(2) 【ファンドの沿革】

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

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

A．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

A．株券又は新株引受権証書

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

J．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

Q．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

T．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

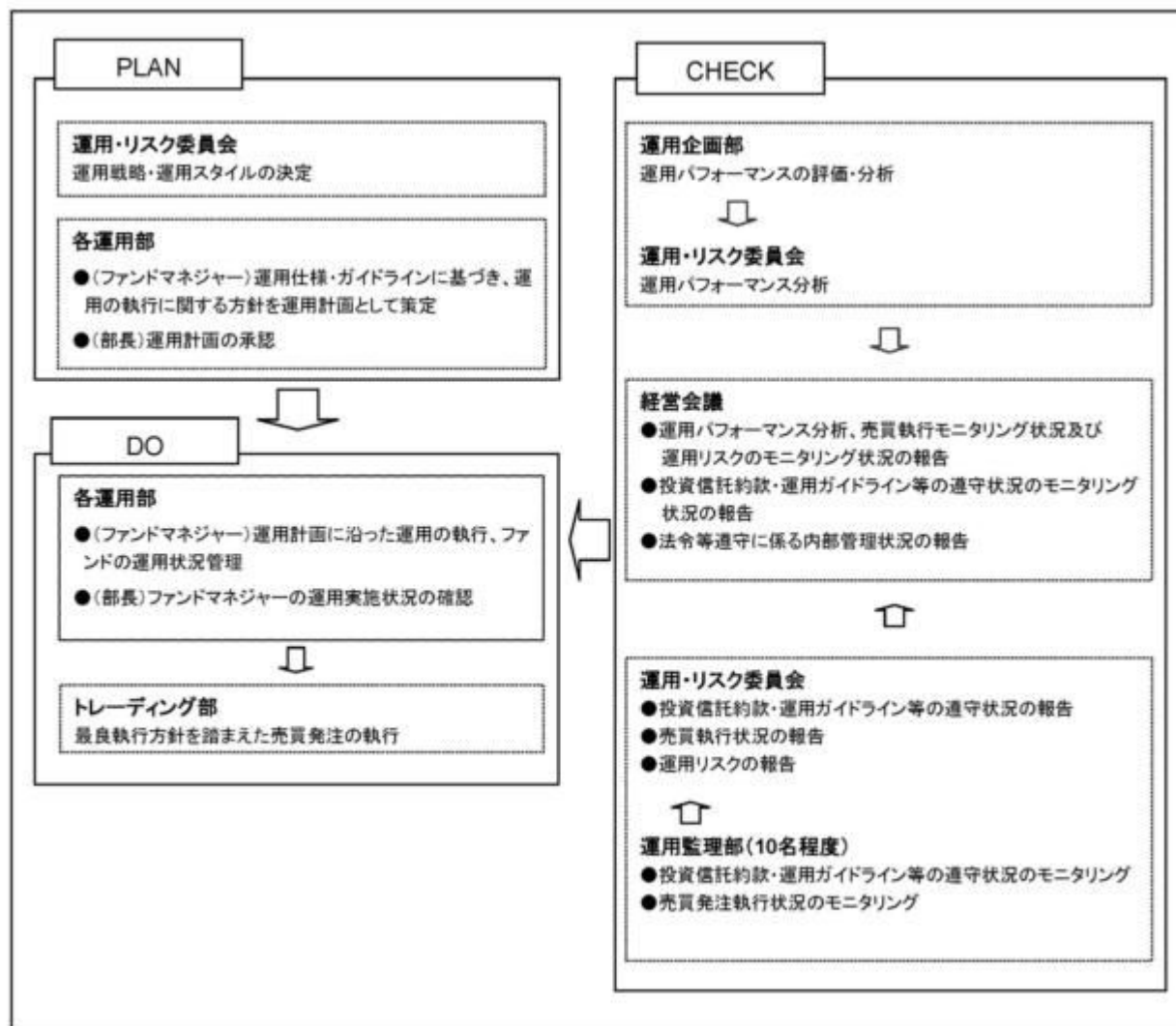
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の運用指図

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

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

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

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

価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

J．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

囲内とします。

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

〇．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

Ｑ．再投資の指図

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

Ｒ．資金の借入れ

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｓ．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

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

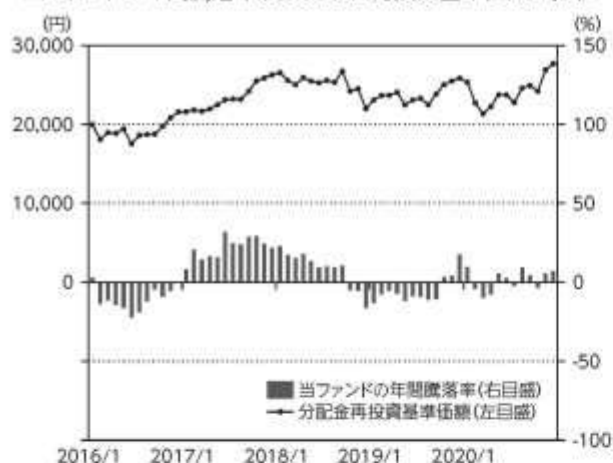
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

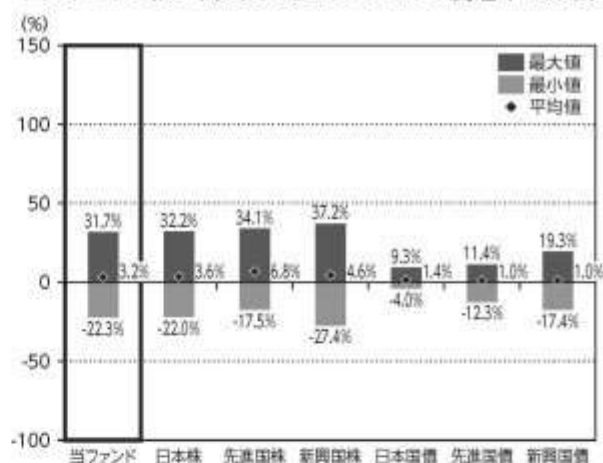
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2020年12月30日現在のものでありますので、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12月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,878,884,365	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		947,427	0.05
合計(純資産総額)		1,879,831,792	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	940,100,253	1.9643	1,846,638,927	1.9986	1,878,884,365	99.95

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第9期計算期間末 (2011年12月12日)	1,089,966,022	1,089,966,022	9,711	9,711
第10期計算期間末 (2012年12月10日)	1,172,924,685	1,172,924,685	10,460	10,460
第11期計算期間末 (2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末 (2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末 (2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末 (2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末 (2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
第16期計算期間末 (2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
第17期計算期間末 (2019年12月10日)	2,105,502,404	2,105,502,404	25,822	25,822
第18期計算期間末 (2020年12月10日)	1,905,184,214	1,905,184,214	27,212	27,212
2019年12月末日	2,119,406,025		25,863	
2020年 1月末日	2,058,127,124		25,301	
2月末日	1,811,625,001		22,696	
3月末日	1,651,378,093		21,337	
4月末日	1,741,732,397		22,255	
5月末日	1,871,916,240		23,760	
6月末日	1,818,290,853		23,714	
7月末日	1,714,330,068		22,753	
8月末日	1,833,449,319		24,601	

9月末日	1,847,277,637		24,910
10月末日	1,764,537,597		24,196
11月末日	1,905,343,135		26,889
12月末日	1,879,831,792		27,679

【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12月11日～2011年12月12日	0
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	0
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	0
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	0
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	0
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	14.4
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	7.7
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	10.5
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	5.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第9期計算期間	2010年12月11日～2011年12月12日	222,832,492	159,705,810	1,122,403,586

第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	232,065,601	233,152,933	1,121,316,254
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	109,110,724	139,292,136	815,389,267
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	181,680,786	296,943,765	700,126,288

(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	270,631,456,610	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,742,343,327	1.00
合計(純資産総額)		273,373,799,937	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,508,255,000	0.92

(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	1,207,700	7,733.12	9,339,298,456	7,957.00	9,609,668,900	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	678,100	7,880.50	5,343,769,216	10,285.00	6,974,258,500	2.55
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	842,800	4,871.08	4,105,353,767	8,058.00	6,791,282,400	2.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,100	39,714.87	3,896,028,784	58,000.00	5,689,800,000	2.08
日本	株式	任天堂	その他製品	66,400	43,228.57	2,870,377,312	65,830.00	4,371,112,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,419,900	2,811.78	3,992,456,310	2,645.50	3,756,345,450	1.37
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	900,600	4,337.71	3,906,548,092	3,755.00	3,381,753,000	1.24
日本	株式	日本電産	電気機器	260,500	7,803.25	2,032,748,282	12,980.00	3,381,290,000	1.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,302,900	570.11	4,163,497,592	456.10	3,330,852,690	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	929,200	2,493.84	2,317,284,796	3,535.00	3,284,722,000	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	182,000	12,674.66	2,306,789,100	18,040.00	3,283,280,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	741,000	4,277.89	3,169,921,920	4,321.00	3,201,861,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	137,900	16,234.94	2,238,799,438	22,920.00	3,160,668,000	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	214,700	10,985.28	2,358,541,052	14,270.00	3,063,769,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	318,000	6,671.98	2,121,690,608	9,320.00	2,963,760,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	68,700	24,994.11	1,717,095,953	38,400.00	2,638,080,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	101,800	20,426.73	2,079,441,980	25,360.00	2,581,648,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	852,200	2,993.86	2,551,373,060	2,877.50	2,452,205,500	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	774,400	3,258.04	2,523,026,586	3,066.00	2,374,310,400	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	738,300	3,878.09	2,863,196,817	3,188.00	2,353,700,400	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	228,100	3,327.51	759,005,874	9,743.00	2,222,378,300	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	745,700	2,570.02	1,916,470,165	2,964.00	2,210,254,800	0.81
日本	株式	S M C	機械	34,000	52,463.66	1,783,764,560	62,950.00	2,140,300,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	520,100	4,442.74	2,310,673,260	4,065.00	2,114,206,500	0.77
日本	株式	花王	化学	259,200	9,095.28	2,357,498,054	7,970.00	2,065,824,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	377,500	6,020.58	2,272,771,112	5,308.00	2,003,770,000	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,450,700	1,632.03	2,367,595,960	1,307.50	1,896,790,250	0.69
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,000	15,297.24	1,682,697,308	17,040.00	1,874,400,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	338,600	3,597.34	1,218,062,350	5,503.00	1,863,315,800	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	699,000	2,856.97	1,997,027,134	2,541.00	1,776,159,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.49

繊維製品	0.47
パルプ・紙	0.22
化学	7.50
医薬品	5.87
石油・石炭製品	0.36
ゴム製品	0.50
ガラス・土石製品	0.78
鉄鋼	0.61
非鉄金属	0.73
金属製品	0.60
機械	5.71
電気機器	17.14
輸送用機器	7.32
精密機器	2.77
その他製品	2.75
電気・ガス業	1.28
陸運業	3.46
海運業	0.19
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.07
卸売業	4.52
小売業	4.75
銀行業	4.40
証券、商品先物取引業	0.76
保険業	1.89
その他金融業	1.10
不動産業	1.92
サービス業	5.73
小計	99.00
合計	99.00

(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	139円		2,467,727,250	2,508,255,000	0.92

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年12月11日

作成基準日：2020年12月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 27,679円

純資産総額 18.80億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

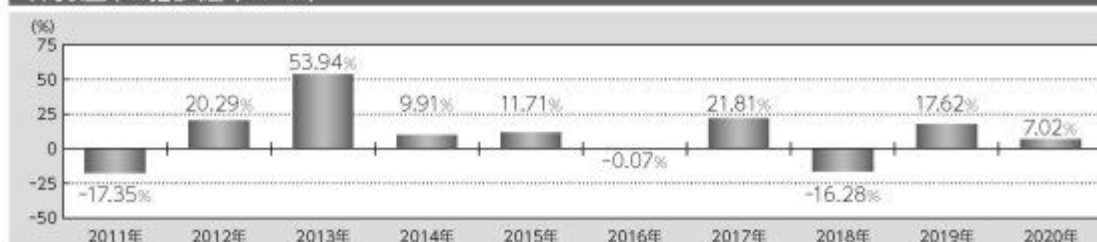
決算期	分配金
2016年12月	0円
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.5%
ソニー	日本	株式	電気機器	2.5%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.5%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.1%
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	1.4%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.2%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.2%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.2%
第一三共	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)

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年12月11日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

（2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2019年12月10日現在)	第18期 (2020年12月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,197,317	12,949,497
親投資信託受益証券	2,104,448,858	1,904,229,842
未収入金	3,903,432	14,426,057
流動資産合計	2,113,549,607	1,931,605,396
資産合計	2,113,549,607	1,931,605,396
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,850,441	22,482,451
未払受託者報酬	538,052	504,967
未払委託者報酬	3,658,709	3,433,747
未払利息	1	17
流動負債合計	8,047,203	26,421,182
負債合計	8,047,203	26,421,182
純資産の部		
元本等		
元本	815,389,267	700,126,288
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,290,113,137	1,205,057,926
(分配準備積立金)	540,690,655	451,142,862
元本等合計	2,105,502,404	1,905,184,214
純資産合計	2,105,502,404	1,905,184,214
負債純資産合計	2,113,549,607	1,931,605,396

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2018年12月11日	自	2019年12月11日
	至	2019年12月10日	至	2020年12月10日
営業収益				
受取利息		2		25
有価証券売買等損益		209,484,080		85,665,497
営業収益合計		209,484,082		85,665,522
営業費用				
支払利息		2,183		2,428
受託者報酬		1,063,077		1,022,303
委託者報酬		7,228,846		6,951,606
その他費用		74		9
営業費用合計		8,294,180		7,976,346
営業利益又は営業損失（ ）		201,189,902		77,689,176
経常利益又は経常損失（ ）		201,189,902		77,689,176
当期純利益又は当期純損失（ ）		201,189,902		77,689,176
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（ ）		1,914,695		53,138,597
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,129,790,184		1,290,113,137
剰余金増加額又は欠損金減少額		146,371,199		242,976,557
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		146,371,199		242,976,557
剰余金減少額又は欠損金増加額		185,323,453		458,859,541
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		185,323,453		458,859,541
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,290,113,137		1,205,057,926

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2019年12月10日現在)	第18期 (2020年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	815,389,267口	700,126,288口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5822円 (25,822円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7212円 (27,212円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2018年12月11日 至 2019年12月10日			第18期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	45,885,019円	費用控除後の配当等収益額	A	36,789,122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	46,550,675円
収益調整金額	C	1,196,972,840円	収益調整金額	C	1,126,342,257円
分配準備積立金額	D	494,805,636円	分配準備積立金額	D	367,803,065円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,737,663,495円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,577,485,119円
当ファンドの期末残存口数	F	815,389,267口	当ファンドの期末残存口数	F	700,126,288口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	21,310円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,531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12月11日 至 2020年12月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第18期 (2020年12月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期	第18期
	自 2018年12月11日 至 2019年12月10日	自 2019年12月11日 至 2020年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	845,570,679円	815,389,267円
期中追加設定元本額	109,110,724円	181,680,786円
期中一部解約元本額	139,292,136円	296,943,765円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17期 (2019年12月10日現在)	第18期 (2020年12月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	210,172,817	128,538,421
合計	210,172,817	128,538,421

（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	969,369,702	1,904,229,842	
合計		969,369,702	1,904,229,842	

(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12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,919,647,640
株式	266,366,408,260
派生商品評価勘定	1,908,000
未収入金	278,700
未収配当金	193,480,288
差入委託証拠金	122,028,000
流動資産合計	269,603,750,888
資産合計	269,603,750,888
負債の部	
流動負債	
前受金	1,908,000
未払解約金	297,345,753
未払利息	3,876
流動負債合計	299,257,629
負債合計	299,257,629
純資産の部	
元本等	
元本	137,089,975,360
剰余金	
剰余金又は欠損金()	132,214,517,899
元本等合計	269,304,493,259
純資産合計	269,304,493,259
負債純資産合計	269,603,750,888

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2020年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,089,975,360口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.9644円 (1万口当たり純資産額) (19,644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12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2020年12月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月11日
期首元本額	127,660,137,704円
期中追加設定元本額	29,411,588,107円
期中一部解約元本額	19,981,750,451円
期末元本額	137,089,975,360円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	640,821,144円
DC日本株式インデックスファンド	309,712,500円
DC日本株式インデックスファンドL	53,314,661,083円
DC日本株式インデックスファンドA	969,369,702円
DCバランスファンド30	2,232,457,442円
DCバランスファンド50	3,447,027,985円
DCバランスファンド70	1,930,930,933円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	579,541,640円
日本株式インデックスe	1,572,377,447円
インデックスコレクション（国内株式）	18,763,187,489円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,263,196,074円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,443,297,840円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,882,878,879円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,621,256,492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）	2,831,088,827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）	1,273,091,679円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	71,138,034円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	782,916,252円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	90,105,202円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	206,706,678円

区分	2020年12月10日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,676,847円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	613,988,932円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,032,415,436円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	552,347,584円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,234,934,274円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	825,568,877円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	114,291,583円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,460,260,527円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	37,206,713円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	187,378,068円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,369,434,247円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	68,857,812円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	72,861,148円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	29,174,119円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	756,890,453円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	353,641,581円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,825,111,344円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	110,100,942円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	46,767,235円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,717,595円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	156,004,573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）	3,582,148円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		7,770,513,210
合計		7,770,513,210

(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12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,810,802,000	-	2,812,710,000	1,908,000

合計	2,810,802,000	-	2,812,710,000	1,908,000
----	---------------	---	---------------	-----------

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,100	2,815.00	14,356,500	
日本水産	147,000	423.00	62,181,000	
マルハニチロ	21,200	2,183.00	46,279,600	
雪国まいたけ	9,000	1,710.00	15,390,000	
カネコ種苗	4,500	1,545.00	6,952,500	
サカタのタネ	17,500	3,470.00	60,725,000	
ホクト	11,200	2,101.00	23,531,200	
ホクリヨウ	2,300	710.00	1,633,000	
住石ホールディングス	29,700	116.00	3,445,200	
日鉄鉱業	3,400	5,660.00	19,244,000	
三井松島ホールディングス	5,700	699.00	3,984,300	
国際石油開発帝石	540,600	574.00	310,304,400	
石油資源開発	19,200	1,775.00	34,080,000	
K&Oエナジーグループ	7,100	1,504.00	10,678,400	
ヒノキヤグループ	3,600	2,121.00	7,635,600	
ショーボンドホールディングス	22,900	5,090.00	116,561,000	
ミライト・ホールディングス	43,700	1,665.00	72,760,500	
タマホーム	7,900	1,413.00	11,162,700	
サンヨーホームズ	1,300	714.00	928,200	
日本アクア	5,800	622.00	3,607,600	
ファーストコーポレーション	4,500	719.00	3,235,500	
ベステラ	2,500	1,520.00	3,800,000	
TATERU	27,600	176.00	4,857,600	
キャンディル	2,500	501.00	1,252,500	
スペースバリューホールディングス	17,900	607.00	10,865,300	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	705.00	1,974,000	
第一カッター興業	1,800	2,580.00	4,644,000	
安藤・間	87,500	718.00	62,825,000	

東急建設	43,100	504.00	21,722,400
コムシスホールディングス	52,100	3,130.00	163,073,000
ピーアールホールディングス	16,000	678.00	10,848,000
高松コンストラクショングループ	9,100	2,024.00	18,418,400
東建コーポレーション	4,500	7,750.00	34,875,000
ソネック	1,500	877.00	1,315,500
ヤマウラ	6,400	925.00	5,920,000
大成建設	113,200	3,815.00	431,858,000
大林組	339,500	939.00	318,790,500
清水建設	344,500	832.00	286,624,000
飛鳥建設	9,700	1,101.00	10,679,700
長谷工コーポレーション	131,400	1,184.00	155,577,600
松井建設	13,400	779.00	10,438,600
銭高組	1,500	4,485.00	6,727,500
鹿島建設	266,500	1,378.00	367,237,000
不動テトラ	8,900	1,700.00	15,130,000
大末建設	3,900	844.00	3,291,600
鉄建建設	7,400	1,823.00	13,490,200
西松建設	26,200	2,077.00	54,417,400
三井住友建設	82,000	431.00	35,342,000
大豊建設	8,100	3,580.00	28,998,000
前田建設工業	85,000	919.00	78,115,000
佐田建設	7,300	447.00	3,263,100
ナカノフドー建設	9,300	394.00	3,664,200
奥村組	16,000	2,445.00	39,120,000
東鉄工業	14,600	2,804.00	40,938,400
イチケン	2,400	1,776.00	4,262,400
富士ピー・エス	5,000	598.00	2,990,000
浅沼組	3,800	3,960.00	15,048,000
戸田建設	141,000	643.00	90,663,000
熊谷組	15,700	2,604.00	40,882,800
北野建設	2,100	2,573.00	5,403,300
植木組	1,500	2,785.00	4,177,500
矢作建設工業	15,000	858.00	12,870,000
ピーエス三菱	11,200	588.00	6,585,600
日本ハウスホールディングス	23,200	237.00	5,498,400
大東建託	37,100	9,700.00	359,870,000
新日本建設	14,400	855.00	12,312,000
N I P P O	28,100	2,750.00	77,275,000
東亜道路工業	2,100	3,775.00	7,927,500
前田道路	30,000	1,720.00	51,600,000
日本道路	3,300	7,580.00	25,014,000

東亜建設工業	10,600	2,020.00	21,412,000
日本国土開発	33,000	578.00	19,074,000
若築建設	6,100	1,170.00	7,137,000
東洋建設	38,100	430.00	16,383,000
五洋建設	134,600	897.00	120,736,200
世紀東急工業	16,300	812.00	13,235,600
福田組	3,900	5,480.00	21,372,000
住友林業	86,000	1,899.00	163,314,000
日本基礎技術	11,400	499.00	5,688,600
巴コーポレーション	15,100	416.00	6,281,600
大和ハウス工業	335,800	3,186.00	1,069,858,800
ライト工業	19,400	1,785.00	34,629,000
積水ハウス	368,100	2,015.00	741,721,500
日特建設	8,900	809.00	7,200,100
北陸電気工事	5,900	1,295.00	7,640,500
ユアテック	19,400	756.00	14,666,400
日本リーテック	7,100	2,362.00	16,770,200
四電工	1,800	2,778.00	5,000,400
中電工	13,700	2,169.00	29,715,300
関電工	48,300	817.00	39,461,100
きんでん	80,600	1,640.00	132,184,000
東京エネシス	11,300	858.00	9,695,400
トーエネック	3,400	3,880.00	13,192,000
住友電設	9,600	2,607.00	25,027,200
日本電設工業	18,600	2,102.00	39,097,200
協和エクシオ	51,500	2,809.00	144,663,500
新日本空調	9,000	2,165.00	19,485,000
九電工	23,800	3,125.00	74,375,000
三機工業	24,100	1,186.00	28,582,600
日揮ホールディングス	104,500	924.00	96,558,000
中外炉工業	3,700	1,850.00	6,845,000
ヤマト	10,900	771.00	8,403,900
太平電業	8,200	2,541.00	20,836,200
高砂熱学工業	26,000	1,482.00	38,532,000
三晃金属工業	1,500	2,651.00	3,976,500
朝日工業社	2,300	3,120.00	7,176,000
明星工業	22,000	782.00	17,204,000
大気社	16,500	2,751.00	45,391,500
ダイダン	8,100	2,923.00	23,676,300
日比谷総合設備	10,900	1,897.00	20,677,300
フィル・カンパニー	1,900	1,953.00	3,710,700
O S J Bホールディングス	53,500	264.00	14,124,000

東洋エンジニアリング	14,300	427.00	6,106,100
レイズネクスト	18,200	1,167.00	21,239,400
日本製粉	31,800	1,647.00	52,374,600
日清製粉グループ本社	122,700	1,692.00	207,608,400
日東富士製粉	800	6,550.00	5,240,000
昭和産業	10,000	3,075.00	30,750,000
鳥越製粉	9,600	1,005.00	9,648,000
中部飼料	13,300	1,427.00	18,979,100
フィード・ワン	14,600	891.00	13,008,600
東洋精糖	1,800	1,220.00	2,196,000
日本甜菜製糖	5,700	1,615.00	9,205,500
三井製糖	9,500	1,789.00	16,995,500
塩水港精糖	11,800	222.00	2,619,600
日新製糖	5,100	1,844.00	9,404,400
森永製菓	25,500	3,905.00	99,577,500
中村屋	2,800	3,985.00	11,158,000
江崎グリコ	29,900	4,535.00	135,596,500
名糖産業	5,200	1,432.00	7,446,400
井村屋グループ	6,200	2,629.00	16,299,800
不二家	6,900	2,472.00	17,056,800
山崎製パン	81,400	1,742.00	141,798,800
第一屋製パン	2,100	1,005.00	2,110,500
モロゾフ	1,800	5,860.00	10,548,000
亀田製菓	6,200	4,960.00	30,752,000
寿スピリッツ	10,500	5,360.00	56,280,000
カルビー	49,500	3,095.00	153,202,500
森永乳業	20,100	5,060.00	101,706,000
六甲バター	7,200	1,938.00	13,953,600
ヤクルト本社	74,700	5,370.00	401,139,000
明治ホールディングス	71,800	7,470.00	536,346,000
雪印メグミルク	26,200	2,256.00	59,107,200
プリマハム	17,000	3,115.00	52,955,000
日本ハム	41,500	4,735.00	196,502,500
林兼産業	3,600	582.00	2,095,200
丸大食品	11,600	1,698.00	19,696,800
S Foods	8,700	3,360.00	29,232,000
柿安本店	3,800	2,539.00	9,648,200
伊藤ハム米久ホールディングス	69,900	682.00	47,671,800
サッポロホールディングス	37,100	2,064.00	76,574,400
アサヒグループホールディングス	237,300	4,564.00	1,083,037,200
キリンホールディングス	460,700	2,414.00	1,112,129,800
宝ホールディングス	80,500	1,272.00	102,396,000

オエノンホールディングス	30,900	413.00	12,761,700	
養命酒製造	3,300	1,899.00	6,266,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,200	1,640.00	136,448,000	
サントリー 食品インターナショナル	72,700	3,880.00	282,076,000	
ダイドーグループホールディングス	5,600	5,670.00	31,752,000	
伊藤園	33,000	7,100.00	234,300,000	
キーコーヒー	10,700	2,156.00	23,069,200	
ユニカフェ	3,300	1,200.00	3,960,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,208.00	1,812,000	
日清オイリオグループ	14,000	3,030.00	42,420,000	
不二製油グループ本社	26,500	2,824.00	74,836,000	
かどや製油	1,200	3,910.00	4,692,000	
J - オイルミルズ	5,600	3,535.00	19,796,000	
キッコーマン	78,200	6,550.00	512,210,000	
味の素	239,900	2,257.00	541,454,300	
キューピー	60,500	2,162.00	130,801,000	
ハウス食品グループ本社	40,600	3,825.00	155,295,000	
カゴメ	44,400	3,725.00	165,390,000	
焼津水産化学工業	5,300	993.00	5,262,900	
アリアケジャパン	9,900	7,200.00	71,280,000	
ピエトロ	1,400	1,698.00	2,377,200	
エバラ食品工業	2,600	2,410.00	6,266,000	
やまみ	900	2,034.00	1,830,600	
ニチレイ	51,700	2,782.00	143,829,400	
東洋水産	55,900	5,180.00	289,562,000	
イトアンドホールディングス	3,800	1,853.00	7,041,400	
大冷	1,400	1,969.00	2,756,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	819.00	4,914,000	
日清食品ホールディングス	46,200	8,710.00	402,402,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,234.00	11,840,200	
一正蒲鉾	4,200	1,166.00	4,897,200	
フジッコ	11,800	1,995.00	23,541,000	
ロック・フィールド	11,700	1,614.00	18,883,800	
日本たばこ産業	582,500	2,165.00	1,261,112,500	
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,918.00	11,699,800	
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,417.00	10,060,700	
なとり	6,100	1,924.00	11,736,400	
イフジ産業	1,900	817.00	1,552,300	
ピクルスコーポレーション	2,400	3,165.00	7,596,000	
北の達人コーポレーション	37,900	478.00	18,116,200	
ユーグレナ	47,000	786.00	36,942,000	
ミヨシ油脂	3,800	1,289.00	4,898,200	

理研ビタミン	10,300	1,376.00	14,172,800
片倉工業	14,400	1,396.00	20,102,400
グンゼ	7,900	3,520.00	27,808,000
東洋紡	42,100	1,340.00	56,414,000
ユニチカ	31,900	393.00	12,536,700
富士紡ホールディングス	5,200	3,800.00	19,760,000
倉敷紡績	10,700	1,878.00	20,094,600
シキボウ	5,600	1,027.00	5,751,200
日本毛織	35,200	1,019.00	35,868,800
トーア紡コーポレーション	4,200	474.00	1,990,800
帝国繊維	12,100	2,530.00	30,613,000
帝人	86,700	1,947.00	168,804,900
東レ	768,100	625.70	480,600,170
サカイオーベックス	3,000	2,113.00	6,339,000
住江織物	2,300	2,239.00	5,149,700
日本フェルト	6,700	448.00	3,001,600
イチカワ	1,800	1,288.00	2,318,400
日東製網	1,200	1,554.00	1,864,800
アツギ	9,000	512.00	4,608,000
ダイニック	4,000	825.00	3,300,000
セーレン	26,300	1,587.00	41,738,100
ソトー	4,400	901.00	3,964,400
東海染工	1,600	1,129.00	1,806,400
小松マテーレ	17,500	984.00	17,220,000
ワコールホールディングス	26,500	2,049.00	54,298,500
ホギメディカル	12,100	3,350.00	40,535,000
T S Iホールディングス	32,900	216.00	7,106,400
マツオカコーポレーション	3,100	2,295.00	7,114,500
ワールド	15,100	1,301.00	19,645,100
三陽商会	5,500	575.00	3,162,500
ナイガイ	4,300	347.00	1,492,100
オンワードホールディングス	64,400	205.00	13,202,000
ルックホールディングス	3,800	1,010.00	3,838,000
ゴールドウイン	19,200	7,080.00	135,936,000
デサント	20,800	1,749.00	36,379,200
キング	5,300	522.00	2,766,600
ヤマトインターナショナル	9,700	337.00	3,268,900
特種東海製紙	6,500	5,200.00	33,800,000
王子ホールディングス	443,200	550.00	243,760,000
日本製紙	46,900	1,217.00	57,077,300
三菱製紙	12,000	326.00	3,912,000
北越コーポレーション	63,200	374.00	23,636,800

中越パルプ工業	4,500	1,281.00	5,764,500
巴川製紙所	3,100	796.00	2,467,600
大王製紙	51,100	1,784.00	91,162,400
阿波製紙	2,700	474.00	1,279,800
レンゴー	100,200	824.00	82,564,800
トーモク	6,500	1,717.00	11,160,500
ザ・パック	8,000	2,960.00	23,680,000
クラレ	167,000	1,129.00	188,543,000
旭化成	702,700	1,063.00	746,970,100
共和レザー	5,800	612.00	3,549,600
昭和電工	80,500	2,160.00	173,880,000
住友化学	778,800	412.00	320,865,600
住友精化	4,700	3,975.00	18,682,500
日産化学	58,500	6,290.00	367,965,000
ラサ工業	3,700	2,246.00	8,310,200
クレハ	9,100	6,450.00	58,695,000
多木化学	4,100	6,640.00	27,224,000
テイカ	7,800	1,559.00	12,160,200
石原産業	19,000	629.00	11,951,000
片倉コープアグリ	2,700	1,221.00	3,296,700
日本曹達	15,700	2,887.00	45,325,900
東ソー	163,900	1,765.00	289,283,500
トクヤマ	30,600	2,359.00	72,185,400
セントラル硝子	21,700	2,271.00	49,280,700
東亜合成	66,500	1,273.00	84,654,500
大阪ソーダ	10,800	2,701.00	29,170,800
関東電化工業	25,100	752.00	18,875,200
デンカ	38,700	3,850.00	148,995,000
信越化学工業	182,000	17,245.00	3,138,590,000
日本カーバイド工業	3,700	1,292.00	4,780,400
堺化学工業	6,900	2,064.00	14,241,600
第一稀元素化学工業	11,500	817.00	9,395,500
エア・ウォーター	98,600	1,778.00	175,310,800
日本酸素ホールディングス	101,900	1,786.00	181,993,400
日本化学工業	3,300	2,596.00	8,566,800
東邦アセチレン	1,600	1,248.00	1,996,800
日本パーカライズニング	53,500	1,094.00	58,529,000
高圧ガス工業	16,800	835.00	14,028,000
チタン工業	1,300	2,325.00	3,022,500
四国化成工業	15,500	1,194.00	18,507,000
戸田工業	2,500	2,430.00	6,075,000
ステラ ケミファ	5,800	3,440.00	19,952,000

保土谷化学工業	4,000	4,595.00	18,380,000
日本触媒	16,500	5,420.00	89,430,000
大日精化工業	9,400	2,408.00	22,635,200
カネカ	27,400	3,450.00	94,530,000
三菱瓦斯化学	98,600	2,330.00	229,738,000
三井化学	98,400	2,894.00	284,769,600
J S R	98,800	2,786.00	275,256,800
東京応化工業	18,200	6,990.00	127,218,000
大阪有機化学工業	9,800	3,000.00	29,400,000
三菱ケミカルホールディングス	708,700	640.40	453,851,480
K Hネオケム	17,500	2,751.00	48,142,500
ダイセル	132,300	720.00	95,256,000
住友ベークライト	16,700	3,535.00	59,034,500
積水化学工業	224,200	1,929.00	432,481,800
日本ゼオン	95,600	1,386.00	132,501,600
アイカ工業	31,800	3,665.00	116,547,000
宇部興産	53,500	1,909.00	102,131,500
積水樹脂	19,100	2,192.00	41,867,200
タキロンシーアイ	22,900	701.00	16,052,900
旭有機材	6,000	1,547.00	9,282,000
ニチバン	5,600	1,646.00	9,217,600
リケンテクノス	25,900	453.00	11,732,700
大倉工業	5,000	1,833.00	9,165,000
積水化成品工業	14,200	536.00	7,611,200
群栄化学工業	2,400	2,412.00	5,788,800
タイガースポリマー	5,600	425.00	2,380,000
ミライアル	3,700	1,160.00	4,292,000
ダイキアクシス	3,800	1,139.00	4,328,200
ダイキョーニシカワ	22,300	818.00	18,241,400
竹本容器	3,800	1,009.00	3,834,200
森六ホールディングス	5,700	2,149.00	12,249,300
日本化薬	65,600	957.00	62,779,200
カーリットホールディングス	11,300	698.00	7,887,400
日本精化	8,500	1,483.00	12,605,500
扶桑化学工業	10,700	3,785.00	40,499,500
トリケミカル研究所	2,400	14,020.00	33,648,000
A D E K A	48,800	1,783.00	87,010,400
日油	39,900	4,895.00	195,310,500
新日本理化	17,500	235.00	4,112,500
ハリマ化成グループ	8,800	1,077.00	9,477,600
花王	259,200	7,745.00	2,007,504,000
第一工業製薬	3,900	4,335.00	16,906,500

石原ケミカル	2,900	2,102.00	6,095,800
日華化学	3,600	938.00	3,376,800
ニイタカ	2,200	3,115.00	6,853,000
三洋化成工業	6,300	4,675.00	29,452,500
有機合成薬品工業	8,100	313.00	2,535,300
大日本塗料	12,000	993.00	11,916,000
日本ペイントホールディングス	87,500	10,680.00	934,500,000
関西ペイント	119,100	3,005.00	357,895,500
神東塗料	8,300	196.00	1,626,800
中国塗料	30,200	993.00	29,988,600
日本特殊塗料	7,900	1,246.00	9,843,400
藤倉化成	14,300	541.00	7,736,300
太陽ホールディングス	7,800	6,130.00	47,814,000
D I C	44,800	2,688.00	120,422,400
サカタインクス	23,100	1,202.00	27,766,200
東洋インキＳＣホールディングス	22,400	2,007.00	44,956,800
T & K T O K A	8,200	821.00	6,732,200
富士フィルムホールディングス	207,500	5,611.00	1,164,282,500
資生堂	215,100	7,305.00	1,571,305,500
ライオン	140,700	2,490.00	350,343,000
高砂香料工業	6,800	2,506.00	17,040,800
マンダム	24,300	1,691.00	41,091,300
ミルボン	14,500	6,020.00	87,290,000
ファンケル	43,800	4,235.00	185,493,000
コーセー	20,400	16,580.00	338,232,000
コタ	6,200	1,387.00	8,599,400
シーボン	1,400	1,955.00	2,737,000
ポーラ・オルビスホールディングス	46,200	2,050.00	94,710,000
ノエビアホールディングス	9,200	4,365.00	40,158,000
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,011.00	2,426,400
エステー	7,000	1,967.00	13,769,000
アグロ カネショウ	4,100	1,726.00	7,076,600
コニシ	17,800	1,608.00	28,622,400
長谷川香料	18,700	2,043.00	38,204,100
星光P M C	6,200	732.00	4,538,400
小林製薬	30,300	12,500.00	378,750,000
荒川化学工業	9,700	1,157.00	11,222,900
メック	7,400	2,214.00	16,383,600
日本高純度化学	3,000	2,775.00	8,325,000
タカラバイオ	28,300	2,917.00	82,551,100
J C U	13,100	3,740.00	48,994,000
新田ゼラチン	6,800	684.00	4,651,200

O A Tアグリオ	2,000	1,459.00	2,918,000	
デクセリアルズ	28,000	1,311.00	36,708,000	
アース製薬	8,200	5,960.00	48,872,000	
北興化学工業	10,100	1,114.00	11,251,400	
大成ラミック	3,600	2,956.00	10,641,600	
クミアイ化学工業	44,800	1,080.00	48,384,000	
日本農薬	19,300	531.00	10,248,300	
アキレス	7,500	1,444.00	10,830,000	
有沢製作所	17,100	956.00	16,347,600	
日東電工	74,700	8,610.00	643,167,000	
レック	11,500	1,469.00	16,893,500	
三光合成	12,400	406.00	5,034,400	
きもと	18,400	202.00	3,716,800	
藤森工業	9,700	4,795.00	46,511,500	
前澤化成工業	6,900	989.00	6,824,100	
未来工業	5,800	1,779.00	10,318,200	
ウェーブロックホールディングス	3,700	794.00	2,937,800	
J S P	6,300	1,575.00	9,922,500	
エフピコ	22,700	4,110.00	93,297,000	
天馬	7,200	1,998.00	14,385,600	
信越ポリマー	19,400	981.00	19,031,400	
東リ	26,900	255.00	6,859,500	
ニフコ	39,700	3,845.00	152,646,500	
バルカー	8,800	2,000.00	17,600,000	
ユニ・チャーム	229,500	4,831.00	1,108,714,500	
ショーエイコーポレーション	1,800	1,006.00	1,810,800	
協和キリン	108,900	2,835.00	308,731,500	
武田薬品工業	900,600	3,877.00	3,491,626,200	
アステラス製薬	938,500	1,493.00	1,401,180,500	
大日本住友製薬	80,200	1,326.00	106,345,200	
塩野義製薬	136,100	5,620.00	764,882,000	
わかもと製薬	12,900	257.00	3,315,300	
あすか製薬	12,300	1,803.00	22,176,900	
日本新薬	28,300	7,240.00	204,892,000	
バイオフェルミン製薬	1,800	2,463.00	4,433,400	
中外製薬	338,600	5,018.00	1,699,094,800	
科研製薬	18,500	3,965.00	73,352,500	
エーザイ	129,600	7,702.00	998,179,200	
ロート製薬	55,600	3,125.00	173,750,000	
小野薬品工業	248,600	3,213.00	798,751,800	
久光製薬	28,600	6,170.00	176,462,000	
持田製薬	15,000	3,920.00	58,800,000	

参天製薬	201,700	1,708.00	344,503,600
扶桑薬品工業	3,800	2,931.00	11,137,800
日本ケミファ	1,400	2,330.00	3,262,000
ツムラ	33,500	3,270.00	109,545,000
日医工	30,700	1,012.00	31,068,400
キッセイ薬品工業	19,200	2,163.00	41,529,600
生化学工業	21,000	1,038.00	21,798,000
栄研化学	19,000	1,970.00	37,430,000
日水製薬	4,500	964.00	4,338,000
鳥居薬品	6,800	3,325.00	22,610,000
JCRファーマ	30,500	2,501.00	76,280,500
東和薬品	13,800	1,869.00	25,792,200
富士製薬工業	7,400	1,270.00	9,398,000
沢井製薬	22,200	4,860.00	107,892,000
ゼリア新薬工業	19,600	1,917.00	37,573,200
第一三共	929,200	3,395.00	3,154,634,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,900	1,927.00	46,055,300
大幸薬品	13,300	1,620.00	21,546,000
ダイト	6,900	3,695.00	25,495,500
大塚ホールディングス	225,000	4,401.00	990,225,000
大正製薬ホールディングス	22,900	6,610.00	151,369,000
ペプチドリーム	55,000	5,430.00	298,650,000
日本コークス工業	91,400	70.00	6,398,000
ニチレキ	12,800	1,629.00	20,851,200
ユシロ化学工業	6,100	1,200.00	7,320,000
ビーピー・カストロール	3,900	1,287.00	5,019,300
富士石油	28,900	177.00	5,115,300
MORESCO	3,900	1,020.00	3,978,000
出光興産	120,100	2,238.00	268,783,800
ENEOSホールディングス	1,628,300	354.20	576,743,860
コスモエネルギーホールディングス	31,300	1,753.00	54,868,900
横浜ゴム	62,700	1,594.00	99,943,800
TOYO TIRE	57,000	1,709.00	97,413,000
ブリヂストン	287,800	3,682.00	1,059,679,600
住友ゴム工業	97,200	902.00	87,674,400
藤倉コンポジット	9,500	392.00	3,724,000
オカモト	6,600	4,055.00	26,763,000
フコク	4,700	695.00	3,266,500
ニッタ	12,200	2,343.00	28,584,600
住友理工	21,000	561.00	11,781,000
三ツ星ベルト	14,200	1,706.00	24,225,200
バンドー化学	19,000	594.00	11,286,000

日東紡績	16,100	4,215.00	67,861,500
A G C	99,400	3,430.00	340,942,000
日本板硝子	51,800	440.00	22,792,000
石塚硝子	2,000	1,887.00	3,774,000
日本山村硝子	4,700	916.00	4,305,200
日本電気硝子	40,200	2,382.00	95,756,400
オハラ	4,400	1,652.00	7,268,800
住友大阪セメント	20,500	3,180.00	65,190,000
太平洋セメント	68,400	2,773.00	189,673,200
日本ヒューム	11,000	798.00	8,778,000
日本コンクリート工業	23,800	322.00	7,663,600
三谷セキサン	5,100	3,990.00	20,349,000
アジアパイルホールディングス	15,700	471.00	7,394,700
東海カーボン	106,000	1,175.00	124,550,000
日本カーボン	6,000	3,925.00	23,550,000
東洋炭素	6,400	1,859.00	11,897,600
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	2,958.00	17,748,000
T O T O	77,300	5,800.00	448,340,000
日本碍子	130,000	1,686.00	219,180,000
日本特殊陶業	82,400	1,900.00	156,560,000
M A R U W A	4,200	11,230.00	47,166,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,351.00	6,817,900
黒崎播磨	2,200	3,650.00	8,030,000
ヨータイ	8,800	830.00	7,304,000
イソライト工業	5,900	490.00	2,891,000
東京窯業	14,200	338.00	4,799,600
ニッカトー	5,100	805.00	4,105,500
フジインコーポレーテッド	9,700	3,840.00	37,248,000
クニミネ工業	4,500	1,046.00	4,707,000
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,022.00	1,839,600
ニチアス	29,700	2,448.00	72,705,600
ニチハ	15,100	3,155.00	47,640,500
日本製鉄	479,100	1,335.00	639,598,500
神戸製鋼所	196,000	537.00	105,252,000
中山製鋼所	15,000	390.00	5,850,000
合同製鐵	5,800	1,950.00	11,310,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	289,100	1,071.00	309,626,100
東京製鐵	52,200	632.00	32,990,400
共英製鋼	12,100	1,463.00	17,702,300
大和工業	22,800	2,723.00	62,084,400
東京鐵鋼	4,400	2,137.00	9,402,800
大阪製鐵	5,700	1,242.00	7,079,400

淀川製鋼所	14,500	1,996.00	28,942,000
丸一鋼管	34,800	2,265.00	78,822,000
モリ工業	3,200	2,662.00	8,518,400
大同特殊鋼	17,500	4,480.00	78,400,000
日本高周波鋼業	4,100	341.00	1,398,100
日本冶金工業	8,900	1,795.00	15,975,500
山陽特殊製鋼	7,400	1,308.00	9,679,200
愛知製鋼	6,000	2,927.00	17,562,000
日立金属	115,300	1,545.00	178,138,500
日本金属	2,500	1,036.00	2,590,000
大太平洋金属	7,300	2,082.00	15,198,600
新日本電工	69,300	266.00	18,433,800
栗本鐵工所	5,300	1,710.00	9,063,000
虹技	1,600	1,207.00	1,931,200
三菱製鋼	8,000	585.00	4,680,000
日亜鋼業	15,800	290.00	4,582,000
日本精線	1,800	3,815.00	6,867,000
エンビプロ・ホールディングス	4,600	632.00	2,907,200
シンニッタン	16,900	188.00	3,177,200
新家工業	2,500	1,156.00	2,890,000
大紀アルミニウム工業所	17,700	739.00	13,080,300
日本軽金属ホールディングス	27,100	1,952.00	52,899,200
三井金属鉱業	28,900	3,535.00	102,161,500
東邦亜鉛	5,500	2,407.00	13,238,500
三菱マテリアル	70,700	2,069.00	146,278,300
住友金属鉱山	136,800	4,258.00	582,494,400
D O W Aホールディングス	27,100	3,665.00	99,321,500
古河機械金属	19,100	1,298.00	24,791,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	963.00	10,785,600
東邦チタニウム	19,300	787.00	15,189,100
U A C J	16,300	1,899.00	30,953,700
C Kサンエツ	2,300	3,935.00	9,050,500
古河電気工業	33,300	2,895.00	96,403,500
住友電気工業	400,300	1,240.50	496,572,150
フジクラ	129,300	465.00	60,124,500
昭和電線ホールディングス	12,500	1,773.00	22,162,500
東京特殊電線	1,600	2,418.00	3,868,800
タツタ電線	21,400	694.00	14,851,600
カナレ電気	1,800	1,800.00	3,240,000
平河ヒューテック	5,400	1,152.00	6,220,800
リョービ	13,200	1,288.00	17,001,600
アーレスティ	14,300	338.00	4,833,400

アサヒホールディングス	18,800	3,255.00	61,194,000
稲葉製作所	6,000	1,372.00	8,232,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,259.00	7,454,700
トーカロ	29,700	1,337.00	39,708,900
アルファＣｏ	3,800	973.00	3,697,400
SUMCO	137,000	2,381.00	326,197,000
川田テクノロジーズ	2,200	4,290.00	9,438,000
RS Technologies	3,500	4,975.00	17,412,500
ジェイテックコーポレーション	700	3,700.00	2,590,000
信和	6,200	674.00	4,178,800
東洋製罐グループホールディングス	68,200	1,103.00	75,224,600
ホッカンホールディングス	5,900	1,403.00	8,277,700
コロナ	5,900	941.00	5,551,900
横河ブリッジホールディングス	19,900	2,108.00	41,949,200
駒井ハルテック	2,000	1,657.00	3,314,000
高田機工	1,000	2,553.00	2,553,000
三和ホールディングス	100,900	1,200.00	121,080,000
文化シャッター	31,500	944.00	29,736,000
三協立山	13,800	767.00	10,584,600
アルインコ	7,800	918.00	7,160,400
東洋シャッター	2,600	738.00	1,918,800
LIXIL	157,900	2,328.00	367,591,200
日本フィルコン	7,400	514.00	3,803,600
ノーリツ	22,200	1,668.00	37,029,600
長府製作所	10,900	2,088.00	22,759,200
リンナイ	20,800	11,890.00	247,312,000
ダイニチ工業	5,800	829.00	4,808,200
日東精工	13,400	443.00	5,936,200
三洋工業	1,400	1,896.00	2,654,400
岡部	21,700	797.00	17,294,900
ジーテクト	13,300	1,480.00	19,684,000
東ブレ	20,000	1,440.00	28,800,000
高周波熱錬	20,600	480.00	9,888,000
東京製綱	7,700	891.00	6,860,700
サンコール	8,000	445.00	3,560,000
モリテック スチール	8,300	528.00	4,382,400
パイオラックス	15,800	1,707.00	26,970,600
エイチワン	10,500	781.00	8,200,500
日本発條	114,800	664.00	76,227,200
中央発條	1,300	2,997.00	3,896,100
アドバネクス	1,500	1,287.00	1,930,500
立川ブラインド工業	4,700	1,355.00	6,368,500

三益半導体工業	8,400	2,779.00	23,343,600
日本ドライケミカル	2,700	1,541.00	4,160,700
日本製鋼所	32,500	2,930.00	95,225,000
三浦工業	46,300	5,660.00	262,058,000
タクマ	36,300	1,790.00	64,977,000
ツガミ	22,200	1,592.00	35,342,400
オークマ	12,500	5,890.00	73,625,000
芝浦機械	12,100	2,290.00	27,709,000
アマダ	132,900	1,107.00	147,120,300
アイダエンジニアリング	28,100	954.00	26,807,400
滝澤鉄工所	3,400	986.00	3,352,400
F U J I	46,000	2,715.00	124,890,000
牧野フライス製作所	12,600	4,060.00	51,156,000
オーエスジー	52,800	1,895.00	100,056,000
ダイジェット工業	1,300	1,334.00	1,734,200
旭ダイヤモンド工業	28,300	427.00	12,084,100
D M G 森精機	67,800	1,608.00	109,022,400
ソディック	23,400	841.00	19,679,400
ディスコ	14,500	32,750.00	474,875,000
日東工器	5,900	1,770.00	10,443,000
日進工具	4,200	2,699.00	11,335,800
パンチ工業	9,800	476.00	4,664,800
富士ダイス	4,800	661.00	3,172,800
豊和工業	6,000	840.00	5,040,000
O K K	4,400	393.00	1,729,200
東洋機械金属	7,800	406.00	3,166,800
津田駒工業	2,100	900.00	1,890,000
エンシュウ	2,700	938.00	2,532,600
島精機製作所	16,900	1,806.00	30,521,400
オプトラン	13,400	2,255.00	30,217,000
N C ホールディングス	3,300	529.00	1,745,700
イワキポンプ	6,900	840.00	5,796,000
フリー	10,500	1,074.00	11,277,000
ヤマシンフィルタ	24,000	1,118.00	26,832,000
日阪製作所	13,300	837.00	11,132,100
やまびこ	20,800	1,383.00	28,766,400
平田機工	5,100	8,530.00	43,503,000
ペガサスミシン製造	11,100	331.00	3,674,100
マルマエ	4,000	1,225.00	4,900,000
タツモ	4,600	1,552.00	7,139,200
ナブテスコ	63,100	4,300.00	271,330,000
三井海洋開発	11,400	1,779.00	20,280,600

レオン自動機	10,600	1,117.00	11,840,200
S M C	34,000	65,550.00	2,228,700,000
ホソカワミクロン	3,800	6,430.00	24,434,000
ユニオンツール	4,000	3,105.00	12,420,000
オイレス工業	13,900	1,683.00	23,393,700
日精エー・エス・ビー機械	3,100	6,110.00	18,941,000
サトーホールディングス	15,300	2,190.00	33,507,000
技研製作所	9,400	4,195.00	39,433,000
日本エアータック	3,500	1,562.00	5,467,000
カワタ	3,200	1,069.00	3,420,800
日精樹脂工業	9,100	876.00	7,971,600
オカダアイヨン	3,400	1,061.00	3,607,400
ワイエイシイホールディングス	4,600	1,137.00	5,230,200
小松製作所	490,300	2,763.50	1,354,944,050
住友重機械工業	62,000	2,290.00	141,980,000
日立建機	43,400	2,941.00	127,639,400
日工	14,900	689.00	10,266,100
巴工業	4,300	1,904.00	8,187,200
井関農機	10,900	1,411.00	15,379,900
T O W A	11,000	1,969.00	21,659,000
丸山製作所	2,300	1,504.00	3,459,200
北川鉄工所	4,900	1,367.00	6,698,300
ローツェ	4,800	5,790.00	27,792,000
タカキタ	3,900	684.00	2,667,600
クボタ	568,700	2,175.50	1,237,206,850
荏原実業	2,700	3,870.00	10,449,000
三菱化工機	3,800	3,175.00	12,065,000
月島機械	20,000	1,399.00	27,980,000
帝国電機製作所	9,000	1,248.00	11,232,000
新東工業	25,800	743.00	19,169,400
澁谷工業	9,500	3,625.00	34,437,500
アイチ コーポレーション	18,800	941.00	17,690,800
小森コーポレーション	27,600	724.00	19,982,400
鶴見製作所	8,400	1,799.00	15,111,600
住友精密工業	1,600	2,007.00	3,211,200
日本ギア工業	4,500	297.00	1,336,500
酒井重工業	2,100	2,382.00	5,002,200
荏原製作所	44,900	3,410.00	153,109,000
石井鐵工所	1,400	2,817.00	3,943,800
西島製作所	11,000	889.00	9,779,000
北越工業	11,200	1,048.00	11,737,600
ダイキン工業	137,900	22,770.00	3,139,983,000

オルガノ	3,900	6,060.00	23,634,000
トーヨーカネツ	4,700	2,115.00	9,940,500
栗田工業	58,600	3,790.00	222,094,000
椿本チエイン	15,500	2,797.00	43,353,500
大同工業	5,300	668.00	3,540,400
木村化工機	9,200	546.00	5,023,200
アネスト岩田	16,900	997.00	16,849,300
ダイフク	55,300	12,370.00	684,061,000
サムコ	2,700	3,375.00	9,112,500
加藤製作所	6,000	1,007.00	6,042,000
油研工業	1,900	1,510.00	2,869,000
タダノ	52,400	896.00	46,950,400
フジテック	39,400	2,221.00	87,507,400
C K D	29,700	2,337.00	69,408,900
キトー	8,200	1,618.00	13,267,600
平和	30,200	1,450.00	43,790,000
理想科学工業	9,600	1,279.00	12,278,400
S A N K Y O	24,100	2,644.00	63,720,400
日本金銭機械	12,100	529.00	6,400,900
マースグループホールディングス	6,900	1,598.00	11,026,200
フクシマガリレイ	6,700	4,590.00	30,753,000
オーイズミ	4,700	386.00	1,814,200
ダイコク電機	5,000	865.00	4,325,000
竹内製作所	18,100	2,517.00	45,557,700
アマノ	28,400	2,667.00	75,742,800
J U K I	15,100	515.00	7,776,500
蛇の目ミシン工業	9,900	798.00	7,900,200
マックス	16,600	1,408.00	23,372,800
グローリー	27,800	2,104.00	58,491,200
新晃工業	10,100	1,695.00	17,119,500
大和冷機工業	17,400	1,158.00	20,149,200
セガサミーホールディングス	107,400	1,486.00	159,596,400
日本ピストンリング	4,000	1,019.00	4,076,000
リケン	5,000	2,172.00	10,860,000
T P R	14,600	1,435.00	20,951,000
ツバキ・ナカシマ	20,800	953.00	19,822,400
ホシザキ	34,100	9,840.00	335,544,000
大豊工業	8,900	663.00	5,900,700
日本精工	203,900	941.00	191,869,900
N T N	250,500	251.00	62,875,500
ジェイテクト	103,900	780.00	81,042,000
不二越	10,100	4,255.00	42,975,500

日本トムソン	32,300	375.00	12,112,500	
THK	67,500	3,410.00	230,175,000	
ユーシン精機	8,500	887.00	7,539,500	
前澤給装工業	4,000	2,365.00	9,460,000	
イーグル工業	13,400	969.00	12,984,600	
前澤工業	7,300	455.00	3,321,500	
日本ピラー工業	11,000	1,611.00	17,721,000	
キット	43,400	655.00	28,427,000	
マキタ	141,200	5,320.00	751,184,000	
日立造船	86,100	433.00	37,281,300	
三菱重工業	181,400	2,711.00	491,775,400	
IHI	78,000	1,770.00	138,060,000	
スター精密	16,700	1,698.00	28,356,600	
日清紡ホールディングス	66,300	800.00	53,040,000	
イビデン	66,400	5,030.00	333,992,000	
コニカミノルタ	238,000	374.00	89,012,000	
ブラザー工業	132,400	2,064.00	273,273,600	
ミネベアミツミ	201,200	2,165.00	435,598,000	
日立製作所	520,100	4,207.00	2,188,060,700	
三菱電機	1,082,400	1,502.50	1,626,306,000	
富士電機	65,200	3,665.00	238,958,000	
東洋電機製造	4,000	1,151.00	4,604,000	
安川電機	116,500	4,865.00	566,772,500	
シンフォニアテクノロジー	14,100	1,424.00	20,078,400	
明電舎	19,900	2,094.00	41,670,600	
オリジン	3,000	1,332.00	3,996,000	
山洋電気	5,300	5,240.00	27,772,000	
デンヨー	9,300	2,105.00	19,576,500	
東芝テック	13,600	3,880.00	52,768,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	4,200.00	8,400,000	
マブチモーター	30,100	4,570.00	137,557,000	
日本電産	260,500	12,400.00	3,230,200,000	
トレックス・セミコンダクター	6,600	1,371.00	9,048,600	
東光高岳	6,400	1,822.00	11,660,800	
ダイヘン	11,900	4,910.00	58,429,000	
ヤーマン	17,900	2,374.00	42,494,600	
JVCケンウッド	91,600	148.00	13,556,800	
ミマキエンジニアリング	10,700	511.00	5,467,700	
IPEX	5,300	1,992.00	10,557,600	
日新電機	25,400	1,137.00	28,879,800	
大崎電気工業	21,700	555.00	12,043,500	
オムロン	97,000	8,960.00	869,120,000	

日東工業	15,900	2,015.00	32,038,500
I D E C	15,700	1,855.00	29,123,500
正興電機製作所	2,800	2,294.00	6,423,200
不二電機工業	2,200	1,313.00	2,888,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,300	2,689.00	97,610,700
サクサホールディングス	2,600	1,421.00	3,694,600
メルコホールディングス	3,900	3,285.00	12,811,500
テクノメディカ	2,800	1,508.00	4,222,400
日本電気	131,300	5,420.00	711,646,000
富士通	104,400	13,740.00	1,434,456,000
沖電気工業	44,100	915.00	40,351,500
岩崎通信機	4,700	849.00	3,990,300
電気興業	5,200	2,773.00	14,419,600
サンケン電気	11,800	3,900.00	46,020,000
ナカヨ	2,100	1,456.00	3,057,600
アイホン	6,200	1,705.00	10,571,000
ルネサスエレクトロニクス	464,500	1,014.00	471,003,000
セイコーエプソン	134,400	1,626.00	218,534,400
ワコム	73,300	912.00	66,849,600
アルバック	19,900	4,515.00	89,848,500
アクセル	5,100	759.00	3,870,900
E I Z O	8,400	3,795.00	31,878,000
日本信号	27,600	945.00	26,082,000
京三製作所	25,500	445.00	11,347,500
能美防災	14,500	2,393.00	34,698,500
ホーチキ	8,200	1,294.00	10,610,800
星和電機	6,100	656.00	4,001,600
エレコム	12,500	4,750.00	59,375,000
パナソニック	1,236,700	1,170.00	1,446,939,000
シャープ	125,300	1,406.00	176,171,800
アンリツ	69,700	2,286.00	159,334,200
富士通ゼネラル	29,400	2,828.00	83,143,200
ソニー	678,100	9,818.00	6,657,585,800
T D K	52,300	14,080.00	736,384,000
帝国通信工業	5,200	1,159.00	6,026,800
タムラ製作所	36,300	576.00	20,908,800
アルプスアルパイン	96,200	1,265.00	121,693,000
池上通信機	3,400	921.00	3,131,400
鈴木	5,900	1,064.00	6,277,600
日本トリム	1,600	4,160.00	6,656,000
ローランド ディー . ジー .	6,700	1,880.00	12,596,000
フォスター電機	11,400	1,206.00	13,748,400

S M K	2,800	3,035.00	8,498,000
ヨコオ	7,200	2,561.00	18,439,200
ホシデン	30,100	969.00	29,166,900
ヒロセ電機	16,700	15,100.00	252,170,000
日本航空電子工業	24,900	1,497.00	37,275,300
T O A	11,700	865.00	10,120,500
マクセルホールディングス	23,700	1,323.00	31,355,100
古野電気	14,400	1,161.00	16,718,400
ユニデンホールディングス	3,000	2,330.00	6,990,000
スミダコーポレーション	9,700	1,100.00	10,670,000
アイコム	6,000	2,712.00	16,272,000
リオン	4,700	3,195.00	15,016,500
本多通信工業	10,300	488.00	5,026,400
横河電機	99,300	1,933.00	191,946,900
新電元工業	3,900	2,567.00	10,011,300
アズビル	68,300	5,180.00	353,794,000
東亜ディーケーケー	5,900	881.00	5,197,900
日本光電工業	44,900	3,490.00	156,701,000
チノー	3,800	1,441.00	5,475,800
共和電業	11,500	402.00	4,623,000
日本電子材料	4,300	1,743.00	7,494,900
堀場製作所	21,500	5,630.00	121,045,000
アドバンテスト	80,500	7,540.00	606,970,000
小野測器	5,500	516.00	2,838,000
エスペック	9,800	2,015.00	19,747,000
キーエンス	98,100	52,640.00	5,163,984,000
日置電機	5,300	4,260.00	22,578,000
シスメックス	77,400	11,645.00	901,323,000
日本マイクロニクス	19,300	1,103.00	21,287,900
メガチップス	10,200	3,005.00	30,651,000
O B A R A G R O U P	6,500	3,910.00	25,415,000
澤藤電機	1,600	2,301.00	3,681,600
原田工業	5,700	862.00	4,913,400
コーセル	14,900	1,208.00	17,999,200
イリソ電子工業	9,200	4,695.00	43,194,000
オブテックスグループ	18,000	1,952.00	35,136,000
千代田インテグレ	4,900	1,587.00	7,776,300
アイ・オー・データ機器	4,000	1,061.00	4,244,000
レーザーテック	47,600	11,420.00	543,592,000
スタンレー電気	76,000	3,410.00	259,160,000
岩崎電気	4,600	1,403.00	6,453,800
ウシオ電機	60,100	1,308.00	78,610,800

岡谷電機産業	9,800	409.00	4,008,200
ヘリオス テクノ ホールディング	11,600	300.00	3,480,000
エノモト	3,600	1,427.00	5,137,200
日本セラミック	11,200	2,984.00	33,420,800
遠藤照明	6,400	540.00	3,456,000
古河電池	8,000	1,403.00	11,224,000
双信電機	6,400	454.00	2,905,600
山一電機	8,200	1,622.00	13,300,400
図研	7,200	2,868.00	20,649,600
日本電子	21,500	4,475.00	96,212,500
カシオ計算機	95,800	1,947.00	186,522,600
ファナック	101,800	26,035.00	2,650,363,000
日本シイエムケイ	26,600	418.00	11,118,800
エンプラス	5,700	3,215.00	18,325,500
大真空	4,200	2,531.00	10,630,200
ローム	45,100	9,800.00	441,980,000
浜松ホトニクス	77,700	5,940.00	461,538,000
三井ハイテック	12,100	2,943.00	35,610,300
新光電気工業	36,600	2,328.00	85,204,800
京セラ	152,400	6,187.00	942,898,800
太陽誘電	48,200	4,555.00	219,551,000
村田製作所	318,000	8,799.00	2,798,082,000
双葉電子工業	17,700	860.00	15,222,000
北陸電気工業	4,900	924.00	4,527,600
ニチコン	37,200	1,213.00	45,123,600
日本ケミコン	8,700	1,825.00	15,877,500
K O A	16,700	1,513.00	25,267,100
市光工業	17,100	628.00	10,738,800
小糸製作所	64,900	6,870.00	445,863,000
ミツバ	19,900	486.00	9,671,400
S C R E E Nホールディングス	18,800	7,160.00	134,608,000
キャノン電子	10,300	1,527.00	15,728,100
キャノン	537,900	2,063.00	1,109,687,700
リコー	275,500	749.00	206,349,500
象印マホービン	29,500	1,853.00	54,663,500
M U T O Hホールディングス	1,700	1,468.00	2,495,600
東京エレクトロン	68,700	36,420.00	2,502,054,000
トヨタ紡織	31,600	1,659.00	52,424,400
芦森工業	2,300	976.00	2,244,800
ユニプレス	21,000	962.00	20,202,000
豊田自動織機	87,600	7,820.00	685,032,000
モリタホールディングス	19,000	1,660.00	31,540,000

三櫻工業	13,800	822.00	11,343,600
デンソー	238,300	5,720.00	1,363,076,000
東海理化電機製作所	28,500	1,662.00	47,367,000
三井E & Sホールディングス	39,100	352.00	13,763,200
川崎重工業	84,200	1,760.00	148,192,000
名村造船所	34,800	199.00	6,925,200
日本車輛製造	3,900	2,484.00	9,687,600
三菱ロジスネクスト	14,300	1,272.00	18,189,600
近畿車輛	1,600	1,304.00	2,086,400
日産自動車	1,276,600	561.30	716,555,580
いすゞ自動車	313,600	1,020.00	319,872,000
トヨタ自動車	1,207,700	7,480.00	9,033,596,000
日野自動車	135,200	1,002.00	135,470,400
三菱自動車工業	400,700	198.00	79,338,600
エフテック	7,700	606.00	4,666,200
レシップホールディングス	4,200	549.00	2,305,800
G M B	2,000	662.00	1,324,000
ファルテック	2,000	588.00	1,176,000
武蔵精密工業	24,100	1,577.00	38,005,700
日産車体	21,100	894.00	18,863,400
新明和工業	29,200	872.00	25,462,400
極東開発工業	20,100	1,492.00	29,989,200
トピー工業	9,000	1,258.00	11,322,000
ティラド	4,000	1,319.00	5,276,000
曙ブレーキ工業	59,400	134.00	7,959,600
タチエス	17,800	1,209.00	21,520,200
N O K	58,200	1,156.00	67,279,200
フタバ産業	30,200	540.00	16,308,000
K Y B	12,100	2,532.00	30,637,200
大同メタル工業	20,900	468.00	9,781,200
プレス工業	53,800	339.00	18,238,200
ミクニ	13,900	284.00	3,947,600
太平洋工業	22,700	1,060.00	24,062,000
河西工業	14,800	390.00	5,772,000
アイシン精機	89,100	3,075.00	273,982,500
マツダ	318,500	663.00	211,165,500
今仙電機製作所	10,100	826.00	8,342,600
本田技研工業	852,200	3,100.00	2,641,820,000
スズキ	214,500	5,268.00	1,129,986,000
S U B A R U	336,000	2,121.00	712,656,000
安永	5,300	1,377.00	7,298,100
ヤマハ発動機	153,000	2,204.00	337,212,000

T B K	13,000	443.00	5,759,000
エクセディ	14,700	1,302.00	19,139,400
豊田合成	35,000	2,853.00	99,855,000
愛三工業	17,100	477.00	8,156,700
盟和産業	1,700	893.00	1,518,100
日本プラスト	8,600	482.00	4,145,200
ヨロズ	10,200	1,165.00	11,883,000
エフ・シー・シー	17,700	1,993.00	35,276,100
シマノ	40,500	24,350.00	986,175,000
テイ・エス テック	25,200	3,275.00	82,530,000
ジャムコ	5,400	666.00	3,596,400
テルモ	306,300	4,108.00	1,258,280,400
クリエートメディック	3,600	984.00	3,542,400
日機装	35,000	1,035.00	36,225,000
日本エム・ディ・エム	6,200	2,351.00	14,576,200
島津製作所	129,400	3,755.00	485,897,000
J M S	9,200	900.00	8,280,000
長野計器	7,900	879.00	6,944,100
ブイ・テクノロジー	5,100	5,490.00	27,999,000
東京計器	6,900	940.00	6,486,000
愛知時計電機	1,400	4,395.00	6,153,000
インターアクション	5,800	2,020.00	11,716,000
オーバル	9,800	353.00	3,459,400
東京精密	19,600	4,875.00	95,550,000
マニー	43,100	2,570.00	110,767,000
ニコン	165,300	672.00	111,081,600
トプコン	54,500	1,322.00	72,049,000
オリンパス	598,900	2,220.50	1,329,857,450
理研計器	9,600	2,897.00	27,811,200
タムロン	8,700	1,712.00	14,894,400
H O Y A	214,700	12,975.00	2,785,732,500
シード	4,700	624.00	2,932,800
ノーリツ鋼機	7,300	2,463.00	17,979,900
エー・アンド・デイ	9,900	1,029.00	10,187,100
朝日インテック	122,600	3,635.00	445,651,000
シチズン時計	126,900	293.00	37,181,700
リズム	3,400	611.00	2,077,400
大研医器	7,600	526.00	3,997,600
メニコン	15,300	6,280.00	96,084,000
シンシア	1,300	398.00	517,400
松風	4,900	1,787.00	8,756,300
セイコーホールディングス	15,300	1,389.00	21,251,700

ニプロ	74,900	1,190.00	89,131,000
中本パックス	2,700	1,540.00	4,158,000
スノーピーク	6,400	1,748.00	11,187,200
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,405.00	50,217,000
トランザクション	5,900	913.00	5,386,700
粧美堂	3,200	391.00	1,251,200
ニホンフラッシュ	10,100	1,290.00	13,029,000
前田工織	11,900	2,537.00	30,190,300
永大産業	14,100	283.00	3,990,300
アートネイチャー	11,600	664.00	7,702,400
バンダイナムコホールディングス	111,900	9,372.00	1,048,726,800
アイフィスジャパン	2,800	803.00	2,248,400
共立印刷	18,100	122.00	2,208,200
S H O E I	9,500	3,645.00	34,627,500
フランスベッドホールディングス	15,300	863.00	13,203,900
パイロットコーポレーション	19,100	2,986.00	57,032,600
萩原工業	6,000	1,497.00	8,982,000
トッパン・フォームズ	23,200	1,052.00	24,406,400
フジシールインターナショナル	24,300	2,031.00	49,353,300
タカラトミー	48,500	947.00	45,929,500
廣済堂	7,500	680.00	5,100,000
エステールホールディングス	2,900	624.00	1,809,600
タカノ	4,200	597.00	2,507,400
プロネクサス	9,300	1,030.00	9,579,000
ホクシン	6,700	109.00	730,300
ウッドワン	3,600	1,122.00	4,039,200
大建工業	7,300	1,917.00	13,994,100
凸版印刷	152,800	1,525.00	233,020,000
大日本印刷	141,700	1,884.00	266,962,800
共同印刷	3,300	3,070.00	10,131,000
N I S S H A	22,200	1,468.00	32,589,600
光村印刷	900	1,795.00	1,615,500
T A K A R A & C O M P A N Y	5,200	1,923.00	9,999,600
アシックス	95,700	2,180.00	208,626,000
ツツミ	3,400	2,132.00	7,248,800
小松ウオール工業	3,300	1,758.00	5,801,400
ヤマハ	64,400	6,490.00	417,956,000
河合楽器製作所	3,300	2,926.00	9,655,800
クリナップ	10,100	481.00	4,858,100
ピジョン	69,500	4,640.00	322,480,000
オリバー	2,300	2,300.00	5,290,000
兼松サステック	700	1,614.00	1,129,800

キングジム	9,000	920.00	8,280,000	
リンテック	25,700	2,266.00	58,236,200	
イトーキ	21,500	356.00	7,654,000	
任天堂	66,400	59,010.00	3,918,264,000	
三菱鉛筆	17,800	1,440.00	25,632,000	
タカスタンダード	22,400	1,430.00	32,032,000	
コクヨ	51,900	1,461.00	75,825,900	
ナカバヤシ	10,600	620.00	6,572,000	
グロープライド	4,800	4,200.00	20,160,000	
オカムラ	37,800	938.00	35,456,400	
美津濃	9,800	2,034.00	19,933,200	
東京電力ホールディングス	864,100	272.00	235,035,200	
中部電力	331,100	1,231.00	407,584,100	
関西電力	410,100	934.30	383,156,430	
中国電力	156,100	1,277.00	199,339,700	
北陸電力	99,000	679.00	67,221,000	
東北電力	270,400	850.00	229,840,000	
四国電力	97,500	686.00	66,885,000	
九州電力	223,100	878.00	195,881,800	
北海道電力	101,300	378.00	38,291,400	
沖縄電力	21,000	1,392.00	29,232,000	
電源開発	86,100	1,373.00	118,215,300	
エフオン	5,800	1,053.00	6,107,400	
イーレックス	15,700	1,899.00	29,814,300	
レノバ	18,100	2,691.00	48,707,100	
東京瓦斯	208,200	2,255.50	469,595,100	
大阪瓦斯	210,000	2,010.00	422,100,000	
東邦瓦斯	53,200	6,590.00	350,588,000	
北海道瓦斯	5,800	1,539.00	8,926,200	
広島ガス	22,300	368.00	8,206,400	
西部瓦斯	12,200	3,605.00	43,981,000	
静岡ガス	30,700	1,022.00	31,375,400	
メタウォーター	10,500	2,272.00	23,856,000	
SBSホールディングス	8,000	2,541.00	20,328,000	
東武鉄道	112,800	3,080.00	347,424,000	
相鉄ホールディングス	34,600	2,620.00	90,652,000	
東急	273,000	1,277.00	348,621,000	
京浜急行電鉄	139,000	1,811.00	251,729,000	
小田急電鉄	161,000	3,205.00	516,005,000	
京王電鉄	56,200	7,630.00	428,806,000	
京成電鉄	75,300	3,760.00	283,128,000	
富士急行	14,800	4,745.00	70,226,000	

新京成電鉄	2,800	2,235.00	6,258,000
東日本旅客鉄道	190,500	6,908.00	1,315,974,000
西日本旅客鉄道	96,400	5,453.00	525,669,200
東海旅客鉄道	90,000	14,255.00	1,282,950,000
西武ホールディングス	141,300	1,062.00	150,060,600
鴻池運輸	17,200	1,015.00	17,458,000
西日本鉄道	30,000	2,910.00	87,300,000
ハマキョウレックス	8,300	2,922.00	24,252,600
サカイ引越センター	5,700	5,330.00	30,381,000
近鉄グループホールディングス	102,500	4,665.00	478,162,500
阪急阪神ホールディングス	136,700	3,440.00	470,248,000
南海電気鉄道	48,600	2,650.00	128,790,000
京阪ホールディングス	45,600	4,950.00	225,720,000
神戸電鉄	2,400	3,630.00	8,712,000
名古屋鉄道	84,300	2,764.00	233,005,200
山陽電気鉄道	7,300	1,999.00	14,592,700
日本通運	35,500	6,980.00	247,790,000
ヤマトホールディングス	169,800	2,556.00	434,008,800
山九	28,500	3,910.00	111,435,000
丸運	5,800	252.00	1,461,600
丸全昭和運輸	8,300	3,345.00	27,763,500
センコーグループホールディングス	56,500	996.00	56,274,000
トナミホールディングス	2,500	6,170.00	15,425,000
ニッコンホールディングス	36,700	2,109.00	77,400,300
日本石油輸送	1,100	2,602.00	2,862,200
福山通運	13,100	4,360.00	57,116,000
セイノーホールディングス	76,800	1,392.00	106,905,600
エスライン	3,100	905.00	2,805,500
神奈川中央交通	2,500	3,960.00	9,900,000
日立物流	18,800	3,095.00	58,186,000
丸和運輸機関	10,800	4,110.00	44,388,000
C & F ロジホールディングス	10,400	1,933.00	20,103,200
九州旅客鉄道	89,900	2,276.00	204,612,400
S Gホールディングス	215,200	2,809.00	604,496,800
日本郵船	86,100	2,394.00	206,123,400
商船三井	65,200	2,992.00	195,078,400
川崎汽船	31,600	1,986.00	62,757,600
N S ユナイテッド海運	6,300	1,388.00	8,744,400
飯野海運	50,700	420.00	21,294,000
共栄タンカー	2,900	838.00	2,430,200
乾汽船	5,900	939.00	5,540,100
日本航空	230,100	1,964.00	451,916,400

ANAホールディングス	207,800	2,434.50	505,889,100
パスコ	2,000	1,443.00	2,886,000
トランコム	2,900	8,590.00	24,911,000
日新	8,900	1,260.00	11,214,000
三菱倉庫	32,500	2,934.00	95,355,000
三井倉庫ホールディングス	11,700	2,120.00	24,804,000
住友倉庫	36,900	1,344.00	49,593,600
澁澤倉庫	5,600	2,317.00	12,975,200
東陽倉庫	18,500	318.00	5,883,000
日本トランスシティ	22,600	575.00	12,995,000
ケイヒン	2,000	1,365.00	2,730,000
中央倉庫	6,200	1,169.00	7,247,800
川西倉庫	1,900	1,112.00	2,112,800
安田倉庫	8,400	1,016.00	8,534,400
ファイズホールディングス	2,200	1,024.00	2,252,800
東洋埠頭	3,100	1,463.00	4,535,300
宇徳	8,800	475.00	4,180,000
上組	57,200	1,876.00	107,307,200
サンリツ	2,400	697.00	1,672,800
キムラユニティー	2,700	1,046.00	2,824,200
キューソー流通システム	2,600	1,682.00	4,373,200
近鉄エクスプレス	21,800	2,134.00	46,521,200
東海運	5,800	317.00	1,838,600
エーアイティー	7,200	981.00	7,063,200
内外トランスライン	3,600	1,320.00	4,752,000
日本コンセプト	3,300	1,776.00	5,860,800
NEC ネットズエスアイ	30,200	1,705.00	51,491,000
クロスキャット	3,000	1,199.00	3,597,000
システナ	38,000	2,137.00	81,206,000
デジタルアーツ	5,300	8,600.00	45,580,000
日鉄ソリューションズ	16,000	2,929.00	46,864,000
キューブシステム	5,800	1,238.00	7,180,400
エイジア	2,000	2,024.00	4,048,000
コア	4,700	1,394.00	6,551,800
ラクーンホールディングス	5,400	1,743.00	9,412,200
ソリトンシステムズ	5,400	1,885.00	10,179,000
ソフトクリエイトホールディングス	4,700	2,724.00	12,802,800
T I S	106,300	2,071.00	220,147,300
J N S ホールディングス	4,200	571.00	2,398,200
電算システム	4,100	3,245.00	13,304,500
グリー	65,500	582.00	38,121,000
コーエーテクモホールディングス	21,800	6,070.00	132,326,000

三菱総合研究所	4,600	4,215.00	19,389,000
電算	1,300	2,474.00	3,216,200
A G S	6,300	813.00	5,121,900
ファインデックス	9,100	1,254.00	11,411,400
ブレインパッド	2,800	4,565.00	12,782,000
K L a b	19,300	997.00	19,242,100
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	13,100	1,068.00	13,990,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,614.00	4,182,400
ネクソン	268,000	2,949.00	790,332,000
アイスタイル	30,200	421.00	12,714,200
エムアップホールディングス	3,200	2,492.00	7,974,400
エイチーム	7,600	1,099.00	8,352,400
エニグモ	10,200	1,267.00	12,923,400
テクノスジャパン	8,500	693.00	5,890,500
コロプラ	35,100	948.00	33,274,800
ブロードリーフ	53,000	715.00	37,895,000
クロス・マーケティンググループ	5,400	361.00	1,949,400
デジタルハーツホールディングス	5,800	1,242.00	7,203,600
システム情報	8,200	1,108.00	9,085,600
メディアドゥ	3,500	6,810.00	23,835,000
じげん	27,000	336.00	9,072,000
ブイキューブ	5,800	3,125.00	18,125,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	759.00	1,973,400
サイバーリンクス	1,800	6,590.00	11,862,000
フィックスターズ	11,500	960.00	11,040,000
C A R T A H O L D I N G S	4,500	1,235.00	5,557,500
オブティム	5,600	2,787.00	15,607,200
セレス	3,600	2,453.00	8,830,800
S H I F T	4,800	13,220.00	63,456,000
ティーガイア	9,600	1,811.00	17,385,600
セック	1,600	2,976.00	4,761,600
日本アジアグループ	11,200	685.00	7,672,000
テクマトリックス	15,100	2,050.00	30,955,000
プロシップ	3,200	1,444.00	4,620,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,700	2,626.00	67,488,200
G M O ペイメントゲートウェイ	22,500	13,570.00	305,325,000
ザッパラス	5,100	483.00	2,463,300
システムリサーチ	3,000	1,582.00	4,746,000
インターネットイニシアティブ	15,800	4,150.00	65,570,000
さくらインターネット	11,700	677.00	7,920,900
ヴィンクス	3,200	1,216.00	3,891,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,400	9,400.00	22,560,000

S R Aホールディングス	5,700	2,454.00	13,987,800
システムインテグレータ	3,700	637.00	2,356,900
朝日ネット	7,800	858.00	6,692,400
e B A S E	12,900	1,059.00	13,661,100
アバント	10,300	1,163.00	11,978,900
アドソル日進	3,900	3,000.00	11,700,000
フリービット	5,800	942.00	5,463,600
コムチュア	12,000	3,100.00	37,200,000
サイバーコム	2,000	1,744.00	3,488,000
アステリア	6,700	1,042.00	6,981,400
アイル	6,100	1,511.00	9,217,100
マークラインズ	4,500	2,764.00	12,438,000
メディカル・データ・ビジョン	12,200	2,580.00	31,476,000
g u m i	13,900	881.00	12,245,900
ショーケース	2,600	1,006.00	2,615,600
モバイルファクトリー	2,600	1,002.00	2,605,200
テラスカイ	3,900	4,260.00	16,614,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,469.00	6,316,700
P C Iホールディングス	4,200	1,228.00	5,157,600
パイプドHD	1,500	1,602.00	2,403,000
アイビーシー	1,900	1,195.00	2,270,500
ネオジャパン	2,100	2,518.00	5,287,800
P R T I M E S	1,900	3,055.00	5,804,500
ランドコンピュータ	1,800	1,111.00	1,999,800
ダブルスタンダード	1,400	4,160.00	5,824,000
オープンドア	5,400	1,364.00	7,365,600
マイネット	3,500	852.00	2,982,000
アカツキ	3,800	4,380.00	16,644,000
ベネフィットジャパン	900	1,673.00	1,505,700
U b i c o mホールディングス	2,400	3,280.00	7,872,000
L I N E	24,600	5,360.00	131,856,000
カナミックネットワーク	10,000	765.00	7,650,000
ノムラシステムコーポレーション	5,300	358.00	1,897,400
チェンジ	7,500	7,420.00	55,650,000
シンクロ・フード	5,300	306.00	1,621,800
オークネット	5,800	1,450.00	8,410,000
セグエグループ	2,900	1,323.00	3,836,700
エイトレッド	1,800	2,505.00	4,509,000
A O I T Y O H o l d i n g s	11,300	413.00	4,666,900
マクロミル	22,000	686.00	15,092,000
ビーグリー	2,200	1,825.00	4,015,000
オロ	3,400	4,430.00	15,062,000

ユーザーローカル	1,100	3,815.00	4,196,500
テモナ	2,400	1,118.00	2,683,200
ニーズウェル	2,300	683.00	1,570,900
サインポスト	2,500	874.00	2,185,000
ソルクシーズ	4,300	981.00	4,218,300
フェイス	4,000	754.00	3,016,000
プロトコーポレーション	9,700	1,028.00	9,971,600
ハイマックス	2,700	1,126.00	3,040,200
野村総合研究所	150,600	3,370.00	507,522,000
サイバネットシステム	7,800	1,018.00	7,940,400
C Eホールディングス	6,000	555.00	3,330,000
日本システム技術	1,900	1,512.00	2,872,800
インタージホールディングス	13,500	1,015.00	13,702,500
東邦システムサイエンス	3,100	921.00	2,855,100
ソースネクスト	51,100	298.00	15,227,800
インフォコム	11,700	3,290.00	38,493,000
HEROZ	1,600	2,942.00	4,707,200
ラクスル	8,600	4,760.00	40,936,000
F I G	12,400	274.00	3,397,600
システムサポート	2,600	1,556.00	4,045,600
イーソル	5,900	1,288.00	7,599,200
アルテリア・ネットワークス	11,900	1,530.00	18,207,000
E d u L a b	1,000	6,820.00	6,820,000
東海ソフト	900	1,100.00	990,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	1,441.00	2,882,000
東名	700	1,198.00	838,600
ヴィッツ	500	2,498.00	1,249,000
トピラシステムズ	1,200	1,627.00	1,952,400
L i n k - U	900	1,528.00	1,375,200
フォーカスシステムズ	6,800	900.00	6,120,000
クレスコ	6,600	1,283.00	8,467,800
フジ・メディア・ホールディングス	102,500	1,122.00	115,005,000
オービック	36,800	21,740.00	800,032,000
ジャストシステム	17,300	6,850.00	118,505,000
T D Cソフト	9,500	980.00	9,310,000
Zホールディングス	1,459,000	625.50	912,604,500
トレンドマイクロ	56,700	5,710.00	323,757,000
I Dホールディングス	4,200	1,223.00	5,136,600
日本オラクル	21,600	11,280.00	243,648,000
アルファシステムズ	3,400	3,535.00	12,019,000
フューチャー	12,900	1,782.00	22,987,800
C A C H o l d i n g s	7,100	1,468.00	10,422,800

S Bテクノロジー	3,900	3,690.00	14,391,000
トーセ	3,100	846.00	2,622,600
オービックビジネスコンサルタント	10,900	6,730.00	73,357,000
伊藤忠テクノソリューションズ	48,500	3,780.00	183,330,000
アイティフォー	13,100	920.00	12,052,000
東計電算	1,600	4,515.00	7,224,000
エクスネット	1,900	973.00	1,848,700
大塚商会	57,500	5,030.00	289,225,000
サイボウズ	12,500	2,601.00	32,512,500
電通国際情報サービス	6,600	6,680.00	44,088,000
A C C E S S	10,200	762.00	7,772,400
デジタルガレージ	19,200	4,150.00	79,680,000
E Mシステムズ	15,300	846.00	12,943,800
ウェザーニューズ	3,600	5,640.00	20,304,000
C I J	7,500	932.00	6,990,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,415.00	4,439,500
日本エンタープライズ	11,900	214.00	2,546,600
WOWOW	5,200	2,839.00	14,762,800
スカラ	7,300	825.00	6,022,500
インテリジェント ウェイブ	6,500	687.00	4,465,500
I M A G I C A G R O U P	9,600	368.00	3,532,800
ネットワンシステムズ	40,500	3,660.00	148,230,000
システムソフト	25,600	89.00	2,278,400
アルゴグラフィックス	9,100	2,999.00	27,290,900
マーベラス	16,500	846.00	13,959,000
エイベックス	18,500	994.00	18,389,000
日本ユニシス	33,200	3,790.00	125,828,000
兼松エレクトロニクス	5,800	3,990.00	23,142,000
都築電気	3,500	1,591.00	5,568,500
T B S ホールディングス	64,700	1,934.00	125,129,800
日本テレビホールディングス	88,900	1,141.00	101,434,900
朝日放送グループホールディングス	10,900	685.00	7,466,500
テレビ朝日ホールディングス	29,300	1,700.00	49,810,000
スカパーJ S A Tホールディングス	70,400	503.00	35,411,200
テレビ東京ホールディングス	8,800	2,302.00	20,257,600
日本BS放送	3,800	1,078.00	4,096,400
ビジョン	13,400	1,043.00	13,976,200
スマートバリュー	3,000	964.00	2,892,000
ワイヤレスゲート	4,700	622.00	2,923,400
コネクシオ	6,200	1,263.00	7,830,600
クロップス	2,200	772.00	1,698,400
日本電信電話	1,419,900	2,579.50	3,662,632,050

K D D I	774,400	2,950.50	2,284,867,200
ソフトバンク	965,400	1,311.50	1,266,122,100
光通信	11,000	25,660.00	282,260,000
エムティーアイ	10,600	797.00	8,448,200
GMOインターネット	38,100	2,785.00	106,108,500
ファイバーゲート	3,500	2,213.00	7,745,500
アйдママーケティングコミュニケーション	3,800	371.00	1,409,800
K A D O K A W A	28,700	3,545.00	101,741,500
学研ホールディングス	14,400	1,752.00	25,228,800
ゼンリン	21,400	1,266.00	27,092,400
昭文社ホールディングス	5,400	470.00	2,538,000
インプレスホールディングス	8,800	168.00	1,478,400
アイネット	5,600	1,520.00	8,512,000
松竹	7,000	13,870.00	97,090,000
東宝	62,700	4,230.00	265,221,000
東映	4,000	16,130.00	64,520,000
エヌ・ティ・ティ・データ	283,000	1,362.00	385,446,000
ピー・シー・エー	1,900	4,450.00	8,455,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	1,519.00	5,772,200
D T S	23,800	2,203.00	52,431,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,300	6,330.00	286,749,000
シーイーシー	11,500	1,509.00	17,353,500
カブコン	50,100	6,330.00	317,133,000
アイ・エス・ビー	2,500	2,790.00	6,975,000
ジャステック	6,900	1,288.00	8,887,200
S C S K	24,500	5,930.00	145,285,000
日本システムウエア	3,600	2,140.00	7,704,000
アイネス	10,600	1,418.00	15,030,800
T K C	9,000	6,790.00	61,110,000
富士ソフト	11,400	4,835.00	55,119,000
N S D	34,300	1,953.00	66,987,900
コナミホールディングス	38,600	5,980.00	230,828,000
福井コンピュータホールディングス	4,200	3,355.00	14,091,000
J B C Cホールディングス	7,300	1,490.00	10,877,000
ミロク情報サービス	9,500	1,994.00	18,943,000
ソフトバンクグループ	842,800	8,306.00	7,000,296,800
ハウスイ	900	1,015.00	913,500
高千穂交易	4,100	1,138.00	4,665,800
カワニシホールディングス	1,300	1,407.00	1,829,100
伊藤忠食品	2,600	5,360.00	13,936,000
エレマテック	10,000	1,003.00	10,030,000
J A L U X	3,000	1,348.00	4,044,000

あらた	8,500	5,090.00	43,265,000
トーメンデバイス	1,600	3,320.00	5,312,000
東京エレクトロン デバイス	3,900	3,125.00	12,187,500
フィールズ	8,200	393.00	3,222,600
双日	588,800	234.00	137,779,200
アルフレッサ ホールディングス	118,500	2,043.00	242,095,500
横浜冷凍	27,900	866.00	24,161,400
ラサ商事	5,700	902.00	5,141,400
アルコニックス	11,300	1,468.00	16,588,400
神戸物産	73,600	3,440.00	253,184,000
ハイパー	1,600	589.00	942,400
あい ホールディングス	15,200	2,191.00	33,303,200
ディーブイエックス	3,800	1,011.00	3,841,800
ダイワボウホールディングス	9,100	7,040.00	64,064,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,400	2,035.00	51,689,000
ラクト・ジャパン	4,600	2,959.00	13,611,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,100	841.00	16,904,100
八洲電機	8,300	975.00	8,092,500
メディアスホールディングス	6,100	810.00	4,941,000
レスターホールディングス	11,100	2,210.00	24,531,000
ジューテックホールディングス	2,400	993.00	2,383,200
大光	4,600	662.00	3,045,200
OCHIホールディングス	3,100	1,311.00	4,064,100
TOKAIホールディングス	56,300	1,007.00	56,694,100
黒谷	2,900	741.00	2,148,900
Cominix	1,900	751.00	1,426,900
三洋貿易	10,700	981.00	10,496,700
ビューティガレージ	1,700	2,828.00	4,807,600
ウイン・パートナーズ	7,700	1,151.00	8,862,700
ミタチ産業	3,200	636.00	2,035,200
シップヘルスケアホールディングス	17,100	5,370.00	91,827,000
明治電機工業	3,400	1,414.00	4,807,600
デリカフーズホールディングス	3,800	643.00	2,443,400
スターティアホールディングス	2,400	702.00	1,684,800
コメダホールディングス	23,200	1,858.00	43,105,600
ピーバンドットコム	1,100	902.00	992,200
アセンテック	2,300	1,779.00	4,091,700
富士興産	3,300	894.00	2,950,200
協栄産業	1,200	1,301.00	1,561,200
小野建	9,600	1,215.00	11,664,000
南陽	2,300	1,587.00	3,650,100
佐島電機	7,300	795.00	5,803,500

エコトレーディング	2,500	657.00	1,642,500
伯東	6,500	1,069.00	6,948,500
コンドーテック	8,300	1,032.00	8,565,600
中山福	6,200	537.00	3,329,400
ナガイレーベン	14,100	2,701.00	38,084,100
三菱食品	11,700	2,772.00	32,432,400
松田産業	7,800	1,828.00	14,258,400
第一興商	15,900	3,675.00	58,432,500
メディカルホールディングス	115,100	2,037.00	234,458,700
S P K	4,600	1,292.00	5,943,200
萩原電気ホールディングス	3,900	2,500.00	9,750,000
アズワン	7,000	14,200.00	99,400,000
スズデン	3,700	1,223.00	4,525,100
尾家産業	3,100	1,447.00	4,485,700
シモジマ	6,500	1,376.00	8,944,000
ドウシシャ	10,100	1,938.00	19,573,800
小津産業	2,400	1,868.00	4,483,200
高速	6,400	1,582.00	10,124,800
たけびし	3,700	1,566.00	5,794,200
リックス	2,400	1,630.00	3,912,000
丸文	9,500	536.00	5,092,000
ハピネット	8,900	1,502.00	13,367,800
橋本総業ホールディングス	2,200	2,642.00	5,812,400
日本ライフライン	31,600	1,614.00	51,002,400
タカショー	6,900	802.00	5,533,800
マルカ	3,500	1,931.00	6,758,500
I D O M	28,800	575.00	16,560,000
進和	6,300	2,194.00	13,822,200
エスケイジャパン	2,300	433.00	995,900
ダイトロン	4,500	1,535.00	6,907,500
シークス	13,600	1,592.00	21,651,200
田中商事	3,300	691.00	2,280,300
オーハシテクニカ	5,500	1,363.00	7,496,500
白銅	3,800	1,419.00	5,392,200
ダイコー通産	700	1,336.00	935,200
伊藤忠商事	745,700	2,931.50	2,186,019,550
丸紅	1,109,700	662.40	735,065,280
高島	1,700	1,599.00	2,718,300
長瀬産業	60,000	1,488.00	89,280,000
蝶理	6,800	1,583.00	10,764,400
豊田通商	119,000	3,750.00	446,250,000
三共生興	16,200	452.00	7,322,400

兼松	39,800	1,234.00	49,113,200
ツカモトコーポレーション	1,900	1,444.00	2,743,600
三井物産	923,000	1,900.50	1,754,161,500
日本紙パルプ商事	6,100	3,595.00	21,929,500
カメイ	13,900	1,197.00	16,638,300
東都水産	1,400	4,550.00	6,370,000
OUGホールディングス	1,700	2,845.00	4,836,500
スターゼン	3,900	4,145.00	16,165,500
山善	41,700	1,054.00	43,951,800
椿本興業	2,000	3,840.00	7,680,000
住友商事	672,600	1,333.00	896,575,800
内田洋行	4,200	4,335.00	18,207,000
三菱商事	699,000	2,527.50	1,766,722,500
第一実業	5,200	4,055.00	21,086,000
キャノンマーケティングジャパン	26,400	2,269.00	59,901,600
西華産業	6,000	1,308.00	7,848,000
佐藤商事	8,800	1,007.00	8,861,600
菱洋エレクトロ	10,800	2,762.00	29,829,600
東京産業	9,700	586.00	5,684,200
ユアサ商事	10,100	3,500.00	35,350,000
神鋼商事	2,700	1,916.00	5,173,200
トルク	6,400	258.00	1,651,200
阪和興業	19,900	2,727.00	54,267,300
正栄食品工業	6,900	3,750.00	25,875,000
カナデン	8,700	1,353.00	11,771,100
菱電商事	7,700	1,525.00	11,742,500
フルサト工業	5,900	1,299.00	7,664,100
岩谷産業	27,600	5,880.00	162,288,000
ナイス	4,500	1,621.00	7,294,500
昭光通商	3,400	599.00	2,036,600
ニチモウ	1,700	1,960.00	3,332,000
極東貿易	3,100	1,310.00	4,061,000
イワキ	14,000	519.00	7,266,000
三愛石油	26,300	1,223.00	32,164,900
稲畑産業	23,500	1,441.00	33,863,500
G S Iクレオス	2,600	1,708.00	4,440,800
明和産業	9,900	435.00	4,306,500
クワザワホールディングス	3,800	570.00	2,166,000
ヤマエ久野	7,800	1,211.00	9,445,800
ワキタ	22,700	1,147.00	26,036,900
東邦ホールディングス	34,200	1,867.00	63,851,400
サンゲツ	28,800	1,487.00	42,825,600

ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,315.00	20,645,500
シナネンホールディングス	4,400	2,928.00	12,883,200
伊藤忠エネクス	23,600	1,015.00	23,954,000
サンリオ	29,900	1,540.00	46,046,000
サンワテクノス	7,600	955.00	7,258,000
リョーサン	11,800	1,896.00	22,372,800
新光商事	16,000	739.00	11,824,000
トーホー	4,800	1,990.00	9,552,000
三信電気	5,700	2,170.00	12,369,000
東陽テクニカ	11,400	1,123.00	12,802,200
モスフードサービス	14,000	2,805.00	39,270,000
加賀電子	10,600	2,201.00	23,330,600
ソーダニッカ	11,000	539.00	5,929,000
立花エレテック	7,900	1,656.00	13,082,400
フォーバル	4,700	878.00	4,126,600
PAL TAC	17,100	5,660.00	96,786,000
三谷産業	14,100	411.00	5,795,100
西本Wismettacホールディングス	2,400	2,244.00	5,385,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,387.00	1,387,000
コア商事ホールディングス	2,000	1,492.00	2,984,000
国際紙パルプ商事	25,300	250.00	6,325,000
ヤマタネ	5,400	1,361.00	7,349,400
丸紅建材リース	1,000	1,701.00	1,701,000
日鉄物産	7,600	3,775.00	28,690,000
泉州電業	3,000	3,040.00	9,120,000
トラスコ中山	24,400	2,805.00	68,442,000
オートバックスセブン	39,600	1,383.00	54,766,800
モリト	7,800	604.00	4,711,200
加藤産業	15,400	3,430.00	52,822,000
北恵	2,700	867.00	2,340,900
イノテック	5,500	972.00	5,346,000
イエローハット	20,100	1,564.00	31,436,400
J Kホールディングス	9,700	867.00	8,409,900
日伝	9,700	2,281.00	22,125,700
北沢産業	8,100	268.00	2,170,800
杉本商事	5,800	2,482.00	14,395,600
因幡電機産業	30,300	2,451.00	74,265,300
東テク	3,500	2,760.00	9,660,000
ミスミグループ本社	133,600	3,425.00	457,580,000
アルテック	7,900	293.00	2,314,700
タキヒヨー	3,200	1,974.00	6,316,800
蔵王産業	2,100	1,321.00	2,774,100

スズケン	45,200	3,930.00	177,636,000
ジェコス	7,400	951.00	7,037,400
グローセル	10,700	429.00	4,590,300
ローソン	27,000	4,805.00	129,735,000
サンエー	8,900	4,175.00	37,157,500
カワチ薬品	8,300	2,914.00	24,186,200
エービーシー・マート	16,700	5,510.00	92,017,000
ハードオフコーポレーション	4,500	708.00	3,186,000
アスクル	11,200	4,220.00	47,264,000
ゲオホールディングス	19,300	1,232.00	23,777,600
アダストリア	14,900	1,874.00	27,922,600
くら寿司	6,300	6,630.00	41,769,000
キャンドウ	5,200	1,884.00	9,796,800
パルグループホールディングス	11,000	1,210.00	13,310,000
エディオン	49,100	1,005.00	49,345,500
サーラコーポレーション	22,000	561.00	12,342,000
ワッツ	4,900	818.00	4,008,200
ハローズ	4,100	3,515.00	14,411,500
フジオフードグループ本社	9,000	1,380.00	12,420,000
あみやき亭	2,400	2,881.00	6,914,400
ひらまつ	19,600	174.00	3,410,400
大黒天物産	2,600	5,830.00	15,158,000
ハニーズホールディングス	9,600	929.00	8,918,400
ファーマライズホールディングス	2,800	771.00	2,158,800
アルペン	8,200	2,363.00	19,376,600
ハブ	3,300	565.00	1,864,500
クオールホールディングス	15,900	1,104.00	17,553,600
ジーンズホールディングス	5,700	6,740.00	38,418,000
ビックカメラ	63,400	1,090.00	69,106,000
DCMホールディングス	65,400	1,153.00	75,406,200
Monotaro	75,800	5,300.00	401,740,000
東京一番フーズ	3,000	614.00	1,842,000
きちりホールディングス	3,100	670.00	2,077,000
アーランドサービスホールディングス	9,000	2,112.00	19,008,000
J.フロント リテイリング	127,500	892.00	113,730,000
ドトール・日レスホールディングス	15,500	1,520.00	23,560,000
マツモトキヨシホールディングス	44,100	4,665.00	205,726,500
ブロンコビリー	5,600	2,417.00	13,535,200
ZOZO	73,400	2,659.00	195,170,600
トレジャー・ファクトリー	3,400	679.00	2,308,600
物語コーポレーション	2,900	12,610.00	36,569,000
ココカラファイン	11,200	7,800.00	87,360,000

三越伊勢丹ホールディングス	186,800	609.00	113,761,200	
H a m e e	3,900	1,602.00	6,247,800	
ウエルシアホールディングス	63,400	4,015.00	254,551,000	
クリエイトSDホールディングス	18,000	3,805.00	68,490,000	
丸善CHIホールディングス	12,400	366.00	4,538,400	
ティーライフ	1,700	1,141.00	1,939,700	
チムニー	3,400	1,255.00	4,267,000	
シュッピン	7,500	851.00	6,382,500	
オイシックス・ラ・大地	10,600	2,870.00	30,422,000	
ネクステージ	18,300	1,355.00	24,796,500	
ジョイフル本田	31,300	1,427.00	44,665,100	
鳥貴族	3,300	1,518.00	5,009,400	
ホットランド	8,100	1,290.00	10,449,000	
すかいらーくホールディングス	119,600	1,637.00	195,785,200	
SFPホールディングス	6,200	1,308.00	8,109,600	
綿半ホールディングス	8,100	1,340.00	10,854,000	
ヨシックス	1,800	1,866.00	3,358,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,100	1,109.00	34,489,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	896.00	5,107,200	
B E E N O S	5,000	2,534.00	12,670,000	
あさひ	8,000	1,661.00	13,288,000	
日本調剤	6,600	1,512.00	9,979,200	
コスモス薬品	9,400	17,020.00	159,988,000	
トーエル	5,400	782.00	4,222,800	
オンリー	2,200	455.00	1,001,000	
セブン&アイ・ホールディングス	417,100	3,603.00	1,502,811,300	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	57,300	606.00	34,723,800	
ツルハホールディングス	23,300	16,340.00	380,722,000	
サンマルクホールディングス	8,500	1,393.00	11,840,500	
フェリシモ	2,500	1,322.00	3,305,000	
トリドールホールディングス	26,500	1,394.00	36,941,000	
T O K Y O B A S E	9,900	509.00	5,039,100	
ウイルプラスホールディングス	1,600	689.00	1,102,400	
J Mホールディングス	8,100	2,407.00	19,496,700	
サツドラホールディングス	1,700	2,030.00	3,451,000	
アレンザホールディングス	5,500	1,285.00	7,067,500	
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,565.00	4,538,500	
パロックジャパンリミテッド	7,700	665.00	5,120,500	
クスリのアオキホールディングス	9,600	8,840.00	84,864,000	
力の源ホールディングス	4,800	597.00	2,865,600	
スシローグローバルホールディングス	58,600	3,410.00	199,826,000	

メディカルシステムネットワーク	10,600	615.00	6,519,000
はるやまホールディングス	5,200	683.00	3,551,600
ノジマ	19,000	2,650.00	50,350,000
カップ・クリエイト	14,900	1,460.00	21,754,000
ライトオン	8,000	608.00	4,864,000
良品計画	141,600	1,991.00	281,925,600
三城ホールディングス	11,900	297.00	3,534,300
アドヴァン	16,400	1,307.00	21,434,800
アルビス	4,100	2,478.00	10,159,800
コナカ	13,300	273.00	3,630,900
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,630.00	2,282,000
G - 7ホールディングス	6,300	2,303.00	14,508,900
イオン北海道	14,200	949.00	13,475,800
コジマ	18,600	709.00	13,187,400
ヒマラヤ	3,900	947.00	3,693,300
コーナン商事	15,200	3,120.00	47,424,000
エコス	4,000	2,078.00	8,312,000
ワタミ	12,800	891.00	11,404,800
マルシェ	3,200	495.00	1,584,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	234,400	2,484.00	582,249,600
西松屋チェーン	23,500	1,461.00	34,333,500
ゼンショーホールディングス	51,100	2,652.00	135,517,200
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,747.00	11,879,600
ハークスレイ	2,400	892.00	2,140,800
サイゼリヤ	15,900	1,912.00	30,400,800
V Tホールディングス	44,600	388.00	17,304,800
魚力	3,100	1,797.00	5,570,700
フジ・コーポレーション	2,900	2,171.00	6,295,900
ユナイテッドアローズ	11,300	1,580.00	17,854,000
ハイデイ日高	15,500	1,747.00	27,078,500
京都きもの友禅	7,600	224.00	1,702,400
コロワイド	35,400	1,625.00	57,525,000
ピーシーデポコーポレーション	14,400	591.00	8,510,400
壱番屋	7,500	5,090.00	38,175,000
P L A N T	2,900	740.00	2,146,000
スギホールディングス	21,300	6,980.00	148,674,000
薬王堂ホールディングス	4,700	2,457.00	11,547,900
スクロール	16,600	740.00	12,284,000
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,914.00	20,862,600
木曽路	14,000	2,429.00	34,006,000
S R Sホールディングス	12,800	853.00	10,918,400
タカキュー	8,200	135.00	1,107,000

リテールパートナーズ	14,200	1,399.00	19,865,800
ケーヨー	22,100	738.00	16,309,800
上新電機	12,600	2,778.00	35,002,800
日本瓦斯	16,900	5,470.00	92,443,000
ロイヤルホールディングス	18,600	1,944.00	36,158,400
いなげや	13,300	1,990.00	26,467,000
島忠	20,100	5,480.00	110,148,000
チヨダ	11,400	918.00	10,465,200
ライフコーポレーション	8,100	3,550.00	28,755,000
リンガーハット	13,100	2,306.00	30,208,600
MrMaxHD	14,900	800.00	11,920,000
AOKIホールディングス	21,700	500.00	10,850,000
オークワ	16,800	1,307.00	21,957,600
コメリ	16,500	2,741.00	45,226,500
青山商事	22,400	500.00	11,200,000
しまむら	12,400	10,160.00	125,984,000
はせがわ	6,200	290.00	1,798,000
高島屋	77,800	850.00	66,130,000
松屋	21,700	809.00	17,555,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,700	680.00	34,476,000
近鉄百貨店	4,100	3,355.00	13,755,500
丸井グループ	97,800	1,912.00	186,993,600
アクシアル リテイリング	8,900	4,925.00	43,832,500
イオン	410,300	3,096.00	1,270,288,800
イズミ	21,700	3,760.00	81,592,000
平和堂	21,700	2,137.00	46,372,900
フジ	12,900	1,932.00	24,922,800
ヤオコー	12,100	7,050.00	85,305,000
ゼビオホールディングス	13,100	821.00	10,755,100
ケースホールディングス	103,000	1,268.00	130,604,000
Olympicグループ	5,700	933.00	5,318,100
日産東京販売ホールディングス	16,400	252.00	4,132,800
シルバーライフ	1,500	2,266.00	3,399,000
Genky DrugStores	4,700	4,090.00	19,223,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	713.00	1,853,800
ブックオフグループホールディングス	6,200	840.00	5,208,000
ギフト	1,100	1,711.00	1,882,100
アインホールディングス	13,100	6,190.00	81,089,000
元気寿司	2,800	2,403.00	6,728,400
ヤマダホールディングス	325,200	504.00	163,900,800
アーランドサカモト	16,800	1,768.00	29,702,400
ニトリホールディングス	46,200	21,065.00	973,203,000

グルメ杵屋	7,800	1,000.00	7,800,000	
愛眼	8,500	234.00	1,989,000	
ケーユーホールディングス	5,800	825.00	4,785,000	
吉野家ホールディングス	35,100	1,938.00	68,023,800	
松屋フーズホールディングス	5,200	3,380.00	17,576,000	
サガミホールディングス	14,400	1,253.00	18,043,200	
関西スーパーマーケット	9,000	1,240.00	11,160,000	
王将フードサービス	7,900	6,000.00	47,400,000	
プレナス	12,000	1,729.00	20,748,000	
ミニストップ	8,000	1,378.00	11,024,000	
アークス	21,900	2,225.00	48,727,500	
パローホールディングス	23,700	2,640.00	62,568,000	
ベルク	5,300	6,320.00	33,496,000	
大庄	5,900	1,039.00	6,130,100	
ファーストリテイリング	14,300	85,140.00	1,217,502,000	
サンドラッグ	40,100	4,410.00	176,841,000	
サックスパー ホールディングス	9,400	539.00	5,066,600	
ヤマザワ	2,600	1,738.00	4,518,800	
やまや	2,200	2,140.00	4,708,000	
ベルーナ	23,100	903.00	20,859,300	
島根銀行	2,800	640.00	1,792,000	
じもとホールディングス	7,200	878.00	6,321,600	
めぶきフィナンシャルグループ	554,700	203.00	112,604,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,400	1,130.00	16,272,000	
九州フィナンシャルグループ	233,600	474.00	110,726,400	
ゆうちょ銀行	302,400	844.00	255,225,600	
富山第一銀行	25,400	290.00	7,366,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	609,700	371.00	226,198,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	739.00	52,469,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	62,700	515.00	32,290,500	
三十三フィナンシャルグループ	9,900	1,261.00	12,483,900	
第四北越フィナンシャルグループ	18,500	2,347.00	43,419,500	
ひろぎんホールディングス	157,500	596.00	93,870,000	
新生銀行	78,300	1,210.00	94,743,000	
あおぞら銀行	63,600	1,851.00	117,723,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,302,900	441.80	3,226,421,220	
りそなホールディングス	1,160,700	369.40	428,762,580	
三井住友トラスト・ホールディングス	201,800	3,171.00	639,907,800	
三井住友フィナンシャルグループ	738,300	3,067.00	2,264,366,100	
千葉銀行	356,300	581.00	207,010,300	
群馬銀行	205,100	329.00	67,477,900	
武蔵野銀行	15,900	1,559.00	24,788,100	

千葉興業銀行	29,300	256.00	7,500,800	
筑波銀行	44,400	196.00	8,702,400	
七十七銀行	36,100	1,447.00	52,236,700	
青森銀行	8,300	2,492.00	20,683,600	
秋田銀行	6,800	1,384.00	9,411,200	
山形銀行	12,000	1,049.00	12,588,000	
岩手銀行	7,000	2,115.00	14,805,000	
東邦銀行	95,500	218.00	20,819,000	
東北銀行	5,100	1,034.00	5,273,400	
みちのく銀行	6,900	1,122.00	7,741,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	89,900	1,858.00	167,034,200	
静岡銀行	260,000	753.00	195,780,000	
十六銀行	13,400	1,904.00	25,513,600	
スルガ銀行	109,200	332.00	36,254,400	
八十二銀行	257,600	358.00	92,220,800	
山梨中央銀行	12,400	763.00	9,461,200	
大垣共立銀行	21,100	2,240.00	47,264,000	
福井銀行	9,100	1,829.00	16,643,900	
北國銀行	10,600	2,808.00	29,764,800	
清水銀行	4,400	1,786.00	7,858,400	
富山銀行	2,100	3,475.00	7,297,500	
滋賀銀行	21,400	2,279.00	48,770,600	
南都銀行	17,800	1,850.00	32,930,000	
百五銀行	96,100	308.00	29,598,800	
京都銀行	38,200	5,270.00	201,314,000	
紀陽銀行	37,800	1,526.00	57,682,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	71,100	1,036.00	73,659,600	
山陰合同銀行	63,300	546.00	34,561,800	
中国銀行	91,900	848.00	77,931,200	
鳥取銀行	3,600	1,111.00	3,999,600	
伊予銀行	152,300	661.00	100,670,300	
百十四銀行	11,300	1,542.00	17,424,600	
四国銀行	16,200	699.00	11,323,800	
阿波銀行	17,400	2,513.00	43,726,200	
大分銀行	6,100	2,338.00	14,261,800	
宮崎銀行	7,100	2,279.00	16,180,900	
佐賀銀行	6,500	1,356.00	8,814,000	
沖縄銀行	9,800	2,944.00	28,851,200	
琉球銀行	24,600	833.00	20,491,800	
セブン銀行	356,700	218.00	77,760,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,450,700	1,311.50	1,902,593,050	
高知銀行	3,900	801.00	3,123,900	

山口フィナンシャルグループ	133,300	628.00	83,712,400
長野銀行	3,500	1,388.00	4,858,000
名古屋銀行	8,000	2,686.00	21,488,000
北洋銀行	160,900	233.00	37,489,700
愛知銀行	3,900	3,105.00	12,109,500
中京銀行	4,400	2,015.00	8,866,000
大光銀行	3,700	1,214.00	4,491,800
愛媛銀行	14,900	1,035.00	15,421,500
トマト銀行	4,100	1,084.00	4,444,400
京葉銀行	45,500	439.00	19,974,500
栃木銀行	51,600	182.00	9,391,200
北日本銀行	3,300	1,934.00	6,382,200
東和銀行	18,700	617.00	11,537,900
福島銀行	10,000	205.00	2,050,000
大東銀行	5,500	612.00	3,366,000
トモニホールディングス	82,500	340.00	28,050,000
フィデアホールディングス	103,600	110.00	11,396,000
池田泉州ホールディングス	122,800	149.00	18,297,200
F P G	33,200	512.00	16,998,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,500	1,467.00	8,068,500
マーキュリアインベストメント	4,400	660.00	2,904,000
S B Iホールディングス	122,600	2,853.00	349,777,800
ジャフコ グループ	16,400	4,670.00	76,588,000
大和証券グループ本社	856,900	470.00	402,743,000
野村ホールディングス	1,878,700	548.80	1,031,030,560
岡三証券グループ	91,300	386.00	35,241,800
丸三証券	32,000	474.00	15,168,000
東洋証券	39,200	139.00	5,448,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,000	314.00	38,622,000
光世証券	2,700	657.00	1,773,900
水戸証券	31,400	238.00	7,473,200
いちよし証券	20,300	467.00	9,480,100
松井証券	61,200	812.00	49,694,400
マネックスグループ	78,700	327.00	25,734,900
極東証券	14,500	696.00	10,092,000
岩井コスモホールディングス	10,200	1,279.00	13,045,800
藍澤證券	19,400	725.00	14,065,000
マネーパートナーズグループ	12,000	203.00	2,436,000
スパークス・グループ	49,900	267.00	13,323,300
かんぽ生命保険	37,800	1,872.00	70,761,600
S O M P Oホールディングス	200,700	4,154.00	833,707,800
アニコム ホールディングス	35,500	1,053.00	37,381,500

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	279,100	3,126.00	872,466,600
第一生命ホールディングス	604,100	1,637.50	989,213,750
東京海上ホールディングス	377,500	5,270.00	1,989,425,000
T & Dホールディングス	319,100	1,206.00	384,834,600
アドバンスクリエイト	2,200	1,901.00	4,182,200
全国保証	30,100	4,735.00	142,523,500
イントラスト	3,800	887.00	3,370,600
日本モーゲージサービス	4,500	1,147.00	5,161,500
C a s a	3,800	1,021.00	3,879,800
アルヒ	17,000	1,761.00	29,937,000
プレミアグループ	5,800	2,189.00	12,696,200
クレディセゾン	74,900	1,252.00	93,774,800
芙蓉総合リース	11,200	6,560.00	73,472,000
みずほリース	16,500	3,000.00	49,500,000
東京センチュリー	21,500	7,180.00	154,370,000
日本証券金融	47,200	518.00	24,449,600
アイフル	163,200	262.00	42,758,400
リコーリース	8,400	3,045.00	25,578,000
イオンフィナンシャルサービス	65,400	1,219.00	79,722,600
アコム	214,700	471.00	101,123,700
ジャックス	11,800	1,852.00	21,853,600
オリエントコーポレーション	289,500	112.00	32,424,000
日立キャピタル	25,200	2,351.00	59,245,200
オリックス	662,400	1,569.50	1,039,636,800
三菱UFJリース	271,100	471.00	127,688,100
九州リースサービス	5,400	600.00	3,240,000
日本取引所グループ	306,400	2,566.50	786,375,600
イー・ギャランティ	12,300	2,069.00	25,448,700
アサックス	5,700	703.00	4,007,100
NECキャピタルソリューション	4,400	1,825.00	8,030,000
いちご	140,500	326.00	45,803,000
日本駐車場開発	117,400	144.00	16,905,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,394.00	9,200,400
A Dワークスグループ	20,200	160.00	3,232,000
ヒューリック	227,900	1,105.00	251,829,500
三栄建築設計	5,200	1,567.00	8,148,400
野村不動産ホールディングス	65,500	2,289.00	149,929,500
三重交通グループホールディングス	24,900	480.00	11,952,000
サムティ	16,100	1,710.00	27,531,000
ディア・ライフ	18,800	421.00	7,914,800
日本商業開発	7,700	1,731.00	13,328,700
ハウスコム	3,000	1,289.00	3,867,000

日本管理センター	7,000	1,246.00	8,722,000
サンセイランディック	5,200	746.00	3,879,200
フージャースホールディングス	21,300	730.00	15,549,000
オープンハウス	34,000	3,915.00	133,110,000
東急不動産ホールディングス	293,300	531.00	155,742,300
飯田グループホールディングス	89,800	2,057.00	184,718,600
イーランド	3,700	770.00	2,849,000
ムゲンエステート	9,600	500.00	4,800,000
ハウズドゥ	5,200	1,201.00	6,245,200
シーアールイー	3,900	1,306.00	5,093,400
グッドコムアセット	6,200	1,561.00	9,678,200
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,455.00	8,637,500
テンポイノベーション	4,200	822.00	3,452,400
パーク24	58,300	1,793.00	104,531,900
パラカ	3,700	1,615.00	5,975,500
三井不動産	519,700	2,256.50	1,172,703,050
三菱地所	748,900	1,757.50	1,316,191,750
平和不動産	20,100	3,445.00	69,244,500
東京建物	106,500	1,475.00	157,087,500
ダイビル	28,600	1,317.00	37,666,200
京阪神ビルディング	17,900	1,956.00	35,012,400
住友不動産	240,400	3,478.00	836,111,200
テーオーシー	23,300	682.00	15,890,600
東京楽天地	2,100	4,240.00	8,904,000
スターツコーポレーション	15,100	3,040.00	45,904,000
フジ住宅	15,000	629.00	9,435,000
空港施設	14,000	485.00	6,790,000
明和地所	8,800	528.00	4,646,400
ゴールドクレスト	9,500	1,560.00	14,820,000
エスリード	5,300	1,351.00	7,160,300
日神グループホールディングス	19,800	403.00	7,979,400
日本エスコン	19,300	900.00	17,370,000
タカラレーベン	48,800	313.00	15,274,400
A V A N T I A	7,900	840.00	6,636,000
イオンモール	54,400	1,656.00	90,086,400
毎日コムネット	4,900	692.00	3,390,800
ファースト住建	6,100	1,024.00	6,246,400
カチタス	26,900	3,155.00	84,869,500
トーセイ	16,100	1,226.00	19,738,600
穴吹興産	3,300	1,655.00	5,461,500
サンフロンティア不動産	16,500	895.00	14,767,500
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	1,035.00	11,281,500

インテリックス	3,000	525.00	1,575,000
ランドビジネス	3,600	336.00	1,209,600
サンネクスタグループ	4,900	1,005.00	4,924,500
グランディハウス	12,400	384.00	4,761,600
日本空港ビルデング	34,300	6,700.00	229,810,000
明豊ファシリティワークス	5,000	689.00	3,445,000
日本工営	7,000	2,880.00	20,160,000
L I F U L L	36,600	392.00	14,347,200
ミクシィ	19,800	2,565.00	50,787,000
ジェイエシーリクルートメント	7,000	1,889.00	13,223,000
日本M&Aセンター	79,200	6,630.00	525,096,000
メンバーズ	3,100	1,986.00	6,156,600
中広	2,000	326.00	652,000
UTグループ	16,300	3,290.00	53,627,000
アイティメディア	4,200	2,289.00	9,613,800
タケエイ	11,500	1,260.00	14,490,000
E・Jホールディングス	4,200	1,028.00	4,317,600
ビーネックスグループ	13,100	1,135.00	14,868,500
コシダカホールディングス	25,400	463.00	11,760,200
アルトナー	2,700	880.00	2,376,000
パソナグループ	11,300	1,935.00	21,865,500
C D S	2,700	1,354.00	3,655,800
リンクアンドモチベーション	19,000	595.00	11,305,000
G C A	13,700	740.00	10,138,000
エス・エム・エス	32,200	3,610.00	116,242,000
サニーサイドアップグループ	3,900	653.00	2,546,700
パーソルホールディングス	103,500	2,050.00	212,175,000
リニカル	5,300	711.00	3,768,300
クックパッド	33,100	318.00	10,525,800
アイ・ケイ・ケイ	5,300	628.00	3,328,400
学情	3,800	1,437.00	5,460,600
スタジオアリス	5,300	1,961.00	10,393,300
シミックホールディングス	5,200	1,357.00	7,056,400
エプコ	2,700	1,002.00	2,705,400
N J S	2,600	2,008.00	5,220,800
総合警備保障	41,200	5,410.00	222,892,000
カカクコム	76,500	2,812.00	215,118,000
アイロムグループ	3,700	1,690.00	6,253,000
セントケア・ホールディング	6,900	845.00	5,830,500
サイネックス	2,000	671.00	1,342,000
ルネサンス	6,000	911.00	5,466,000
ディップ	14,200	2,763.00	39,234,600

デジタルホールディングス	7,300	1,991.00	14,534,300
ツクイホールディングス	24,700	555.00	13,708,500
キャリアデザインセンター	2,600	977.00	2,540,200
ベネフィット・ワン	37,700	3,080.00	116,116,000
エムスリー	228,100	8,702.00	1,984,926,200
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	267.00	2,189,400
アウトソーシング	59,400	1,503.00	89,278,200
ウェルネット	10,800	484.00	5,227,200
ワールドホールディングス	3,600	2,094.00	7,538,400
ディー・エヌ・エー	43,900	1,925.00	84,507,500
博報堂D Yホールディングス	144,000	1,465.00	210,960,000
ぐるなび	18,400	513.00	9,439,200
タカミヤ	11,300	534.00	6,034,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,200	891.00	7,306,200
ファンコミュニケーションズ	28,900	432.00	12,484,800
ライク	3,500	2,042.00	7,147,000
ビジネス・ブレークスルー	4,800	427.00	2,049,600
エスプール	26,800	741.00	19,858,800
WDBホールディングス	4,800	2,737.00	13,137,600
手間いらず	700	5,270.00	3,689,000
ティア	6,500	411.00	2,671,500
C D G	1,200	1,501.00	1,801,200
バリューコマース	7,000	3,425.00	23,975,000
インフォマート	104,800	892.00	93,481,600
J Pホールディングス	33,200	283.00	9,395,600
エコナックホールディングス	20,800	91.00	1,892,800
E P Sホールディングス	14,200	1,006.00	14,285,200
レッグス	2,700	1,830.00	4,941,000
プレステージ・インターナショナル	38,900	958.00	37,266,200
アミューズ	5,700	2,529.00	14,415,300
ドリームインキュベータ	3,300	1,455.00	4,801,500
クイック	6,600	1,160.00	7,656,000
T A C	7,100	238.00	1,689,800
ケネディクス	89,200	749.00	66,810,800
電通グループ	116,400	3,315.00	385,866,000
イオンファンタジー	4,100	2,364.00	9,692,400
シーティーエス	11,900	994.00	11,828,600
ネクシィーズグループ	3,400	856.00	2,910,400
H . U . グループホールディングス	29,000	2,838.00	82,302,000
アルプス技研	9,200	2,242.00	20,626,400
ダイオーズ	2,200	958.00	2,107,600
日本空調サービス	11,100	774.00	8,591,400

オリエンタルランド	110,000	18,390.00	2,022,900,000
ダスキン	25,800	2,840.00	73,272,000
明光ネットワークジャパン	13,400	583.00	7,812,200
ファルコホールディングス	5,800	1,635.00	9,483,000
ラウンドワン	29,100	949.00	27,615,900
リゾートトラスト	47,500	1,628.00	77,330,000
ビー・エム・エル	13,400	3,415.00	45,761,000
りらいあコミュニケーションズ	18,100	1,331.00	24,091,100
リソー教育	47,900	312.00	14,944,800
早稲田アカデミー	4,700	982.00	4,615,400
ユー・エス・エス	115,900	2,082.00	241,303,800
東京個別指導学院	4,000	623.00	2,492,000
サイバーエージェント	63,800	6,930.00	442,134,000
楽天	482,300	1,007.00	485,676,100
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,039.00	5,818,400
モーニングスター	11,700	453.00	5,300,100
テー・オー・ダブリュー	17,100	282.00	4,822,200
山田コンサルティンググループ	6,900	975.00	6,727,500
セントラルスポーツ	3,900	2,223.00	8,669,700
フルキャストホールディングス	9,200	1,795.00	16,514,000
エン・ジャパン	18,400	3,450.00	63,480,000
リソルホールディングス	1,200	3,795.00	4,554,000
テクノプロ・ホールディングス	20,700	8,320.00	172,224,000
アトラ	2,400	323.00	775,200
インターワークス	2,600	332.00	863,200
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	15,280.00	64,176,000
Keeper 技研	7,700	2,070.00	15,939,000
ファーストロジック	2,200	774.00	1,702,800
三機サービス	2,200	972.00	2,138,400
Gunosy	6,700	722.00	4,837,400
デザインワン・ジャパン	3,900	215.00	838,500
イー・ガーディアン	4,600	3,030.00	13,938,000
リブセンス	6,500	239.00	1,553,500
ジャパンマテリアル	31,900	1,418.00	45,234,200
ベクトル	13,100	932.00	12,209,200
ウチヤマホールディングス	5,700	302.00	1,721,400
チャーム・ケア・コーポレーション	8,900	1,202.00	10,697,800
キャリアリンク	3,500	1,876.00	6,566,000
I B J	8,700	833.00	7,247,100
アサンテ	4,300	1,448.00	6,226,400
N・フィールド	7,300	784.00	5,723,200
バリューHR	4,200	1,695.00	7,119,000

M & Aキャピタルパートナーズ	8,400	6,320.00	53,088,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,921.00	7,876,100
E R Iホールディングス	3,200	676.00	2,163,200
アビスト	1,700	3,020.00	5,134,000
シグマクシス	7,200	1,765.00	12,708,000
ウィルグループ	7,000	1,007.00	7,049,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,900	313.00	4,976,700
メドピア	4,900	6,390.00	31,311,000
リクルートホールディングス	741,000	4,187.00	3,102,567,000
エラン	7,200	3,065.00	22,068,000
土木管理総合試験所	5,600	355.00	1,988,000
ネットマーケティング	4,300	577.00	2,481,100
日本郵政	848,000	770.00	652,960,000
ベルシステム24ホールディングス	17,400	1,726.00	30,032,400
鎌倉新書	8,000	950.00	7,600,000
S M N	2,500	750.00	1,875,000
L I T A L I C O	3,600	3,460.00	12,456,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	946.00	1,986,600
エアトリ	5,600	1,347.00	7,543,200
アトラエ	3,200	2,717.00	8,694,400
ストライク	3,900	5,950.00	23,205,000
ソラスト	28,700	1,473.00	42,275,100
セラク	3,300	2,197.00	7,250,100
インソース	4,300	3,430.00	14,749,000
ベイカレント・コンサルティング	6,300	15,650.00	98,595,000
Orchestra Holdings	2,200	2,320.00	5,104,000
アイモバイル	3,800	1,177.00	4,472,600
キャリアインデックス	4,500	738.00	3,321,000
M S - J a p a n	3,600	840.00	3,024,000
船場	2,200	904.00	1,988,800
グレイステクノロジー	4,800	6,840.00	32,832,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	11,900	4,660.00	55,454,000
フルテック	1,600	1,468.00	2,348,800
グリーンズ	2,600	489.00	1,271,400
GameWith	3,400	574.00	1,951,600
ソウルドアウト	2,600	1,535.00	3,991,000
M S & C o n s u l t i n g	2,300	612.00	1,407,600
エル・ティー・エス	800	4,415.00	3,532,000
ミダック	1,400	3,195.00	4,473,000
日総工産	7,100	765.00	5,431,500
キュービーネットホールディングス	4,400	1,534.00	6,749,600
R P Aホールディングス	8,200	635.00	5,207,000

スプリックス	3,200	793.00	2,537,600
マネジメントソリューションズ	5,200	1,384.00	7,196,800
プロレド・パートナーズ	1,400	4,250.00	5,950,000
フロンティア・マネジメント	900	4,915.00	4,423,500
ピアラ	600	2,234.00	1,340,400
コプロ・ホールディングス	700	3,100.00	2,170,000
ギークス	1,200	1,125.00	1,350,000
カーブスホールディングス	28,700	788.00	22,615,600
フォーラムエンジニアリング	5,600	857.00	4,799,200
ダイレクトマーケティングミックス	4,100	2,863.00	11,738,300
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	663.00	3,646,500
リログループ	56,600	2,622.00	148,405,200
東祥	6,600	1,640.00	10,824,000
エイチ・アイ・エス	15,900	1,750.00	27,825,000
ラックランド	3,000	2,375.00	7,125,000
共立メンテナンス	17,200	3,920.00	67,424,000
イチネンホールディングス	11,700	1,279.00	14,964,300
建設技術研究所	6,800	2,112.00	14,361,600
スペース	6,900	796.00	5,492,400
長大	4,300	1,400.00	6,020,000
燦ホールディングス	4,700	1,259.00	5,917,300
スバル興業	700	8,460.00	5,922,000
東京テアトル	4,200	1,293.00	5,430,600
タナベ経営	2,100	1,325.00	2,782,500
ナガワ	3,300	8,950.00	29,535,000
よみうりランド	2,300	6,040.00	13,892,000
東京都競馬	6,800	5,060.00	34,408,000
カナモト	18,300	2,282.00	41,760,600
東京ドーム	42,000	1,302.00	54,684,000
西尾レントオール	9,600	2,148.00	20,620,800
トランス・コスモス	9,900	2,737.00	27,096,300
乃村工藝社	44,600	850.00	37,910,000
藤田観光	4,100	1,495.00	6,129,500
KNT-CTホールディングス	6,400	993.00	6,355,200
日本管財	11,200	2,031.00	22,747,200
トーカイ	10,100	2,077.00	20,977,700
セコム	109,800	9,699.00	1,064,950,200
セントラル警備保障	5,000	3,620.00	18,100,000
丹青社	19,800	851.00	16,849,800
メイテック	12,700	5,110.00	64,897,000
応用地質	12,200	1,241.00	15,140,200
船井総研ホールディングス	21,400	2,576.00	55,126,400

進学会ホールディングス	4,500	434.00	1,953,000	
オオバ	7,600	749.00	5,692,400	
いであ	2,600	1,811.00	4,708,600	
学究社	3,200	1,271.00	4,067,200	
ベネッセホールディングス	34,500	2,099.00	72,415,500	
イオンディライト	12,800	2,593.00	33,190,400	
ナック	5,900	928.00	5,475,200	
ダイセキ	17,400	3,110.00	54,114,000	
ステップ	3,900	1,599.00	6,236,100	
合 計	113,245,000		266,366,408,260	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドA】

【純資産額計算書】

(2020年12月30日現在)

資産総額	1,886,940,525円
負債総額	7,108,733円
純資産総額（ - ）	1,879,831,792円
発行済口数	679,149,319口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7679円
（1万口当たり純資産額）	（27,679円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2020年12月30日現在)

資産総額	273,583,374,447円
負債総額	209,574,510円
純資産総額（ - ）	273,373,799,937円
発行済口数	136,781,317,249口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9986円
（1万口当たり純資産額）	（19,986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12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[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2021年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年12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	524	13,396,945
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	302,014
単位型公社債投資信託	41	287,976
合計	644	13,986,935

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（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。

また、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：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		
₁ 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

（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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				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	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	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	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	
(1) 賞与引当金	従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
(2) 退職給付引当金	従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
7. ヘッジ会計の会計処理	
(1) ヘッジ会計の方法	繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象	

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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

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

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(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	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(*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)投資有価証券

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

(6)未払金

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

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

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

(デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(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	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

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

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注)1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社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

2021年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
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Aの2019年12月11日から2020年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2020年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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、「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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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、継続企業的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。

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。

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、継続企業的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。継続企業的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、企業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、監査等委員会に対して、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

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

以 上

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

2. 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。