【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6月30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】	ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。

②三井住友トラスト・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。

③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 7月 1日から2021年12月28日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞
当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買または金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事

情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（株式一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　）	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 （　　）

（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、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（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
①一般…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。
②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②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、為替のヘッジを行な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。

マザーファンドの投資プロセス

投資ユニバース
東証市場第一部に上場されている株式(上場予定銘柄を含む)

ベンチマーク分析
ベンチマークを構成する個別銘柄ウェイト(資本異動等調整後)の推計
信用リスクが高い銘柄をユニバースから除外

ポートフォリオ分析
ポートフォリオとベンチマークの乖離状況等を把握

リバランス案の作成
取引コスト等を勘案しつつ個別銘柄ウェイトのベンチマークからの乖離を極小化すべく、リバランス案を作成

ポートフォリオ構築
キャッシュマネジメント
リバランス案に基づき売買を行い、ポートフォリオを構築
株価指数先物を用いて、先物を含む株式エクスポージャー比率を調整

※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。

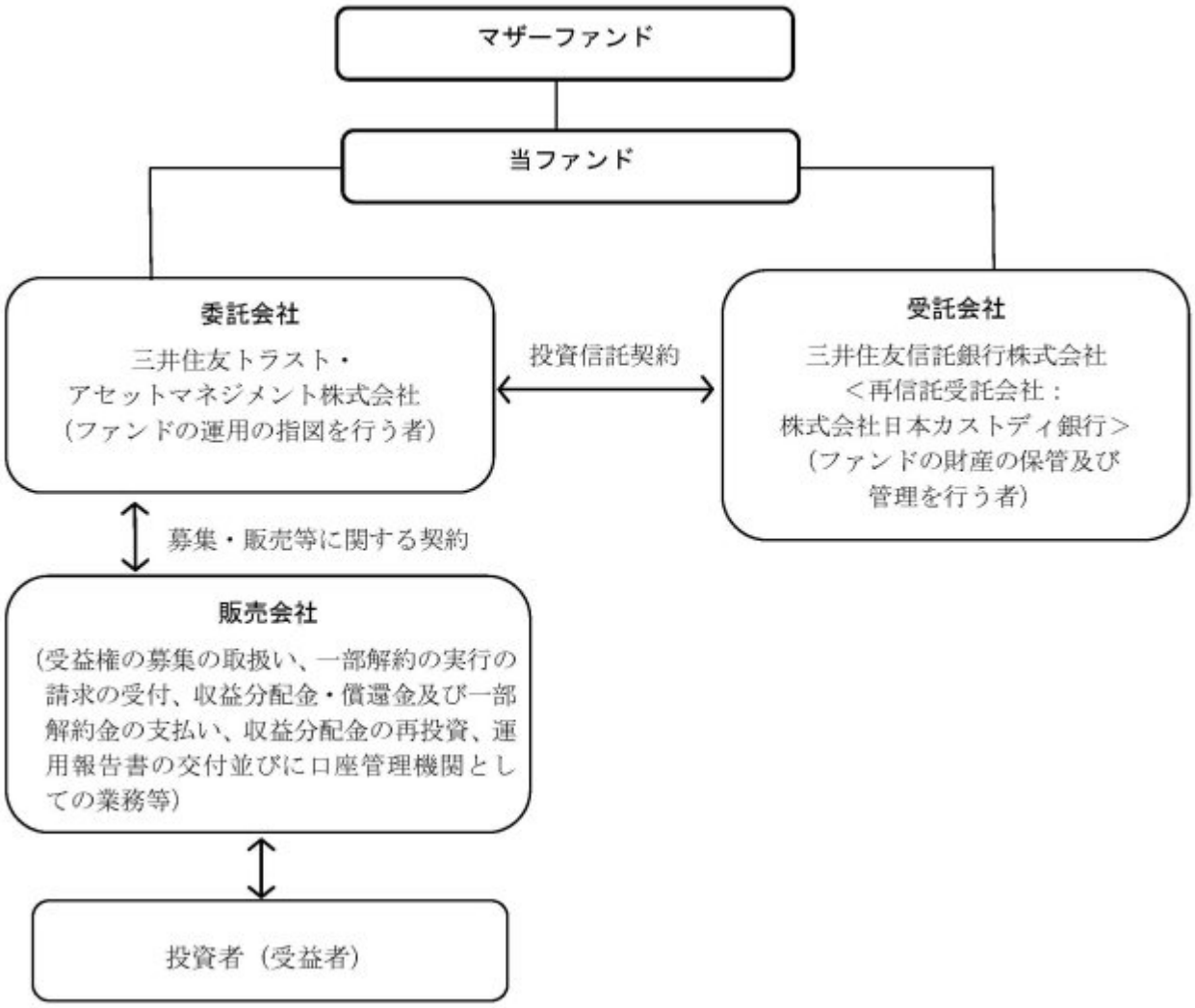
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2021年 4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】

①　運用方針

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

②　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、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。

B．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

E．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

F．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

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

（2）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記（５）＜約款に定める投資制限＞Ｊ．、Ｋ．及びＬ．に定めるものに限ります。）

３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

②　運用指図できる投資対象である有価証券

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

通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

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

③　運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記②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②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記Ａ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買または金融商品取引法第28条第８項第３号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

① 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。
② 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
③ 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。
④ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。
⑤ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
⑥ 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。
⑦ 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

① 株式への投資割合には制限を設けません。
② 外貨建資産への投資は、行いません。
③ 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。
④ 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。
⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在

し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑥　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。

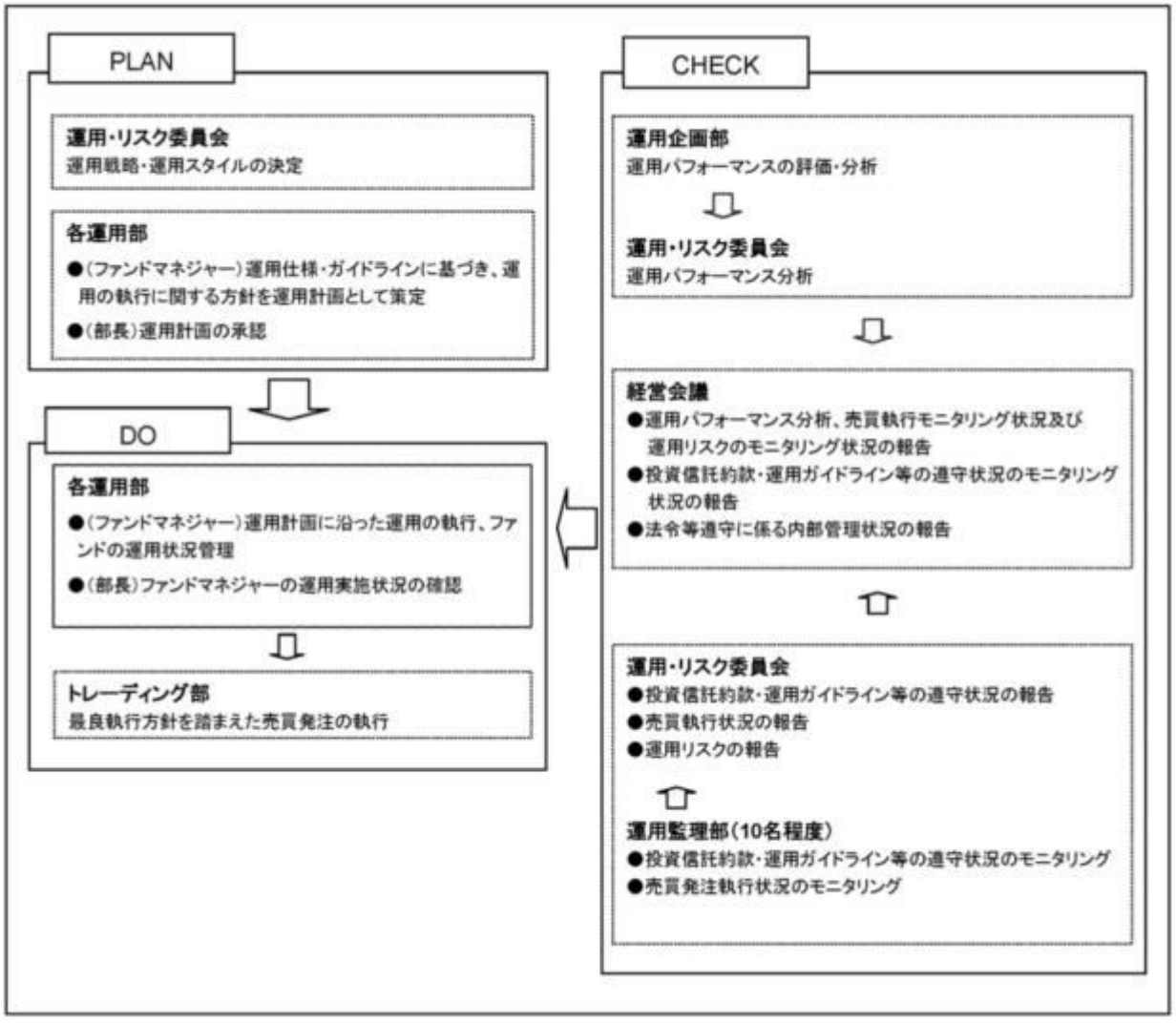
⑦　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑧　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。

⑨　デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年１回の毎決算時（決算日は３月31日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

Ａ．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

Ｂ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

Ｃ．新株引受権証券等への投資割合

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

Ｄ．投資信託証券への投資割合

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

Ｅ．同一銘柄の株式への投資割合

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

Ｆ．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

Ｇ．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

Ｈ．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場に

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

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

Ⅰ．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

Ｋ．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｌ．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

O．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

Q．再投資の指図

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

R．資金の借入れ

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｓ．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の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。

①　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。

②　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。

③　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＞

①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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。

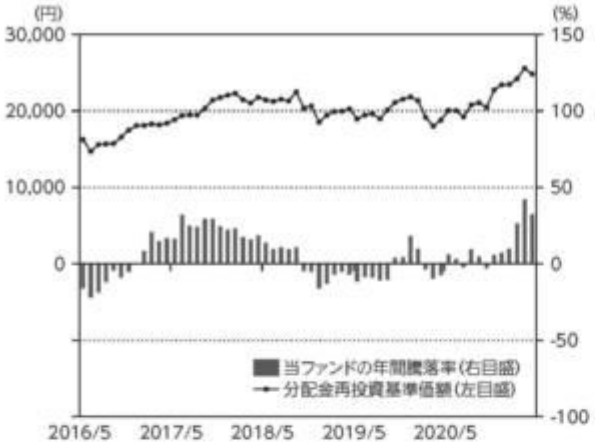
（２）リスクの管理体制

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〕

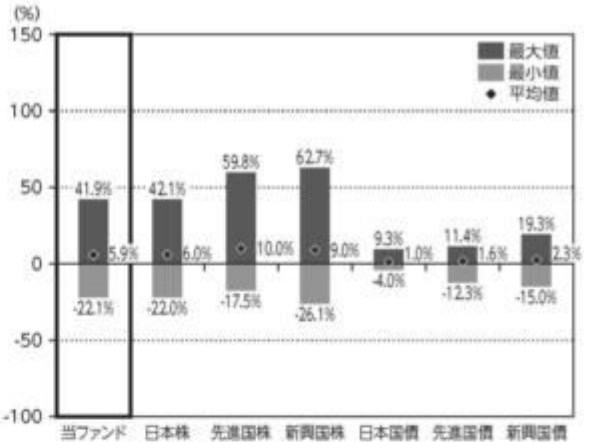
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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5月～2021年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜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

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.209%（税抜　0.19%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.1045%　（税抜　0.095%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.0715%　（税抜　0.065%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.033%　（税抜　0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

②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。

③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】

①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を含みます。）。

②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。

③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を含みます。）。

④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。

⑤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、2021年 4月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。
※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は、2021年4月30日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	113,896,820,828	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	57,290,868	0.05
合計(純資産総額)		113,954,111,696	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】

①【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	53,676,808,911	2.1832	117,191,344,915	2.1219	113,896,820,828	99.95

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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10期計算期間末 (2012年 4月 2日)	36,891,288,373	36,891,288,373	9,334	9,334
第11期計算期間末 (2013年 4月 1日)	47,541,549,876	47,541,549,876	11,141	11,141
第12期計算期間末 (2014年 3月31日)	56,643,451,778	56,643,451,778	13,652	13,652
第13期計算期間末 (2015年 3月31日)	73,026,107,098	73,026,107,098	17,815	17,815
第14期計算期間末 (2016年 3月31日)	69,315,595,697	69,315,595,697	15,862	15,862
第15期計算期間末 (2017年 3月31日)	79,513,820,774	79,513,820,774	18,169	18,169
第16期計算期間末 (2018年 4月 2日)	94,197,935,571	94,197,935,571	20,938	20,938
第17期計算期間末 (2019年 4月 1日)	93,580,494,253	93,580,494,253	20,237	20,237
第18期計算期間末 (2020年 3月31日)	82,302,972,845	82,302,972,845	18,017	18,017
第19期計算期間末 (2021年 3月31日)	117,130,660,109	117,130,660,109	25,563	25,563
2020年 4月末日	85,968,762,633	—	18,795	—
5月末日	92,738,112,212	—	20,070	—
6月末日	92,544,475,777	—	20,035	—
7月末日	88,658,332,163	—	19,226	—
8月末日	95,735,859,573	—	20,792	—
9月末日	97,221,040,879	—	21,057	—
10月末日	94,490,453,483	—	20,457	—
11月末日	103,816,900,683	—	22,739	—
12月末日	106,850,526,530	—	23,411	—

2021年 1月末日	106,988,032,348	—	23,461	—
2月末日	110,084,052,982	—	24,189	—
3月末日	117,130,660,109	—	25,563	—
4月末日	113,954,111,696	—	24,839	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	0
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	0
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	0
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	0
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	0
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	0.6
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	19.4
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	22.5
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	30.5
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	△11.0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	14.5
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	15.2
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	△3.3
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	△11.0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	41.9

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第10期計算期間	2011年 4月 1日～2012年 4月 2日	8,098,197,566	3,730,095,100	39,521,711,663

第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	9,677,054,316	6,526,059,313	42,672,706,666
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	12,128,505,388	13,309,747,403	41,491,464,651
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	9,661,910,614	10,162,747,005	40,990,628,260
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	12,364,658,702	9,655,862,890	43,699,424,072
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	8,332,373,769	8,267,206,141	43,764,591,700
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	9,068,541,994	7,843,419,871	44,989,713,823
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	7,404,869,734	6,151,695,641	46,242,887,916
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	7,667,675,777	8,228,600,168	45,681,963,525
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	7,900,549,624	7,762,885,703	45,819,627,446

(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	279,042,924,900	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,885,210,567	1.72
合計(純資産総額)		283,928,135,467	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	4,639,660,000	1.63

(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	1,084,200	7,660.64	8,305,672,500	8,127.00	8,811,293,400	3.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	833,300	8,795.41	7,329,216,264	9,885.00	8,237,170,500	2.90
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	670,400	10,475.26	7,022,614,955	10,900.00	7,307,360,000	2.57
日本	株式	キーエンス	電気機器	105,100	57,597.06	6,053,451,226	52,520.00	5,519,852,000	1.94
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	7,220,400	483.07	3,487,970,576	578.00	4,173,391,200	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	61,200	63,920.00	3,911,904,000	62,690.00	3,836,628,000	1.35
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	732,600	4,669.44	3,420,837,928	4,939.00	3,618,311,400	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	193,800	19,273.38	3,735,181,710	18,450.00	3,575,610,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,228,400	2,699.58	3,316,165,700	2,755.00	3,384,242,000	1.19
日本	株式	日本電産	電気機器	257,600	14,200.73	3,658,110,042	12,655.00	3,259,928,000	1.15
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	890,400	3,588.63	3,195,318,444	3,635.00	3,236,604,000	1.14
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	62,700	43,517.67	2,728,558,000	48,320.00	3,029,664,000	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	136,300	23,128.78	3,152,454,054	21,930.00	2,989,059,000	1.05
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	842,200	3,239.61	2,728,403,520	3,306.00	2,784,313,200	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	730,500	3,339.06	2,439,185,203	3,802.00	2,777,361,000	0.98
日本	株式	日立製作所	電気機器	514,600	4,359.85	2,243,579,294	5,381.00	2,769,062,600	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	314,400	10,491.52	3,298,534,400	8,703.00	2,736,223,200	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	842,600	2,851.34	2,402,541,520	3,232.00	2,723,283,200	0.96
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	210,600	13,615.16	2,867,354,055	12,435.00	2,618,811,000	0.92
日本	株式	第一三共	医薬品	918,700	3,577.60	3,286,746,600	2,787.00	2,560,416,900	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	737,200	3,142.55	2,316,688,278	3,408.00	2,512,377,600	0.88
日本	株式	ファナック	電気機器	93,900	27,067.98	2,541,683,500	25,175.00	2,363,932,500	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,434,300	1,407.58	2,018,903,343	1,535.00	2,201,650,500	0.78
日本	株式	ＳＭＣ	機械	31,300	68,240.00	2,135,912,000	63,450.00	1,985,985,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	855,800	2,059.84	1,762,812,300	2,303.50	1,971,335,300	0.69
日本	株式	三菱商事	卸売業	641,700	2,683.97	1,722,304,800	3,020.00	1,937,934,000	0.68
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	412,400	3,952.58	1,630,047,100	4,699.00	1,937,867,600	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	347,600	5,422.66	1,884,919,000	5,230.00	1,817,948,000	0.64
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,070,300	1,633.36	1,748,194,040	1,682.00	1,800,244,600	0.63
日本	株式	花王	化学	256,200	7,684.25	1,968,706,395	7,007.00	1,795,193,400	0.63

(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	0.17
		建設業	2.34
		食料品	3.23

		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.27
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.63
		機械	5.61
		電気機器	17.66
		輸送用機器	6.98
		精密機器	2.52
		その他製品	2.40
		電気・ガス業	1.26
		陸運業	3.31
		海運業	0.27
		空運業	0.44
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.39
		卸売業	4.69
		小売業	4.56
		銀行業	4.95
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	1.83
		その他金融業	1.08
		不動産業	1.94
		サービス業	5.43
		小計	98.28
合計			98.28

(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	244	円	4,756,181,800	4,639,660,000	1.63

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

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

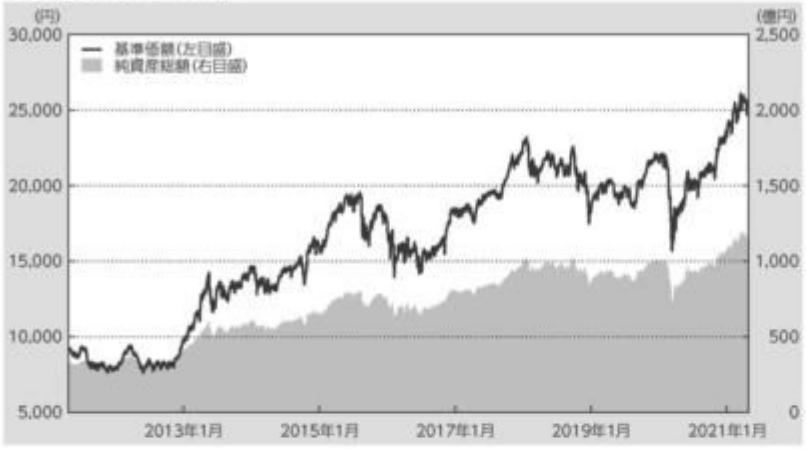
≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2002年4月１日
作成基準日：2021年4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	24,839円
純資産総額	1,139.54億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2017年３月	0円
2018年４月	0円
2019年４月	0円
2020年３月	0円
2021年３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	3.1%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2.9%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.6%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.5%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.3%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.3%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.2%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.1%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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等でご確認いただけます。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
ありません。

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

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

＜受付不可日＞

ありません。

＜一部解約受付の中止等＞

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

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

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

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

＜問い合わせ先＞
上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞
基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当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＞
①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。
②国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2002年 4月 1日設定）

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年４月１日から翌年３月31日までとすることを原則とします。

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②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。

③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。

④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）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。

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④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②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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(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。

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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＞

①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。受託会社がその任務

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。

②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、販売会社を経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れ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＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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

①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。

②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

①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。

②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。

③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。

④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19期計算期間(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 （2020年 3月31日現在）	第19期 （2021年 3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	502,687,731	368,810,104
親投資信託受益証券	82,260,885,286	117,071,379,855
未収入金	23,785,650	-
流動資産合計	82,787,358,667	117,440,189,959
資産合計	82,787,358,667	117,440,189,959
負債の部		
流動負債		
未払解約金	385,934,818	198,468,522
未払受託者報酬	15,544,689	17,535,872
未払委託者報酬	82,904,964	93,524,601
未払利息	1,351	855
流動負債合計	484,385,822	309,529,850
負債合計	484,385,822	309,529,850
純資産の部		
元本等		
元本	45,681,963,525	45,819,627,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,621,009,320	71,311,032,663
（分配準備積立金）	22,562,544,559	37,309,480,761
元本等合計	82,302,972,845	117,130,660,109
純資産合計	82,302,972,845	117,130,660,109
負債純資産合計	82,787,358,667	117,440,189,959

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2019年 4月 2日 至　2020年 3月31日	第19期 自　2020年 4月 1日 至　2021年 3月31日
営業収益		
受取利息	274	1,540
有価証券売買等損益	△9,823,056,730	34,698,577,183
営業収益合計	△9,823,056,456	34,698,578,723
営業費用		
支払利息	111,671	90,220
受託者報酬	30,162,449	32,574,158
委託者報酬	160,866,318	173,728,747
その他費用	436	411
営業費用合計	191,140,874	206,393,536
営業利益又は営業損失（△）	△10,014,197,330	34,492,185,187
経常利益又は経常損失（△）	△10,014,197,330	34,492,185,187
当期純利益又は当期純損失（△）	△10,014,197,330	34,492,185,187
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（△）	△221,419,749	2,644,943,814
期首剰余金又は期首欠損金（△）	47,337,606,337	36,621,009,320
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,459,997,802	9,192,623,457
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,459,997,802	9,192,623,457
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,383,817,238	6,349,841,487
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,383,817,238	6,349,841,487
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,621,009,320	71,311,032,663

（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18期 (2020年 3月31日現在)	第19期 (2021年 3月31日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	45,681,963,525口	45,819,627,446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 1.8017円 (1万口当たり純資産額) (18,017円)	1口当たり純資産額 2.5563円 (1万口当たり純資産額) (25,563円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第18期
自 2019年 4月 2日
至 2020年 3月31日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,115,894,418円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	59,857,556,822円
分配準備積立金額	D	20,446,650,141円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,420,101,381円
当ファンドの期末残存口数	F	45,681,963,525口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	18,042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

第19期
自 2020年 4月 1日
至 2021年 3月31日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,138,196,682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	16,111,220,386円
収益調整金額	C	63,654,551,946円
分配準備積立金額	D	19,060,063,693円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,964,032,707円
当ファンドの期末残存口数	F	45,819,627,446口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	22,035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

（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19期 自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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19期 (2021年 3月31日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第18期 自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日	第19期 自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	46,242,887,916円	45,681,963,525円
期中追加設定元本額	7,667,675,777円	7,900,549,624円
期中一部解約元本額	8,228,600,168円	7,762,885,703円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 (2020年 3月31日現在)	第19期 (2021年 3月31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	△9,727,535,827	33,626,308,109
合計	△9,727,535,827	33,626,308,109

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	53,616,386,469	117,071,379,855	
合計		53,616,386,469	117,071,379,855	

(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

	2021年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,689,290,477
株式	287,439,300,520
派生商品評価勘定	47,385,000
未収入金	31,997,462
未収配当金	2,635,534,144
差入委託証拠金	185,443,600
流動資産合計	293,028,951,203
資産合計	293,028,951,203
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,187,200
前受金	14,198,900
未払金	72,155,818
未払解約金	300,829,312
未払利息	6,238
流動負債合計	420,377,468
負債合計	420,377,468
純資産の部	
元本等	
元本	134,006,418,790
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	158,602,154,945
元本等合計	292,608,573,735
純資産合計	292,608,573,735
負債純資産合計	293,028,951,203

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 3月31日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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）

		2021年 3月31日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	134,006,418,790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 2.1835円 (1万口当たり純資産額) (21,835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

	2021年 3月31日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 3月31日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 3月31日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2021年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 4月 1日
期首元本額	145,410,304,747円
期中追加設定元本額	8,741,994,728円
期中一部解約元本額	20,145,880,685円
期末元本額	134,006,418,790円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	612,064,368円
ＤＣ日本株式インデックスファンド	314,351,199円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	53,616,386,469円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	773,393,446円
ＤＣバランスファンド３０	2,191,513,210円
ＤＣバランスファンド５０	3,400,802,010円
ＤＣバランスファンド７０	1,917,920,228円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	546,884,615円
日本株式インデックスｅ	1,511,458,788円
インデックスコレクション（国内株式）	19,052,778,724円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	11,953,467,650円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	2,346,501,100円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	1,914,021,150円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,614,520,589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）	2,803,725,761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）	1,153,304,306円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	59,603,197円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	670,977,288円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	76,131,257円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	147,771,600円

区分	2021年 3月31日現在
ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	719,719円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	304,300,625円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	893,128,481円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	487,890,299円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	8,466,121,963円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	787,263,829円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	90,995,258円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	1,315,475,854円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	32,044,269円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	168,950,016円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	2,190,049,575円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	61,393,696円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	64,696,512円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	26,373,162円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	705,568,308円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	301,162,964円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	5,146,382,251円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	94,905,621円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	41,480,334円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	9,783,188円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	136,338,556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）	3,817,355円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 3月31日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,402,686,525
合計	14,402,686,525

(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

（2021年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,085,741,100	－	5,099,940,000	14,198,900

合計	5,085,741,100	―	5,099,940,000	14,198,900

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	4,700	3,055.00	14,358,500	
日本水産	135,300	532.00	71,979,600	
マルハニチロ	22,800	2,625.00	59,850,000	
雪国まいたけ	9,000	1,973.00	17,757,000	
カネコ種苗	4,400	1,627.00	7,158,800	
サカタのタネ	17,400	4,090.00	71,166,000	
ホクト	12,200	2,087.00	25,461,400	
ホクリヨウ	2,300	719.00	1,653,700	
住石ホールディングス	25,500	123.00	3,136,500	
日鉄鉱業	3,300	6,810.00	22,473,000	
三井松島ホールディングス	6,100	995.00	6,069,500	
国際石油開発帝石	535,700	756.00	404,989,200	
石油資源開発	19,000	2,055.00	39,045,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,100	1,468.00	10,422,800	
ヒノキヤグループ	3,600	2,512.00	9,043,200	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,770.00	99,216,000	
ミライト・ホールディングス	50,500	1,827.00	92,263,500	
タマホーム	8,800	2,194.00	19,307,200	
サンヨーホームズ	1,700	785.00	1,334,500	
日本アクア	5,800	616.00	3,572,800	
ファーストコーポレーション	4,400	751.00	3,304,400	
ベステラ	2,800	1,668.00	4,670,400	
ＴＡＴＥＲＵ	27,300	187.00	5,105,100	
キャンディル	2,500	551.00	1,377,500	
スペースバリューホールディングス	17,800	795.00	14,151,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	903.00	2,528,400	
第一カッター興業	3,600	1,476.00	5,313,600	
安藤・間	93,400	849.00	79,296,600	

東急建設	42,700	602.00	25,705,400	
コムシスホールディングス	51,700	3,410.00	176,297,000	
ビーアールホールディングス	17,200	591.00	10,165,200	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,156.00	19,619,600	
東建コーポレーション	4,500	10,810.00	48,645,000	
ソネック	1,500	853.00	1,279,500	
ヤマウラ	6,300	925.00	5,827,500	
大成建設	104,700	4,270.00	447,069,000	
大林組	336,400	1,015.00	341,446,000	
清水建設	315,100	896.00	282,329,600	
飛島建設	9,600	1,204.00	11,558,400	
長谷工コーポレーション	110,200	1,549.00	170,699,800	
松井建設	13,200	749.00	9,886,800	
錢高組	1,500	5,160.00	7,740,000	
鹿島建設	246,500	1,571.00	387,251,500	
不動テトラ	8,200	1,926.00	15,793,200	
大末建設	4,200	954.00	4,006,800	
鉄建建設	6,800	1,976.00	13,436,800	
西松建設	24,100	2,808.00	67,672,800	
三井住友建設	81,300	499.00	40,568,700	
大豊建設	7,400	3,875.00	28,675,000	
前田建設工業	84,300	956.00	80,590,800	
佐田建設	7,600	448.00	3,404,800	
ナカノフドー建設	8,000	397.00	3,176,000	
奥村組	18,500	2,942.00	54,427,000	
東鉄工業	14,400	2,647.00	38,116,800	
イチケン	2,400	2,053.00	4,927,200	
富士ピー・エス	4,300	599.00	2,575,700	
淺沼組	4,000	4,480.00	17,920,000	
戸田建設	139,700	811.00	113,296,700	
熊谷組	15,600	3,005.00	46,878,000	
北野建設	2,000	2,536.00	5,072,000	
植木組	3,000	1,553.00	4,659,000	
矢作建設工業	14,900	840.00	12,516,000	
ピーエス三菱	11,100	673.00	7,470,300	
日本ハウスホールディングス	23,000	339.00	7,797,000	
大東建託	36,700	12,830.00	470,861,000	
新日本建設	14,300	883.00	12,626,900	
ＮＩＰＰＯ	27,800	3,020.00	83,956,000	
東亜道路工業	2,100	4,235.00	8,893,500	
前田道路	20,800	2,143.00	44,574,400	
日本道路	3,300	8,230.00	27,159,000	

東亜建設工業	9,000	2,440.00	21,960,000	
日本国土開発	32,700	615.00	20,110,500	
若築建設	6,000	1,373.00	8,238,000	
東洋建設	37,700	575.00	21,677,500	
五洋建設	142,900	869.00	124,180,100	
世紀東急工業	16,200	931.00	15,082,200	
福田組	3,900	5,290.00	20,631,000	
住友林業	79,100	2,386.00	188,732,600	
日本基礎技術	10,300	507.00	5,222,100	
巴コーポレーション	14,900	401.00	5,974,900	
大和ハウス工業	310,700	3,241.00	1,006,978,700	
ライト工業	19,300	1,880.00	36,284,000	
積水ハウス	364,900	2,374.00	866,272,600	
日特建設	8,800	830.00	7,304,000	
北陸電気工事	5,800	1,228.00	7,122,400	
ユアテック	19,200	815.00	15,648,000	
日本リーテック	7,000	2,036.00	14,252,000	
四電工	1,800	3,075.00	5,535,000	
中電工	15,500	2,361.00	36,595,500	
関電工	54,700	971.00	53,113,700	
きんでん	68,300	1,885.00	128,745,500	
東京エネシス	11,200	916.00	10,259,200	
トーエネック	3,400	3,915.00	13,311,000	
住友電設	9,500	2,409.00	22,885,500	
日本電設工業	18,400	1,937.00	35,640,800	
協和エクシオ	51,000	2,922.00	149,022,000	
新日本空調	8,900	2,406.00	21,413,400	
九電工	23,600	4,230.00	99,828,000	
三機工業	23,800	1,453.00	34,581,400	
日揮ホールディングス	112,200	1,356.00	152,143,200	
中外炉工業	3,600	2,120.00	7,632,000	
ヤマト	10,800	673.00	7,268,400	
太平電業	7,500	2,645.00	19,837,500	
高砂熱学工業	30,400	1,724.00	52,409,600	
三晃金属工業	1,300	3,045.00	3,958,500	
朝日工業社	2,500	3,055.00	7,637,500	
明星工業	21,800	775.00	16,895,000	
大氣社	16,400	3,035.00	49,774,000	
ダイダン	7,500	2,963.00	22,222,500	
日比谷総合設備	10,800	1,942.00	20,973,600	
フィル・カンパニー	1,900	2,249.00	4,273,100	
ＯＳＪＢホールディングス	49,000	296.00	14,504,000	

東洋エンジニアリング	14,100	782.00	11,026,200	
レイズネクスト	18,000	1,196.00	21,528,000	
ニップン	31,500	1,657.00	52,195,500	
日清製粉グループ本社	121,600	1,850.00	224,960,000	
日東富士製粉	800	7,620.00	6,096,000	
昭和産業	9,100	3,105.00	28,255,500	
鳥越製粉	9,500	837.00	7,951,500	
中部飼料	13,200	1,435.00	18,942,000	
フィード・ワン	14,500	915.00	13,267,500	
東洋精糖	1,800	1,215.00	2,187,000	
日本甜菜製糖	5,600	1,641.00	9,189,600	
三井製糖	8,500	1,962.00	16,677,000	
塩水港精糖	12,800	260.00	3,328,000	
日新製糖	5,100	1,833.00	9,348,300	
森永製菓	25,300	3,955.00	100,061,500	
中村屋	2,600	3,885.00	10,101,000	
江崎グリコ	29,600	4,445.00	131,572,000	
名糖産業	4,700	1,511.00	7,101,700	
井村屋グループ	6,100	2,538.00	15,481,800	
不二家	6,900	2,269.00	15,656,100	
山崎製パン	80,700	1,789.00	144,372,300	
第一屋製パン	2,100	975.00	2,047,500	
モロゾフ	1,700	5,820.00	9,894,000	
亀田製菓	6,100	4,820.00	29,402,000	
寿スピリッツ	10,400	7,190.00	74,776,000	
カルビー	49,100	2,822.00	138,560,200	
森永乳業	19,900	5,820.00	115,818,000	
六甲バター	7,100	1,690.00	11,999,000	
ヤクルト本社	74,100	5,600.00	414,960,000	
明治ホールディングス	71,200	7,120.00	506,944,000	
雪印メグミルク	25,900	2,249.00	58,249,100	
プリマハム	15,100	3,490.00	52,699,000	
日本ハム	41,100	4,745.00	195,019,500	
林兼産業	3,600	656.00	2,361,600	
丸大食品	10,600	1,716.00	18,189,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9,700	3,785.00	36,714,500	
柿安本店	3,700	2,639.00	9,764,300	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,300	729.00	50,519,700	
サッポロホールディングス	36,700	2,293.00	84,153,100	
アサヒグループホールディングス	235,200	4,665.00	1,097,208,000	
キリンホールディングス	456,600	2,120.50	968,220,300	
宝ホールディングス	79,800	1,507.00	120,258,600	

オエノンホールディングス	30,600	409.00	12,515,400	
養命酒製造	3,300	1,906.00	6,289,800	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82,400	1,929.00	158,949,600	
サントリー食品インターナショナル	72,000	4,115.00	296,280,000	
ダイドーグループホールディングス	6,100	5,320.00	32,452,000	
伊藤園	32,700	6,790.00	222,033,000	
キーコーヒー	10,600	2,127.00	22,546,200	
ユニカフェ	3,200	1,023.00	3,273,600	
ジャパンフーズ	1,500	1,231.00	1,846,500	
日清オイリオグループ	13,900	3,265.00	45,383,500	
不二製油グループ本社	26,200	2,953.00	77,368,600	
かどや製油	1,200	4,215.00	5,058,000	
Ｊ－オイルミルズ	10,000	1,995.00	19,950,000	
キッコーマン	77,500	6,590.00	510,725,000	
味の素	256,100	2,265.50	580,194,550	
ブルドックソース	4,900	2,701.00	13,234,900	
キユーピー	60,000	2,520.00	151,200,000	
ハウス食品グループ本社	40,300	3,640.00	146,692,000	
カゴメ	44,000	3,515.00	154,660,000	
焼津水産化学工業	5,200	1,003.00	5,215,600	
アリアケジャパン	9,800	6,710.00	65,758,000	
ピエトロ	1,400	1,841.00	2,577,400	
エバラ食品工業	2,400	2,709.00	6,501,600	
やまみ	1,200	2,121.00	2,545,200	
ニチレイ	51,300	2,849.00	146,153,700	
東洋水産	55,400	4,650.00	257,610,000	
イートアンドホールディングス	3,700	1,958.00	7,244,600	
大冷	1,200	1,935.00	2,322,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	990.00	5,940,000	
日清食品ホールディングス	42,200	8,210.00	346,462,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,335.00	12,375,500	
一正蒲鉾	4,200	1,292.00	5,426,400	
フジッコ	11,700	1,950.00	22,815,000	
ロック・フィールド	11,600	1,687.00	19,569,200	
日本たばこ産業	577,300	2,125.00	1,226,762,500	
ケンコーマヨネーズ	6,600	1,887.00	12,454,200	
わらべや日洋ホールディングス	7,000	1,689.00	11,823,000	
なとり	6,000	1,964.00	11,784,000	
イフジ産業	1,700	938.00	1,594,600	
ピックルスコーポレーション	2,600	3,480.00	9,048,000	
ファーマフーズ	9,400	3,570.00	33,558,000	
北の達人コーポレーション	37,600	637.00	23,951,200	

ユーグレナ	46,500	1,059.00	49,243,500	
ミヨシ油脂	3,800	1,295.00	4,921,000	
理研ビタミン	10,200	1,365.00	13,923,000	
片倉工業	14,300	1,455.00	20,806,500	
グンゼ	7,800	4,155.00	32,409,000	
東洋紡	41,700	1,424.00	59,380,800	
ユニチカ	31,500	411.00	12,946,500	
富士紡ホールディングス	5,200	4,000.00	20,800,000	
倉敷紡績	9,800	1,918.00	18,796,400	
シキボウ	5,900	995.00	5,870,500	
日本毛織	34,900	1,030.00	35,947,000	
トーア紡コーポレーション	4,200	484.00	2,032,800	
帝国繊維	12,000	2,242.00	26,904,000	
帝人	99,100	1,907.00	188,983,700	
東レ	761,200	712.50	542,355,000	
サカイオーベックス	2,900	3,005.00	8,714,500	
住江織物	2,300	2,269.00	5,218,700	
日本フエルト	6,700	453.00	3,035,100	
イチカワ	1,600	1,407.00	2,251,200	
日東製網	1,100	1,821.00	2,003,100	
アツギ	8,300	556.00	4,614,800	
ダイニック	4,000	831.00	3,324,000	
セーレン	26,000	1,946.00	50,596,000	
ソトー	4,400	825.00	3,630,000	
東海染工	1,500	1,120.00	1,680,000	
小松マテーレ	17,400	973.00	16,930,200	
ワコールホールディングス	26,300	2,455.00	64,566,500	
ホギメディカル	14,200	3,375.00	47,925,000	
ＴＳＩホールディングス	32,300	321.00	10,368,300	
マツオカコーポレーション	3,400	1,926.00	6,548,400	
ワールド	13,800	1,478.00	20,396,400	
三陽商会	5,500	791.00	4,350,500	
ナイガイ	4,200	348.00	1,461,600	
オンワードホールディングス	63,600	312.00	19,843,200	
ルックホールディングス	3,700	1,215.00	4,495,500	
ゴールドウイン	17,400	7,080.00	123,192,000	
デサント	18,000	1,882.00	33,876,000	
キング	5,800	584.00	3,387,200	
ヤマトインターナショナル	9,600	347.00	3,331,200	
特種東海製紙	6,500	4,870.00	31,655,000	
王子ホールディングス	473,000	716.00	338,668,000	
日本製紙	46,500	1,326.00	61,659,000	

三菱製紙	14,900	378.00	5,632,200	
北越コーポレーション	75,200	518.00	38,953,600	
中越パルプ工業	4,000	1,268.00	5,072,000	
巴川製紙所	3,500	840.00	2,940,000	
大王製紙	50,700	1,899.00	96,279,300	
阿波製紙	2,700	460.00	1,242,000	
レンゴー	108,300	961.00	104,076,300	
トーモク	6,400	1,848.00	11,827,200	
ザ・パック	8,000	3,020.00	24,160,000	
クラレ	165,500	1,263.00	209,026,500	
旭化成	696,400	1,274.50	887,561,800	
共和レザー	5,700	753.00	4,292,100	
昭和電工	79,800	3,150.00	251,370,000	
住友化学	827,000	573.00	473,871,000	
住友精化	5,100	4,040.00	20,604,000	
日産化学	58,000	5,910.00	342,780,000	
ラサ工業	3,400	2,114.00	7,187,600	
クレハ	9,000	7,640.00	68,760,000	
多木化学	4,100	6,020.00	24,682,000	
テイカ	7,700	1,487.00	11,449,900	
石原産業	18,800	911.00	17,126,800	
片倉コープアグリ	2,700	1,270.00	3,429,000	
日本曹達	14,700	3,495.00	51,376,500	
東ソー	162,400	2,118.00	343,963,200	
トクヤマ	31,200	2,793.00	87,141,600	
セントラル硝子	20,000	2,356.00	47,120,000	
東亞合成	64,100	1,298.00	83,201,800	
大阪ソーダ	10,700	2,637.00	28,215,900	
関東電化工業	24,900	895.00	22,285,500	
デンカ	38,300	4,420.00	169,286,000	
信越化学工業	194,300	18,610.00	3,615,923,000	
日本カーバイド工業	3,700	1,342.00	4,965,400	
堺化学工業	7,400	2,103.00	15,562,200	
第一稀元素化学工業	10,600	1,308.00	13,864,800	
エア・ウォーター	107,100	1,940.00	207,774,000	
日本酸素ホールディングス	86,500	2,104.00	181,996,000	
日本化学工業	3,000	2,978.00	8,934,000	
東邦アセチレン	1,600	1,342.00	2,147,200	
日本パーカライジング	53,000	1,195.00	63,335,000	
高圧ガス工業	16,700	735.00	12,274,500	
チタン工業	1,300	2,016.00	2,620,800	
四国化成工業	14,000	1,265.00	17,710,000	

戸田工業	2,200	2,164.00	4,760,800	
ステラ　ケミファ	5,700	3,190.00	18,183,000	
保土谷化学工業	3,100	4,830.00	14,973,000	
日本触媒	19,000	6,340.00	120,460,000	
大日精化工業	8,700	2,471.00	21,497,700	
カネカ	27,200	4,550.00	123,760,000	
三菱瓦斯化学	105,300	2,714.00	285,784,200	
三井化学	90,700	3,495.00	316,996,500	
ＪＳＲ	105,400	3,340.00	352,036,000	
東京応化工業	18,000	6,920.00	124,560,000	
大阪有機化学工業	9,700	3,710.00	35,987,000	
三菱ケミカルホールディングス	702,400	829.90	582,921,760	
ＫＨネオケム	17,300	2,798.00	48,405,400	
ダイセル	141,300	852.00	120,387,600	
住友ベークライト	16,500	4,525.00	74,662,500	
積水化学工業	222,200	2,125.00	472,175,000	
日本ゼオン	94,800	1,769.00	167,701,200	
アイカ工業	29,300	3,990.00	116,907,000	
宇部興産	53,100	2,358.00	125,209,800	
積水樹脂	17,300	2,097.00	36,278,100	
タキロンシーアイ	22,700	679.00	15,413,300	
旭有機材	5,900	1,500.00	8,850,000	
ニチバン	5,500	1,914.00	10,527,000	
リケンテクノス	25,600	516.00	13,209,600	
大倉工業	5,000	2,062.00	10,310,000	
積水化成品工業	14,100	596.00	8,403,600	
群栄化学工業	2,400	2,530.00	6,072,000	
タイガースポリマー	5,500	478.00	2,629,000	
ミライアル	3,400	1,271.00	4,321,400	
ダイキアクシス	3,800	961.00	3,651,800	
ダイキョーニシカワ	22,200	774.00	17,182,800	
竹本容器	3,800	880.00	3,344,000	
森六ホールディングス	5,600	2,258.00	12,644,800	
恵和	1,500	2,182.00	3,273,000	
日本化薬	65,000	1,069.00	69,485,000	
カーリットホールディングス	10,400	733.00	7,623,200	
日本精化	7,600	1,499.00	11,392,400	
扶桑化学工業	8,300	4,065.00	33,739,500	
トリケミカル研究所	9,200	3,525.00	32,430,000	
ＡＤＥＫＡ	48,400	2,172.00	105,124,800	
日油	39,600	5,790.00	229,284,000	
新日本理化	17,400	293.00	5,098,200	

ハリマ化成グループ	7,800	944.00	7,363,200	
花王	256,900	7,313.00	1,878,709,700	
第一工業製薬	3,600	3,680.00	13,248,000	
石原ケミカル	2,600	2,256.00	5,865,600	
日華化学	3,500	920.00	3,220,000	
ニイタカ	2,200	2,645.00	5,819,000	
三洋化成工業	6,300	5,600.00	35,280,000	
有機合成薬品工業	8,100	308.00	2,494,800	
大日本塗料	11,900	909.00	10,817,100	
日本ペイントホールディングス	433,500	1,595.00	691,432,500	
関西ペイント	118,000	2,955.00	348,690,000	
神東塗料	8,300	210.00	1,743,000	
中国塗料	25,300	995.00	25,173,500	
日本特殊塗料	7,900	1,076.00	8,500,400	
藤倉化成	14,200	532.00	7,554,400	
太陽ホールディングス	7,700	6,030.00	46,431,000	
ＤＩＣ	44,400	2,867.00	127,294,800	
サカタインクス	22,900	1,064.00	24,365,600	
東洋インキＳＣホールディングス	22,200	2,031.00	45,088,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,100	854.00	6,917,400	
富士フイルムホールディングス	188,500	6,571.00	1,238,633,500	
資生堂	213,200	7,422.00	1,582,370,400	
ライオン	139,500	2,159.00	301,180,500	
高砂香料工業	6,700	2,629.00	17,614,300	
マンダム	22,500	2,088.00	46,980,000	
ミルボン	14,300	6,070.00	86,801,000	
ファンケル	39,100	3,735.00	146,038,500	
コーセー	20,200	15,660.00	316,332,000	
コタ	6,820	1,575.00	10,741,500	
シーボン	1,400	2,047.00	2,865,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	45,800	2,664.00	122,011,200	
ノエビアホールディングス	9,100	5,020.00	45,682,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,044.00	2,505,600	
新日本製薬	2,200	2,338.00	5,143,600	
エステー	6,900	1,955.00	13,489,500	
アグロ　カネショウ	4,000	1,630.00	6,520,000	
コニシ	17,600	1,795.00	31,592,000	
長谷川香料	18,500	2,115.00	39,127,500	
星光ＰＭＣ	6,100	815.00	4,971,500	
小林製薬	30,100	10,330.00	310,933,000	
荒川化学工業	8,900	1,320.00	11,748,000	
メック	7,400	2,409.00	17,826,600	

日本高純度化学	2,900	2,800.00	8,120,000	
タカラバイオ	28,100	2,968.00	83,400,800	
ＪＣＵ	12,100	4,170.00	50,457,000	
新田ゼラチン	6,700	671.00	4,495,700	
ＯＡＴアグリオ	2,000	1,505.00	3,010,000	
デクセリアルズ	29,900	1,892.00	56,570,800	
アース製薬	8,100	6,660.00	53,946,000	
北興化学工業	10,000	1,172.00	11,720,000	
大成ラミック	3,300	2,862.00	9,444,600	
クミアイ化学工業	44,400	1,004.00	44,577,600	
日本農薬	19,100	544.00	10,390,400	
アキレス	7,400	1,484.00	10,981,600	
有沢製作所	14,900	1,000.00	14,900,000	
日東電工	68,700	9,460.00	649,902,000	
レック	12,700	1,263.00	16,040,100	
三光合成	11,200	453.00	5,073,600	
きもと	16,400	215.00	3,526,000	
藤森工業	9,600	4,500.00	43,200,000	
前澤化成工業	6,800	1,020.00	6,936,000	
未来工業	3,800	1,820.00	6,916,000	
ウェーブロックホールディングス	3,700	742.00	2,745,400	
ＪＳＰ	6,300	1,860.00	11,718,000	
エフピコ	19,700	4,505.00	88,748,500	
天馬	8,000	2,226.00	17,808,000	
信越ポリマー	16,500	992.00	16,368,000	
東リ	26,700	250.00	6,675,000	
ニフコ	39,400	4,035.00	158,979,000	
バルカー	8,700	2,131.00	18,539,700	
ユニ・チャーム	227,500	4,645.00	1,056,737,500	
ショーエイコーポレーション	2,400	1,078.00	2,587,200	
協和キリン	107,900	3,310.00	357,149,000	
武田薬品工業	892,500	3,985.00	3,556,612,500	
アステラス製薬	930,100	1,702.00	1,583,030,200	
大日本住友製薬	79,500	1,927.00	153,196,500	
塩野義製薬	134,900	5,952.00	802,924,800	
わかもと製薬	12,800	428.00	5,478,400	
あすか製薬	12,200	1,464.00	17,860,800	
日本新薬	30,400	8,230.00	250,192,000	
ビオフェルミン製薬	1,800	2,855.00	5,139,000	
中外製薬	335,500	4,489.00	1,506,059,500	
科研製薬	18,400	4,335.00	79,764,000	
エーザイ	118,500	7,419.00	879,151,500	

ロート製薬	51,100	2,953.00	150,898,300	
小野薬品工業	246,400	2,890.00	712,096,000	
久光製薬	31,200	7,210.00	224,952,000	
持田製薬	14,900	4,290.00	63,921,000	
参天製薬	186,600	1,523.00	284,191,800	
扶桑薬品工業	3,500	2,545.00	8,907,500	
日本ケミファ	1,300	2,630.00	3,419,000	
ツムラ	35,800	3,955.00	141,589,000	
日医工	30,400	995.00	30,248,000	
キッセイ薬品工業	19,000	2,450.00	46,550,000	
生化学工業	18,900	1,034.00	19,542,600	
栄研化学	18,900	2,163.00	40,880,700	
日水製薬	3,900	995.00	3,880,500	
鳥居薬品	6,700	3,000.00	20,100,000	
ＪＣＲファーマ	30,200	3,585.00	108,267,000	
東和薬品	15,400	2,443.00	37,622,200	
富士製薬工業	7,300	1,274.00	9,300,200	
沢井製薬	23,500	5,305.00	124,667,500	
ゼリア新薬工業	19,500	2,103.00	41,008,500	
第一三共	921,000	3,225.00	2,970,225,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,928.00	45,693,600	
大幸薬品	13,200	1,248.00	16,473,600	
ダイト	6,900	3,595.00	24,805,500	
大塚ホールディングス	222,900	4,687.00	1,044,732,300	
大正製薬ホールディングス	25,500	7,140.00	182,070,000	
ペプチドリーム	54,700	5,060.00	276,782,000	
日本コークス工業	90,600	114.00	10,328,400	
ニチレキ	12,700	1,580.00	20,066,000	
ユシロ化学工業	6,000	1,152.00	6,912,000	
ビーピー・カストロール	3,800	1,344.00	5,107,200	
富士石油	26,000	230.00	5,980,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,900	1,131.00	4,410,900	
出光興産	119,000	2,854.00	339,626,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,613,800	501.60	809,482,080	
コスモエネルギーホールディングス	33,900	2,637.00	89,394,300	
横浜ゴム	62,100	1,980.00	122,958,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	56,500	1,958.00	110,627,000	
ブリヂストン	285,200	4,475.00	1,276,270,000	
住友ゴム工業	96,400	1,305.00	125,802,000	
藤倉コンポジット	9,400	608.00	5,715,200	
オカモト	6,500	4,205.00	27,332,500	
フコク	4,700	816.00	3,835,200	

ニッタ	11,100	2,634.00	29,237,400	
住友理工	20,800	713.00	14,830,400	
三ツ星ベルト	13,000	1,781.00	23,153,000	
バンドー化学	18,900	748.00	14,137,200	
日東紡績	16,000	4,025.00	64,400,000	
ＡＧＣ	98,500	4,630.00	456,055,000	
日本板硝子	54,400	567.00	30,844,800	
石塚硝子	1,800	2,000.00	3,600,000	
日本山村硝子	4,600	1,024.00	4,710,400	
日本電気硝子	39,800	2,565.00	102,087,000	
オハラ	4,300	1,688.00	7,258,400	
住友大阪セメント	19,300	3,525.00	68,032,500	
太平洋セメント	63,600	2,911.00	185,139,600	
日本ヒューム	9,900	765.00	7,573,500	
日本コンクリート工業	23,400	412.00	9,640,800	
三谷セキサン	5,000	4,005.00	20,025,000	
アジアパイルホールディングス	16,700	534.00	8,917,800	
東海カーボン	105,000	1,787.00	187,635,000	
日本カーボン	5,900	4,645.00	27,405,500	
東洋炭素	6,300	2,144.00	13,507,200	
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	3,550.00	21,300,000	
ＴＯＴＯ	76,600	6,800.00	520,880,000	
日本碍子	118,100	2,024.00	239,034,400	
日本特殊陶業	81,700	1,911.00	156,128,700	
ＭＡＲＵＷＡ	3,700	11,360.00	42,032,000	
品川リフラクトリーズ	2,600	2,884.00	7,498,400	
黒崎播磨	1,800	4,895.00	8,811,000	
ヨータイ	7,800	1,027.00	8,010,600	
イソライト工業	4,900	650.00	3,185,000	
東京窯業	14,000	335.00	4,690,000	
ニッカトー	5,000	760.00	3,800,000	
フジミインコーポレーテッド	8,600	4,315.00	37,109,000	
クニミネ工業	3,500	1,280.00	4,480,000	
エーアンドエーマテリアル	2,100	1,110.00	2,331,000	
ニチアス	27,100	2,810.00	76,151,000	
ニチハ	15,000	3,230.00	48,450,000	
日本製鉄	506,400	1,886.50	955,323,600	
神戸製鋼所	194,300	748.00	145,336,400	
中山製鋼所	14,800	436.00	6,452,800	
合同製鐵	5,700	2,174.00	12,391,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	307,000	1,363.00	418,441,000	
東京製鐵	41,400	847.00	35,065,800	

共英製鋼	12,000	1,660.00	19,920,000	
大和工業	22,600	3,285.00	74,241,000	
東京鐵鋼	4,100	1,888.00	7,740,800	
大阪製鐵	5,700	1,425.00	8,122,500	
淀川製鋼所	14,300	2,451.00	35,049,300	
丸一鋼管	34,500	2,525.00	87,112,500	
モリ工業	3,200	2,650.00	8,480,000	
大同特殊鋼	17,400	5,110.00	88,914,000	
日本高周波鋼業	4,000	441.00	1,764,000	
日本冶金工業	8,300	2,055.00	17,056,500	
山陽特殊製鋼	12,700	1,633.00	20,739,100	
愛知製鋼	6,000	3,710.00	22,260,000	
日立金属	100,000	1,822.00	182,200,000	
日本金属	2,700	1,154.00	3,115,800	
大平洋金属	7,200	2,145.00	15,444,000	
新日本電工	68,600	345.00	23,667,000	
栗本鐵工所	4,800	1,751.00	8,404,800	
虹技	1,500	1,214.00	1,821,000	
三菱製鋼	7,900	875.00	6,912,500	
日亜鋼業	15,700	329.00	5,165,300	
日本精線	1,500	3,545.00	5,317,500	
エンビプロ・ホールディングス	4,600	1,020.00	4,692,000	
シンニッタン	13,000	290.00	3,770,000	
新家工業	2,700	1,750.00	4,725,000	
大紀アルミニウム工業所	16,100	1,072.00	17,259,200	
日本軽金属ホールディングス	28,900	2,213.00	63,955,700	
三井金属鉱業	28,600	3,840.00	109,824,000	
東邦亜鉛	5,900	2,389.00	14,095,100	
三菱マテリアル	70,100	2,584.00	181,138,400	
住友金属鉱山	135,600	4,779.00	648,032,400	
ＤＯＷＡホールディングス	26,900	4,605.00	123,874,500	
古河機械金属	17,600	1,336.00	23,513,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	960.00	10,656,000	
東邦チタニウム	19,100	995.00	19,004,500	
ＵＡＣＪ	16,100	2,668.00	42,954,800	
ＣＫサンエツ	2,200	4,170.00	9,174,000	
古河電気工業	33,000	2,970.00	98,010,000	
住友電気工業	370,300	1,658.00	613,957,400	
フジクラ	128,100	543.00	69,558,300	
昭和電線ホールディングス	10,300	1,630.00	16,789,000	
東京特殊電線	1,400	2,600.00	3,640,000	
タツタ電線	18,800	629.00	11,825,200	

カナレ電気	1,800	1,804.00	3,247,200	
平河ヒューテック	5,900	1,365.00	8,053,500	
リョービ	13,100	1,662.00	21,772,200	
アーレスティ	13,200	482.00	6,362,400	
アサヒホールディングス	39,800	2,118.00	84,296,400	
稲葉製作所	6,000	1,499.00	8,994,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,369.00	8,291,500	
トーカロ	27,400	1,448.00	39,675,200	
アルファＣｏ	3,700	1,229.00	4,547,300	
ＳＵＭＣＯ	135,800	2,526.00	343,030,800	
川田テクノロジーズ	2,200	4,710.00	10,362,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,400	6,390.00	21,726,000	
ジェイテックコーポレーション	900	3,345.00	3,010,500	
信和	5,600	857.00	4,799,200	
東洋製罐グループホールディングス	67,600	1,316.00	88,961,600	
ホッカンホールディングス	5,400	1,462.00	7,894,800	
コロナ	5,900	953.00	5,622,700	
横河ブリッジホールディングス	18,200	2,051.00	37,328,200	
駒井ハルテック	2,200	2,199.00	4,837,800	
高田機工	1,000	2,815.00	2,815,000	
三和ホールディングス	100,000	1,449.00	144,900,000	
文化シヤッター	31,300	1,054.00	32,990,200	
三協立山	13,700	824.00	11,288,800	
アルインコ	7,000	985.00	6,895,000	
東洋シヤッター	2,300	680.00	1,564,000	
ＬＩＸＩＬ	146,100	3,075.00	449,257,500	
日本フイルコン	7,400	523.00	3,870,200	
ノーリツ	22,000	1,764.00	38,808,000	
長府製作所	10,800	2,173.00	23,468,400	
リンナイ	20,600	12,390.00	255,234,000	
ダイニチ工業	5,100	869.00	4,431,900	
日東精工	13,300	587.00	7,807,100	
三洋工業	1,300	1,851.00	2,406,300	
岡部	21,500	780.00	16,770,000	
ジーテクト	13,200	1,503.00	19,839,600	
東プレ	19,800	1,561.00	30,907,800	
高周波熱錬	20,400	609.00	12,423,600	
東京製綱	7,600	1,225.00	9,310,000	
サンコール	9,100	484.00	4,404,400	
モリテック　スチール	8,300	435.00	3,610,500	
パイオラックス	15,700	1,625.00	25,512,500	
エイチワン	10,400	801.00	8,330,400	

日本発條	105,700	830.00	87,731,000	
中央発條	5,200	1,002.00	5,210,400	
アドバネクス	1,500	1,624.00	2,436,000	
立川ブラインド工業	4,700	1,382.00	6,495,400	
三益半導体工業	8,300	2,729.00	22,650,700	
日本ドライケミカル	2,700	1,701.00	4,592,700	
日本製鋼所	32,200	2,627.00	84,589,400	
三浦工業	45,900	5,980.00	274,482,000	
タクマ	36,000	2,397.00	86,292,000	
ツガミ	22,100	1,663.00	36,752,300	
オークマ	12,400	6,350.00	78,740,000	
芝浦機械	11,000	2,795.00	30,745,000	
アマダ	155,600	1,234.00	192,010,400	
アイダエンジニアリング	27,900	994.00	27,732,600	
滝澤鉄工所	3,100	1,141.00	3,537,100	
ＦＵＪＩ	42,400	2,835.00	120,204,000	
牧野フライス製作所	12,500	4,335.00	54,187,500	
オーエスジー	52,400	1,971.00	103,280,400	
ダイジェット工業	1,300	1,312.00	1,705,600	
旭ダイヤモンド工業	28,100	531.00	14,921,100	
ＤＭＧ森精機	67,200	1,814.00	121,900,800	
ソディック	23,200	1,029.00	23,872,800	
ディスコ	14,400	34,750.00	500,400,000	
日東工器	5,100	1,923.00	9,807,300	
日進工具	8,400	1,667.00	14,002,800	
パンチ工業	9,000	608.00	5,472,000	
冨士ダイス	5,400	691.00	3,731,400	
豊和工業	6,000	867.00	5,202,000	
ＯＫＫ	4,100	460.00	1,886,000	
東洋機械金属	7,700	500.00	3,850,000	
津田駒工業	2,000	930.00	1,860,000	
エンシュウ	2,700	976.00	2,635,200	
島精機製作所	15,500	2,567.00	39,788,500	
オプトラン	13,300	2,743.00	36,481,900	
ＮＣホールディングス	3,300	708.00	2,336,400	
イワキポンプ	6,800	903.00	6,140,400	
フリュー	10,400	1,076.00	11,190,400	
ヤマシンフィルタ	21,500	882.00	18,963,000	
日阪製作所	13,200	849.00	11,206,800	
やまびこ	20,600	1,228.00	25,296,800	
平田機工	5,000	6,860.00	34,300,000	
ペガサスミシン製造	10,900	458.00	4,992,200	

マルマエ	4,000	1,341.00	5,364,000	
タツモ	4,500	1,931.00	8,689,500	
ナブテスコ	62,500	5,060.00	316,250,000	
三井海洋開発	11,300	2,263.00	25,571,900	
レオン自動機	10,500	1,174.00	12,327,000	
ＳＭＣ	31,400	64,310.00	2,019,334,000	
ホソカワミクロン	3,700	6,710.00	24,827,000	
ユニオンツール	4,000	3,520.00	14,080,000	
オイレス工業	14,900	1,694.00	25,240,600	
日精エー・エス・ビー機械	3,100	5,260.00	16,306,000	
サトーホールディングス	14,000	2,883.00	40,362,000	
技研製作所	9,400	4,990.00	46,906,000	
日本エアーテック	3,500	1,237.00	4,329,500	
カワタ	3,000	905.00	2,715,000	
日精樹脂工業	8,300	1,022.00	8,482,600	
オカダアイヨン	3,400	1,308.00	4,447,200	
ワイエイシイホールディングス	4,200	976.00	4,099,200	
小松製作所	486,100	3,419.00	1,661,975,900	
住友重機械工業	61,400	3,075.00	188,805,000	
日立建機	50,200	3,545.00	177,959,000	
日工	16,200	731.00	11,842,200	
巴工業	4,200	2,175.00	9,135,000	
井関農機	10,800	1,649.00	17,809,200	
ＴＯＷＡ	10,000	2,137.00	21,370,000	
丸山製作所	2,300	1,759.00	4,045,700	
北川鉄工所	4,900	1,584.00	7,761,600	
ローツェ	4,700	7,820.00	36,754,000	
タカキタ	3,800	688.00	2,614,400	
クボタ	563,600	2,519.50	1,419,990,200	
荏原実業	2,700	5,110.00	13,797,000	
三菱化工機	3,500	2,827.00	9,894,500	
月島機械	19,900	1,283.00	25,531,700	
帝国電機製作所	7,500	1,322.00	9,915,000	
新東工業	25,600	773.00	19,788,800	
澁谷工業	9,400	3,550.00	33,370,000	
アイチ　コーポレーション	18,700	890.00	16,643,000	
小森コーポレーション	27,400	750.00	20,550,000	
鶴見製作所	8,300	1,815.00	15,064,500	
住友精密工業	1,600	2,370.00	3,792,000	
日本ギア工業	4,500	342.00	1,539,000	
酒井重工業	1,900	2,245.00	4,265,500	
荏原製作所	44,500	4,515.00	200,917,500	

石井鐵工所	1,600	2,999.00	4,798,400	
酉島製作所	11,000	869.00	9,559,000	
北越工業	11,100	1,084.00	12,032,400	
ダイキン工業	136,700	22,320.00	3,051,144,000	
オルガノ	3,500	6,640.00	23,240,000	
トーヨーカネツ	4,100	2,715.00	11,131,500	
栗田工業	58,100	4,745.00	275,684,500	
椿本チエイン	15,300	3,050.00	46,665,000	
大同工業	5,200	968.00	5,033,600	
木村化工機	9,100	759.00	6,906,900	
アネスト岩田	18,100	1,033.00	18,697,300	
ダイフク	59,000	10,840.00	639,560,000	
サムコ	2,700	3,185.00	8,599,500	
加藤製作所	6,000	1,152.00	6,912,000	
油研工業	1,900	1,716.00	3,260,400	
タダノ	51,900	1,187.00	61,605,300	
フジテック	37,000	2,358.00	87,246,000	
ＣＫＤ	24,900	2,307.00	57,444,300	
キトー	9,100	1,825.00	16,607,500	
平和	30,000	1,807.00	54,210,000	
理想科学工業	8,300	1,471.00	12,209,300	
ＳＡＮＫＹＯ	25,500	2,933.00	74,791,500	
日本金銭機械	12,000	611.00	7,332,000	
マースグループホールディングス	6,900	1,653.00	11,405,700	
フクシマガリレイ	7,400	4,360.00	32,264,000	
オーイズミ	4,700	420.00	1,974,000	
ダイコク電機	5,000	1,027.00	5,135,000	
竹内製作所	18,000	3,095.00	55,710,000	
アマノ	28,100	2,688.00	75,532,800	
ＪＵＫＩ	14,900	890.00	13,261,000	
蛇の目ミシン工業	9,800	836.00	8,192,800	
マックス	14,800	1,637.00	24,227,600	
グローリー	27,600	2,380.00	65,688,000	
新晃工業	10,000	2,178.00	21,780,000	
大和冷機工業	17,300	1,104.00	19,099,200	
セガサミーホールディングス	97,600	1,727.00	168,555,200	
日本ピストンリング	4,000	1,165.00	4,660,000	
リケン	5,000	2,500.00	12,500,000	
ＴＰＲ	14,500	1,605.00	23,272,500	
ツバキ・ナカシマ	20,600	1,696.00	34,937,600	
ホシザキ	33,800	9,880.00	333,944,000	
大豊工業	8,800	1,068.00	9,398,400	

日本精工	220,400	1,135.00	250,154,000	
ＮＴＮ	248,300	341.00	84,670,300	
ジェイテクト	103,000	1,130.00	116,390,000	
不二越	10,000	4,815.00	48,150,000	
日本トムソン	29,500	662.00	19,529,000	
ＴＨＫ	66,900	3,830.00	256,227,000	
ユーシン精機	7,200	891.00	6,415,200	
前澤給装工業	7,600	1,145.00	8,702,000	
イーグル工業	13,300	1,192.00	15,853,600	
前澤工業	6,600	634.00	4,184,400	
日本ピラー工業	10,900	1,864.00	20,317,600	
キッツ	33,200	641.00	21,281,200	
マキタ	139,900	4,745.00	663,825,500	
日立造船	85,200	895.00	76,254,000	
三菱重工業	168,600	3,449.00	581,501,400	
ＩＨＩ	72,200	2,245.00	162,089,000	
スター精密	16,600	1,650.00	27,390,000	
日清紡ホールディングス	65,700	824.00	54,136,800	
イビデン	51,800	5,090.00	263,662,000	
コニカミノルタ	218,800	600.00	131,280,000	
ブラザー工業	131,300	2,449.00	321,553,700	
ミネベアミツミ	185,200	2,829.00	523,930,800	
日立製作所	515,800	5,004.00	2,581,063,200	
東芝	159,300	3,740.00	595,782,000	
三菱電機	1,072,800	1,686.50	1,809,277,200	
富士電機	64,700	4,610.00	298,267,000	
東洋電機製造	4,300	1,307.00	5,620,100	
安川電機	115,500	5,510.00	636,405,000	
シンフォニアテクノロジー	14,000	1,315.00	18,410,000	
明電舎	18,300	2,407.00	44,048,100	
オリジン	3,000	1,450.00	4,350,000	
山洋電気	5,300	5,890.00	31,217,000	
デンヨー	9,200	2,092.00	19,246,400	
東芝テック	11,500	4,055.00	46,632,500	
芝浦メカトロニクス	2,000	5,550.00	11,100,000	
マブチモーター	29,800	4,865.00	144,977,000	
日本電産	258,200	13,435.00	3,468,917,000	
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,696.00	10,515,200	
東光高岳	5,800	1,579.00	9,158,200	
ダイヘン	11,800	4,865.00	57,407,000	
ヤーマン	17,900	1,570.00	28,103,000	
ＪＶＣケンウッド	95,900	220.00	21,098,000	

ミマキエンジニアリング	10,700	628.00	6,719,600	
Ｉ－ＰＥＸ	5,300	2,023.00	10,721,900	
日新電機	25,300	1,244.00	31,473,200	
大崎電気工業	21,500	610.00	13,115,000	
オムロン	89,300	8,640.00	771,552,000	
日東工業	15,800	2,028.00	32,042,400	
ＩＤＥＣ	14,500	1,775.00	25,737,500	
正興電機製作所	2,800	1,978.00	5,538,400	
不二電機工業	2,300	1,279.00	2,941,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	38,800	3,000.00	116,400,000	
サクサホールディングス	2,600	1,603.00	4,167,800	
メルコホールディングス	3,900	3,860.00	15,054,000	
テクノメディカ	2,800	1,654.00	4,631,200	
日本電気	136,300	6,520.00	888,676,000	
富士通	96,500	16,000.00	1,544,000,000	
沖電気工業	43,700	1,150.00	50,255,000	
岩崎通信機	4,700	901.00	4,234,700	
電気興業	5,200	2,716.00	14,123,200	
サンケン電気	12,600	5,190.00	65,394,000	
ナカヨ	2,100	1,538.00	3,229,800	
アイホン	6,100	1,849.00	11,278,900	
ルネサスエレクトロニクス	462,200	1,200.00	554,640,000	
セイコーエプソン	133,200	1,800.00	239,760,000	
ワコム	78,600	743.00	58,399,800	
アルバック	19,800	4,655.00	92,169,000	
アクセル	5,300	986.00	5,225,800	
ＥＩＺＯ	9,100	4,175.00	37,992,500	
日本信号	25,200	981.00	24,721,200	
京三製作所	23,300	412.00	9,599,600	
能美防災	14,500	2,150.00	31,175,000	
ホーチキ	8,300	1,369.00	11,362,700	
星和電機	6,400	613.00	3,923,200	
エレコム	24,800	2,456.00	60,908,800	
パナソニック	1,144,100	1,423.50	1,628,626,350	
シャープ	142,700	1,910.00	272,557,000	
アンリツ	64,500	2,416.00	155,832,000	
富士通ゼネラル	32,800	3,085.00	101,188,000	
ソニー	672,000	11,595.00	7,791,840,000	
ＴＤＫ	51,800	15,330.00	794,094,000	
帝国通信工業	5,300	1,100.00	5,830,000	
タムラ製作所	38,800	511.00	19,826,800	
アルプスアルパイン	88,100	1,460.00	128,626,000	

池上通信機	3,400	890.00	3,026,000	
鈴木	5,400	1,091.00	5,891,400	
日本トリム	2,500	4,105.00	10,262,500	
ローランド　ディー．ジー．	6,700	1,810.00	12,127,000	
フォスター電機	11,400	1,306.00	14,888,400	
ＳＭＫ	2,800	2,834.00	7,935,200	
ヨコオ	8,100	2,713.00	21,975,300	
ホシデン	29,900	1,156.00	34,564,400	
ヒロセ電機	16,500	17,020.00	280,830,000	
日本航空電子工業	24,700	1,790.00	44,213,000	
ＴＯＡ	12,800	963.00	12,326,400	
マクセルホールディングス	21,800	1,399.00	30,498,200	
古野電気	14,500	1,093.00	15,848,500	
ユニデンホールディングス	2,800	2,578.00	7,218,400	
スミダコーポレーション	9,800	1,082.00	10,603,600	
アイコム	4,500	2,762.00	12,429,000	
リオン	4,700	3,000.00	14,100,000	
本多通信工業	9,700	523.00	5,073,100	
横河電機	107,400	2,038.00	218,881,200	
新電元工業	4,200	3,250.00	13,650,000	
アズビル	72,600	4,765.00	345,939,000	
東亜ディーケーケー	6,100	820.00	5,002,000	
日本光電工業	44,600	3,230.00	144,058,000	
チノー	3,500	1,455.00	5,092,500	
共和電業	11,500	435.00	5,002,500	
日本電子材料	4,000	1,903.00	7,612,000	
堀場製作所	21,300	6,980.00	148,674,000	
アドバンテスト	79,800	9,680.00	772,464,000	
小野測器	5,700	556.00	3,169,200	
エスペック	9,900	1,849.00	18,305,100	
キーエンス	105,300	50,270.00	5,293,431,000	
日置電機	5,300	4,295.00	22,763,500	
シスメックス	83,800	11,925.00	999,315,000	
日本マイクロニクス	19,100	1,685.00	32,183,500	
メガチップス	11,000	3,530.00	38,830,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,400	3,785.00	24,224,000	
澤藤電機	1,400	2,381.00	3,333,400	
原田工業	5,100	906.00	4,620,600	
コーセル	13,700	1,094.00	14,987,800	
イリソ電子工業	9,100	4,935.00	44,908,500	
オプテックスグループ	18,000	1,650.00	29,700,000	
千代田インテグレ	4,900	1,900.00	9,310,000	

アイ・オー・データ機器	4,600	1,052.00	4,839,200	
レーザーテック	47,200	14,520.00	685,344,000	
スタンレー電気	75,300	3,295.00	248,113,500	
岩崎電気	4,300	1,560.00	6,708,000	
ウシオ電機	55,500	1,459.00	80,974,500	
岡谷電機産業	9,300	397.00	3,692,100	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,800	433.00	5,109,400	
エノモト	3,300	2,081.00	6,867,300	
日本セラミック	11,100	2,667.00	29,603,700	
遠藤照明	6,400	681.00	4,358,400	
古河電池	8,100	1,708.00	13,834,800	
双信電機	6,700	470.00	3,149,000	
山一電機	7,500	1,498.00	11,235,000	
図研	7,200	2,826.00	20,347,200	
日本電子	19,700	4,390.00	86,483,000	
カシオ計算機	86,300	2,085.00	179,935,500	
ファナック	94,200	26,185.00	2,466,627,000	
日本シイエムケイ	24,500	480.00	11,760,000	
エンプラス	5,000	4,145.00	20,725,000	
大真空	3,900	2,476.00	9,656,400	
ローム	44,700	10,810.00	483,207,000	
浜松ホトニクス	77,100	6,540.00	504,234,000	
三井ハイテック	10,700	4,630.00	49,541,000	
新光電気工業	36,200	3,425.00	123,985,000	
京セラ	163,600	7,025.00	1,149,290,000	
太陽誘電	47,800	5,200.00	248,560,000	
村田製作所	315,200	8,842.00	2,786,998,400	
双葉電子工業	19,100	971.00	18,546,100	
北陸電気工業	4,700	958.00	4,502,600	
ニチコン	34,400	1,121.00	38,562,400	
日本ケミコン	10,800	1,942.00	20,973,600	
ＫＯＡ	15,300	1,565.00	23,944,500	
市光工業	17,000	760.00	12,920,000	
小糸製作所	64,400	7,420.00	477,848,000	
ミツバ	19,700	678.00	13,356,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,600	9,740.00	181,164,000	
キヤノン電子	10,300	1,722.00	17,736,600	
キヤノン	533,100	2,502.50	1,334,082,750	
リコー	273,000	1,124.00	306,852,000	
象印マホービン	29,400	1,935.00	56,889,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	1,637.00	2,946,600	
東京エレクトロン	62,800	46,790.00	2,938,412,000	

トヨタ紡織	31,300	1,830.00	57,279,000	
芦森工業	2,100	1,055.00	2,215,500	
ユニプレス	17,600	1,063.00	18,708,800	
豊田自動織機	86,800	9,860.00	855,848,000	
モリタホールディングス	17,200	1,787.00	30,736,400	
三櫻工業	14,900	1,292.00	19,250,800	
デンソー	236,200	7,347.00	1,735,361,400	
東海理化電機製作所	28,300	1,876.00	53,090,800	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	41,500	557.00	23,115,500	
川崎重工業	83,500	2,742.00	228,957,000	
名村造船所	32,200	222.00	7,148,400	
日本車輌製造	3,900	2,489.00	9,707,100	
三菱ロジスネクスト	14,200	1,296.00	18,403,200	
近畿車輛	1,800	1,332.00	2,397,600	
日産自動車	1,265,200	615.90	779,236,680	
いすゞ自動車	310,800	1,189.00	369,541,200	
トヨタ自動車	1,086,800	8,616.00	9,363,868,800	
日野自動車	134,000	952.00	127,568,000	
三菱自動車工業	397,100	315.00	125,086,500	
エフテック	7,600	751.00	5,707,600	
レシップホールディングス	4,200	592.00	2,486,400	
ＧＭＢ	2,000	974.00	1,948,000	
ファルテック	1,900	816.00	1,550,400	
武蔵精密工業	23,900	1,889.00	45,147,100	
日産車体	15,700	796.00	12,497,200	
新明和工業	30,300	1,022.00	30,966,600	
極東開発工業	18,500	1,654.00	30,599,000	
トピー工業	8,900	1,395.00	12,415,500	
ティラド	3,400	2,041.00	6,939,400	
曙ブレーキ工業	58,900	196.00	11,544,400	
タチエス	16,500	1,200.00	19,800,000	
ＮＯＫ	51,900	1,501.00	77,901,900	
フタバ産業	26,900	593.00	15,951,700	
ＫＹＢ	12,000	3,020.00	36,240,000	
大同メタル工業	22,300	588.00	13,112,400	
プレス工業	53,300	333.00	17,748,900	
ミクニ	13,800	318.00	4,388,400	
太平洋工業	22,500	1,271.00	28,597,500	
河西工業	14,600	454.00	6,628,400	
アイシン精機	78,500	4,200.00	329,700,000	
マツダ	336,700	902.00	303,703,400	
今仙電機製作所	9,500	782.00	7,429,000	

本田技研工業	844,600	3,319.00	2,803,227,400	
スズキ	212,600	5,025.00	1,068,315,000	
ＳＵＢＡＲＵ	307,400	2,204.00	677,509,600	
安永	5,200	1,320.00	6,864,000	
ヤマハ発動機	151,600	2,711.00	410,987,600	
ＴＢＫ	12,900	451.00	5,817,900	
エクセディ	14,600	1,673.00	24,425,800	
豊田合成	34,700	2,908.00	100,907,600	
愛三工業	16,900	671.00	11,339,900	
盟和産業	1,700	897.00	1,524,900	
日本プラスト	9,100	619.00	5,632,900	
ヨロズ	9,200	1,335.00	12,282,000	
エフ・シー・シー	17,600	1,858.00	32,700,800	
シマノ	40,100	26,375.00	1,057,637,500	
テイ・エス　テック	49,800	1,649.00	82,120,200	
ジャムコ	6,300	1,010.00	6,363,000	
テルモ	328,900	3,999.00	1,315,271,100	
クリエートメディック	3,600	1,002.00	3,607,200	
日機装	34,700	1,127.00	39,106,900	
日本エム・ディ・エム	6,200	2,265.00	14,043,000	
島津製作所	138,100	4,005.00	553,090,500	
ＪＭＳ	9,100	978.00	8,899,800	
長野計器	7,800	981.00	7,651,800	
ブイ・テクノロジー	5,000	5,450.00	27,250,000	
東京計器	6,900	944.00	6,513,600	
愛知時計電機	1,400	4,350.00	6,090,000	
インターアクション	5,400	2,337.00	12,619,800	
オーバル	9,700	288.00	2,793,600	
東京精密	18,100	5,040.00	91,224,000	
マニー	42,700	2,780.00	118,706,000	
ニコン	163,800	1,035.00	169,533,000	
トプコン	54,100	1,342.00	72,602,200	
オリンパス	593,600	2,291.00	1,359,937,600	
理研計器	9,500	2,755.00	26,172,500	
タムロン	8,700	2,156.00	18,757,200	
ＨＯＹＡ	211,000	13,005.00	2,744,055,000	
シード	4,600	790.00	3,634,000	
ノーリツ鋼機	9,700	2,656.00	25,763,200	
エー・アンド・デイ	9,000	1,244.00	11,196,000	
朝日インテック	112,900	3,050.00	344,345,000	
シチズン時計	136,200	378.00	51,483,600	
リズム	3,400	907.00	3,083,800	

大研医器	8,500	609.00	5,176,500	
メニコン	16,500	6,530.00	107,745,000	
シンシア	1,200	877.00	1,052,400	
松風	4,900	1,984.00	9,721,600	
セイコーホールディングス	15,200	1,877.00	28,530,400	
ニプロ	80,000	1,337.00	106,960,000	
中本パックス	2,700	1,668.00	4,503,600	
スノーピーク	6,400	3,440.00	22,016,000	
パラマウントベッドホールディングス	20,600	2,353.00	48,471,800	
トランザクション	5,900	1,309.00	7,723,100	
粧美堂	3,100	410.00	1,271,000	
ニホンフラッシュ	9,200	1,359.00	12,502,800	
前田工繊	11,800	3,340.00	39,412,000	
永大産業	14,000	298.00	4,172,000	
アートネイチャー	10,300	705.00	7,261,500	
バンダイナムコホールディングス	88,700	7,893.00	700,109,100	
アイフィスジャパン	2,700	741.00	2,000,700	
共立印刷	17,900	140.00	2,506,000	
ＳＨＯＥＩ	9,400	4,560.00	42,864,000	
フランスベッドホールディングス	13,800	969.00	13,372,200	
パイロットコーポレーション	19,000	3,530.00	67,070,000	
萩原工業	6,000	1,458.00	8,748,000	
トッパン・フォームズ	19,200	1,117.00	21,446,400	
フジシールインターナショナル	22,000	2,474.00	54,428,000	
タカラトミー	48,100	1,005.00	48,340,500	
廣済堂	7,500	1,027.00	7,702,500	
エステールホールディングス	2,900	667.00	1,934,300	
タカノ	3,700	611.00	2,260,700	
プロネクサス	9,200	1,213.00	11,159,600	
ホクシン	6,600	126.00	831,600	
ウッドワン	3,600	1,271.00	4,575,600	
大建工業	7,200	2,204.00	15,868,800	
凸版印刷	163,100	1,870.00	304,997,000	
大日本印刷	129,600	2,319.00	300,542,400	
共同印刷	3,300	2,985.00	9,850,500	
ＮＩＳＳＨＡ	22,000	1,370.00	30,140,000	
光村印刷	900	1,822.00	1,639,800	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,300	1,845.00	9,778,500	
アシックス	94,900	1,765.00	167,498,500	
ツツミ	2,700	2,175.00	5,872,500	
ローランド	6,200	3,995.00	24,769,000	
小松ウオール工業	3,300	2,019.00	6,662,700	

ヤマハ	63,800	6,010.00	383,438,000	
河合楽器製作所	3,000	3,500.00	10,500,000	
クリナップ	10,000	543.00	5,430,000	
ピジョン	68,900	4,200.00	289,380,000	
オリバー	2,300	2,902.00	6,674,600	
兼松サステック	700	1,802.00	1,261,400	
キングジム	8,900	951.00	8,463,900	
リンテック	23,000	2,504.00	57,592,000	
イトーキ	21,300	418.00	8,903,400	
任天堂	61,400	61,810.00	3,795,134,000	
三菱鉛筆	17,700	1,598.00	28,284,600	
タカラスタンダード	22,200	1,667.00	37,007,400	
コクヨ	51,500	1,714.00	88,271,000	
ナカバヤシ	10,500	615.00	6,457,500	
グローブライド	5,200	4,275.00	22,230,000	
オカムラ	36,900	1,297.00	47,859,300	
美津濃	10,600	2,174.00	23,044,400	
東京電力ホールディングス	909,900	369.00	335,753,100	
中部電力	328,200	1,425.00	467,685,000	
関西電力	406,400	1,198.00	486,867,200	
中国電力	154,700	1,359.00	210,237,300	
北陸電力	98,100	757.00	74,261,700	
東北電力	251,200	1,045.00	262,504,000	
四国電力	89,200	860.00	76,712,000	
九州電力	236,900	1,092.00	258,694,800	
北海道電力	100,400	505.00	50,702,000	
沖縄電力	20,900	1,551.00	32,415,900	
電源開発	85,400	1,934.00	165,163,600	
エフオン	6,500	1,101.00	7,156,500	
イーレックス	15,700	1,846.00	28,982,200	
レノバ	18,100	3,725.00	67,422,500	
東京瓦斯	206,300	2,462.50	508,013,750	
大阪瓦斯	194,300	2,157.00	419,105,100	
東邦瓦斯	52,800	6,830.00	360,624,000	
北海道瓦斯	5,800	1,604.00	9,303,200	
広島ガス	22,100	416.00	9,193,600	
西部瓦斯	12,100	3,170.00	38,357,000	
静岡ガス	30,500	995.00	30,347,500	
メタウォーター	12,100	2,215.00	26,801,500	
ＳＢＳホールディングス	7,900	2,769.00	21,875,100	
東武鉄道	111,800	2,976.00	332,716,800	
相鉄ホールディングス	36,800	2,479.00	91,227,200	

東急	270,600	1,474.00	398,864,400	
京浜急行電鉄	137,800	1,671.00	230,263,800	
小田急電鉄	171,800	3,025.00	519,695,000	
京王電鉄	59,900	7,440.00	445,656,000	
京成電鉄	80,400	3,620.00	291,048,000	
富士急行	14,600	5,880.00	85,848,000	
新京成電鉄	2,800	2,224.00	6,227,200	
東日本旅客鉄道	188,800	7,839.00	1,480,003,200	
西日本旅客鉄道	95,600	6,135.00	586,506,000	
東海旅客鉄道	89,200	16,550.00	1,476,260,000	
西武ホールディングス	129,300	1,220.00	157,746,000	
鴻池運輸	17,100	1,209.00	20,673,900	
西日本鉄道	29,700	2,957.00	87,822,900	
ハマキョウレックス	8,200	3,245.00	26,609,000	
サカイ引越センター	4,900	4,955.00	24,279,500	
近鉄グループホールディングス	101,600	4,220.00	428,752,000	
阪急阪神ホールディングス	135,500	3,545.00	480,347,500	
南海電気鉄道	48,200	2,542.00	122,524,400	
京阪ホールディングス	45,200	4,600.00	207,920,000	
神戸電鉄	2,400	3,670.00	8,808,000	
名古屋鉄道	83,500	2,633.00	219,855,500	
山陽電気鉄道	7,300	1,888.00	13,782,400	
アルプス物流	7,100	949.00	6,737,900	
日本通運	35,200	8,240.00	290,048,000	
ヤマトホールディングス	142,400	3,035.00	432,184,000	
山九	26,100	4,860.00	126,846,000	
丸運	5,800	285.00	1,653,000	
丸全昭和運輸	8,200	3,245.00	26,609,000	
センコーグループホールディングス	56,000	1,048.00	58,688,000	
トナミホールディングス	2,400	5,390.00	12,936,000	
ニッコンホールディングス	34,100	2,223.00	75,804,300	
日本石油輸送	1,100	2,721.00	2,993,100	
福山通運	13,000	4,560.00	59,280,000	
セイノーホールディングス	76,100	1,542.00	117,346,200	
エスライン	2,800	909.00	2,545,200	
神奈川中央交通	2,500	3,775.00	9,437,500	
日立物流	22,300	3,720.00	82,956,000	
丸和運輸機関	21,400	1,929.00	41,280,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,300	1,809.00	18,632,700	
九州旅客鉄道	78,600	2,574.00	202,316,400	
ＳＧホールディングス	192,000	2,537.00	487,104,000	
日本郵船	85,300	3,775.00	322,007,500	

商船三井	60,600	3,875.00	234,825,000	
川崎汽船	31,300	2,535.00	79,345,500	
ＮＳユナイテッド海運	5,300	1,885.00	9,990,500	
飯野海運	49,000	530.00	25,970,000	
共栄タンカー	2,600	1,010.00	2,626,000	
乾汽船	5,200	1,062.00	5,522,400	
日本航空	247,500	2,470.00	611,325,000	
ＡＮＡホールディングス	274,200	2,572.00	705,242,400	
パスコ	2,000	1,490.00	2,980,000	
トランコム	3,100	8,830.00	27,373,000	
日新	8,100	1,454.00	11,777,400	
三菱倉庫	35,200	3,385.00	119,152,000	
三井倉庫ホールディングス	10,800	2,168.00	23,414,400	
住友倉庫	36,500	1,471.00	53,691,500	
澁澤倉庫	5,600	2,263.00	12,672,800	
東陽倉庫	17,000	346.00	5,882,000	
日本トランスシティ	22,400	561.00	12,566,400	
ケイヒン	2,000	1,400.00	2,800,000	
中央倉庫	6,200	1,131.00	7,012,200	
川西倉庫	1,900	1,235.00	2,346,500	
安田倉庫	8,300	971.00	8,059,300	
ファイズホールディングス	1,800	938.00	1,688,400	
東洋埠頭	3,100	1,575.00	4,882,500	
宇徳	7,200	496.00	3,571,200	
上組	56,700	2,097.00	118,899,900	
サンリツ	2,600	730.00	1,898,000	
キムラユニティー	2,700	1,210.00	3,267,000	
キユーソー流通システム	2,500	1,673.00	4,182,500	
近鉄エクスプレス	19,200	2,873.00	55,161,600	
東海運	5,800	353.00	2,047,400	
エーアイテイー	6,400	1,001.00	6,406,400	
内外トランスライン	3,600	1,427.00	5,137,200	
日本コンセプト	3,200	1,779.00	5,692,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	34,900	1,948.00	67,985,200	
クロスキャット	2,900	1,146.00	3,323,400	
システナ	37,600	2,212.00	83,171,200	
デジタルアーツ	6,100	9,690.00	59,109,000	
日鉄ソリューションズ	15,800	3,510.00	55,458,000	
キューブシステム	5,800	1,176.00	6,820,800	
エイジア	1,700	1,738.00	2,954,600	
コア	4,600	1,511.00	6,950,600	
ラクーンホールディングス	7,500	2,704.00	20,280,000	

ソリトンシステムズ	5,400	1,663.00	8,980,200	
ソフトクリエイトホールディングス	4,200	2,508.00	10,533,600	
ＴＩＳ	105,300	2,641.00	278,097,300	
ＪＮＳホールディングス	5,100	592.00	3,019,200	
電算システム	4,000	3,230.00	12,920,000	
グリー	64,900	559.00	36,279,100	
GMOペパボ	700	7,930.00	5,551,000	
コーエーテクモホールディングス	28,080	4,965.00	139,417,200	
三菱総合研究所	4,600	4,120.00	18,952,000	
電算	1,200	2,577.00	3,092,400	
ＡＧＳ	5,600	842.00	4,715,200	
ファインデックス	9,000	1,086.00	9,774,000	
ブレインパッド	2,800	5,480.00	15,344,000	
ＫＬａｂ	19,200	805.00	15,456,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,100	1,377.00	19,415,700	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	2,691.00	4,843,800	
ネクソン	266,000	3,590.00	954,940,000	
アイスタイル	32,500	478.00	15,535,000	
エムアップホールディングス	2,800	2,935.00	8,218,000	
エイチーム	7,400	1,719.00	12,720,600	
エニグモ	10,100	1,382.00	13,958,200	
テクノスジャパン	8,400	691.00	5,804,400	
コロプラ	34,800	834.00	29,023,200	
ブロードリーフ	52,500	543.00	28,507,500	
クロス・マーケティンググループ	5,100	553.00	2,820,300	
デジタルハーツホールディングス	4,900	1,622.00	7,947,800	
システム情報	8,100	1,051.00	8,513,100	
メディアドゥ	4,000	6,570.00	26,280,000	
じげん	26,500	437.00	11,580,500	
ブイキューブ	5,800	2,660.00	15,428,000	
エンカレッジ・テクノロジ	2,100	660.00	1,386,000	
サイバーリンクス	3,500	1,649.00	5,771,500	
フィックスターズ	11,400	1,033.00	11,776,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,532.00	6,740,800	
オプティム	7,400	2,973.00	22,000,200	
セレス	3,500	4,675.00	16,362,500	
ＳＨＩＦＴ	4,700	13,090.00	61,523,000	
ティーガイア	11,300	1,917.00	21,662,100	
セック	1,600	2,791.00	4,465,600	
日本アジアグループ	10,200	977.00	9,965,400	
テクマトリックス	16,400	1,967.00	32,258,800	
プロシップ	3,200	1,336.00	4,275,200	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	2,186.00	55,743,000	
GMOペイメントゲートウェイ	22,400	14,680.00	328,832,000	
ザッパラス	4,500	444.00	1,998,000	
システムリサーチ	3,200	2,080.00	6,656,000	
インターネットイニシアティブ	28,100	2,598.00	73,003,800	
さくらインターネット	11,500	782.00	8,993,000	
ヴィンクス	3,100	1,103.00	3,419,300	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	6,790.00	16,296,000	
ＳＲＡホールディングス	5,700	2,711.00	15,452,700	
システムインテグレータ	3,200	685.00	2,192,000	
朝日ネット	8,800	809.00	7,119,200	
ｅＢＡＳＥ	12,800	945.00	12,096,000	
アバント	11,400	1,655.00	18,867,000	
アドソル日進	3,800	2,848.00	10,822,400	
ＯＤＫソリューションズ	1,900	752.00	1,428,800	
フリービット	6,400	1,001.00	6,406,400	
コムチュア	9,700	2,670.00	25,899,000	
サイバーコム	2,000	1,576.00	3,152,000	
アステリア	7,800	838.00	6,536,400	
アイル	5,900	1,649.00	9,729,100	
マークラインズ	4,500	2,500.00	11,250,000	
メディカル・データ・ビジョン	12,100	2,139.00	25,881,900	
ｇｕｍｉ	14,800	909.00	13,453,200	
ショーケース	2,400	966.00	2,318,400	
モバイルファクトリー	2,500	1,517.00	3,792,500	
テラスカイ	3,500	3,355.00	11,742,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	2,294.00	10,781,800	
ＰＣＩホールディングス	4,100	1,448.00	5,936,800	
パイプドＨＤ	2,300	1,855.00	4,266,500	
アイビーシー	1,900	1,007.00	1,913,300	
ネオジャパン	2,100	1,655.00	3,475,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,300	3,530.00	8,119,000	
ランドコンピュータ	1,700	1,128.00	1,917,600	
ダブルスタンダード	1,400	4,130.00	5,782,000	
オープンドア	6,300	1,835.00	11,560,500	
マイネット	3,400	857.00	2,913,800	
アカツキ	4,200	4,475.00	18,795,000	
ベネフィットジャパン	900	1,803.00	1,622,700	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,800	3,075.00	8,610,000	
カナミックネットワーク	9,900	741.00	7,335,900	
ノムラシステムコーポレーション	5,100	317.00	1,616,700	
チェンジ	14,800	3,555.00	52,614,000	

シンクロ・フード	6,700	394.00	2,639,800	
オークネット	5,700	1,370.00	7,809,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,400	1,230.00	1,722,000	
セグエグループ	2,800	1,291.00	3,614,800	
エイトレッド	2,100	2,274.00	4,775,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11,000	706.00	7,766,000	
マクロミル	21,700	958.00	20,788,600	
ビーグリー	2,200	1,503.00	3,306,600	
オロ	3,400	3,805.00	12,937,000	
ユーザーローカル	1,600	4,600.00	7,360,000	
テモナ	2,500	846.00	2,115,000	
ニーズウェル	2,300	674.00	1,550,200	
サインポスト	2,600	1,277.00	3,320,200	
ソルクシーズ	4,200	924.00	3,880,800	
フェイス	3,500	802.00	2,807,000	
プロトコーポレーション	9,600	1,171.00	11,241,600	
ハイマックス	3,100	1,240.00	3,844,000	
野村総合研究所	192,100	3,425.00	657,942,500	
サイバネットシステム	7,700	876.00	6,745,200	
ＣＥホールディングス	5,900	562.00	3,315,800	
日本システム技術	2,000	1,520.00	3,040,000	
インテージホールディングス	13,300	1,301.00	17,303,300	
東邦システムサイエンス	3,000	965.00	2,895,000	
ソースネクスト	50,400	365.00	18,396,000	
インフォコム	9,700	2,814.00	27,295,800	
ＨＥＲＯＺ	3,000	2,972.00	8,916,000	
ラクスル	8,600	5,160.00	44,376,000	
ＩＰＳ	1,900	2,845.00	5,405,500	
ＦＩＧ	12,100	274.00	3,315,400	
システムサポート	3,200	1,574.00	5,036,800	
イーソル	5,900	1,257.00	7,416,300	
アルテリア・ネットワークス	11,800	1,642.00	19,375,600	
ＥｄｕＬａｂ	1,000	8,230.00	8,230,000	
東海ソフト	1,400	1,209.00	1,692,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,900	2,100.00	3,990,000	
サーバーワークス	800	4,355.00	3,484,000	
東名	700	1,162.00	813,400	
ヴィッツ	500	2,147.00	1,073,500	
トビラシステムズ	1,200	1,441.00	1,729,200	
Ｓａｎｓａｎ	7,000	9,510.00	66,570,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	800	1,162.00	929,600	
ギフティ	4,800	3,490.00	16,752,000	

ベース	900	5,720.00	5,148,000	
フォーカスシステムズ	7,200	987.00	7,106,400	
クレスコ	7,300	1,613.00	11,774,900	
フジ・メディア・ホールディングス	109,300	1,355.00	148,101,500	
オービック	33,200	20,230.00	671,636,000	
ジャストシステム	15,000	6,050.00	90,750,000	
ＴＤＣソフト	9,400	1,019.00	9,578,600	
Ｚホールディングス	1,446,500	550.60	796,442,900	
トレンドマイクロ	56,300	5,540.00	311,902,000	
ＩＤホールディングス	4,200	1,275.00	5,355,000	
日本オラクル	21,400	10,800.00	231,120,000	
アルファシステムズ	2,900	3,600.00	10,440,000	
フューチャー	12,800	2,000.00	25,600,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,000	1,437.00	10,059,000	
ＳＢテクノロジー	3,800	3,210.00	12,198,000	
トーセ	3,100	840.00	2,604,000	
オービックビジネスコンサルタント	10,800	5,800.00	62,640,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,000	3,565.00	171,120,000	
アイティフォー	13,900	830.00	11,537,000	
東計電算	1,600	4,550.00	7,280,000	
エックスネット	1,800	1,075.00	1,935,000	
大塚商会	57,000	5,180.00	295,260,000	
サイボウズ	12,400	2,232.00	27,676,800	
電通国際情報サービス	13,100	3,915.00	51,286,500	
ＡＣＣＥＳＳ	10,100	834.00	8,423,400	
デジタルガレージ	17,400	4,505.00	78,387,000	
ＥＭシステムズ	17,600	848.00	14,924,800	
ウェザーニューズ	3,200	5,270.00	16,864,000	
ＣＩＪ	7,400	905.00	6,697,000	
ビジネスエンジニアリング	1,100	3,470.00	3,817,000	
日本エンタープライズ	11,400	273.00	3,112,200	
WOWOW	5,100	2,812.00	14,341,200	
スカラ	9,600	745.00	7,152,000	
インテリジェント　ウェイブ	6,400	699.00	4,473,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,300	540.00	5,022,000	
ネットワンシステムズ	43,000	3,535.00	152,005,000	
システムソフト	23,800	167.00	3,974,600	
アルゴグラフィックス	8,300	3,175.00	26,352,500	
マーベラス	16,800	861.00	14,464,800	
エイベックス	18,200	1,367.00	24,879,400	
日本ユニシス	36,600	3,410.00	124,806,000	
兼松エレクトロニクス	5,800	3,730.00	21,634,000	

都築電気	4,000	1,657.00	6,628,000	
ＴＢＳホールディングス	69,900	2,172.00	151,822,800	
日本テレビホールディングス	88,000	1,454.00	127,952,000	
朝日放送グループホールディングス	10,700	727.00	7,778,900	
テレビ朝日ホールディングス	32,600	2,081.00	67,840,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	69,700	492.00	34,292,400	
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,386.00	18,372,200	
日本ＢＳ放送	3,700	1,105.00	4,088,500	
ビジョン	13,200	1,105.00	14,586,000	
スマートバリュー	2,900	846.00	2,453,400	
ワイヤレスゲート	4,600	448.00	2,060,800	
コネクシオ	6,100	1,388.00	8,466,800	
クロップス	2,100	920.00	1,932,000	
日本電信電話	1,231,300	2,842.00	3,499,354,600	
ＫＤＤＩ	844,200	3,395.00	2,866,059,000	
ソフトバンク	956,800	1,438.50	1,376,356,800	
光通信	12,400	22,270.00	276,148,000	
エムティーアイ	10,400	808.00	8,403,200	
GMOインターネット	37,800	3,170.00	119,826,000	
ファイバーゲート	3,500	1,852.00	6,482,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	481.00	1,491,100	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	28,400	4,295.00	121,978,000	
学研ホールディングス	14,300	1,459.00	20,863,700	
ゼンリン	19,200	1,325.00	25,440,000	
昭文社ホールディングス	4,600	479.00	2,203,400	
インプレスホールディングス	8,700	247.00	2,148,900	
アイネット	5,500	1,523.00	8,376,500	
松竹	7,000	13,720.00	96,040,000	
東宝	62,200	4,490.00	279,278,000	
東映	3,500	23,890.00	83,615,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	280,400	1,713.00	480,325,200	
ピー・シー・エー	1,600	4,255.00	6,808,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,931.00	7,144,700	
ＤＴＳ	21,900	2,526.00	55,319,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,900	6,150.00	276,135,000	
シーイーシー	11,400	1,437.00	16,381,800	
カプコン	90,200	3,595.00	324,269,000	
アイ・エス・ビー	5,000	1,253.00	6,265,000	
ジャステック	6,900	1,206.00	8,321,400	
ＳＣＳＫ	24,300	6,560.00	159,408,000	
日本システムウエア	3,600	2,087.00	7,513,200	
アイネス	10,500	1,329.00	13,954,500	

ＴＫＣ	17,800	3,520.00	62,656,000	
富士ソフト	11,300	5,730.00	64,749,000	
ＮＳＤ	33,900	1,841.00	62,409,900	
コナミホールディングス	38,300	6,590.00	252,397,000	
福井コンピュータホールディングス	4,900	3,965.00	19,428,500	
ＪＢＣＣホールディングス	7,200	1,482.00	10,670,400	
ミロク情報サービス	10,500	2,061.00	21,640,500	
ソフトバンクグループ	835,300	9,330.00	7,793,349,000	
ホウスイ	900	1,009.00	908,100	
高千穂交易	4,100	1,125.00	4,612,500	
オルバヘルスケアホールディングス	1,700	1,698.00	2,886,600	
伊藤忠食品	2,600	5,490.00	14,274,000	
エレマテック	8,500	1,018.00	8,653,000	
ＪＡＬＵＸ	3,000	1,634.00	4,902,000	
あらた	8,400	4,905.00	41,202,000	
トーメンデバイス	1,400	4,020.00	5,628,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,500	3,895.00	13,632,500	
フィールズ	9,200	576.00	5,299,200	
双日	583,500	312.00	182,052,000	
アルフレッサ　ホールディングス	109,600	2,133.00	233,776,800	
横浜冷凍	27,700	913.00	25,290,100	
ラサ商事	5,600	941.00	5,269,600	
アルコニックス	11,300	1,654.00	18,690,200	
神戸物産	72,900	2,965.00	216,148,500	
ハイパー	1,700	554.00	941,800	
あい　ホールディングス	15,100	2,193.00	33,114,300	
ディーブイエックス	3,400	1,065.00	3,621,000	
ダイワボウホールディングス	48,000	1,682.00	80,736,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,200	2,209.00	55,666,800	
ラクト・ジャパン	4,600	2,825.00	12,995,000	
グリムス	2,400	1,902.00	4,564,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,400	789.00	14,517,600	
八洲電機	8,200	997.00	8,175,400	
メディアスホールディングス	6,000	938.00	5,628,000	
レスターホールディングス	11,000	2,040.00	22,440,000	
ジューテックホールディングス	2,400	1,041.00	2,498,400	
大光	4,100	696.00	2,853,600	
ＯＣＨＩホールディングス	3,100	1,318.00	4,085,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	51,200	956.00	48,947,200	
黒谷	2,900	809.00	2,346,100	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,900	785.00	1,491,500	
三洋貿易	10,700	1,153.00	12,337,100	

ビューティガレージ	1,700	3,840.00	6,528,000	
ウイン・パートナーズ	7,600	1,052.00	7,995,200	
ミタチ産業	2,900	684.00	1,983,600	
シップヘルスケアホールディングス	37,200	3,110.00	115,692,000	
明治電機工業	3,600	1,492.00	5,371,200	
デリカフーズホールディングス	4,100	670.00	2,747,000	
スターティアホールディングス	2,100	1,248.00	2,620,800	
コメダホールディングス	23,100	2,015.00	46,546,500	
ピーバンドットコム	1,400	828.00	1,159,200	
アセンテック	2,700	1,645.00	4,441,500	
富士興産	3,200	1,219.00	3,900,800	
協栄産業	1,200	1,383.00	1,659,600	
小野建	9,500	1,382.00	13,129,000	
南陽	2,200	1,697.00	3,733,400	
佐鳥電機	6,600	801.00	5,286,600	
エコートレーディング	2,300	672.00	1,545,600	
伯東	6,500	1,280.00	8,320,000	
コンドーテック	8,200	1,069.00	8,765,800	
中山福	6,100	492.00	3,001,200	
ナガイレーベン	14,000	2,740.00	38,360,000	
三菱食品	11,600	3,095.00	35,902,000	
松田産業	7,700	2,036.00	15,677,200	
第一興商	15,700	4,290.00	67,353,000	
メディパルホールディングス	105,900	2,124.00	224,931,600	
ＳＰＫ	4,600	1,292.00	5,943,200	
萩原電気ホールディングス	3,900	2,629.00	10,253,100	
アズワン	7,600	13,910.00	105,716,000	
スズデン	3,700	1,297.00	4,798,900	
尾家産業	3,100	1,408.00	4,364,800	
シモジマ	6,500	1,289.00	8,378,500	
ドウシシャ	10,000	1,871.00	18,710,000	
小津産業	2,300	2,016.00	4,636,800	
高速	5,600	1,490.00	8,344,000	
たけびし	3,700	1,505.00	5,568,500	
リックス	2,400	1,552.00	3,724,800	
丸文	9,400	530.00	4,982,000	
ハピネット	8,800	1,535.00	13,508,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	2,730.00	5,733,000	
日本ライフライン	34,200	1,401.00	47,914,200	
タカショー	6,900	764.00	5,271,600	
マルカ	3,400	2,017.00	6,857,800	
ＩＤＯＭ	35,600	721.00	25,667,600	

進和	6,300	2,175.00	13,702,500	
エスケイジャパン	2,600	464.00	1,206,400	
ダイトロン	4,500	1,801.00	8,104,500	
シークス	13,400	1,632.00	21,868,800	
田中商事	3,300	690.00	2,277,000	
オーハシテクニカ	5,400	1,571.00	8,483,400	
白銅	3,800	1,782.00	6,771,600	
ダイコー通産	1,000	1,727.00	1,727,000	
伊藤忠商事	739,000	3,587.00	2,650,793,000	
丸紅	1,041,900	920.80	959,381,520	
高島	1,700	1,778.00	3,022,600	
長瀬産業	59,400	1,729.00	102,702,600	
蝶理	6,800	1,685.00	11,458,000	
豊田通商	106,100	4,645.00	492,834,500	
三共生興	16,000	550.00	8,800,000	
兼松	42,200	1,486.00	62,709,200	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,512.00	2,721,600	
三井物産	857,800	2,302.00	1,974,655,600	
日本紙パルプ商事	5,500	3,650.00	20,075,000	
カメイ	13,800	1,242.00	17,139,600	
東都水産	1,200	4,410.00	5,292,000	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,978.00	5,062,600	
スターゼン	7,800	2,428.00	18,938,400	
山善	41,300	1,042.00	43,034,600	
椿本興業	2,000	3,800.00	7,600,000	
住友商事	666,800	1,577.00	1,051,543,600	
内田洋行	4,200	4,925.00	20,685,000	
三菱商事	643,300	3,130.00	2,013,529,000	
第一実業	4,800	4,180.00	20,064,000	
キヤノンマーケティングジャパン	26,200	2,456.00	64,347,200	
西華産業	5,600	1,546.00	8,657,600	
佐藤商事	8,700	1,086.00	9,448,200	
菱洋エレクトロ	8,000	2,670.00	21,360,000	
東京産業	9,600	646.00	6,201,600	
ユアサ商事	10,800	3,120.00	33,696,000	
神鋼商事	2,400	2,251.00	5,402,400	
トルク	6,400	264.00	1,689,600	
阪和興業	21,200	3,395.00	71,974,000	
正栄食品工業	6,800	4,540.00	30,872,000	
カナデン	8,600	1,213.00	10,431,800	
菱電商事	7,600	1,649.00	12,532,400	
フルサト工業	5,400	1,366.00	7,376,400	

岩谷産業	25,400	6,830.00	173,482,000	
ナイス	4,200	1,881.00	7,900,200	
昭光通商	3,400	797.00	2,709,800	
ニチモウ	1,700	2,124.00	3,610,800	
極東貿易	3,000	1,497.00	4,491,000	
イワキ	14,000	646.00	9,044,000	
三愛石油	26,000	1,313.00	34,138,000	
稲畑産業	25,400	1,658.00	42,113,200	
ＧＳＩクレオス	5,200	1,276.00	6,635,200	
明和産業	9,800	491.00	4,811,800	
クワザワホールディングス	3,800	687.00	2,610,600	
ヤマエ久野	7,700	1,171.00	9,016,700	
ワキタ	20,800	999.00	20,779,200	
東邦ホールディングス	33,900	2,030.00	68,817,000	
サンゲツ	28,500	1,677.00	47,794,500	
ミツウロコグループホールディングス	15,600	1,357.00	21,169,200	
シナネンホールディングス	3,900	3,045.00	11,875,500	
伊藤忠エネクス	23,400	1,092.00	25,552,800	
サンリオ	29,700	1,754.00	52,093,800	
サンワテクノス	7,000	1,081.00	7,567,000	
リョーサン	11,700	2,259.00	26,430,300	
新光商事	14,300	800.00	11,440,000	
トーホー	4,800	1,887.00	9,057,600	
三信電気	5,700	2,005.00	11,428,500	
東陽テクニカ	11,300	1,071.00	12,102,300	
モスフードサービス	14,900	3,250.00	48,425,000	
加賀電子	9,600	2,480.00	23,808,000	
ソーダニッカ	10,100	574.00	5,797,400	
立花エレテック	7,800	1,614.00	12,589,200	
フォーバル	3,700	875.00	3,237,500	
ＰＡＬＴＡＣ	16,900	5,990.00	101,231,000	
三谷産業	14,000	429.00	6,006,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,400	3,270.00	7,848,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,195.00	2,195,000	
コーア商事ホールディングス	3,000	1,586.00	4,758,000	
国際紙パルプ商事	22,600	255.00	5,763,000	
ヤマタネ	4,600	1,520.00	6,992,000	
丸紅建材リース	1,000	1,927.00	1,927,000	
日鉄物産	7,500	4,055.00	30,412,500	
泉州電業	3,000	3,600.00	10,800,000	
トラスコ中山	24,200	2,938.00	71,099,600	
オートバックスセブン	39,200	1,500.00	58,800,000	

モリト	7,700	645.00	4,966,500	
加藤産業	15,300	3,575.00	54,697,500	
北恵	2,700	937.00	2,529,900	
イノテック	6,000	1,328.00	7,968,000	
イエローハット	20,000	1,893.00	37,860,000	
ＪＫホールディングス	9,600	878.00	8,428,800	
日伝	8,800	2,190.00	19,272,000	
北沢産業	7,300	267.00	1,949,100	
杉本商事	5,300	2,368.00	12,550,400	
因幡電機産業	28,200	2,668.00	75,237,600	
東テク	3,500	2,903.00	10,160,500	
ミスミグループ本社	132,500	3,215.00	425,987,500	
アルテック	7,800	351.00	2,737,800	
タキヒヨー	3,500	1,876.00	6,566,000	
蔵王産業	2,100	1,419.00	2,979,900	
スズケン	44,800	4,325.00	193,760,000	
ジェコス	7,300	963.00	7,029,900	
グローセル	11,500	444.00	5,106,000	
ローソン	26,700	5,430.00	144,981,000	
サンエー	8,000	4,605.00	36,840,000	
カワチ薬品	7,500	2,881.00	21,607,500	
エービーシー・マート	16,500	6,240.00	102,960,000	
ハードオフコーポレーション	4,900	833.00	4,081,700	
アスクル	9,300	4,230.00	39,339,000	
ゲオホールディングス	14,300	1,188.00	16,988,400	
アダストリア	14,800	2,029.00	30,029,200	
くら寿司	6,200	7,450.00	46,190,000	
キャンドゥ	5,200	2,012.00	10,462,400	
アイケイ	2,600	891.00	2,316,600	
パルグループホールディングス	9,400	1,530.00	14,382,000	
エディオン	45,000	1,239.00	55,755,000	
サーラコーポレーション	21,800	613.00	13,363,400	
ワッツ	4,900	912.00	4,468,800	
ハローズ	4,100	2,907.00	11,918,700	
フジオフードグループ本社	8,900	1,365.00	12,148,500	
あみやき亭	2,400	2,969.00	7,125,600	
大黒天物産	2,600	7,270.00	18,902,000	
ハニーズホールディングス	8,600	1,082.00	9,305,200	
ファーマライズホールディングス	2,900	800.00	2,320,000	
アルペン	8,200	2,374.00	19,466,800	
ハブ	3,700	682.00	2,523,400	
クオールホールディングス	14,400	1,556.00	22,406,400	

ジンズホールディングス	5,600	7,870.00	44,072,000	
ビックカメラ	62,900	1,240.00	77,996,000	
ＤＣＭホールディングス	65,400	1,158.00	75,733,200	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	150,400	2,994.00	450,297,600	
東京一番フーズ	3,100	591.00	1,832,100	
きちりホールディングス	3,200	595.00	1,904,000	
アークランドサービスホールディングス	8,900	2,181.00	19,410,900	
Ｊ．フロント　リテイリング	126,400	1,051.00	132,846,400	
ドトール・日レスホールディングス	16,900	1,720.00	29,068,000	
マツモトキヨシホールディングス	43,700	4,930.00	215,441,000	
ブロンコビリー	5,600	2,367.00	13,255,200	
ＺＯＺＯ	62,400	3,270.00	204,048,000	
トレジャー・ファクトリー	3,300	1,094.00	3,610,200	
物語コーポレーション	5,600	7,200.00	40,320,000	
ココカラファイン	9,400	8,510.00	79,994,000	
三越伊勢丹ホールディングス	185,100	778.00	144,007,800	
Ｈａｍｅｅ	2,800	1,635.00	4,578,000	
マーケットエンタープライズ	800	1,600.00	1,280,000	
ウエルシアホールディングス	55,900	3,800.00	212,420,000	
クリエイトＳＤホールディングス	15,600	3,600.00	56,160,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,300	389.00	4,784,700	
ティーライフ	1,700	1,357.00	2,306,900	
チムニー	3,200	1,316.00	4,211,200	
シュッピン	7,400	1,023.00	7,570,200	
オイシックス・ラ・大地	10,500	2,915.00	30,607,500	
ネクステージ	18,300	1,886.00	34,513,800	
ジョイフル本田	31,100	1,435.00	44,628,500	
鳥貴族ホールディングス	3,200	1,645.00	5,264,000	
ホットランド	8,100	1,288.00	10,432,800	
すかいらーくホールディングス	118,600	1,656.00	196,401,600	
ＳＦＰホールディングス	5,200	1,408.00	7,321,600	
綿半ホールディングス	8,100	1,301.00	10,538,100	
ヨシックス	2,200	2,136.00	4,699,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,900	1,166.00	36,029,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	1,294.00	7,375,800	
ＢＥＥＮＯＳ	5,000	2,908.00	14,540,000	
あさひ	8,000	1,604.00	12,832,000	
日本調剤	6,500	1,785.00	11,602,500	
コスモス薬品	10,700	17,270.00	184,789,000	
トーエル	5,400	934.00	5,043,600	
オンリー	2,300	478.00	1,099,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	413,400	4,463.00	1,845,004,200	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	56,800	863.00	49,018,400	
ツルハホールディングス	23,100	14,280.00	329,868,000	
サンマルクホールディングス	8,500	1,721.00	14,628,500	
フェリシモ	2,500	1,389.00	3,472,500	
トリドールホールディングス	26,300	1,660.00	43,658,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,800	703.00	6,889,400	
ウイルプラスホールディングス	1,800	1,413.00	2,543,400	
ＪＭホールディングス	8,100	2,275.00	18,427,500	
サツドラホールディングス	1,700	2,234.00	3,797,800	
アレンザホールディングス	6,200	1,329.00	8,239,800	
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,855.00	5,379,500	
バロックジャパンリミテッド	7,600	787.00	5,981,200	
クスリのアオキホールディングス	10,500	8,480.00	89,040,000	
力の源ホールディングス	4,800	624.00	2,995,200	
スシローグローバルホールディングス	58,000	4,890.00	283,620,000	
メディカルシステムネットワーク	9,500	712.00	6,764,000	
はるやまホールディングス	5,300	682.00	3,614,600	
ノジマ	18,900	2,812.00	53,146,800	
カッパ・クリエイト	14,800	1,481.00	21,918,800	
ライトオン	7,900	696.00	5,498,400	
良品計画	140,400	2,618.00	367,567,200	
三城ホールディングス	13,500	290.00	3,915,000	
アドヴァン	11,000	1,017.00	11,187,000	
アルビス	3,500	2,461.00	8,613,500	
コナカ	12,400	332.00	4,116,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,674.00	2,343,600	
Ｇ－７ホールディングス	6,300	2,639.00	16,625,700	
イオン北海道	14,000	1,212.00	16,968,000	
コジマ	18,500	706.00	13,061,000	
ヒマラヤ	3,900	991.00	3,864,900	
コーナン商事	15,100	3,185.00	48,093,500	
エコス	4,000	1,953.00	7,812,000	
ワタミ	13,900	1,004.00	13,955,600	
マルシェ	2,800	493.00	1,380,400	
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	211,200	2,611.00	551,443,200	
西松屋チェーン	23,300	1,672.00	38,957,600	
ゼンショーホールディングス	56,800	2,831.00	160,800,800	
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,712.00	11,470,400	
ハークスレイ	2,500	910.00	2,275,000	
サイゼリヤ	15,800	2,275.00	35,945,000	
ＶＴホールディングス	40,300	446.00	17,973,800	

魚力	3,400	1,918.00	6,521,200	
フジ・コーポレーション	2,900	2,559.00	7,421,100	
ユナイテッドアローズ	12,200	2,106.00	25,693,200	
ハイデイ日高	15,400	1,797.00	27,673,800	
京都きもの友禅	7,600	282.00	2,143,200	
コロワイド	35,100	1,900.00	66,690,000	
ピーシーデポコーポレーション	12,800	495.00	6,336,000	
壱番屋	7,500	4,820.00	36,150,000	
ＰＬＡＮＴ	3,000	746.00	2,238,000	
スギホールディングス	21,100	8,770.00	185,047,000	
薬王堂ホールディングス	4,700	2,795.00	13,136,500	
スクロール	15,300	1,087.00	16,631,100	
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,925.00	19,057,500	
木曽路	13,900	2,335.00	32,456,500	
ＳＲＳホールディングス	13,500	859.00	11,596,500	
リテールパートナーズ	13,000	1,390.00	18,070,000	
ケーヨー	19,700	733.00	14,440,100	
上新電機	12,500	3,160.00	39,500,000	
日本瓦斯	52,500	1,926.00	101,115,000	
ロイヤルホールディングス	18,400	2,002.00	36,836,800	
いなげや	11,900	1,656.00	19,706,400	
チヨダ	11,300	991.00	11,198,300	
ライフコーポレーション	8,000	3,375.00	27,000,000	
リンガーハット	13,000	2,275.00	29,575,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,900	719.00	10,713,100	
ＡＯＫＩホールディングス	21,500	617.00	13,265,500	
オークワ	16,700	1,210.00	20,207,000	
コメリ	16,400	3,085.00	50,594,000	
青山商事	23,800	827.00	19,682,600	
しまむら	12,300	12,770.00	157,071,000	
はせがわ	6,400	303.00	1,939,200	
高島屋	77,100	1,181.00	91,055,100	
松屋	23,200	918.00	21,297,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	50,200	916.00	45,983,200	
近鉄百貨店	4,100	3,250.00	13,325,000	
丸井グループ	89,400	2,079.00	185,862,600	
アクシアル　リテイリング	8,800	4,815.00	42,372,000	
イオン	406,600	3,299.00	1,341,373,400	
イズミ	21,500	4,335.00	93,202,500	
平和堂	19,600	2,244.00	43,982,400	
フジ	12,800	2,149.00	27,507,200	
ヤオコー	12,000	6,800.00	81,600,000	

ゼビオホールディングス	13,000	936.00	12,168,000	
ケーズホールディングス	94,300	1,521.00	143,430,300	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,700	852.00	4,856,400	
日産東京販売ホールディングス	16,500	259.00	4,273,500	
シルバーライフ	1,500	2,123.00	3,184,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,700	3,820.00	17,954,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,200	1,312.00	2,886,400	
ブックオフグループホールディングス	6,200	995.00	6,169,000	
ギフト	1,100	2,090.00	2,299,000	
アインホールディングス	15,400	7,140.00	109,956,000	
元気寿司	3,000	2,643.00	7,929,000	
ヤマダホールディングス	354,500	597.00	211,636,500	
アークランドサカモト	16,700	1,700.00	28,390,000	
ニトリホールディングス	41,900	21,425.00	897,707,500	
グルメ杵屋	7,800	964.00	7,519,200	
愛眼	8,400	231.00	1,940,400	
ケーユーホールディングス	5,800	972.00	5,637,600	
吉野家ホールディングス	34,800	2,200.00	76,560,000	
松屋フーズホールディングス	5,200	3,500.00	18,200,000	
サガミホールディングス	14,500	1,137.00	16,486,500	
関西スーパーマーケット	8,200	1,123.00	9,208,600	
王将フードサービス	7,000	5,820.00	40,740,000	
プレナス	12,000	1,891.00	22,692,000	
ミニストップ	7,900	1,457.00	11,510,300	
アークス	20,300	2,391.00	48,537,300	
バローホールディングス	21,700	2,487.00	53,967,900	
ベルク	5,300	6,170.00	32,701,000	
大庄	5,900	977.00	5,764,300	
ファーストリテイリング	14,100	88,130.00	1,242,633,000	
サンドラッグ	39,800	4,050.00	161,190,000	
サックスバー　ホールディングス	9,300	605.00	5,626,500	
ヤマザワ	2,600	1,742.00	4,529,200	
やまや	2,200	2,454.00	5,398,800	
ベルーナ	22,900	1,298.00	29,724,200	
島根銀行	3,600	734.00	2,642,400	
じもとホールディングス	7,100	795.00	5,644,500	
めぶきフィナンシャルグループ	549,800	261.00	143,497,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,300	1,400.00	18,620,000	
九州フィナンシャルグループ	216,100	475.00	102,647,500	
ゆうちょ銀行	299,800	1,064.00	318,987,200	
富山第一銀行	25,200	314.00	7,912,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	644,600	449.00	289,425,400	

西日本フィナンシャルホールディングス	70,400	795.00	55,968,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	49,700	637.00	31,658,900	
三十三フィナンシャルグループ	9,200	1,392.00	12,806,400	
第四北越フィナンシャルグループ	17,200	2,610.00	44,892,000	
ひろぎんホールディングス	156,100	677.00	105,679,700	
新生銀行	86,300	1,789.00	154,390,700	
あおぞら銀行	63,000	2,534.00	159,642,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,237,700	591.70	4,282,547,090	
りそなホールディングス	1,150,500	464.80	534,752,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	200,000	3,859.00	771,800,000	
三井住友フィナンシャルグループ	732,200	4,007.00	2,933,925,400	
千葉銀行	353,100	725.00	255,997,500	
群馬銀行	217,800	397.00	86,466,600	
武蔵野銀行	15,800	1,827.00	28,866,600	
千葉興業銀行	26,900	297.00	7,989,300	
筑波銀行	44,000	184.00	8,096,000	
七十七銀行	33,200	1,561.00	51,825,200	
青森銀行	8,200	2,525.00	20,705,000	
秋田銀行	6,300	1,465.00	9,229,500	
山形銀行	11,900	1,136.00	13,518,400	
岩手銀行	6,900	2,389.00	16,484,100	
東邦銀行	94,600	246.00	23,271,600	
東北銀行	5,100	1,143.00	5,829,300	
みちのく銀行	6,800	1,087.00	7,391,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	95,500	2,099.00	200,454,500	
静岡銀行	257,700	870.00	224,199,000	
十六銀行	13,300	2,209.00	29,379,700	
スルガ銀行	92,800	427.00	39,625,600	
八十二銀行	238,300	403.00	96,034,900	
山梨中央銀行	12,300	919.00	11,303,700	
大垣共立銀行	20,900	2,227.00	46,544,300	
福井銀行	9,000	1,960.00	17,640,000	
北國銀行	9,800	2,823.00	27,665,400	
清水銀行	4,400	1,695.00	7,458,000	
富山銀行	2,000	3,190.00	6,380,000	
滋賀銀行	21,200	2,396.00	50,795,200	
南都銀行	15,400	1,972.00	30,368,800	
百五銀行	95,200	334.00	31,796,800	
京都銀行	37,900	6,810.00	258,099,000	
紀陽銀行	37,500	1,657.00	62,137,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	70,400	1,029.00	72,441,600	
山陰合同銀行	66,700	561.00	37,418,700	

中国銀行	91,100	935.00	85,178,500	
鳥取銀行	3,400	1,143.00	3,886,200	
伊予銀行	140,200	664.00	93,092,800	
百十四銀行	11,200	1,690.00	18,928,000	
四国銀行	15,000	782.00	11,730,000	
阿波銀行	16,200	2,492.00	40,370,400	
大分銀行	6,100	2,154.00	13,139,400	
宮崎銀行	6,600	2,337.00	15,424,200	
佐賀銀行	6,000	1,476.00	8,856,000	
沖縄銀行	9,700	3,050.00	29,585,000	
琉球銀行	23,000	780.00	17,940,000	
セブン銀行	353,500	253.00	89,435,500	
みずほフィナンシャルグループ	1,437,700	1,599.00	2,298,882,300	
高知銀行	3,800	850.00	3,230,000	
山口フィナンシャルグループ	132,100	736.00	97,225,600	
長野銀行	3,500	1,386.00	4,851,000	
名古屋銀行	8,500	3,150.00	26,775,000	
北洋銀行	159,500	320.00	51,040,000	
愛知銀行	3,600	3,020.00	10,872,000	
中京銀行	3,800	1,758.00	6,680,400	
大光銀行	3,600	1,505.00	5,418,000	
愛媛銀行	14,800	1,025.00	15,170,000	
トマト銀行	4,100	1,141.00	4,678,100	
京葉銀行	45,100	458.00	20,655,800	
栃木銀行	51,100	190.00	9,709,000	
北日本銀行	3,300	2,004.00	6,613,200	
東和銀行	18,600	688.00	12,796,800	
福島銀行	12,100	263.00	3,182,300	
大東銀行	5,100	701.00	3,575,100	
トモニホールディングス	81,800	324.00	26,503,200	
フィデアホールディングス	102,700	137.00	14,069,900	
池田泉州ホールディングス	121,700	178.00	21,662,600	
ＦＰＧ	32,900	722.00	23,753,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,500	1,678.00	9,229,000	
マーキュリアインベストメント	4,300	800.00	3,440,000	
ＳＢＩホールディングス	129,800	3,000.00	389,400,000	
ジャフコ　グループ	16,300	6,580.00	107,254,000	
大和証券グループ本社	792,700	572.10	453,503,670	
野村ホールディングス	1,615,700	581.40	939,367,980	
岡三証券グループ	90,500	451.00	40,815,500	
丸三証券	31,600	643.00	20,318,800	
東洋証券	35,600	194.00	6,906,400	

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	113,200	405.00	45,846,000	
光世証券	2,700	785.00	2,119,500	
水戸証券	28,700	322.00	9,241,400	
いちよし証券	21,400	614.00	13,139,600	
松井証券	52,000	901.00	46,852,000	
マネックスグループ	95,000	934.00	88,730,000	
極東証券	14,400	869.00	12,513,600	
岩井コスモホールディングス	10,900	1,767.00	19,260,300	
藍澤證券	19,100	1,002.00	19,138,200	
マネーパートナーズグループ	11,800	259.00	3,056,200	
スパークス・グループ	49,300	298.00	14,691,400	
かんぽ生命保険	131,200	2,274.00	298,348,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	186,500	4,242.00	791,133,000	
アニコム　ホールディングス	29,800	1,006.00	29,978,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	257,000	3,249.00	834,993,000	
第一生命ホールディングス	559,000	1,902.00	1,063,218,000	
東京海上ホールディングス	350,700	5,265.00	1,846,435,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	316,200	1,426.00	450,901,200	
アドバンスクリエイト	4,400	1,079.00	4,747,600	
全国保証	27,500	5,080.00	139,700,000	
イントラスト	3,100	684.00	2,120,400	
日本モーゲージサービス	5,500	1,176.00	6,468,000	
Ｃａｓａ	3,100	999.00	3,096,900	
アルヒ	15,700	1,805.00	28,338,500	
プレミアグループ	4,900	2,413.00	11,823,700	
クレディセゾン	61,800	1,328.00	82,070,400	
芙蓉総合リース	11,100	7,620.00	84,582,000	
みずほリース	16,400	3,325.00	54,530,000	
東京センチュリー	24,600	7,440.00	183,024,000	
日本証券金融	44,900	798.00	35,830,200	
アイフル	177,900	320.00	56,928,000	
リコーリース	8,400	3,470.00	29,148,000	
イオンフィナンシャルサービス	64,800	1,485.00	96,228,000	
アコム	212,900	515.00	109,643,500	
ジャックス	11,700	2,269.00	26,547,300	
オリエントコーポレーション	286,900	154.00	44,182,600	
日立キャピタル	25,000	3,196.00	79,900,000	
オリックス	642,400	1,868.00	1,200,003,200	
三菱ＵＦＪリース	238,900	668.00	159,585,200	
九州リースサービス	5,300	695.00	3,683,500	
日本取引所グループ	285,900	2,595.00	741,910,500	
イー・ギャランティ	12,200	2,087.00	25,461,400	

アサックス	5,600	716.00	4,009,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,400	2,026.00	8,914,400	
いちご	121,900	327.00	39,861,300	
日本駐車場開発	113,600	153.00	17,380,800	
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,214.00	8,012,400	
ＳＲＥホールディングス	1,400	4,560.00	6,384,000	
ＡＤワークスグループ	20,300	165.00	3,349,500	
ヒューリック	225,600	1,305.00	294,408,000	
三栄建築設計	5,000	1,764.00	8,820,000	
野村不動産ホールディングス	64,900	2,665.00	172,958,500	
三重交通グループホールディングス	24,200	510.00	12,342,000	
サムティ	15,800	2,028.00	32,042,400	
ディア・ライフ	18,000	454.00	8,172,000	
日本商業開発	7,500	1,717.00	12,877,500	
ハウスコム	2,800	1,284.00	3,595,200	
日本管理センター	6,800	1,293.00	8,792,400	
サンセイランディック	4,800	862.00	4,137,600	
フージャースホールディングス	17,300	737.00	12,750,100	
オープンハウス	33,700	4,720.00	159,064,000	
東急不動産ホールディングス	290,000	655.00	189,950,000	
飯田グループホールディングス	88,800	2,676.00	237,628,800	
イーグランド	3,200	936.00	2,995,200	
ムゲンエステート	9,300	517.00	4,808,100	
ハウスドゥ	5,200	1,159.00	6,026,800	
シーアールイー	3,700	1,339.00	4,954,300	
グッドコムアセット	6,000	1,415.00	8,490,000	
ジェイ・エス・ビー	2,300	3,295.00	7,578,500	
テンポイノベーション	4,400	912.00	4,012,800	
フェイスネットワーク	2,000	1,289.00	2,578,000	
パーク２４	57,500	2,069.00	118,967,500	
パラカ	3,600	1,679.00	6,044,400	
三井不動産	482,800	2,513.50	1,213,517,800	
三菱地所	695,900	1,932.50	1,344,826,750	
平和不動産	18,600	3,455.00	64,263,000	
東京建物	105,400	1,681.00	177,177,400	
ダイビル	28,300	1,427.00	40,384,100	
京阪神ビルディング	19,200	1,489.00	28,588,800	
住友不動産	238,200	3,906.00	930,409,200	
テーオーシー	22,500	788.00	17,730,000	
東京楽天地	2,000	4,825.00	9,650,000	
スターツコーポレーション	13,100	2,905.00	38,055,500	
フジ住宅	14,200	741.00	10,522,200	

空港施設	13,100	587.00	7,689,700	
明和地所	7,000	706.00	4,942,000	
ゴールドクレスト	10,300	1,696.00	17,468,800	
エスリード	4,900	1,683.00	8,246,700	
日神グループホールディングス	18,500	488.00	9,028,000	
日本エスコン	19,200	785.00	15,072,000	
タカラレーベン	44,300	373.00	16,523,900	
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,500	907.00	6,802,500	
イオンモール	53,900	1,925.00	103,757,500	
毎日コムネット	4,600	760.00	3,496,000	
ファースト住建	5,600	1,395.00	7,812,000	
カチタス	26,700	3,090.00	82,503,000	
トーセイ	15,900	1,118.00	17,776,200	
穴吹興産	3,100	1,991.00	6,172,100	
サンフロンティア不動産	14,400	967.00	13,924,800	
エフ・ジェー・ネクスト	11,600	1,122.00	13,015,200	
インテリックス	2,400	685.00	1,644,000	
ランドビジネス	3,600	405.00	1,458,000	
サンネクスタグループ	4,700	1,020.00	4,794,000	
グランディハウス	10,100	483.00	4,878,300	
日本空港ビルデング	37,100	5,440.00	201,824,000	
明豊ファシリティワークス	4,900	670.00	3,283,000	
日本工営	6,400	3,140.00	20,096,000	
ＬＩＦＵＬＬ	36,200	411.00	14,878,200	
ミクシィ	19,600	2,770.00	54,292,000	
ジェイエイシーリクルートメント	7,000	1,745.00	12,215,000	
日本M&Aセンター	168,200	2,993.00	503,422,600	
メンバーズ	3,100	2,495.00	7,734,500	
中広	1,900	374.00	710,600	
ＵＴグループ	14,800	3,635.00	53,798,000	
アイティメディア	3,500	1,863.00	6,520,500	
タケエイ	11,600	1,290.00	14,964,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,200	1,061.00	4,456,200	
ビーネックスグループ	27,300	1,761.00	48,075,300	
コシダカホールディングス	24,900	596.00	14,840,400	
アルトナー	2,700	835.00	2,254,500	
パソナグループ	11,200	1,867.00	20,910,400	
ＣＤＳ	2,700	1,503.00	4,058,100	
リンクアンドモチベーション	18,800	601.00	11,298,800	
ＧＣＡ	13,600	847.00	11,519,200	
エス・エム・エス	34,900	3,380.00	117,962,000	
サニーサイドアップグループ	3,800	757.00	2,876,600	

パーソルホールディングス	102,600	2,164.00	222,026,400	
リニカル	6,000	786.00	4,716,000	
クックパッド	32,700	313.00	10,235,100	
アイ・ケイ・ケイ	5,200	705.00	3,666,000	
学情	3,700	1,575.00	5,827,500	
スタジオアリス	5,200	2,094.00	10,888,800	
シミックホールディングス	5,100	1,539.00	7,848,900	
エプコ	2,700	990.00	2,673,000	
ＮＪＳ	2,600	2,070.00	5,382,000	
綜合警備保障	40,800	5,230.00	213,384,000	
カカクコム	75,800	3,020.00	228,916,000	
アイロムグループ	3,700	2,444.00	9,042,800	
セントケア・ホールディング	7,600	1,295.00	9,842,000	
サイネックス	2,000	701.00	1,402,000	
ルネサンス	6,500	1,173.00	7,624,500	
ディップ	16,100	2,899.00	46,673,900	
デジタルホールディングス	7,200	2,005.00	14,436,000	
新日本科学	12,700	699.00	8,877,300	
キャリアデザインセンター	2,500	1,065.00	2,662,500	
ベネフィット・ワン	37,400	2,939.00	109,918,600	
エムスリー	180,900	7,571.00	1,369,593,900	
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	337.00	2,763,400	
アウトソーシング	58,800	1,784.00	104,899,200	
ウェルネット	10,600	559.00	5,925,400	
ワールドホールディングス	3,600	2,867.00	10,321,200	
ディー・エヌ・エー	43,400	2,162.00	93,830,800	
博報堂ＤＹホールディングス	142,800	1,845.00	263,466,000	
ぐるなび	18,100	617.00	11,167,700	
タカミヤ	12,700	614.00	7,797,800	
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	846.00	6,852,600	
ファンコミュニケーションズ	28,600	412.00	11,783,200	
ライク	2,800	2,016.00	5,644,800	
ビジネス・ブレークスルー	4,700	447.00	2,100,900	
エスプール	26,500	1,138.00	30,157,000	
ＷＤＢホールディングス	4,700	2,594.00	12,191,800	
手間いらず	1,000	5,280.00	5,280,000	
ティア	6,300	493.00	3,105,900	
ＣＤＧ	1,000	1,569.00	1,569,000	
アドウェイズ	12,700	818.00	10,388,600	
バリューコマース	6,900	3,590.00	24,771,000	
インフォマート	103,900	953.00	99,016,700	
ＪＰホールディングス	29,800	285.00	8,493,000	

エコナックホールディングス	20,200	98.00	1,979,600	
ＥＰＳホールディングス	14,000	1,130.00	15,820,000	
レッグス	2,600	1,658.00	4,310,800	
プレステージ・インターナショナル	38,600	822.00	31,729,200	
アミューズ	5,600	2,547.00	14,263,200	
ドリームインキュベータ	3,300	1,165.00	3,844,500	
クイック	6,500	1,233.00	8,014,500	
ＴＡＣ	6,200	257.00	1,593,400	
電通グループ	115,300	3,550.00	409,315,000	
イオンファンタジー	4,000	2,428.00	9,712,000	
シーティーエス	11,800	854.00	10,077,200	
ネクシィーズグループ	3,300	1,104.00	3,643,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	28,700	3,715.00	106,620,500	
アルプス技研	9,100	2,191.00	19,938,100	
ダイオーズ	2,200	998.00	2,195,600	
日本空調サービス	10,900	747.00	8,142,300	
オリエンタルランド	109,000	16,625.00	1,812,125,000	
ダスキン	23,800	2,785.00	66,283,000	
明光ネットワークジャパン	13,300	597.00	7,940,100	
ファルコホールディングス	5,000	1,749.00	8,745,000	
ラウンドワン	35,100	1,245.00	43,699,500	
リゾートトラスト	47,100	1,848.00	87,040,800	
ビー・エム・エル	13,200	3,825.00	50,490,000	
りらいあコミュニケーションズ	15,700	1,431.00	22,466,700	
リソー教育	52,500	338.00	17,745,000	
早稲田アカデミー	4,100	912.00	3,739,200	
ユー・エス・エス	114,800	2,164.00	248,427,200	
東京個別指導学院	9,300	618.00	5,747,400	
サイバーエージェント	252,800	1,993.00	503,830,400	
楽天	477,900	1,319.00	630,350,100	
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,432.00	7,876,000	
モーニングスター	11,500	478.00	5,497,000	
テー・オー・ダブリュー	18,500	321.00	5,938,500	
山田コンサルティンググループ	6,100	1,198.00	7,307,800	
セントラルスポーツ	3,900	2,505.00	9,769,500	
フルキャストホールディングス	9,100	1,998.00	18,181,800	
エン・ジャパン	18,300	3,415.00	62,494,500	
リソルホールディングス	1,200	4,140.00	4,968,000	
テクノプロ・ホールディングス	20,500	9,220.00	189,010,000	
アトラ	2,400	366.00	878,400	
インターワークス	3,300	406.00	1,339,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	13,370.00	56,154,000	

ＫｅｅＰｅｒ技研	6,700	2,471.00	16,555,700	
ファーストロジック	2,200	799.00	1,757,800	
三機サービス	2,100	1,079.00	2,265,900	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,600	844.00	5,570,400	
デザインワン・ジャパン	3,700	242.00	895,400	
イー・ガーディアン	4,600	2,885.00	13,271,000	
リブセンス	6,300	236.00	1,486,800	
ジャパンマテリアル	31,600	1,310.00	41,396,000	
ベクトル	12,900	1,296.00	16,718,400	
ウチヤマホールディングス	5,500	393.00	2,161,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,800	1,334.00	10,405,200	
キャリアリンク	3,400	2,638.00	8,969,200	
ＩＢＪ	8,600	951.00	8,178,600	
アサンテ	3,800	1,797.00	6,828,600	
バリューＨＲ	4,200	1,634.00	6,862,800	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	8,400	5,500.00	46,200,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,686.00	6,912,600	
ＥＲＩホールディングス	3,100	605.00	1,875,500	
アビスト	1,600	3,115.00	4,984,000	
シグマクシス	5,700	1,862.00	10,613,400	
ウィルグループ	7,700	1,142.00	8,793,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,700	302.00	4,741,400	
メドピア	4,900	6,540.00	32,046,000	
レアジョブ	1,500	2,141.00	3,211,500	
リクルートホールディングス	734,300	5,401.00	3,965,954,300	
エラン	14,300	1,403.00	20,062,900	
土木管理総合試験所	5,500	351.00	1,930,500	
ネットマーケティング	5,200	589.00	3,062,800	
日本郵政	775,700	986.70	765,383,190	
ベルシステム２４ホールディングス	17,300	1,891.00	32,714,300	
鎌倉新書	10,500	1,279.00	13,429,500	
ＳＭＮ	2,400	766.00	1,838,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,200	4,115.00	17,283,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,000	1,013.00	2,026,000	
エアトリ	5,500	2,297.00	12,633,500	
アトラエ	6,400	1,714.00	10,969,600	
ストライク	3,900	4,415.00	17,218,500	
ソラスト	25,300	1,428.00	36,128,400	
セラク	3,300	1,941.00	6,405,300	
インソース	8,600	2,307.00	19,840,200	
ベイカレント・コンサルティング	6,700	25,250.00	169,175,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,300	3,105.00	7,141,500	

アイモバイル	3,800	1,521.00	5,779,800	
キャリアインデックス	4,500	720.00	3,240,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,300	1,132.00	4,867,600	
船場	2,200	899.00	1,977,800	
グレイステクノロジー	10,400	2,884.00	29,993,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,600	2,380.00	70,448,000	
フルテック	1,500	1,455.00	2,182,500	
グリーンズ	3,900	590.00	2,301,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	3,300	693.00	2,286,900	
ソウルドアウト	2,500	1,600.00	4,000,000	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,900	596.00	1,132,400	
ウェルビー	3,000	1,515.00	4,545,000	
エル・ティー・エス	800	3,850.00	3,080,000	
ミダック	2,300	4,900.00	11,270,000	
日総工産	8,200	859.00	7,043,800	
キュービーネットホールディングス	4,800	1,650.00	7,920,000	
ＲＰＡホールディングス	12,000	648.00	7,776,000	
スプリックス	3,100	951.00	2,948,100	
マネジメントソリューションズ	5,100	2,129.00	10,857,900	
プロレド・パートナーズ	1,500	3,100.00	4,650,000	
テノ．ホールディングス	1,000	1,166.00	1,166,000	
フロンティア・マネジメント	1,800	1,832.00	3,297,600	
ピアラ	600	1,697.00	1,018,200	
コプロ・ホールディングス	1,200	1,451.00	1,741,200	
ギークス	1,400	1,834.00	2,567,600	
カーブスホールディングス	28,300	1,005.00	28,441,500	
フォーラムエンジニアリング	5,500	1,061.00	5,835,500	
ダイレクトマーケティングミックス	4,100	3,385.00	13,878,500	
ポピンズホールディングス	2,100	4,320.00	9,072,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,400	743.00	4,012,200	
リログループ	56,100	2,342.00	131,386,200	
東祥	6,500	1,869.00	12,148,500	
エイチ・アイ・エス	14,900	2,215.00	33,003,500	
ラックランド	3,000	2,447.00	7,341,000	
共立メンテナンス	17,000	3,665.00	62,305,000	
イチネンホールディングス	10,800	1,349.00	14,569,200	
建設技術研究所	6,700	2,520.00	16,884,000	
スペース	6,800	985.00	6,698,000	
長大	4,200	1,788.00	7,509,600	
燦ホールディングス	4,600	1,105.00	5,083,000	
スバル興業	600	8,130.00	4,878,000	
東京テアトル	4,100	1,272.00	5,215,200	

タナベ経営	2,100	1,435.00	3,013,500	
ナガワ	3,300	8,910.00	29,403,000	
東京都競馬	6,700	5,590.00	37,453,000	
カナモト	18,100	2,881.00	52,146,100	
西尾レントオール	9,500	2,994.00	28,443,000	
トランス・コスモス	9,800	2,986.00	29,262,800	
乃村工藝社	44,100	918.00	40,483,800	
藤田観光	4,100	1,931.00	7,917,100	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,500	1,023.00	5,626,500	
日本管財	11,000	2,180.00	23,980,000	
トーカイ	10,000	2,411.00	24,110,000	
セコム	101,000	9,313.00	940,613,000	
セントラル警備保障	5,000	3,405.00	17,025,000	
丹青社	19,500	881.00	17,179,500	
メイテック	12,600	6,110.00	76,986,000	
応用地質	12,100	1,292.00	15,633,200	
船井総研ホールディングス	21,100	2,146.00	45,280,600	
進学会ホールディングス	4,400	451.00	1,984,400	
オオバ	7,400	820.00	6,068,000	
いであ	2,600	1,804.00	4,690,400	
学究社	3,100	1,332.00	4,129,200	
ベネッセホールディングス	37,600	2,328.00	87,532,800	
イオンディライト	12,700	3,225.00	40,957,500	
ナック	5,000	954.00	4,770,000	
ダイセキ	17,200	4,010.00	68,972,000	
ステップ	3,900	1,568.00	6,115,200	
合　計	112,216,300		287,439,300,520	

(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Ｌ】

【純資産額計算書】

（2021年 4月30日現在）

Ⅰ　資産総額	114,153,306,993円
Ⅱ　負債総額	199,195,297円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	113,954,111,696円
Ⅳ　発行済口数	45,877,645,833口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4839円
（1万口当たり純資産額）	（24,839円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2021年 4月30日現在）

Ⅰ　資産総額	285,113,605,436円
Ⅱ　負債総額	1,185,469,969円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	283,928,135,467円
Ⅳ　発行済口数	133,809,130,411口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1219円
（1万口当たり純資産額）	（21,219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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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ます。）に支払います。

⑥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（2021年 4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年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

委託会社の機構は2021年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	520	14,438,941
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	286,876
単位型公社債投資信託	45	290,117
合計	644	15,015,935

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		
その他有価証券評価差額金	393	△587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	△302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（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 （2019年3月31日）		当事業年度 （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

（リース取引関係）

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、自社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。

①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。

②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。

③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 その他有価証券	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 その他有価証券	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 その他有価証券」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．その他有価証券

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	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	売建				
	米ドル		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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		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

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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

① 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。

② 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				
	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	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	△2
	英ポンド	105	－	△0	△0
	カナダドル	19	－	0	0
	スイスフラン	50	－	0	0
	香港ドル	178	－	△0	△0
	ユーロ	306	－	3	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				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	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おりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第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 6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

① 名称： 三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

③ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

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

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2020年7月27日現在）
④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。
⑤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。

①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。
②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。
③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。
④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。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2020年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬ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5月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　中島紀子　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣ日本株式インデックスファンドＬの2020年4月1日から2021年3月31日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣ日本株式インデックスファンドＬの2021年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。