

【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12月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンドL
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

DC日本株式インデックスファンドL

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2021年12月29日から2022年 6月30日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所所有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル 日本	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファン ズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

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

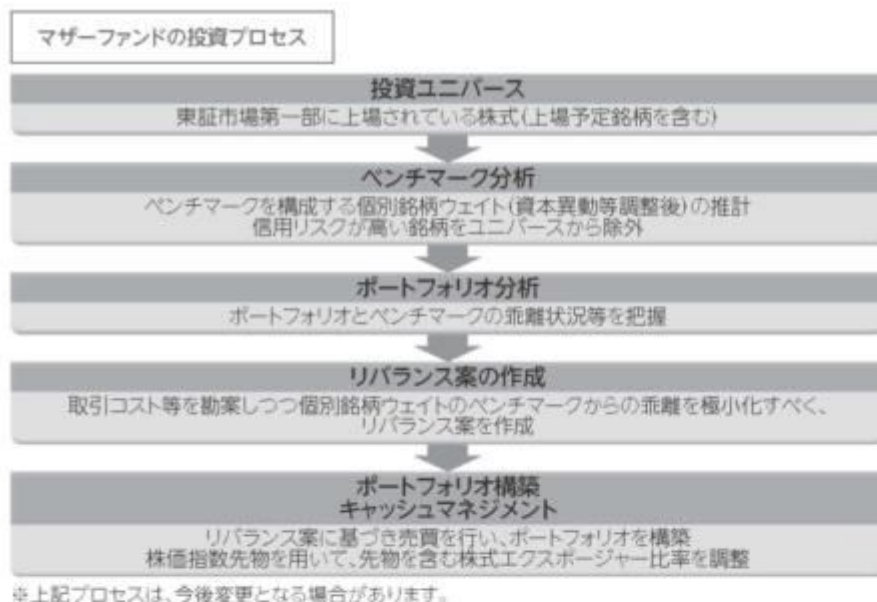
TOPIX（東証株価指数、配当込み）^(注)とは

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

(注) TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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

2022年4月4日に東京証券取引所（以下「東証」といいます。）は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ（スタンダード・グロース）」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。



ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

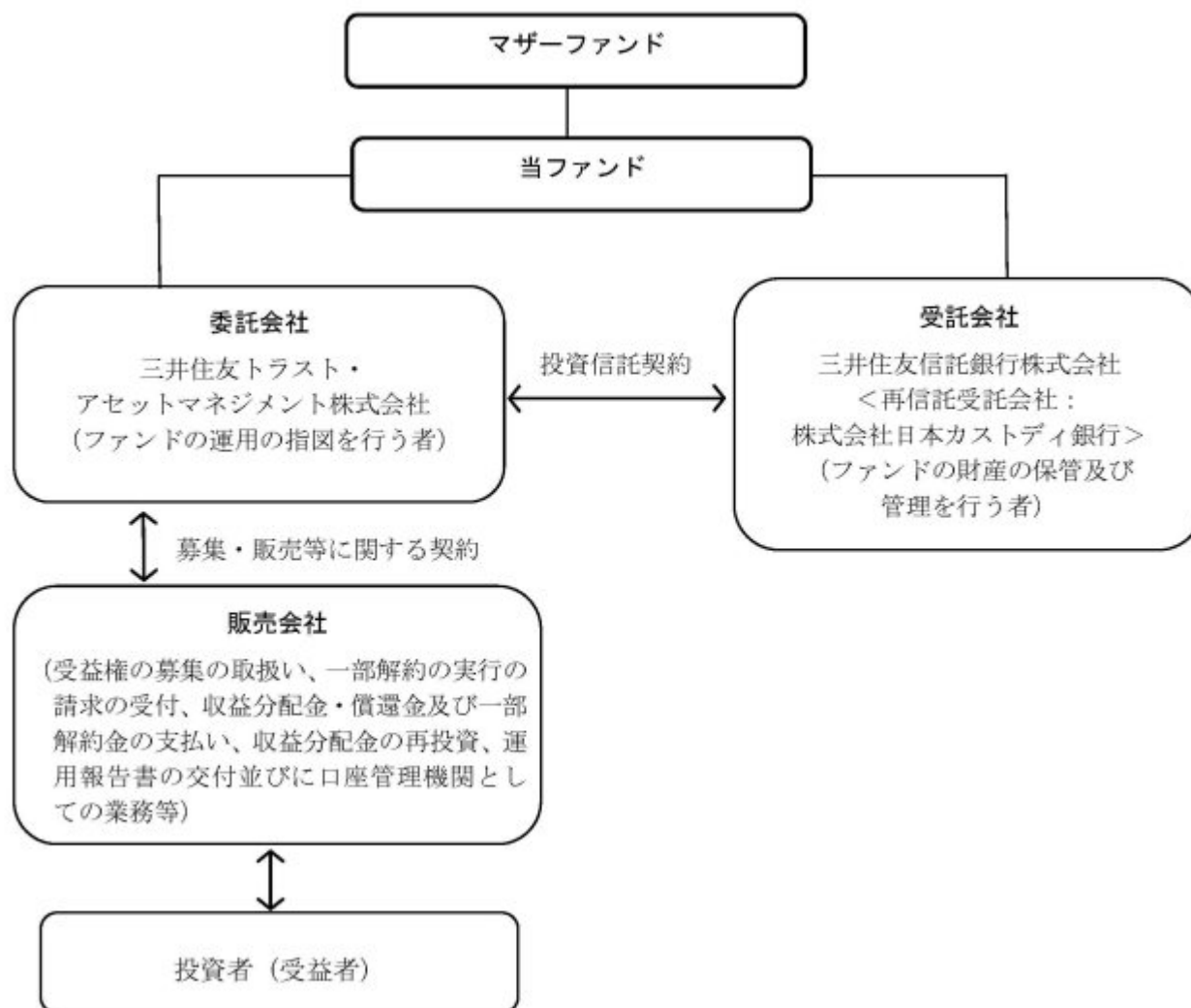
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年10月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

運用指図できる投資対象である有価証券

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

通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

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

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

運用指図できる金融商品

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

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在

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

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

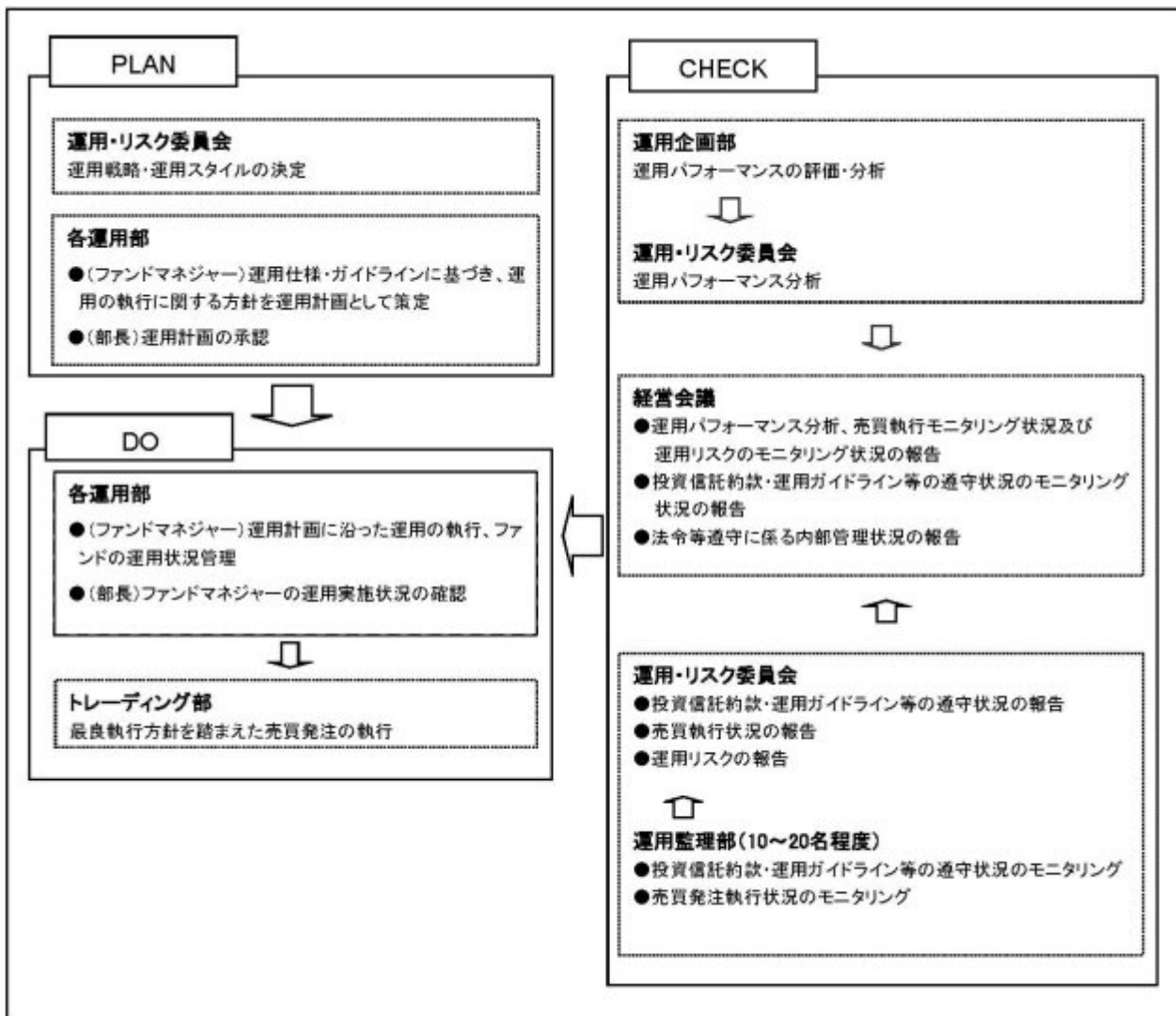
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金

融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場に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ます。

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるとき

は、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

O．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

Q．再投資の指図

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

R．資金の借入れ

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

価証券等の運用は行わないものとします。

- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｓ．受託会社による資金の立替え
 - イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
 - ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
 - ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ｔ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- Ｕ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

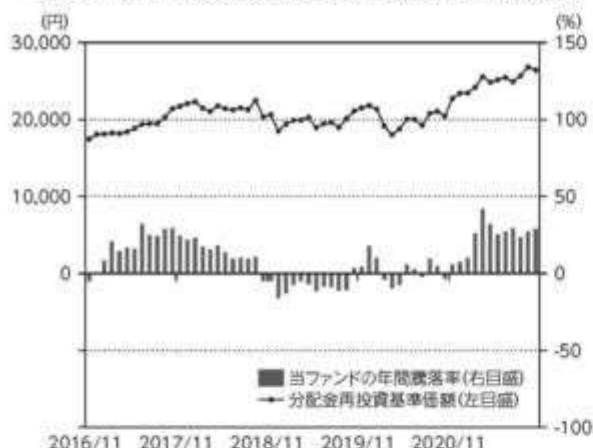
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

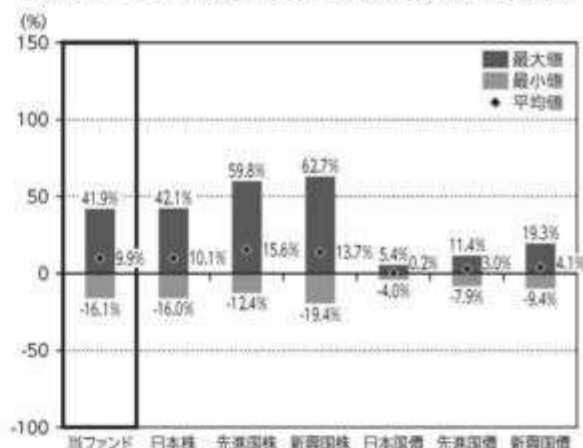
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2016年11月～2021年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式を銘柄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、東証の現物対象であり、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、ファンドの約定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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 NOWMURA-BPI国債	NOWMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動き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、本ファンドのリスパーではなく、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 EMB Global Government Bond Index Emerging Markets (除く日本、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諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2021年10月29日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年10月29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	121,135,160,657	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		60,551,919	0.05
合計(純資産総額)		121,195,712,576	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	53,606,744,549	2.1830	117,024,051,198	2.2597	121,135,160,657	99.95

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第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	
	5月末日	115,908,222,582		25,175	
	6月末日	117,555,014,315		25,470	

7月末日	114,625,240,682		24,911	
8月末日	117,316,100,554		25,695	
9月末日	122,175,341,271		26,810	
10月末日	121,195,712,576		26,426	

【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

【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
第20期中間計算期間	2021年 4月 1日～2021年 9月30日	4.9

(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
第20期中間計算期間	2021年 4月 1日～2021年 9月30日	3,933,292,235	4,182,410,700	45,570,508,981

(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	297,561,751,190	98.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,720,576,030	1.56
合計(純資産総額)		302,282,327,220	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	4,722,225,000	1.56

(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	5,496,900	1,542.20	8,477,327,249	2,006.50	11,029,529,850	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	679,800	10,496.61	7,135,600,276	13,140.00	8,932,572,000	2.96
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,300	57,619.05	5,663,952,804	68,510.00	6,734,533,000	2.23
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	800,000	4,896.93	3,917,548,500	7,572.00	6,057,600,000	2.00
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,864,100	485.96	3,335,690,556	622.50	4,272,902,250	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,245,500	2,705.58	3,369,804,783	3,188.00	3,970,654,000	1.31
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	638,600	8,761.37	5,595,013,879	6,164.00	3,936,330,400	1.30
日本	株式	信越化学工業	化学	182,500	19,258.84	3,514,738,365	20,255.00	3,696,537,500	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	68,900	44,324.58	3,053,963,887	52,850.00	3,641,365,000	1.20
日本	株式	HOYA	精密機器	211,800	13,662.89	2,893,801,649	16,725.00	3,542,355,000	1.17
日本	株式	日本電産	電気機器	281,300	14,033.66	3,947,670,708	12,570.00	3,535,941,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	138,300	23,115.33	3,196,851,416	24,890.00	3,442,287,000	1.14
日本	株式	日立製作所	電気機器	521,900	4,408.39	2,300,742,661	6,554.00	3,420,532,600	1.13
日本	株式	任天堂	その他製品	61,300	63,856.79	3,914,421,439	50,200.00	3,077,260,000	1.02
日本	株式	三菱商事	卸売業	800,900	2,858.53	2,289,398,040	3,612.00	2,892,850,800	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	854,400	2,866.59	2,449,221,270	3,349.00	2,861,385,600	0.95
日本	株式	村田製作所	電気機器	318,900	10,442.89	3,330,239,384	8,653.00	2,759,441,700	0.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	740,900	3,351.68	2,483,262,482	3,721.00	2,756,888,900	0.91
日本	株式	KDDI	情報・通信業	776,400	3,245.86	2,520,087,365	3,528.00	2,739,139,200	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	853,000	3,590.40	3,062,614,524	3,203.00	2,732,159,000	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,613,000	1,428.85	2,304,742,228	1,554.50	2,507,408,500	0.83
日本	株式	第一三共	医薬品	852,800	3,549.96	3,027,411,455	2,867.00	2,444,977,600	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	747,600	3,145.12	2,351,298,060	3,242.00	2,423,719,200	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	122,500	16,199.39	1,984,425,517	17,940.00	2,197,650,000	0.73
日本	株式	S M C	機械	31,800	68,191.61	2,168,493,480	67,940.00	2,160,492,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	830,000	2,070.75	1,718,727,904	2,592.00	2,151,360,000	0.71
日本	株式	ファナック	電気機器	95,200	27,024.96	2,572,776,757	22,310.00	2,123,912,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	352,500	5,420.11	1,910,591,491	5,998.00	2,114,295,000	0.70
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,368,800	1,412.07	1,932,852,016	1,505.00	2,060,044,000	0.68
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	418,100	3,978.06	1,663,227,535	4,782.00	1,999,354,200	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.21

建設業	2.26	
食料品	3.35	
繊維製品	0.47	
パルプ・紙	0.21	
化学	6.84	
医薬品	4.85	
石油・石炭製品	0.42	
ゴム製品	0.68	
ガラス・土石製品	0.78	
鉄鋼	0.79	
非鉄金属	0.70	
金属製品	0.61	
機械	5.35	
電気機器	18.43	
輸送用機器	7.86	
精密機器	2.82	
その他製品	2.14	
電気・ガス業	1.04	
陸運業	3.08	
海運業	0.45	
空運業	0.42	
倉庫・運輸関連業	0.17	
情報・通信業	8.30	
卸売業	4.98	
小売業	4.29	
銀行業	4.59	
証券、商品先物取引業	0.74	
保険業	1.93	
その他金融業	1.14	
不動産業	1.96	
サービス業	6.49	
	小計	98.44
合計		98.44

(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	237円		4,843,163,350	4,722,225,000	1.56

(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。

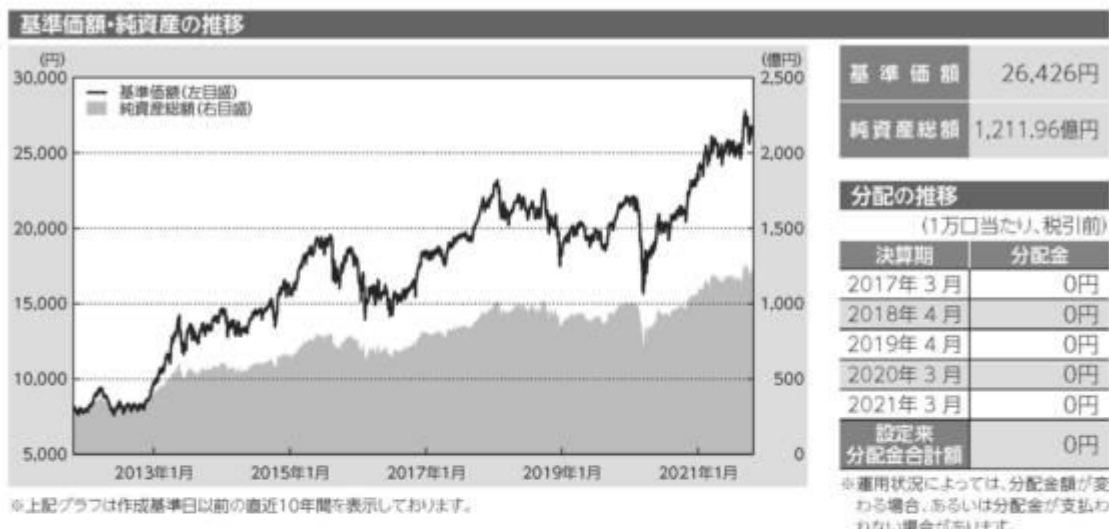
参考情報

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

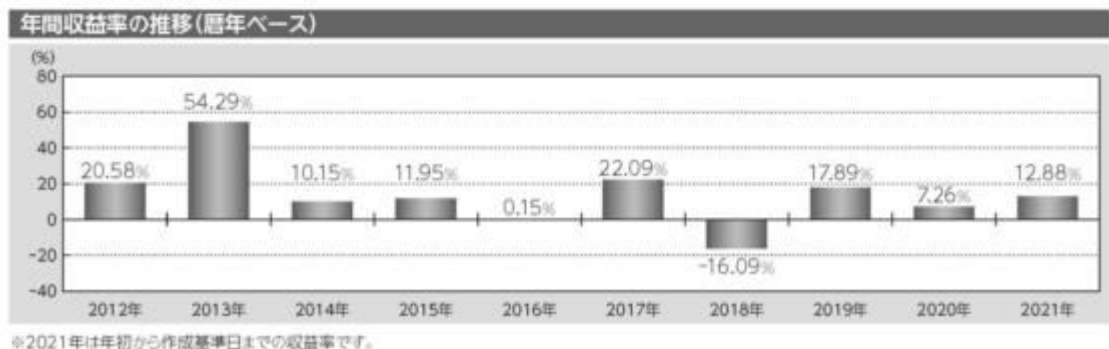
作成基準日：2021年10月29日



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	3.6%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3.0%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.2%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	2.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.4%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.3%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.2%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.2%
HOYA	日本	株式	精密機器	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定

した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年 4月 1日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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		第19期	
	自	2019年 4月 2日	自	2020年 4月 1日
	至	2020年 3月31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 (1万口当たり純資産額) 1.8017円 (18,017円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5563円 (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			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			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,115,894,418円	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	- 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	59,857,556,822円	収益調整金額	C	63,654,551,946円
分配準備積立金額	D	20,446,650,141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	82,420,101,381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	45,681,963,525口	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	18,042円	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	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第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	第19期
	自 2019年 4月 2日 至 2020年 3月31日	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

項目	2021年 3月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,689,290,477
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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	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
D C 日本株式インデックスファンド	314,351,199円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,616,386,469円
D C 日本株式インデックスファンド A	773,393,446円
D C バランスファンド 3 0	2,191,513,210円
D C バランスファンド 5 0	3,400,802,010円
D C バランスファンド 7 0	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 3 0）	11,953,467,650円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,346,501,100円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	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 V A（適格機関投資家専用）	1,153,304,306円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	59,603,197円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	670,977,288円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	76,131,257円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	147,771,600円

区分	2021年 3月31日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	719,719円
V A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
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	90,995,258円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,315,475,854円
V A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
V A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
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	64,696,512円
V A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
V A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)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,085,741,100	-	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	
T A T E R U	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	
ピ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	
飛鳥建設	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	
銭高組	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	
浅沼組	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	
N I P P O	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
大気社	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
O S J B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
ニッポン	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	
キューピー	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
日本フェルト	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
T S I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
東亜合成	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
日本パーカライズニング	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
J S R	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
K H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
A D E K A	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
D I C	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 T O K A	8,100	854.00	6,917,400
富士フィ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P M C	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
J C U	12,100	4,170.00	50,457,000
新田ゼラチン	6,700	671.00	4,495,700
O A T 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
J S P	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
バイオフェルミン製薬	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
A G C	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
T O T O	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
M A R U W A	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
D O W A 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
U A C J	16,100	2,668.00	42,954,800
C K 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C o	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
文化シャッター	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
東洋シャッター	2,300	680.00	1,564,000
LIXIL	146,100	3,075.00	449,257,500
日本フィルコン	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
東ブレ	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
F U J I	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
D M G 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
富士ダイス	5,400	691.00	3,731,400
豊和工業	6,000	867.00	5,202,000
O K K	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
N C 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
S M C	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
T O W A	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
西島製作所	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
C K D	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
S A N K Y O	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
J U K I	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
T P R	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 - P E X	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
I D E C	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
E I Z O	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
T D K	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
オブテックスグループ	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
ハリオス 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
K O A	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
S C R E E Nホールディングス	18,600	9,740.00	181,164,000
キャノン電子	10,300	1,722.00	17,736,600
キャノン	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
M U T O H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
日本車輛製造	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
G M B	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
N O K	51,900	1,501.00	77,901,900
フタバ産業	26,900	593.00	15,951,700
K Y B	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
S U B A R U	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
T B K	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
J M S	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
H O Y A	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	
前田工織	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	
S H O E I	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	
廣濟堂	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	
N I S S H A	22,000	1,370.00	30,140,000	
光村印刷	900	1,822.00	1,639,800	
T A K A R A & C O M P A N Y	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
S G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
N S 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
A N A 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
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
キュ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
エーアイティー	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
N E C ネットエスアイ	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
T I S	105,300	2,641.00	278,097,300
J N S 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
G M O 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
A G S	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
K L a b	19,200	805.00	15,456,000
ポルトウウィン・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・テクノロジー	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
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,532.00	6,740,800
オブティム	7,400	2,973.00	22,000,200
セレス	3,500	4,675.00	16,362,500
S H I F T	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نز	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
トピラシステムズ	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
ギフト	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йд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
カブコン	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

T K C	17,800	3,520.00	62,656,000
富士ソフト	11,300	5,730.00	64,749,000
N S D	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
J B C C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
ハウスイ	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
J A L U X	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
O C H Iホールディングス	3,100	1,318.00	4,085,800
T O K A Iホールディングス	51,200	956.00	48,947,200
黒谷	2,900	809.00	2,346,100
C o m i n i x	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
佐島電機	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
メディバルホールディングス	105,900	2,124.00	224,931,600
S P K	4,600	1,292.00	5,943,200
萩原電気ホールディングス	3,900	2,629.00	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
I D O M	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ترون	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
キャ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
G S I 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
トーヨー	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
P A L T A C	16,900	5,990.00	101,231,000
三谷産業	14,000	429.00	6,006,000
西本W i s m e t t a c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
J K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

ジー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	
D C Mホールディングス	65,400	1,158.00	75,733,200	
M o n o t a R O	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	
ブロンコピリー	5,600	2,367.00	13,255,200	
Z O Z O	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	
H a m e e	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	
クリエイティブSDホールディングス	15,600	3,600.00	56,160,000	
丸善C H I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	
S F P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	
B E E N O S	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	
T O K Y O B A S E	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	
J M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	
カップ・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	
V T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
P L A N T	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
S R S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
M r M a x H D	14,900	719.00	10,713,100
A O K I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	
パ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	
サックスパ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
F P G	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
S B I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
藍澤証券	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
S O M P O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
M S & A D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
C a s a	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U F J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
ハウズドゥ	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
A V A N T I A	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
L I F U L L	36,200	411.00	14,878,200
ミクシィ	19,600	2,770.00	54,292,000
ジェイエ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
C D S	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
G C A	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
エプロ	2,700	990.00	2,673,000
N J S	2,600	2,070.00	5,382,000
総合警備保障	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D Y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
W D B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
C D G	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
J P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	
E P Sホールディングス	14,000	1,130.00	15,820,000	
レグス	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	
T A C	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
I B J	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
E R I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
S M N	2,400	766.00	1,838,400
L I T A L I C O	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 - J a p a n	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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期中間計算期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンドL】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2021年 3月31日現在)	第20期中間計算期間 (2021年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	368,810,104	490,304,722
親投資信託受益証券	117,071,379,855	122,114,009,731
流動資産合計	117,440,189,959	122,604,314,453
資産合計	117,440,189,959	122,604,314,453
負債の部		
流動負債		
未払解約金	198,468,522	306,168,023
未払受託者報酬	17,535,872	19,390,111
未払委託者報酬	93,524,601	103,413,857
未払利息	855	1,191
流動負債合計	309,529,850	428,973,182
負債合計	309,529,850	428,973,182
純資産の部		
元本等		
元本	45,819,627,446	45,570,508,981
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	71,311,032,663	76,604,832,290
(分配準備積立金)	37,309,480,761	34,069,947,578
元本等合計	117,130,660,109	122,175,341,271
純資産合計	117,130,660,109	122,175,341,271
負債純資産合計	117,440,189,959	122,604,314,453

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期中間計算期間 自 2020年 4月 1日 至 2020年 9月30日	第20期中間計算期間 自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日
営業収益		
受取利息	850	649
有価証券売買等損益	14,008,869,968	5,775,046,688
営業収益合計	14,008,870,818	5,775,047,337
営業費用		
支払利息	52,620	60,280
受託者報酬	15,038,286	19,390,111
委託者報酬	80,204,146	103,413,857
その他費用	411	-
営業費用合計	95,295,463	122,864,248
営業利益又は営業損失（ ）	13,913,575,355	5,652,183,089
経常利益又は経常損失（ ）	13,913,575,355	5,652,183,089
中間純利益又は中間純損失（ ）	13,913,575,355	5,652,183,089
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	600,417,359	52,242,526
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	36,621,009,320	71,311,032,663
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,051,139,867	6,179,555,101
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,051,139,867	6,179,555,101
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,935,070,930	6,485,696,037
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,935,070,930	6,485,696,037
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	51,050,236,253	76,604,832,290

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2021年 3月31日現在)	第20期中間計算期間 (2021年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	45,819,627,446口	45,570,508,981口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5563円 (25,563円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6810円 (26,810円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第20期中間計算期間 (2021年 9月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第20期中間計算期間 (2021年 9月30日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第19期 自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日	第20期中間計算期間 自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	45,681,963,525円	45,819,627,446円
期中追加設定元本額	7,900,549,624円	3,933,292,235円
期中一部解約元本額	7,762,885,703円	4,182,410,700円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 9月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,376,832,327
株式	300,883,217,330

	2021年 9月30日現在
項目	金額（円）
未収入金	95,696,541
未収配当金	2,480,167,731
前払金	82,042,400
差入委託証拠金	179,333,600
流動資産合計	306,097,289,929
資産合計	306,097,289,929
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	82,046,800
未払金	1,755,800
未払解約金	225,417,709
未払利息	5,775
流動負債合計	309,226,084
負債合計	309,226,084
純資産の部	
元本等	
元本	133,404,100,100
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	172,383,963,745
元本等合計	305,788,063,845
純資産合計	305,788,063,845
負債純資産合計	306,097,289,929

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2021年 9月30日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,404,100,100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 2.2922円 (1万口当たり純資産額) (22,922円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 4月 1日
期首元本額	134,006,418,790円
期中追加設定元本額	4,932,002,679円
期中一部解約元本額	5,534,321,369円
期末元本額	133,404,100,100円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	605,648,042円
DC日本株式インデックスファンド	313,772,976円
DC日本株式インデックスファンドL	53,273,715,091円
DC日本株式インデックスファンドA	679,150,738円
DCバランスファンド30	2,239,862,855円
DCバランスファンド50	3,498,032,131円
DCバランスファンド70	2,022,377,677円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	556,298,213円
日本株式インデックスe	1,476,810,465円
インデックスコレクション（国内株式）	20,163,240,182円
インデックスコレクション（バランス株式30）	11,875,085,920円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,605,035,243円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,247,359,859円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,493,261,746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）	2,770,595,404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）	1,052,162,030円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	55,185,375円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	622,064,311円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	69,902,314円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	130,381,345円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	159,783,447円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	783,163,456円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	450,941,222円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,841,525,975円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	761,249,216円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	77,859,220円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,227,733,952円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	28,267,653円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	156,492,922円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,087,982,349円

区分	2021年 9月30日現在
V Aバランスファンド2 (株40 / 100) (適格機関投資家専用)	57,978,698円
V Aバランス50 - 50 (適格機関投資家専用)	57,373,835円
V Aファンド25 (適格機関投資家専用)	23,486,050円
バランスファンドV A 2 (適格機関投資家専用)	612,669,952円
バランスV A 25 L (適格機関投資家専用)	278,258,448円
バランスファンドV A 3 (適格機関投資家専用)	4,782,048,009円
世界バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	90,038,740円
国内バランスV A 30 (適格機関投資家専用)	37,965,919円
国内バランスV A 25 (適格機関投資家専用)	7,966,674円
V Aバランス20 - 80 (適格機関投資家専用)	126,781,783円
私募日本株式インデックスファンドA L (適格機関投資家専用)	4,590,663円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,874,022,400	-	4,791,980,000	82,042,400
	合計	4,874,022,400	-	4,791,980,000	82,042,400

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドL】

【純資産額計算書】

(2021年10月29日現在)

資産総額	121,380,659,508円
負債総額	184,946,932円
純資産総額（ - ）	121,195,712,576円
発行済口数	45,861,672,420口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6426円
（1万口当たり純資産額）	（26,426円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年10月29日現在)

資産総額	308,976,954,604円
負債総額	6,694,627,384円
純資産総額（ - ）	302,282,327,220円
発行済口数	133,772,434,924口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2597円
（1万口当たり純資産額）	（22,597円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2021年10月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2021年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年10月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	15,256,330
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	75	253,283
単位型公社債投資信託	53	307,343
合計	661	15,816,956

3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
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	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

(2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日)(自 2020年4月1日
至 2021年3月31日)

営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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			
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
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				
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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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			
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

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、決算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

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
そ の 他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
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

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

2021年6月23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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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（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。

当事業年度（2021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	21,589	21,589	-
（2）金銭の信託	10,857	10,857	-
（3）未収委託者報酬	8,471	8,471	-
（4）未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
（5）投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
（6）未払金	(7,572)	(7,572)	-
（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	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(*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

現金及び預金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 その他有価証券

投資有価証券の時価について、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

未払金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 2020年3月31日	当事業年度 2021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)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(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	-

当事業年度(2021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	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（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

当事業年度（2021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（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

当事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(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(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

当事業年度(2021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
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(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	種類	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。

当事業年度（2021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	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(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	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(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	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(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74百万円 当事業年度77百万円

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44百万円、当事業年度92百万円であります。

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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

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 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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(*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あります。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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 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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	-	営業上の 取引 役員の兼 任	運用受託報 酬	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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）

当事業年度（2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称： 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021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 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員**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2021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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドLの2021年4月1日から2021年9月30日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドLの2021年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。