

【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】	2022年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C 日本株式インデックスファンドA
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンドA

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2022年 3月11日から2022年 9月 9日までとします。

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

れます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

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

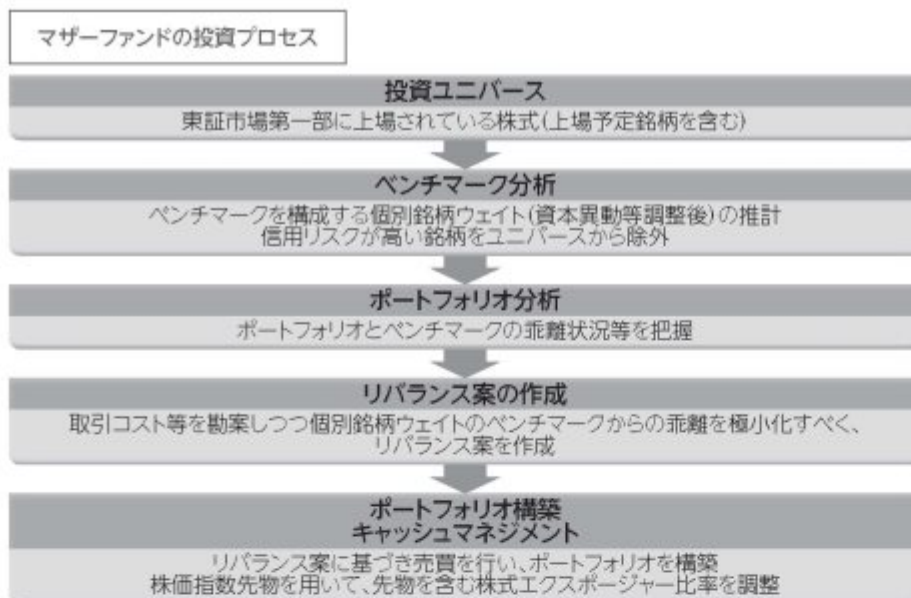
TOPIX(東証株価指数、配当込み)^(注)とは

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

(注)TOPIX(東証株価指数)の著作権等について

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

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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

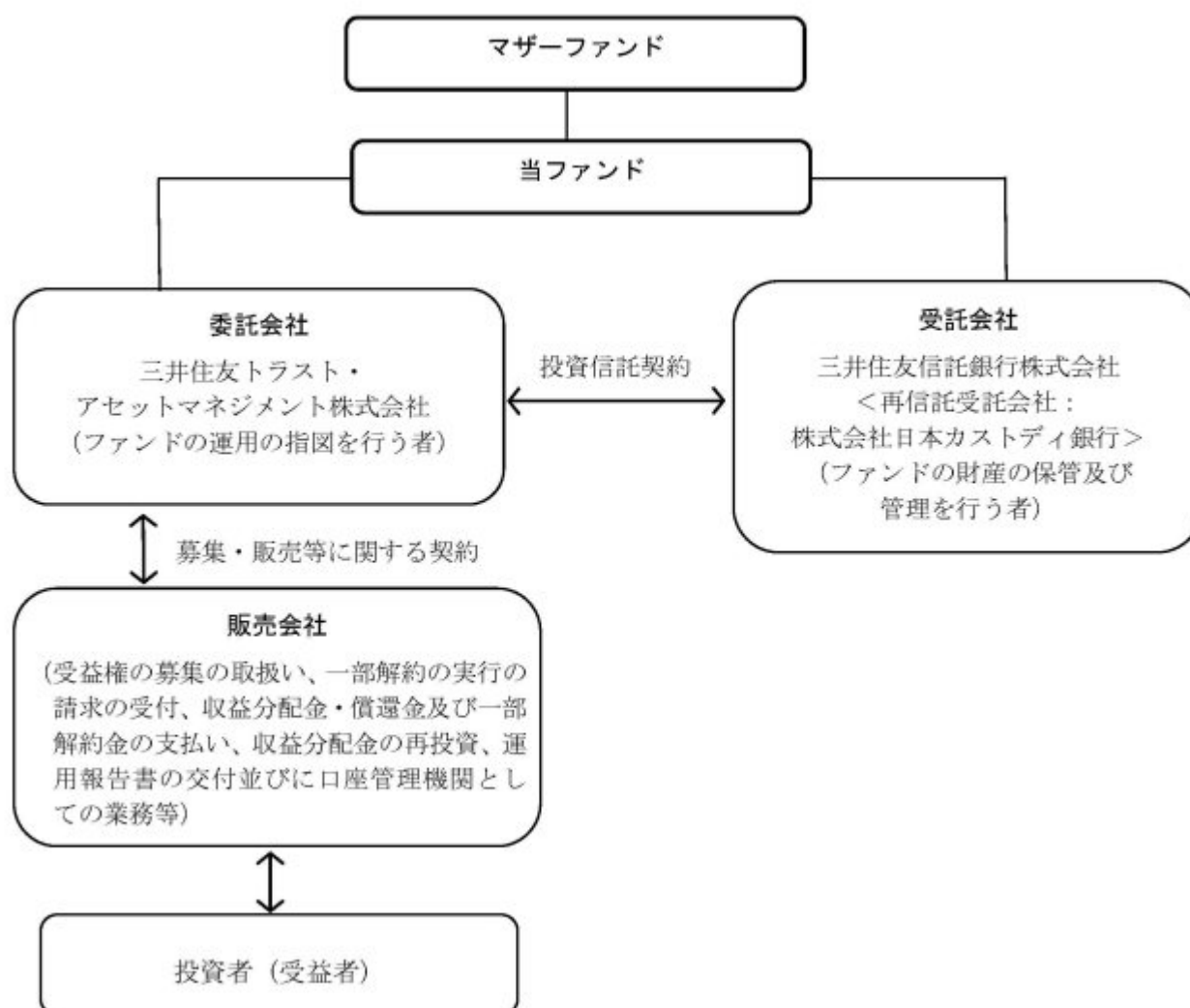
(2) 【ファンドの沿革】

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

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

D．約束手形（上記A．に掲げるものに該当するものを除きます。）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

A．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

A．株券又は新株引受権証書

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

J．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

Q．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

T．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

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

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

運用指図できる金融商品

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

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

B. 金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の運用指図

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

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

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

- ニ．上記ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- Ｊ．先物取引等の運用指図
- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- Ｋ．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｌ．金利先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｎ．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有していない公社債又は、下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をする

ことができるものとします。

- ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- ．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q．再投資の指図
- 委託会社は、上記P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ．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。
- ．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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等が

ら、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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。

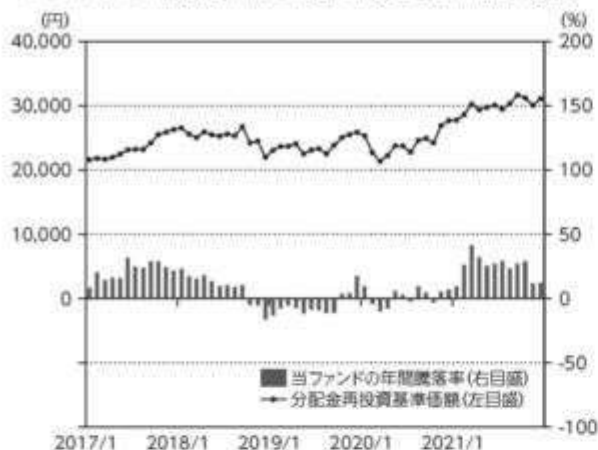
（２）リスクの管理体制

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（流動性リスク管理等を含む）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】

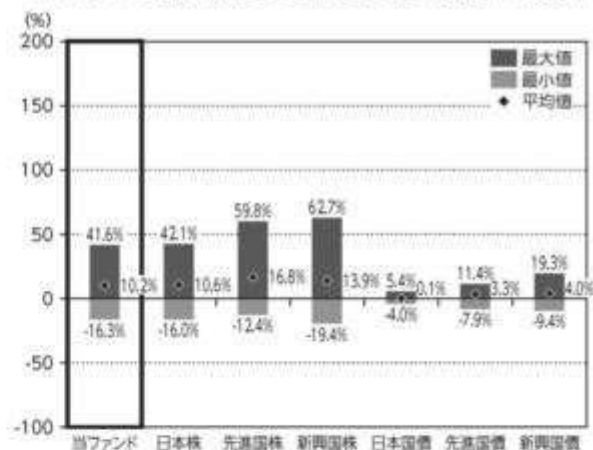
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2017年1月～2021年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全部を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
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中止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケットインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を中止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動サービスに関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・カントリー・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディベラティブ (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、JP, 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。JP, Morganからの選出による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP, Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2021年12月30日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2021年12月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,514,736,477	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		760,266	0.05
合計(純資産総額)		1,515,496,743	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	672,140,787	2.2314	1,499,818,598	2.2536	1,514,736,477	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【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12月10日)	1,172,924,685	1,172,924,685	10,460	10,460
第11期計算期間末	(2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末	(2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末	(2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末	(2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末	(2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
第16期計算期間末	(2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
第17期計算期間末	(2019年12月10日)	2,105,502,404	2,105,502,404	25,822	25,822
第18期計算期間末	(2020年12月10日)	1,905,184,214	1,905,184,214	27,212	27,212
第19期計算期間末	(2021年12月10日)	1,498,036,766	1,498,036,766	30,784	30,784
	2020年12月末日	1,879,831,792		27,679	
	2021年 1月末日	1,807,049,732		27,734	
	2月末日	1,785,674,106		28,590	
	3月末日	1,689,559,698		30,209	
	4月末日	1,481,459,160		29,347	
	5月末日	1,495,997,059		29,739	
	6月末日	1,508,033,544		30,081	
	7月末日	1,449,559,314		29,416	
	8月末日	1,487,990,107		30,335	

9月末日	1,557,531,203		31,646
10月末日	1,527,011,160		31,187
11月末日	1,462,324,763		30,044
12月末日	1,515,496,743		31,080

【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12月13日～2012年12月10日	0
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	0
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	0
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	0
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	0
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第10期計算期間	2011年12月13日～2012年12月10日	7.7
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	10.5
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	5.4
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	13.1

(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12月13日～2012年12月10日	232,065,601	233,152,933	1,121,316,254

第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	109,110,724	139,292,136	815,389,267
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	181,680,786	296,943,765	700,126,288
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	96,749,997	310,248,007	486,628,278

(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	298,542,044,840	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,601,488,092	1.19
合計(純資産総額)		302,143,532,932	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,306,720,000	1.09

(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	5,551,300	1,547.83	8,592,469,246	2,105.50	11,688,262,150	3.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	686,600	10,533.63	7,232,397,155	14,475.00	9,938,535,000	3.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	99,300	57,767.72	5,736,335,173	72,280.00	7,177,404,000	2.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	807,900	4,920.02	3,974,890,659	6,972.00	5,632,678,800	1.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	69,500	44,483.18	3,091,581,384	66,280.00	4,606,460,000	1.52
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,788,400	487.43	3,308,869,812	624.90	4,242,071,160	1.40
日本	株式	日本電産	電気機器	284,100	14,022.05	3,983,666,073	13,520.00	3,841,032,000	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	184,300	19,258.38	3,549,320,128	19,920.00	3,671,256,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	213,900	13,712.52	2,933,109,924	17,110.00	3,659,829,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	139,600	23,133.48	3,229,435,021	26,090.00	3,642,164,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,126,700	2,710.16	3,053,537,272	3,150.00	3,549,105,000	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	644,900	8,725.11	5,626,829,493	5,434.00	3,504,386,600	1.16
日本	株式	任天堂	その他製品	61,900	63,715.92	3,944,015,526	53,650.00	3,320,935,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	527,100	4,433.54	2,336,923,711	6,230.00	3,283,833,000	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	808,900	2,865.35	2,317,782,725	3,652.00	2,954,102,800	0.98
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	748,200	3,356.67	2,511,462,380	3,943.00	2,950,152,600	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	322,000	10,421.03	3,355,574,659	9,157.00	2,948,554,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	862,900	2,869.92	2,476,458,213	3,230.00	2,787,167,000	0.92
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	861,400	3,584.39	3,087,599,424	3,137.00	2,702,211,800	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	755,000	3,147.51	2,376,374,353	3,518.00	2,656,090,000	0.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	784,100	3,246.74	2,545,769,056	3,362.00	2,636,144,200	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	861,200	3,541.34	3,049,810,378	2,925.00	2,519,010,000	0.83
日本	株式	S M C	機械	32,100	68,266.18	2,191,344,421	77,590.00	2,490,639,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	123,800	16,218.25	2,007,819,822	19,395.00	2,401,101,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,629,000	1,430.04	2,329,540,512	1,454.50	2,369,380,500	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	96,200	26,980.01	2,595,477,181	24,380.00	2,345,356,000	0.78
日本	株式	デンソー	輸送用機器	241,300	6,097.19	1,471,252,200	9,529.00	2,299,347,700	0.76
日本	株式	三井物産	卸売業	838,200	2,076.27	1,740,335,412	2,723.50	2,282,837,700	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	356,000	5,425.36	1,931,428,707	6,392.00	2,275,552,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	422,300	3,986.52	1,683,510,538	5,056.00	2,135,148,800	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.23
		建設業	2.15

食料品	3.23
繊維製品	0.46
パルプ・紙	0.20
化学	6.67
医薬品	4.72
石油・石炭製品	0.39
ゴム製品	0.67
ガラス・土石製品	0.77
鉄鋼	0.74
非鉄金属	0.69
金属製品	0.63
機械	5.48
電気機器	19.92
輸送用機器	8.02
精密機器	2.87
その他製品	2.19
電気・ガス業	1.04
陸運業	2.89
海運業	0.51
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	7.89
卸売業	5.22
小売業	4.03
銀行業	4.69
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	1.95
その他金融業	1.13
不動産業	1.81
サービス業	6.23
小計	98.81
合計	98.81

(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	166円	3,297,573,950	3,306,720,000	1.09
----------	-------	---------	----	------	---------------	---------------	------

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年12月11日

作成基準日：2021年12月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の最近10年間を表示しております。

基準価額 31,080円

純資産総額 15.15億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年12月	0円
2018年12月	0円
2019年12月	0円
2020年12月	0円
2021年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.9%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3.3%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.9%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.4%
日本電産	日本	株式	電気機器	1.3%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.2%
HOYA	日本	株式	精密機器	1.2%
ダイキン工業	日本	株式	機械	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

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

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の受付を取り消すことができます。

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年12月11日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・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12月11日から2021年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2020年12月10日現在)	第19期 (2021年12月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,949,497	4,246,760
親投資信託受益証券	1,904,229,842	1,497,281,946
未収入金	14,426,057	226,753
流動資産合計	1,931,605,396	1,501,755,459
資産合計	1,931,605,396	1,501,755,459
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,482,451	465,468
未払受託者報酬	504,967	417,089
未払委託者報酬	3,433,747	2,836,134
未払利息	17	2
流動負債合計	26,421,182	3,718,693
負債合計	26,421,182	3,718,693
純資産の部		
元本等		
元本	700,126,288	486,628,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,205,057,926	1,011,408,488
(分配準備積立金)	451,142,862	415,176,139
元本等合計	1,905,184,214	1,498,036,766
純資産合計	1,905,184,214	1,498,036,766
負債純資産合計	1,931,605,396	1,501,755,459

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	2019年12月11日 至 2020年12月10日	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日
営業収益				
受取利息		25		10
有価証券売買等損益		85,665,497		228,740,422
営業収益合計		85,665,522		228,740,432
営業費用				
支払利息		2,428		1,430
受託者報酬		1,022,303		891,853
委託者報酬		6,951,606		6,064,479
その他費用		9		-
営業費用合計		7,976,346		6,957,762
営業利益又は営業損失（ ）		77,689,176		221,782,670
経常利益又は経常損失（ ）		77,689,176		221,782,670
当期純利益又は当期純損失（ ）		77,689,176		221,782,670
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（ ）		53,138,597		70,907,824
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,290,113,137		1,205,057,926
剰余金増加額又は欠損金減少額		242,976,557		192,266,876
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		242,976,557		192,266,876
剰余金減少額又は欠損金増加額		458,859,541		536,791,160
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		458,859,541		536,791,160
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,205,057,926		1,011,408,488

(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12月10日現在)	第19期 (2021年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	700,126,288口	486,628,278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) 2.7212円 (27,212円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0784円 (30,784円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2019年12月11日 至 2020年12月10日			第19期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,789,122円	費用控除後の配当等収益額	A	29,354,805円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	46,550,675円	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	121,520,041円
収益調整金額	C	1,126,342,257円	収益調整金額	C	833,893,910円
分配準備積立金額	D	367,803,065円	分配準備積立金額	D	264,301,293円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,577,485,119円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,249,070,049円
当ファンドの期末残存口数	F	700,126,288口	当ファンドの期末残存口数	F	486,628,278口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,531円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	25,667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12月11日 至 2021年12月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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12月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第18期	第19期
	自 2019年12月11日 至 2020年12月10日	自 2020年12月11日 至 2021年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	815,389,267円	700,126,288円
期中追加設定元本額	181,680,786円	96,749,997円
期中一部解約元本額	296,943,765円	310,248,007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12月10日現在)	第19期 (2021年12月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	128,538,421	167,535,087
合計	128,538,421	167,535,087

（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	670,945,486	1,497,281,946	
合計		670,945,486	1,497,281,946	

(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12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,573,889,212
株式	296,073,141,580
派生商品評価勘定	1,551,150
未収配当金	190,330,492
前払金	8,742,500
差入委託証拠金	110,050,000
流動資産合計	298,957,704,934
資産合計	298,957,704,934
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,299,700
未払解約金	38,591,449
未払利息	1,670
流動負債合計	48,892,819
負債合計	48,892,819
純資産の部	
元本等	
元本	133,943,427,216
剰余金	
剰余金又は欠損金()	164,965,384,899
元本等合計	298,908,812,115
純資産合計	298,908,812,115
負債純資産合計	298,957,704,934

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,943,427,216口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.2316円 (1万口当たり純資産額) (22,316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12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年12月10日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年12月11日
期首元本額	137,089,975,360円
期中追加設定元本額	8,954,537,061円
期中一部解約元本額	12,101,085,205円
期末元本額	133,943,427,216円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,402,164円
D C日本株式インデックスファンド	308,393,631円
D C日本株式インデックスファンドL	53,569,832,084円
D C日本株式インデックスファンドA	670,945,486円
D Cバランスファンド30	2,243,918,748円
D Cバランスファンド50	3,521,243,158円
D Cバランスファンド70	2,052,041,418円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	571,128,173円
日本株式インデックスe	1,469,897,756円
インデックスコレクション（国内株式）	20,420,629,450円
インデックスコレクション（バランス株式30）	11,953,827,828円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,685,442,580円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,373,519,267円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,490,706,354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）	2,769,650,510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）	1,033,775,218円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	51,665,191円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	612,149,621円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	71,084,559円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	133,287,743円

区分	2021年12月10日現在
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	163,882,792円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	764,502,590円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	445,191,279円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,755,180,215円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	745,198,644円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	79,637,439円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,269,215,068円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	28,129,764円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	156,346,824円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,038,200,680円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	59,879,082円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	59,332,509円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	21,782,830円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	604,485,206円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	271,800,223円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	4,602,676,535円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	87,458,008円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	37,221,899円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	7,827,604円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	129,760,938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）	4,176,148円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	17,724,419,895	
合計	17,724,419,895	

(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12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,811,112,500	-	2,802,370,000	8,742,500
	合計	2,811,112,500	-	2,802,370,000	8,742,500

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	3,105.00	16,146,000	
日本水産	148,500	533.00	79,150,500	
マルハニチロ	23,200	2,356.00	54,659,200	
雪国まいたけ	10,800	1,225.00	13,230,000	
カネコ種苗	4,500	1,365.00	6,142,500	
サカタのタネ	17,700	3,265.00	57,790,500	
ホクト	12,500	1,885.00	23,562,500	
ホクリヨウ	2,000	698.00	1,396,000	
住石ホールディングス	26,000	131.00	3,406,000	
日鉄鉱業	3,400	6,320.00	21,488,000	
三井松島ホールディングス	6,200	1,353.00	8,388,600	
I N P E X	595,900	986.00	587,557,400	
石油資源開発	17,500	2,592.00	45,360,000	
K & O エナジーグループ	7,200	1,481.00	10,663,200	
ヒノキヤグループ	3,200	2,251.00	7,203,200	
ショーボンドホールディングス	21,200	5,150.00	109,180,000	
ミライト・ホールディングス	47,800	1,953.00	93,353,400	
タマホーム	9,000	2,220.00	19,980,000	
サンヨーホームズ	1,700	739.00	1,256,300	
日本アクア	5,900	740.00	4,366,000	
ファーストコーポレーション	4,500	711.00	3,199,500	
ベステラ	3,000	1,316.00	3,948,000	
R o b o t H o m e	24,800	224.00	5,555,200	
キャンディル	2,500	512.00	1,280,000	
スペースバリューホールディングス	15,700	1,147.00	18,007,900	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	1,629.00	4,724,100	
第一カッター興業	3,700	1,351.00	4,998,700	
安藤・間	81,600	885.00	72,216,000	
東急建設	43,500	666.00	28,971,000	

コムシスホールディングス	47,900	2,539.00	121,618,100
ピーアールホールディングス	20,200	351.00	7,090,200
高松コンストラクショングループ	9,200	1,950.00	17,940,000
東建コーポレーション	4,600	9,150.00	42,090,000
ソネック	1,500	1,017.00	1,525,500
ヤマウラ	7,200	939.00	6,760,800
オリエンタル白石	49,900	230.00	11,477,000
大成建設	99,100	3,490.00	345,859,000
大林組	343,000	876.00	300,468,000
清水建設	321,300	712.00	228,765,600
飛鳥建設	9,200	1,017.00	9,356,400
長谷工コーポレーション	102,100	1,431.00	146,105,100
松井建設	13,500	765.00	10,327,500
銭高組	1,500	3,820.00	5,730,000
鹿島建設	251,300	1,326.00	333,223,800
不動テトラ	7,300	1,686.00	12,307,800
大末建設	3,600	1,153.00	4,150,800
鉄建建設	7,400	1,808.00	13,379,200
西松建設	20,800	3,410.00	70,928,000
三井住友建設	77,300	423.00	32,697,900
大豊建設	5,000	3,690.00	18,450,000
佐田建設	7,400	471.00	3,485,400
ナカノフドー建設	8,200	338.00	2,771,600
奥村組	20,200	3,260.00	65,852,000
東鉄工業	15,900	2,435.00	38,716,500
イチケン	2,500	1,888.00	4,720,000
富士ピー・エス	4,400	512.00	2,252,800
浅沼組	3,800	5,340.00	20,292,000
戸田建設	142,400	725.00	103,240,000
熊谷組	17,500	2,879.00	50,382,500
北野建設	2,100	2,081.00	4,370,100
植木組	3,000	1,477.00	4,431,000
矢作建設工業	15,100	745.00	11,249,500
ピーエス三菱	11,300	604.00	6,825,200
日本ハウスホールディングス	23,400	397.00	9,289,800
大東建託	35,100	12,970.00	455,247,000
新日本建設	14,600	826.00	12,059,600
N I P P O	28,400	3,995.00	113,458,000
東亜道路工業	1,800	4,740.00	8,532,000
日本道路	3,300	8,160.00	26,928,000
東亜建設工業	8,400	2,491.00	20,924,400
日本国土開発	33,400	562.00	18,770,800

若築建設	5,700	1,944.00	11,080,800
東洋建設	38,500	580.00	22,330,000
五洋建設	136,000	674.00	91,664,000
世紀東急工業	16,500	844.00	13,926,000
福田組	3,700	4,375.00	16,187,500
住友林業	87,800	2,355.00	206,769,000
日本基礎技術	9,400	592.00	5,564,800
巴コーポレーション	15,200	463.00	7,037,600
大和ハウス工業	316,700	3,333.00	1,055,561,100
ライト工業	21,600	2,002.00	43,243,200
積水ハウス	372,000	2,369.50	881,454,000
日特建設	7,100	673.00	4,778,300
北陸電気工事	5,900	1,112.00	6,560,800
ユアテック	19,600	643.00	12,602,800
日本リーテック	7,200	1,669.00	12,016,800
四電工	3,700	1,671.00	6,182,700
中電工	15,800	2,116.00	33,432,800
関電工	55,800	841.00	46,927,800
きんでん	76,600	1,724.00	132,058,400
東京エネシス	11,400	1,100.00	12,540,000
トーエネック	3,400	3,275.00	11,135,000
住友電設	8,500	2,060.00	17,510,000
日本電設工業	18,800	1,646.00	30,944,800
エクシオグループ	52,000	2,466.00	128,232,000
新日本空調	9,100	2,251.00	20,484,100
九電工	26,500	3,560.00	94,340,000
三機工業	22,300	1,424.00	31,755,200
日揮ホールディングス	105,700	990.00	104,643,000
中外炉工業	3,400	1,606.00	5,460,400
ヤマト	10,100	771.00	7,787,100
太平電業	7,600	2,804.00	21,310,400
高砂熱学工業	31,000	1,894.00	58,714,000
三晃金属工業	1,300	2,307.00	2,999,100
朝日工業社	2,300	3,245.00	7,463,500
明星工業	22,200	713.00	15,828,600
大気社	16,700	3,050.00	50,935,000
ダイダン	7,600	2,287.00	17,381,200
日比谷総合設備	11,000	2,040.00	22,440,000
フィル・カンパニー	2,000	2,250.00	4,500,000
テスホールディングス	6,300	2,587.00	16,298,100
インフロニア・ホールディングス	146,200	1,018.00	148,831,600
東洋エンジニアリング	14,400	721.00	10,382,400

レイズネクスト	16,600	1,179.00	19,571,400
ニッポン	32,100	1,636.00	52,515,600
日清製粉グループ本社	124,000	1,662.00	206,088,000
日東富士製粉	1,600	3,570.00	5,712,000
昭和産業	10,400	2,625.00	27,300,000
鳥越製粉	9,700	714.00	6,925,800
中部飼料	12,400	936.00	11,606,400
フィード・ワン	14,700	700.00	10,290,000
東洋精糖	1,800	1,118.00	2,012,400
日本甜菜製糖	5,700	1,698.00	9,678,600
D M三井製糖ホールディングス	10,000	1,931.00	19,310,000
塩水港精糖	13,100	216.00	2,829,600
日新製糖	5,200	1,689.00	8,782,800
森永製菓	25,800	3,755.00	96,879,000
中村屋	2,600	3,680.00	9,568,000
江崎グリコ	30,200	3,665.00	110,683,000
名糖産業	4,800	1,700.00	8,160,000
井村屋グループ	6,200	2,278.00	14,123,600
不二家	6,100	2,316.00	14,127,600
山崎製パン	82,300	1,524.00	125,425,200
第一屋製パン	2,100	573.00	1,203,300
モロゾフ	1,700	5,320.00	9,044,000
亀田製菓	6,300	4,405.00	27,751,500
寿スピリッツ	10,600	5,910.00	62,646,000
カルビー	50,000	2,656.00	132,800,000
森永乳業	20,300	5,530.00	112,259,000
六甲バター	8,000	1,611.00	12,888,000
ヤクルト本社	81,300	5,870.00	477,231,000
明治ホールディングス	72,600	6,920.00	502,392,000
雪印メグミルク	26,400	2,091.00	55,202,400
プリマハム	13,700	2,446.00	33,510,200
日本ハム	42,000	4,020.00	168,840,000
林兼産業	3,300	538.00	1,775,400
丸大食品	10,800	1,485.00	16,038,000
S Foods	9,900	3,445.00	34,105,500
柿安本店	3,800	2,735.00	10,393,000
伊藤ハム米久ホールディングス	70,700	651.00	46,025,700
サッポロホールディングス	37,500	2,279.00	85,462,500
アサヒグループホールディングス	258,200	4,550.00	1,174,810,000
キリンホールディングス	403,500	1,850.50	746,676,750
宝ホールディングス	74,600	1,230.00	91,758,000
オエノンホールディングス	31,200	371.00	11,575,200

養命酒製造	3,400	1,782.00	6,058,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,000	1,359.00	104,643,000
サントリー食品インターナショナル	73,400	4,165.00	305,711,000
ダイドーグループホールディングス	5,600	4,985.00	27,916,000
伊藤園	33,300	6,210.00	206,793,000
キーコーヒー	10,800	2,028.00	21,902,400
ユニカフェ	3,300	1,051.00	3,468,300
ジャパンフーズ	1,600	1,222.00	1,955,200
日清オイリオグループ	13,700	2,859.00	39,168,300
不二製油グループ本社	23,800	2,322.00	55,263,600
かどや製油	1,200	4,095.00	4,914,000
J - オイルミルズ	10,200	1,707.00	17,411,400
キッコーマン	79,000	8,760.00	692,040,000
味の素	242,400	3,401.00	824,402,400
ブルドックソース	4,600	2,130.00	9,798,000
キューピー	57,700	2,404.00	138,710,800
ハウス食品グループ本社	41,100	2,929.00	120,381,900
カゴメ	41,700	2,927.00	122,055,900
焼津水産化学工業	5,300	965.00	5,114,500
アリアケジャパン	10,000	6,550.00	65,500,000
ピエトロ	1,400	1,795.00	2,513,000
エバラ食品工業	2,400	2,465.00	5,916,000
やまみ	1,200	1,887.00	2,264,400
ニチレイ	52,300	2,623.00	137,182,900
東洋水産	52,700	4,785.00	252,169,500
イトアンドホールディングス	4,100	2,148.00	8,806,800
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	5,700	647.00	3,687,900
日清食品ホールディングス	43,100	8,340.00	359,454,000
永谷園ホールディングス	4,900	2,015.00	9,873,500
一正蒲鉾	4,300	852.00	3,663,600
フジッコ	11,900	1,863.00	22,169,700
ロック・フィールド	11,800	1,508.00	17,794,400
日本たばこ産業	588,600	2,332.50	1,372,909,500
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,336.00	8,283,200
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,026.00	14,587,200
なとり	6,100	1,988.00	12,126,800
イフジ産業	1,900	933.00	1,772,700
ピクルスコーポレーション	5,200	1,911.00	9,937,200
ファーマフーズ	10,400	2,151.00	22,370,400
ユーグレナ	55,900	722.00	40,359,800
紀文食品	6,400	987.00	6,316,800

ミヨシ油脂	4,200	1,312.00	5,510,400
理研ビタミン	11,400	1,664.00	18,969,600
片倉工業	12,100	2,165.00	26,196,500
ゲンゼ	7,300	4,115.00	30,039,500
東洋紡	42,600	1,258.00	53,590,800
ユニチカ	30,400	301.00	9,150,400
富士紡ホールディングス	4,900	4,030.00	19,747,000
倉敷紡績	9,300	1,974.00	18,358,200
シキボウ	5,600	926.00	5,185,600
日本毛織	32,600	911.00	29,698,600
トーア紡コーポレーション	3,900	427.00	1,665,300
帝国繊維	12,200	2,130.00	25,986,000
帝人	101,100	1,374.00	138,911,400
東レ	776,000	692.70	537,535,200
住江織物	2,300	1,516.00	3,486,800
日本フェルト	6,800	443.00	3,012,400
イチカワ	1,600	1,363.00	2,180,800
日東製網	1,100	1,430.00	1,573,000
アツギ	8,400	637.00	5,350,800
ダイニック	4,000	708.00	2,832,000
セーレン	22,100	2,516.00	55,603,600
ソトー	4,000	805.00	3,220,000
東海染工	1,300	1,129.00	1,467,700
小松マテーレ	17,700	1,277.00	22,602,900
ワコールホールディングス	26,800	2,124.00	56,923,200
ホギメディカル	14,500	3,185.00	46,182,500
T S Iホールディングス	36,100	354.00	12,779,400
マツオカコーポレーション	3,500	1,222.00	4,277,000
ワールド	14,100	1,216.00	17,145,600
三陽商会	5,100	928.00	4,732,800
ナイガイ	4,000	305.00	1,220,000
オンワードホールディングス	64,700	305.00	19,733,500
ルックホールディングス	3,500	1,310.00	4,585,000
ゴールドウイン	19,400	6,500.00	126,100,000
デサント	20,900	4,180.00	87,362,000
キング	5,300	551.00	2,920,300
ヤマトインターナショナル	9,800	296.00	2,900,800
特種東海製紙	6,600	4,080.00	26,928,000
王子ホールディングス	447,800	553.00	247,633,400
日本製紙	51,300	1,129.00	57,917,700
三菱製紙	15,200	322.00	4,894,400
北越コーポレーション	70,200	763.00	53,562,600

中越パルプ工業	4,100	982.00	4,026,200
巴川製紙所	3,200	817.00	2,614,400
大王製紙	51,700	1,889.00	97,661,300
阿波製紙	2,800	362.00	1,013,600
レンゴー	101,200	851.00	86,121,200
トモク	6,600	1,827.00	12,058,200
ザ・パック	8,100	2,867.00	23,222,700
北の達人コーポレーション	38,300	359.00	13,749,700
クラレ	156,600	1,004.00	157,226,400
旭化成	710,000	1,102.50	782,775,000
共和レザー	6,700	624.00	4,180,800
昭和電工	92,900	2,568.00	238,567,200
住友化学	787,000	534.00	420,258,000
住友精化	4,700	3,145.00	14,781,500
日産化学	58,300	6,620.00	385,946,000
ラサ工業	3,800	1,688.00	6,414,400
クレハ	8,500	8,070.00	68,595,000
多木化学	4,200	6,100.00	25,620,000
テイカ	7,900	1,299.00	10,262,100
石原産業	17,800	1,186.00	21,110,800
片倉コープアグリ	2,400	1,165.00	2,796,000
日本曹達	13,700	3,380.00	46,306,000
東ソー	154,500	1,684.00	260,178,000
トクヤマ	34,300	1,843.00	63,214,900
セントラル硝子	17,500	2,038.00	35,665,000
東亜合成	61,000	1,220.00	74,420,000
大阪ソーダ	10,000	2,879.00	28,790,000
関東電化工業	23,400	1,051.00	24,593,400
デンカ	39,100	3,610.00	141,151,000
信越化学工業	183,900	19,470.00	3,580,533,000
日本カーバイド工業	3,800	1,304.00	4,955,200
堺化学工業	7,500	2,337.00	17,527,500
第一稀元素化学工業	9,900	1,290.00	12,771,000
エア・ウォーター	101,400	1,783.00	180,796,200
日本酸素ホールディングス	102,900	2,575.00	264,967,500
日本化学工業	3,300	2,672.00	8,817,600
東邦アセチレン	1,800	1,263.00	2,273,400
日本パーカライジング	54,000	1,123.00	60,642,000
高压ガス工業	17,000	803.00	13,651,000
チタン工業	1,200	1,678.00	2,013,600
四国化成工業	14,000	1,430.00	20,020,000
戸田工業	2,300	3,140.00	7,222,000

ステラ ケミファ	5,400	2,592.00	13,996,800	
保土谷化学工業	3,400	5,860.00	19,924,000	
日本触媒	18,000	5,260.00	94,680,000	
大日精化工業	8,800	2,272.00	19,993,600	
カネカ	27,700	3,850.00	106,645,000	
三菱瓦斯化学	99,600	1,932.00	192,427,200	
三井化学	97,300	3,180.00	309,414,000	
J S R	99,800	4,320.00	431,136,000	
東京応化工業	18,400	7,130.00	131,192,000	
大阪有機化学工業	9,100	3,570.00	32,487,000	
三菱ケミカルホールディングス	716,100	840.10	601,595,610	
K Hネオケム	17,700	3,015.00	53,365,500	
ダイセル	154,300	799.00	123,285,700	
住友ベークライト	16,800	5,540.00	93,072,000	
積水化学工業	224,200	1,948.00	436,741,600	
日本ゼオン	96,600	1,249.00	120,653,400	
アイカ工業	29,800	3,505.00	104,449,000	
宇部興産	50,500	1,967.00	99,333,500	
積水樹脂	16,200	2,115.00	34,263,000	
タキロンシーアイ	23,200	549.00	12,736,800	
旭有機材	6,100	1,730.00	10,553,000	
ニチバン	6,300	1,864.00	11,743,200	
リケンテクノス	26,100	511.00	13,337,100	
大倉工業	5,500	2,193.00	12,061,500	
積水化成成品工業	14,400	495.00	7,128,000	
群栄化学工業	2,400	3,600.00	8,640,000	
タイガースポリマー	5,600	455.00	2,548,000	
ミライアル	3,400	1,808.00	6,147,200	
ダイキアクシス	4,100	836.00	3,427,600	
ダイキョーニシカワ	22,600	554.00	12,520,400	
竹本容器	3,800	830.00	3,154,000	
森六ホールディングス	5,800	1,840.00	10,672,000	
恵和	2,700	5,620.00	15,174,000	
日本化薬	84,400	1,183.00	99,845,200	
カーリットホールディングス	10,600	692.00	7,335,200	
日本精化	8,600	2,227.00	19,152,200	
扶桑化学工業	9,600	4,785.00	45,936,000	
トリケミカル研究所	11,000	3,785.00	41,635,000	
A D E K A	49,300	2,578.00	127,095,400	
日油	36,600	5,730.00	209,718,000	
新日本理化	17,700	253.00	4,478,100	
ハリマ化成グループ	8,000	810.00	6,480,000	

花王	241,900	6,031.00	1,458,898,900
第一工業製薬	4,000	3,170.00	12,680,000
石原ケミカル	5,400	1,335.00	7,209,000
日華化学	3,600	839.00	3,020,400
ニイタカ	2,200	2,211.00	4,864,200
三洋化成工業	6,400	5,250.00	33,600,000
有機合成薬品工業	7,500	280.00	2,100,000
大日本塗料	13,100	851.00	11,148,100
日本ペイントホールディングス	402,500	1,310.00	527,275,000
関西ペイント	111,100	2,629.00	292,081,900
神東塗料	8,400	181.00	1,520,400
中国塗料	25,300	903.00	22,845,900
日本特殊塗料	8,000	833.00	6,664,000
藤倉化成	13,300	483.00	6,423,900
太陽ホールディングス	15,800	3,365.00	53,167,000
D I C	45,200	2,960.00	133,792,000
サカタインクス	21,300	1,025.00	21,832,500
東洋インキS Cホールディングス	22,600	1,956.00	44,205,600
T & K T O K A	8,600	822.00	7,069,200
富士フィルムホールディングス	192,200	8,608.00	1,654,457,600
資生堂	203,700	6,738.00	1,372,530,600
ライオン	132,000	1,586.00	209,352,000
高砂香料工業	7,500	2,822.00	21,165,000
マンダム	22,900	1,423.00	32,586,700
ミルボン	13,500	5,680.00	76,680,000
ファンケル	44,300	3,530.00	156,379,000
コーセー	20,600	13,970.00	287,782,000
コタ	6,900	1,552.00	10,708,800
シーボン	1,400	1,697.00	2,375,800
ポーラ・オルビスホールディングス	46,700	2,105.00	98,303,500
ノエビアホールディングス	9,300	5,360.00	49,848,000
アジュバンホールディングス	2,400	1,120.00	2,688,000
新日本製薬	3,000	1,124.00	3,372,000
エステー	7,000	1,556.00	10,892,000
アグロ カネショウ	3,600	1,255.00	4,518,000
コニシ	18,000	1,734.00	31,212,000
長谷川香料	18,900	2,751.00	51,993,900
星光P M C	6,200	704.00	4,364,800
小林製薬	30,600	9,140.00	279,684,000
荒川化学工業	9,100	1,189.00	10,819,900
メック	8,200	4,270.00	35,014,000
日本高純度化学	3,000	2,598.00	7,794,000

タカラバイオ	28,600	2,623.00	75,017,800
J C U	12,300	5,110.00	62,853,000
新田ゼラチン	6,900	606.00	4,181,400
O A T アグリオ	2,300	2,106.00	4,843,800
デクセリアルズ	28,400	3,890.00	110,476,000
アース製薬	9,000	6,490.00	58,410,000
北興化学工業	10,200	878.00	8,955,600
大成ラミック	3,400	2,825.00	9,605,000
クミアイ化学工業	40,700	831.00	33,821,700
日本農薬	19,500	488.00	9,516,000
アキレス	7,000	1,257.00	8,799,000
有沢製作所	16,000	953.00	15,248,000
日東電工	66,100	8,500.00	561,850,000
レック	14,300	867.00	12,398,100
三光合成	11,500	385.00	4,427,500
きもと	16,700	216.00	3,607,200
藤森工業	9,800	3,770.00	36,946,000
前澤化成工業	6,900	1,281.00	8,838,900
未来工業	3,900	1,600.00	6,240,000
ウェーブロックホールディングス	4,200	777.00	3,263,400
J S P	6,400	1,637.00	10,476,800
エフピコ	20,100	4,045.00	81,304,500
天馬	9,000	2,574.00	23,166,000
信越ポリマー	19,600	1,129.00	22,128,400
東リ	27,200	225.00	6,120,000
ニフコ	36,500	3,350.00	122,275,000
バルカー	8,900	2,533.00	22,543,700
ユニ・チャーム	210,800	4,784.00	1,008,467,200
ショーエイコーポレーション	2,900	714.00	2,070,600
協和キリン	128,400	3,205.00	411,522,000
武田薬品工業	859,600	3,081.00	2,648,427,600
アステラス製薬	948,300	1,777.00	1,685,129,100
大日本住友製薬	67,600	1,336.00	90,313,600
塩野義製薬	137,500	7,700.00	1,058,750,000
わかもと製薬	13,000	292.00	3,796,000
日本新薬	28,600	8,080.00	231,088,000
中外製薬	342,100	3,700.00	1,265,770,000
科研製薬	17,200	4,135.00	71,122,000
エーザイ	130,900	6,714.00	878,862,600
ロート製薬	56,100	3,430.00	192,423,000
小野薬品工業	251,200	2,747.00	690,046,400
久光製薬	28,900	3,900.00	112,710,000

持田製薬	13,800	3,430.00	47,334,000
参天製薬	203,900	1,412.00	287,906,800
扶桑薬品工業	3,900	2,462.00	9,601,800
日本ケミファ	1,300	1,971.00	2,562,300
ツムラ	33,900	3,340.00	113,226,000
日医工	33,900	696.00	23,594,400
キッセイ薬品工業	19,400	2,140.00	41,516,000
生化学工業	19,300	979.00	18,894,700
栄研化学	19,200	1,956.00	37,555,200
日水製薬	4,000	1,104.00	4,416,000
鳥居薬品	5,900	2,830.00	16,697,000
JCRファーマ	30,800	2,249.00	69,269,200
東和薬品	15,700	2,717.00	42,656,900
富士製薬工業	6,700	1,017.00	6,813,900
ゼリア新薬工業	19,800	1,975.00	39,105,000
第一三共	859,500	2,807.50	2,413,046,250
キョーリン製薬ホールディングス	21,900	1,793.00	39,266,700
大幸薬品	16,500	787.00	12,985,500
ダイト	7,000	2,987.00	20,909,000
大塚ホールディングス	227,300	4,094.00	930,566,200
大正製薬ホールディングス	26,000	5,420.00	140,920,000
ペプチドリーム	57,400	2,779.00	159,514,600
あすか製薬ホールディングス	12,500	964.00	12,050,000
サワイグループホールディングス	24,000	4,485.00	107,640,000
日本コークス工業	92,400	127.00	11,734,800
ニチレキ	14,000	1,454.00	20,356,000
ユシロ化学工業	5,700	1,101.00	6,275,700
ビーピー・カストロール	3,900	1,406.00	5,483,400
富士石油	29,200	261.00	7,621,200
MORESCO	3,600	1,146.00	4,125,600
出光興産	121,400	2,958.00	359,101,200
ENEOSホールディングス	1,645,300	431.00	709,124,300
コスモエネルギーホールディングス	31,700	2,340.00	74,178,000
横浜ゴム	63,300	1,864.00	117,991,200
TOYO TIRE	57,600	1,802.00	103,795,200
ブリヂストン	315,100	4,923.00	1,551,237,300
住友ゴム工業	98,300	1,213.00	119,237,900
藤倉コンポジット	8,800	815.00	7,172,000
オカモト	6,500	4,105.00	26,682,500
フコク	4,800	946.00	4,540,800
ニッタ	11,300	2,899.00	32,758,700
住友理工	21,200	610.00	12,932,000

三ツ星ベルト	13,300	2,040.00	27,132,000
バンドー化学	17,600	883.00	15,540,800
日東紡績	16,300	2,983.00	48,622,900
A G C	100,400	5,600.00	562,240,000
日本板硝子	52,500	517.00	27,142,500
石塚硝子	1,900	1,948.00	3,701,200
日本山村硝子	4,200	800.00	3,360,000
日本電気硝子	44,000	2,997.00	131,868,000
オハラ	4,400	1,405.00	6,182,000
住友大阪セメント	20,200	3,625.00	73,225,000
太平洋セメント	62,200	2,309.00	143,619,800
日本ヒューム	11,000	703.00	7,733,000
日本コンクリート工業	21,800	265.00	5,777,000
三谷セキサン	5,100	7,880.00	40,188,000
アジアパイルホールディングス	16,900	433.00	7,317,700
東海カーボン	91,700	1,212.00	111,140,400
日本カーボン	5,600	4,365.00	24,444,000
東洋炭素	7,100	3,380.00	23,998,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,745.00	28,944,500
T O T O	78,100	5,510.00	430,331,000
日本碍子	118,500	1,875.00	222,187,500
日本特殊陶業	83,200	1,974.00	164,236,800
M A R U W A	3,800	14,640.00	55,632,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,595.00	9,347,000
黒崎播磨	1,900	4,160.00	7,904,000
ヨータイ	7,000	1,275.00	8,925,000
イソライト工業	4,900	882.00	4,321,800
東京窯業	14,100	309.00	4,356,900
ニッカトー	5,000	684.00	3,420,000
フジミインコーポレーテッド	8,800	7,740.00	68,112,000
クニミネ工業	3,500	1,039.00	3,636,500
エーアンドエーマテリアル	1,800	919.00	1,654,200
ニチアス	25,300	2,770.00	70,081,000
ニチハ	15,200	3,080.00	46,816,000
日本製鉄	484,100	1,839.50	890,501,950
神戸製鋼所	202,000	573.00	115,746,000
中山製鋼所	17,200	431.00	7,413,200
合同製鐵	5,900	1,373.00	8,100,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	292,100	1,407.00	410,984,700
東京製鐵	36,900	1,378.00	50,848,200
共英製鋼	12,200	1,359.00	16,579,800
大和工業	20,700	3,710.00	76,797,000

東京鐵鋼	4,800	1,325.00	6,360,000
大阪製鐵	5,800	1,172.00	6,797,600
淀川製鋼所	14,200	2,468.00	35,045,600
丸一鋼管	38,300	2,632.00	100,805,600
モリ工業	3,200	2,708.00	8,665,600
大同特殊鋼	17,700	4,150.00	73,455,000
日本高周波鋼業	4,100	349.00	1,430,900
日本冶金工業	7,900	2,174.00	17,174,600
山陽特殊製鋼	11,100	1,934.00	21,467,400
愛知製鋼	6,100	2,521.00	15,378,100
日立金属	116,500	2,131.00	248,261,500
日本金属	2,700	921.00	2,486,700
大平洋金属	6,700	2,152.00	14,418,400
新日本電工	70,000	295.00	20,650,000
栗本鐵工所	4,900	1,541.00	7,550,900
虹技	1,500	1,007.00	1,510,500
三菱製鋼	7,000	1,009.00	7,063,000
日亜鋼業	14,200	276.00	3,919,200
日本精線	1,800	4,785.00	8,613,000
エンビプロ・ホールディングス	4,600	1,854.00	8,528,400
シンニッタン	13,300	223.00	2,965,900
新家工業	2,700	1,678.00	4,530,600
大紀アルミニウム工業所	16,300	1,421.00	23,162,300
日本軽金属ホールディングス	27,400	1,690.00	46,306,000
三井金属鉱業	29,200	3,025.00	88,330,000
東邦亜鉛	6,000	2,216.00	13,296,000
三菱マテリアル	71,500	2,027.00	144,930,500
住友金属鉱山	138,300	4,441.00	614,190,300
D O W A ホールディングス	29,500	4,490.00	132,455,000
古河機械金属	17,900	1,251.00	22,392,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,600	812.00	10,231,200
東邦チタニウム	19,400	963.00	18,682,200
U A C J	16,400	2,394.00	39,261,600
C K サンエツ	2,300	3,965.00	9,119,500
古河電気工業	33,600	2,304.00	77,414,400
住友電気工業	404,400	1,522.50	615,699,000
フジクラ	120,700	583.00	70,368,100
昭和電線ホールディングス	9,500	1,836.00	17,442,000
東京特殊電線	1,600	2,892.00	4,627,200
タツタ電線	19,200	479.00	9,196,800
カナレ電気	1,600	1,732.00	2,771,200
平河ヒューテック	6,000	1,202.00	7,212,000

リヨービ	13,400	1,128.00	15,115,200
アーレスティ	11,700	371.00	4,340,700
アサヒホールディングス	43,300	2,005.00	86,816,500
稲葉製作所	6,100	1,336.00	8,149,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	3,150.00	10,395,000
トーカロ	27,900	1,522.00	42,463,800
アルファC o	4,200	1,190.00	4,998,000
SUMCO	166,500	2,372.00	394,938,000
川田テクノロジーズ	2,200	3,805.00	8,371,000
RS Technologies	3,500	6,350.00	22,225,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	1,914.00	2,296,800
信和	6,700	766.00	5,132,200
東洋製罐グループホールディングス	68,900	1,422.00	97,975,800
ホッカンホールディングス	5,900	1,456.00	8,590,400
コロナ	6,000	906.00	5,436,000
横河ブリッジホールディングス	18,600	2,149.00	39,971,400
駒井ハルテック	2,000	2,129.00	4,258,000
高田機工	1,000	2,718.00	2,718,000
三和ホールディングス	102,000	1,244.00	126,888,000
文化シャッター	34,300	1,056.00	36,220,800
三協立山	13,900	733.00	10,188,700
アルインコ	7,900	968.00	7,647,200
東洋シャッター	2,400	618.00	1,483,200
LIXIL	170,200	3,070.00	522,514,000
日本フィルコン	7,500	532.00	3,990,000
ノーリツ	20,700	1,747.00	36,162,900
長府製作所	11,000	2,045.00	22,495,000
リンナイ	20,400	10,900.00	222,360,000
ダイニチ工業	5,200	771.00	4,009,200
日東精工	13,600	623.00	8,472,800
三洋工業	1,300	1,862.00	2,420,600
岡部	21,900	738.00	16,162,200
ジーテクト	13,400	1,442.00	19,322,800
東ブレ	20,200	1,140.00	23,028,000
高周波熱錬	19,300	582.00	11,232,600
東京製綱	6,600	973.00	6,421,800
サンコール	9,300	457.00	4,250,100
モリテック スチール	8,400	380.00	3,192,000
パイオラックス	16,000	1,761.00	28,176,000
エイチワン	10,600	670.00	7,102,000
日本発條	99,500	992.00	98,704,000
中央発條	5,200	901.00	4,685,200

アドバネクス	1,400	1,215.00	1,701,000
立川ブラインド工業	4,800	1,197.00	5,745,600
三益半導体工業	8,400	2,439.00	20,487,600
日本ドライケミカル	2,700	1,921.00	5,186,700
日本製鋼所	32,900	3,700.00	121,730,000
三浦工業	46,800	3,975.00	186,030,000
タクマ	36,800	1,413.00	51,998,400
ツガミ	26,000	1,556.00	40,456,000
オークマ	12,600	5,060.00	63,756,000
芝浦機械	12,300	3,700.00	45,510,000
アマダ	170,900	1,154.00	197,218,600
アイダエンジニアリング	28,500	973.00	27,730,500
滝澤鉄工所	3,200	1,210.00	3,872,000
F U J I	49,900	2,701.00	134,779,900
牧野フライス製作所	11,900	3,835.00	45,636,500
オーエスジー	50,100	1,758.00	88,075,800
ダイジェット工業	1,400	991.00	1,387,400
旭ダイヤモンド工業	28,600	652.00	18,647,200
D M G 森精機	64,300	1,986.00	127,699,800
ソディック	24,000	830.00	19,920,000
ディスコ	15,900	33,050.00	525,495,000
日東工器	6,000	1,782.00	10,692,000
日進工具	8,500	1,528.00	12,988,000
パンチ工業	9,100	536.00	4,877,600
富士ダイス	5,500	676.00	3,718,000
豊和工業	5,800	788.00	4,570,400
O K K	4,100	747.00	3,062,700
東洋機械金属	7,200	518.00	3,729,600
津田駒工業	2,100	665.00	1,396,500
エンシュウ	2,700	670.00	1,809,000
島精機製作所	15,900	2,075.00	32,992,500
オプトラン	13,600	2,492.00	33,891,200
N C ホールディングス	3,100	1,553.00	4,814,300
イワキポンプ	6,900	1,033.00	7,127,700
フリーー	9,700	1,280.00	12,416,000
ヤマシンフィルタ	21,900	501.00	10,971,900
日阪製作所	13,400	854.00	11,443,600
やまびこ	21,000	1,302.00	27,342,000
野村マイクロ・サイエンス	2,900	4,955.00	14,369,500
平田機工	5,100	6,020.00	30,702,000
ペガサスミシン製造	11,100	493.00	5,472,300
マルマエ	4,500	2,841.00	12,784,500

タツモ	5,100	1,567.00	7,991,700
ナブテスコ	61,700	3,235.00	199,599,500
三井海洋開発	11,500	1,413.00	16,249,500
レオン自動機	11,600	1,390.00	16,124,000
S M C	32,000	76,120.00	2,435,840,000
ホソカワミクロン	7,600	3,150.00	23,940,000
ユニオンツール	4,000	4,015.00	16,060,000
オイレス工業	15,200	1,764.00	26,812,800
日精エー・エス・ビー機械	3,700	3,085.00	11,414,500
サトーホールディングス	14,300	2,198.00	31,431,400
技研製作所	9,600	4,290.00	41,184,000
日本エアーテック	5,000	1,255.00	6,275,000
カワタ	3,500	892.00	3,122,000
日精樹脂工業	7,700	1,021.00	7,861,700
オカダアイヨン	3,500	1,489.00	5,211,500
ワイエイシイホールディングス	4,300	909.00	3,908,700
小松製作所	495,700	2,709.50	1,343,099,150
住友重機械工業	62,700	2,663.00	166,970,100
日立建機	43,900	3,365.00	147,723,500
日工	15,200	627.00	9,530,400
巴工業	4,300	2,348.00	10,096,400
井関農機	10,300	1,441.00	14,842,300
T O W A	9,400	3,190.00	29,986,000
丸山製作所	2,300	1,573.00	3,617,900
北川鉄工所	5,000	1,474.00	7,370,000
ローツェ	5,400	11,980.00	64,692,000
タカキタ	3,900	658.00	2,566,200
クボタ	533,600	2,550.00	1,360,680,000
荏原実業	5,100	2,534.00	12,923,400
三菱化工機	3,600	2,281.00	8,211,600
月島機械	20,300	1,141.00	23,162,300
帝国電機製作所	7,700	1,473.00	11,342,100
新東工業	24,400	716.00	17,470,400
澁谷工業	9,600	3,040.00	29,184,000
アイチ コーポレーション	16,200	809.00	13,105,800
小森コーポレーション	28,000	727.00	20,356,000
鶴見製作所	8,500	1,620.00	13,770,000
住友精密工業	1,700	2,142.00	3,641,400
日本ギア工業	4,100	276.00	1,131,600
酒井重工業	2,000	2,797.00	5,594,000
荏原製作所	45,400	6,550.00	297,370,000
石井鐵工所	1,600	2,978.00	4,764,800

西島製作所	10,100	917.00	9,261,700	
北越工業	10,300	1,005.00	10,351,500	
ダイキン工業	139,300	26,470.00	3,687,271,000	
オルガノ	3,200	7,570.00	24,224,000	
トーヨーカネツ	4,200	2,537.00	10,655,400	
栗田工業	59,200	5,200.00	307,840,000	
椿本チエイン	14,400	3,035.00	43,704,000	
大同工業	5,000	941.00	4,705,000	
木村化工機	9,300	921.00	8,565,300	
アネスト岩田	17,100	926.00	15,834,600	
ダイフク	60,200	9,580.00	576,716,000	
サムコ	2,800	3,080.00	8,624,000	
加藤製作所	5,400	843.00	4,552,200	
油研工業	1,900	1,714.00	3,256,600	
タダノ	57,300	1,098.00	62,915,400	
フジテック	40,600	2,537.00	103,002,200	
C K D	32,300	2,230.00	72,029,000	
キトー	9,300	1,883.00	17,511,900	
平和	30,500	1,925.00	58,712,500	
理想科学工業	9,200	2,085.00	19,182,000	
S A N K Y O	23,700	3,100.00	73,470,000	
日本金銭機械	11,200	691.00	7,739,200	
マースグループホールディングス	7,000	1,649.00	11,543,000	
フクシマガリレイ	7,500	4,645.00	34,837,500	
オーイズミ	4,000	389.00	1,556,000	
ダイコク電機	5,100	1,212.00	6,181,200	
竹内製作所	16,700	2,750.00	45,925,000	
アマノ	28,700	2,652.00	76,112,400	
J U K I	15,200	905.00	13,756,000	
ジャノメ	9,400	656.00	6,166,400	
マックス	14,600	1,861.00	27,170,600	
グローリー	28,100	2,200.00	61,820,000	
新晃工業	10,200	1,900.00	19,380,000	
大和冷機工業	15,900	1,236.00	19,652,400	
セガサミーホールディングス	108,500	1,902.00	206,367,000	
日本ピストンリング	4,000	1,266.00	5,064,000	
リケン	4,700	2,534.00	11,909,800	
T P R	14,800	1,463.00	21,652,400	
ツバキ・ナカシマ	24,000	1,492.00	35,808,000	
ホシザキ	32,000	8,580.00	274,560,000	
大豊工業	9,000	764.00	6,876,000	
日本精工	206,000	779.00	160,474,000	

NTN	235,000	227.00	53,345,000	
ジェイテクト	105,000	1,060.00	111,300,000	
不二越	9,300	4,100.00	38,130,000	
日本トムソン	30,000	680.00	20,400,000	
THK	63,700	2,752.00	175,302,400	
ユーシン精機	8,600	756.00	6,501,600	
前澤給装工業	8,300	1,034.00	8,582,200	
イーグル工業	13,600	1,094.00	14,878,400	
前澤工業	6,700	615.00	4,120,500	
日本ピラー工業	11,100	3,345.00	37,129,500	
キッツ	36,900	741.00	27,342,900	
マキタ	133,100	4,979.00	662,704,900	
三井E&Sホールディングス	39,500	379.00	14,970,500	
日立造船	92,700	795.00	73,696,500	
三菱重工業	171,900	2,653.50	456,136,650	
IHI	68,400	2,276.00	155,678,400	
スター精密	16,900	1,608.00	27,175,200	
日清紡ホールディングス	66,900	876.00	58,604,400	
イビデン	57,500	6,860.00	394,450,000	
コニカミノルタ	240,100	492.00	118,129,200	
ブラザー工業	133,800	2,085.00	278,973,000	
ミネベアミツミ	188,700	3,290.00	620,823,000	
日立製作所	526,000	6,540.00	3,440,040,000	
東芝	191,100	4,682.00	894,730,200	
三菱電機	1,093,700	1,479.00	1,617,582,300	
富士電機	65,900	6,100.00	401,990,000	
東洋電機製造	4,300	1,052.00	4,523,600	
安川電機	117,700	5,710.00	672,067,000	
シンフォニアテクノロジー	13,100	1,299.00	17,016,900	
明電舎	18,600	2,677.00	49,792,200	
オリジン	2,700	1,285.00	3,469,500	
山洋電気	5,000	5,780.00	28,900,000	
デンヨー	9,300	1,746.00	16,237,800	
PHCホールディングス	12,800	2,129.00	27,251,200	
東芝テック	11,700	4,500.00	52,650,000	
芝浦メカトロニクス	2,000	8,250.00	16,500,000	
マブチモーター	25,700	3,870.00	99,459,000	
日本電産	283,500	13,430.00	3,807,405,000	
トレックス・セミコンダクター	5,700	3,325.00	18,952,500	
東光高岳	6,600	1,349.00	8,903,400	
ダイヘン	12,000	4,545.00	54,540,000	
ヤーマン	18,500	997.00	18,444,500	

JVCケンウッド	93,100	167.00	15,547,700
ミマキエンジニアリング	10,600	884.00	9,370,400
I-PEX	5,400	1,987.00	10,729,800
日新電機	25,600	1,483.00	37,964,800
大崎電気工業	20,100	453.00	9,105,300
オムロン	91,000	11,750.00	1,069,250,000
日東工業	14,600	1,606.00	23,447,600
I D E C	13,500	2,843.00	38,380,500
正興電機製作所	4,000	1,215.00	4,860,000
不二電機工業	2,600	1,169.00	3,039,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,700	2,501.00	91,786,700
サクサホールディングス	2,500	1,354.00	3,385,000
メルコホールディングス	3,200	4,115.00	13,168,000
テクノメディカ	2,900	1,685.00	4,886,500
日本電気	139,000	5,330.00	740,870,000
富士通	98,400	19,620.00	1,930,608,000
沖電気工業	44,400	890.00	39,516,000
岩崎通信機	4,400	849.00	3,735,600
電気興業	5,700	2,640.00	15,048,000
サンケン電気	10,200	5,970.00	60,894,000
ナカヨ	2,000	1,249.00	2,498,000
アイホン	6,200	1,985.00	12,307,000
ルネサスエレクトロニクス	593,000	1,456.00	863,408,000
セイコーエプソン	135,700	1,958.00	265,700,600
ワコム	85,400	932.00	79,592,800
アルバック	20,100	6,520.00	131,052,000
アクセル	5,500	955.00	5,252,500
E I Z O	8,500	4,085.00	34,722,500
日本信号	27,800	925.00	25,715,000
京三製作所	23,500	477.00	11,209,500
能美防災	14,800	2,098.00	31,050,400
ホーチキ	8,500	1,245.00	10,582,500
星和電機	6,400	515.00	3,296,000
エレコム	25,500	1,467.00	37,408,500
パナソニック	1,166,500	1,246.50	1,454,042,250
シャープ	124,700	1,304.00	162,608,800
アンリツ	70,400	1,765.00	124,256,000
富士通ゼネラル	29,700	2,789.00	82,833,300
ソニーグループ	685,200	13,870.00	9,503,724,000
T D K	158,500	4,575.00	725,137,500
帝国通信工業	5,400	1,271.00	6,863,400
タムラ製作所	42,200	632.00	26,670,400

アルプスアルパイン	97,300	1,069.00	104,013,700
池上通信機	3,200	708.00	2,265,600
日本電波工業	10,200	1,788.00	18,237,600
鈴木	5,700	902.00	5,141,400
メイコー	9,000	4,065.00	36,585,000
日本トリム	2,300	3,545.00	8,153,500
ローランド ディー・ジー	6,700	2,924.00	19,590,800
フォスター電機	11,000	721.00	7,931,000
S M K	2,500	2,316.00	5,790,000
ヨコオ	8,300	2,847.00	23,630,100
ホシデン	26,900	1,197.00	32,199,300
ヒロセ電機	16,900	19,450.00	328,705,000
日本航空電子工業	25,100	1,990.00	49,949,000
T O A	11,700	809.00	9,465,300
マクセル	22,200	1,443.00	32,034,600
古野電気	13,600	1,181.00	16,061,600
ユニデンホールディングス	2,400	3,415.00	8,196,000
スミダコーポレーション	10,900	1,168.00	12,731,200
アイコム	4,000	2,373.00	9,492,000
リオン	4,500	2,400.00	10,800,000
本多通信工業	10,200	439.00	4,477,800
横河電機	109,500	2,089.00	228,745,500
新電元工業	4,200	3,545.00	14,889,000
アズビル	64,100	5,110.00	327,551,000
東亜ディーケーケー	6,200	852.00	5,282,400
日本光電工業	45,400	3,315.00	150,501,000
チノー	3,500	1,547.00	5,414,500
共和電業	10,500	400.00	4,200,000
日本電子材料	5,300	2,255.00	11,951,500
堀場製作所	20,200	6,890.00	139,178,000
アドバンテスト	81,300	10,130.00	823,569,000
小野測器	6,000	501.00	3,006,000
エスベック	9,200	2,182.00	20,074,400
キーエンス	99,100	72,370.00	7,171,867,000
日置電機	5,300	8,890.00	47,117,000
シスメックス	92,500	14,280.00	1,320,900,000
日本マイクロニクス	19,400	1,806.00	35,036,400
メガチップス	10,300	4,950.00	50,985,000
O B A R A G R O U P	5,200	3,430.00	17,836,000
澤藤電機	1,700	1,759.00	2,990,300
原田工業	5,900	997.00	5,882,300
コーセル	14,100	938.00	13,225,800

イリソ電子工業	9,300	4,540.00	42,222,000
オブテックスグループ	18,400	1,640.00	30,176,000
千代田インテグレ	4,900	2,115.00	10,363,500
アイ・オー・データ機器	5,000	786.00	3,930,000
レーザーテック	48,000	30,220.00	1,450,560,000
スタンレー電気	76,700	3,020.00	231,634,000
岩崎電気	4,300	2,297.00	9,877,100
ウシオ電機	56,300	2,018.00	113,613,400
岡谷電機産業	10,000	321.00	3,210,000
ハリオス テクノ ホールディング	11,800	282.00	3,327,600
エノモト	3,500	1,681.00	5,883,500
日本セラミック	10,400	2,878.00	29,931,200
遠藤照明	5,700	1,093.00	6,230,100
古河電池	8,300	1,478.00	12,267,400
双信電機	5,900	657.00	3,876,300
山一電機	8,200	2,316.00	18,991,200
図研	7,300	3,685.00	26,900,500
日本電子	22,800	8,990.00	204,972,000
カシオ計算機	79,200	1,527.00	120,938,400
ファナック	96,000	24,030.00	2,306,880,000
日本シイエムケイ	22,800	610.00	13,908,000
エンプラス	3,000	2,626.00	7,878,000
大真空	15,100	1,525.00	23,027,500
ローム	49,000	10,600.00	519,400,000
浜松ホトニクス	78,500	7,030.00	551,855,000
三井ハイテック	10,800	8,750.00	94,500,000
新光電気工業	32,200	5,460.00	175,812,000
京セラ	153,900	7,088.00	1,090,843,200
太陽誘電	53,100	6,580.00	349,398,000
村田製作所	321,300	8,770.00	2,817,801,000
双葉電子工業	19,700	713.00	14,046,100
北陸電気工業	4,700	1,378.00	6,476,600
ニチコン	34,900	1,243.00	43,380,700
日本ケミコン	10,300	1,954.00	20,126,200
K O A	16,900	1,577.00	26,651,300
市光工業	14,500	536.00	7,772,000
小糸製作所	60,100	6,540.00	393,054,000
ミツバ	20,100	459.00	9,225,900
S C R E E Nホールディングス	19,000	11,700.00	222,300,000
キャノン電子	10,500	1,610.00	16,905,000
キャノン	543,500	2,637.00	1,433,209,500
リコー	303,500	1,007.00	305,624,500

象印マホービン	29,900	1,601.00	47,869,900
MUTOHホールディングス	1,800	1,662.00	2,991,600
東京エレクトロン	69,400	61,840.00	4,291,696,000
トヨタ紡織	44,600	2,200.00	98,120,000
芦森工業	2,100	915.00	1,921,500
ユニプレス	16,300	774.00	12,616,200
豊田自動織機	88,500	9,210.00	815,085,000
モリタホールディングス	17,500	1,319.00	23,082,500
三櫻工業	15,100	1,001.00	15,115,100
デンソー	240,800	8,694.00	2,093,515,200
東海理化電機製作所	28,800	1,579.00	45,475,200
川崎重工業	79,800	1,985.00	158,403,000
名村造船所	32,800	219.00	7,183,200
日本車輛製造	4,000	2,029.00	8,116,000
三菱ロジスネクスト	14,500	1,179.00	17,095,500
近畿車輛	1,600	1,010.00	1,616,000
日産自動車	1,289,900	546.40	704,801,360
いすゞ自動車	343,200	1,485.00	509,652,000
トヨタ自動車	5,540,000	2,052.00	11,368,080,000
日野自動車	136,600	969.00	132,365,400
三菱自動車工業	404,800	330.00	133,584,000
エフテック	7,600	519.00	3,944,400
レシップホールディングス	4,300	584.00	2,511,200
G M B	2,000	726.00	1,452,000
ファルテック	1,900	707.00	1,343,300
武蔵精密工業	24,400	1,803.00	43,993,200
日産車体	16,000	744.00	11,904,000
新明和工業	30,900	877.00	27,099,300
極東開発工業	20,300	1,542.00	31,302,600
トピー工業	9,000	1,102.00	9,918,000
ティラド	3,100	2,972.00	9,213,200
曙ブレーキ工業	60,000	191.00	11,460,000
タチエス	19,100	1,223.00	23,359,300
N O K	52,900	1,267.00	67,024,300
フタバ産業	27,400	414.00	11,343,600
K Y B	11,400	2,959.00	33,732,600
大同メタル工業	21,000	596.00	12,516,000
プレス工業	54,200	392.00	21,246,400
ミクニ	13,900	310.00	4,309,000
太平洋工業	22,900	1,119.00	25,625,100
河西工業	13,400	292.00	3,912,800
アイシン	80,000	4,395.00	351,600,000

マツダ	343,300	914.00	313,776,200
今仙電機製作所	7,200	586.00	4,219,200
本田技研工業	861,100	3,185.00	2,742,603,500
スズキ	250,200	4,597.00	1,150,169,400
S U B A R U	313,400	2,087.50	654,222,500
安永	5,300	963.00	5,103,900
ヤマハ発動機	142,700	2,960.00	422,392,000
T B K	12,000	413.00	4,956,000
エクセディ	16,500	1,747.00	28,825,500
豊田合成	35,300	2,434.00	85,920,200
愛三工業	17,100	804.00	13,748,400
盟和産業	1,500	989.00	1,483,500
日本プラスト	8,600	522.00	4,489,200
ヨロズ	10,200	1,125.00	11,475,000
エフ・シー・シー	17,900	1,525.00	27,297,500
シマノ	44,100	31,640.00	1,395,324,000
テイ・エス テック	46,200	1,410.00	65,142,000
ジャムコ	6,400	906.00	5,798,400
テルモ	309,500	4,678.00	1,447,841,000
クリエートメディック	3,300	995.00	3,283,500
日機装	32,800	894.00	29,323,200
日本エム・ディ・エム	6,300	1,944.00	12,247,200
島津製作所	140,800	4,870.00	685,696,000
J M S	9,300	615.00	5,719,500
長野計器	7,900	1,633.00	12,900,700
ブイ・テクノロジー	4,800	3,500.00	16,800,000
東京計器	7,000	1,003.00	7,021,000
愛知時計電機	1,600	4,710.00	7,536,000
インターアクション	5,500	2,392.00	13,156,000
オーバル	9,900	255.00	2,524,500
東京精密	18,500	4,895.00	90,557,500
マニー	43,600	1,637.00	71,373,200
ニコン	167,000	1,183.00	197,561,000
トプコン	51,400	1,676.00	86,146,400
オリンパス	573,600	2,442.50	1,401,018,000
理研計器	8,800	5,510.00	48,488,000
タムロン	8,500	2,798.00	23,783,000
H O Y A	213,400	17,880.00	3,815,592,000
シード	5,100	557.00	2,840,700
ノーリツ鋼機	9,800	2,557.00	25,058,600
エー・アンド・デイ	10,000	1,218.00	12,180,000
朝日インテック	119,900	2,527.00	302,987,300

シチズン時計	128,100	515.00	65,971,500
リズム	3,400	1,264.00	4,297,600
大研医器	8,700	560.00	4,872,000
メニコン	36,300	3,805.00	138,121,500
シンシア	1,200	529.00	634,800
松風	4,600	2,095.00	9,637,000
セイコーホールディングス	15,500	2,238.00	34,689,000
ニプロ	81,500	1,103.00	89,894,500
中本パックス	3,100	1,669.00	5,173,900
スノーピーク	14,200	3,685.00	52,327,000
パラマウントベッドホールディングス	21,000	1,932.00	40,572,000
トランザクション	6,000	1,008.00	6,048,000
粧美堂	3,200	387.00	1,238,400
ニホンフラッシュ	9,400	1,075.00	10,105,000
前田工織	12,000	3,980.00	47,760,000
永大産業	14,300	288.00	4,118,400
アートネイチャー	9,300	707.00	6,575,100
バンダイナムコホールディングス	98,000	8,989.00	880,922,000
アイフィスジャパン	2,800	668.00	1,870,400
共立印刷	18,300	142.00	2,598,600
S H O E I	10,300	4,865.00	50,109,500
フランスベッドホールディングス	14,100	910.00	12,831,000
パイロットコーポレーション	18,500	4,295.00	79,457,500
萩原工業	7,100	1,352.00	9,599,200
トッパン・フォームズ	15,600	1,548.00	24,148,800
フジシールインターナショナル	26,600	2,088.00	55,540,800
タカラトミー	45,800	1,097.00	50,242,600
広済堂ホールディングス	6,800	797.00	5,419,600
エステールホールディングス	2,600	637.00	1,656,200
タカノ	3,700	668.00	2,471,600
プロネクサス	8,500	1,084.00	9,214,000
ホクシン	7,700	158.00	1,216,600
ウッドワン	3,300	1,031.00	3,402,300
大建工業	6,400	2,235.00	14,304,000
凸版印刷	166,200	1,920.00	319,104,000
大日本印刷	129,300	2,769.00	358,031,700
共同印刷	3,400	2,984.00	10,145,600
N I S S H A	22,400	1,636.00	36,646,400
光村印刷	900	1,474.00	1,326,600
T A K A R A & C O M P A N Y	5,400	1,800.00	9,720,000
アシックス	96,700	2,734.00	264,377,800
ツツミ	2,700	2,132.00	5,756,400

ローランド	7,600	4,125.00	31,350,000
小松ウオール工業	3,300	1,953.00	6,444,900
ヤマハ	65,000	5,840.00	379,600,000
河合楽器製作所	3,100	3,500.00	10,850,000
クリナップ	10,200	534.00	5,446,800
ピジョン	66,100	2,272.00	150,179,200
兼松サステック	700	1,809.00	1,266,300
キングジム	8,800	885.00	7,788,000
リンテック	23,400	2,728.00	63,835,200
イトーキ	20,200	363.00	7,332,600
任天堂	61,700	53,800.00	3,319,460,000
三菱鉛筆	18,000	1,240.00	22,320,000
タカラスタンダード	22,600	1,478.00	33,402,800
コクヨ	52,500	1,730.00	90,825,000
ナカバヤシ	9,800	502.00	4,919,600
グローブライド	9,800	3,170.00	31,066,000
オカムラ	37,600	1,335.00	50,196,000
美津濃	10,800	2,202.00	23,781,600
東京電力ホールディングス	818,500	306.00	250,461,000
中部電力	334,600	1,199.00	401,185,400
関西電力	414,400	1,065.00	441,336,000
中国電力	170,900	938.00	160,304,200
北陸電力	100,000	588.00	58,800,000
東北電力	256,100	812.00	207,953,200
四国電力	98,500	830.00	81,755,000
九州電力	225,400	866.00	195,196,400
北海道電力	95,000	510.00	48,450,000
沖縄電力	23,200	1,451.00	33,663,200
電源開発	93,200	1,508.00	140,545,600
エフオン	6,600	639.00	4,217,400
イーレックス	16,100	2,460.00	39,606,000
レノバ	21,300	4,800.00	102,240,000
東京瓦斯	209,600	1,995.00	418,152,000
大阪瓦斯	198,100	1,871.00	370,645,100
東邦瓦斯	50,200	2,999.00	150,549,800
北海道瓦斯	5,400	1,511.00	8,159,400
広島ガス	20,900	363.00	7,586,700
西部ガスホールディングス	12,300	2,291.00	28,179,300
静岡ガス	28,500	981.00	27,958,500
メタウォーター	12,300	1,941.00	23,874,300
SBSホールディングス	8,100	3,420.00	27,702,000
東武鉄道	106,900	2,626.00	280,719,400

相鉄ホールディングス	35,000	2,053.00	71,855,000
東急	275,800	1,580.00	435,764,000
京浜急行電鉄	140,500	1,140.00	160,170,000
小田急電鉄	162,700	2,156.00	350,781,200
京王電鉄	56,700	5,040.00	285,768,000
京成電鉄	76,100	3,160.00	240,476,000
富士急行	13,000	4,240.00	55,120,000
新京成電鉄	2,500	2,057.00	5,142,500
東日本旅客鉄道	192,500	7,090.00	1,364,825,000
西日本旅客鉄道	132,600	5,051.00	669,762,600
東海旅客鉄道	90,900	16,045.00	1,458,490,500
西武ホールディングス	142,800	1,106.00	157,936,800
鴻池運輸	17,400	1,159.00	20,166,600
西日本鉄道	30,300	2,584.00	78,295,200
ハマキョウレックス	7,700	2,940.00	22,638,000
サカイ引越センター	5,000	4,345.00	21,725,000
近鉄グループホールディングス	103,600	3,225.00	334,110,000
阪急阪神ホールディングス	129,500	3,410.00	441,595,000
南海電気鉄道	46,200	2,141.00	98,914,200
京阪ホールディングス	46,100	2,622.00	120,874,200
神戸電鉄	2,500	3,210.00	8,025,000
名古屋鉄道	85,200	1,721.00	146,629,200
山陽電気鉄道	8,000	2,000.00	16,000,000
アルプス物流	7,200	1,046.00	7,531,200
日本通運	35,900	6,750.00	242,325,000
ヤマトホールディングス	145,100	2,723.00	395,107,300
山九	28,800	4,665.00	134,352,000
丸運	5,900	263.00	1,551,700
丸全昭和運輸	8,400	3,275.00	27,510,000
センコーグループホールディングス	51,900	935.00	48,526,500
トナミホールディングス	2,500	3,875.00	9,687,500
ニッコンホールディングス	34,800	2,126.00	73,984,800
日本石油輸送	1,100	2,627.00	2,889,700
福山通運	17,000	3,950.00	67,150,000
セイノーホールディングス	70,500	1,199.00	84,529,500
エスライン	3,100	900.00	2,790,000
神奈川中央交通	2,600	3,315.00	8,619,000
日立物流	20,000	5,600.00	112,000,000
丸和運輸機関	21,900	1,377.00	30,156,300
C & F ロジホールディングス	10,500	1,695.00	17,797,500
九州旅客鉄道	80,100	2,434.00	194,963,400
S Gホールディングス	195,700	2,604.00	509,602,800

日本郵船	86,800	8,120.00	704,816,000
商船三井	57,600	7,820.00	450,432,000
川崎汽船	31,900	6,840.00	218,196,000
N S ユナイテッド海運	6,200	3,465.00	21,483,000
飯野海運	51,300	543.00	27,855,900
共栄タンカー	3,900	874.00	3,408,600
乾汽船	7,100	2,240.00	15,904,000
日本航空	237,500	2,163.00	513,712,500
A N A ホールディングス	263,100	2,378.00	625,651,800
パスコ	2,000	1,309.00	2,618,000
トランコム	2,900	9,200.00	26,680,000
日新	8,300	1,634.00	13,562,200
三菱倉庫	32,900	2,892.00	95,146,800
三井倉庫ホールディングス	11,000	2,407.00	26,477,000
住友倉庫	36,600	1,960.00	71,736,000
澁澤倉庫	6,200	2,286.00	14,173,200
東陽倉庫	17,400	324.00	5,637,600
日本トランスシティ	22,800	636.00	14,500,800
ケイヒン	1,800	1,324.00	2,383,200
中央倉庫	6,300	970.00	6,111,000
川西倉庫	1,900	1,144.00	2,173,600
安田倉庫	8,500	982.00	8,347,000
ファイズホールディングス	2,200	545.00	1,199,000
東洋埠頭	3,200	1,499.00	4,796,800
宇徳	7,400	723.00	5,350,200
上組	57,000	2,165.00	123,405,000
サンリツ	2,900	826.00	2,395,400
キムラユニティー	2,800	1,318.00	3,690,400
キューソー流通システム	5,200	908.00	4,721,600
近鉄エクスプレス	19,600	3,060.00	59,976,000
東海運	5,900	310.00	1,829,000
エーアイティー	6,500	1,299.00	8,443,500
内外トランスライン	4,000	2,019.00	8,076,000
日本コンセプト	3,300	1,831.00	6,042,300
N E C ネットズエスアイ	35,600	1,841.00	65,539,600
クロスキャット	2,900	1,587.00	4,602,300
システナ	153,400	460.00	70,564,000
デジタルアーツ	5,800	9,100.00	52,780,000
日鉄ソリューションズ	15,600	3,645.00	56,862,000
キューブシステム	5,600	967.00	5,415,200
WOW WORLD	1,600	1,462.00	2,339,200
コア	4,600	1,625.00	7,475,000

ラクーンホールディングス	7,700	1,350.00	10,395,000
ソリトンシステムズ	5,500	1,335.00	7,342,500
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	4,445.00	20,891,500
T I S	102,400	3,460.00	354,304,000
J N S ホールディングス	4,900	498.00	2,440,200
グリー	65,900	791.00	52,126,900
G M O ペパボ	1,200	2,526.00	3,031,200
コーエーテクモホールディングス	34,300	4,790.00	164,297,000
三菱総合研究所	4,600	3,885.00	17,871,000
電算	1,200	2,355.00	2,826,000
A G S	5,600	870.00	4,872,000
ファインデックス	9,200	1,061.00	9,761,200
ブレインパッド	2,800	5,060.00	14,168,000
K L a b	19,700	527.00	10,381,900
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	15,700	942.00	14,789,400
ネクソン	242,100	2,255.00	545,935,500
アイスタイル	33,200	286.00	9,495,200
エムアップホールディングス	3,100	4,255.00	13,190,500
エイチーム	7,500	1,025.00	7,687,500
エニグモ	11,700	1,051.00	12,296,700
テクノスジャパン	8,600	502.00	4,317,200
コロプラ	35,400	677.00	23,965,800
ブロードリーフ	53,400	488.00	26,059,200
クロス・マーケティンググループ	4,200	1,025.00	4,305,000
デジタルハーツホールディングス	4,900	2,544.00	12,465,600
システム情報	8,200	874.00	7,166,800
メディアドゥ	3,800	4,600.00	17,480,000
じげん	30,700	307.00	9,424,900
ブイキューブ	11,000	1,064.00	11,704,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	621.00	1,614,600
サイバーリンクス	3,700	1,085.00	4,014,500
フィックスターズ	11,600	898.00	10,416,800
C A R T A H O L D I N G S	4,400	2,120.00	9,328,000
オブティム	7,600	1,381.00	10,495,600
セレス	4,000	2,472.00	9,888,000
S H I F T	5,400	23,620.00	127,548,000
ティーガイア	9,600	1,599.00	15,350,400
セック	1,600	2,271.00	3,633,600
テクマトリックス	18,200	1,976.00	35,963,200
プロシップ	3,600	1,521.00	5,475,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,100	2,862.00	83,284,200
G M O ペイメントゲートウェイ	20,800	14,920.00	310,336,000

ザッパラス	4,400	573.00	2,521,200
システムリサーチ	3,200	2,014.00	6,444,800
インターネットイニシアティブ	28,600	4,775.00	136,565,000
さくらインターネット	11,700	565.00	6,610,500
ヴィンクス	3,200	844.00	2,700,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	4,325.00	10,380,000
SRAホールディングス	5,200	2,877.00	14,960,400
システムインテグレータ	3,600	562.00	2,023,200
朝日ネット	10,000	615.00	6,150,000
eBASE	13,000	636.00	8,268,000
アバント	11,600	1,291.00	14,975,600
アドソル日進	3,900	1,771.00	6,906,900
ODKソリューションズ	2,400	673.00	1,615,200
フリービット	6,500	1,175.00	7,637,500
コムチュア	12,100	3,525.00	42,652,500
サイバーコム	1,700	1,134.00	1,927,800
アステリア	7,900	801.00	6,327,900
アイル	6,000	1,550.00	9,300,000
マークラインズ	5,400	2,818.00	15,217,200
メディカル・データ・ビジョン	13,700	1,230.00	16,851,000
gumi	15,000	730.00	10,950,000
ショーケース	2,600	523.00	1,359,800
モバイルファクトリー	2,600	911.00	2,368,600
テラスカイ	4,000	1,984.00	7,936,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,800	1,379.00	6,619,200
PCIホールディングス	4,900	1,167.00	5,718,300
パイプドHD	2,000	2,505.00	5,010,000
アイビーシー	1,900	714.00	1,356,600
ネオジャパン	3,100	1,293.00	4,008,300
PR TIMES	2,300	3,240.00	7,452,000
ラクス	37,000	3,040.00	112,480,000
ランドコンピュータ	2,600	844.00	2,194,400
ダブルスタンダード	3,300	3,070.00	10,131,000
オープンドア	6,400	1,992.00	12,748,800
マイネット	3,800	601.00	2,283,800
アカツキ	4,800	2,691.00	12,916,800
ベネフィットジャパン	900	2,653.00	2,387,700
Ubicomホールディングス	2,900	2,617.00	7,589,300
カナミックネットワーク	11,700	492.00	5,756,400
ノムラシステムコーポレーション	6,100	270.00	1,647,000
チェンジ	19,800	2,075.00	41,085,000
シンクロ・フード	5,800	363.00	2,105,400

オークネット	5,800	1,632.00	9,465,600
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	764.00	1,757,200
セグエグループ	2,900	765.00	2,218,500
エイトレッド	1,600	2,270.00	3,632,000
マクロミル	22,100	1,014.00	22,409,400
ビーグリー	2,600	1,805.00	4,693,000
オロ	3,400	3,295.00	11,203,000
ユーザーローカル	3,300	1,634.00	5,392,200
テモナ	2,600	507.00	1,318,200
ニーズウェル	2,600	566.00	1,471,600
マネーフォワード	16,300	7,040.00	114,752,000
サインポスト	3,400	1,270.00	4,318,000
電算システムホールディングス	4,400	2,610.00	11,484,000
ソルクシーズ	9,400	468.00	4,399,200
フェイス	3,000	683.00	2,049,000
プロトコーポレーション	11,500	1,352.00	15,548,000
ハイマックス	3,000	1,081.00	3,243,000
野村総合研究所	207,400	4,885.00	1,013,149,000
サイバネットシステム	7,800	710.00	5,538,000
C Eホールディングス	5,900	494.00	2,914,600
日本システム技術	2,200	2,840.00	6,248,000
インテージホールディングス	13,500	1,690.00	22,815,000
東邦システムサイエンス	3,000	1,005.00	3,015,000
ソースネクスト	46,900	205.00	9,614,500
インフォコム	11,800	2,022.00	23,859,600
シンプレクス・ホールディングス	11,400	2,581.00	29,423,400
HEROZ	3,100	1,436.00	4,451,600
ラクスル	11,800	5,430.00	64,074,000
I P S	3,000	2,049.00	6,147,000
F I G	12,000	331.00	3,972,000
システムサポート	3,300	1,226.00	4,045,800
イーソル	6,700	670.00	4,489,000
アルテリア・ネットワークス	13,700	1,590.00	21,783,000
E d u L a b	1,000	1,198.00	1,198,000
東海ソフト	1,800	1,027.00	1,848,600
ウイングアーク1 s t	6,200	2,098.00	13,007,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	2,760.00	6,900,000
サーバーワークス	1,900	3,465.00	6,583,500
東名	1,100	1,176.00	1,293,600
ヴィッツ	1,100	1,345.00	1,479,500
トビラシステムズ	2,300	954.00	2,194,200
S a n s a n	38,200	2,574.00	98,326,800

Link-U	2,000	1,100.00	2,200,000
ギフトィ	9,400	2,429.00	22,832,600
ベース	1,900	4,180.00	7,942,000
フォーカスシステムズ	7,300	988.00	7,212,400
クレスコ	7,900	1,987.00	15,697,300
フジ・メディア・ホールディングス	103,500	1,151.00	119,128,500
オービック	33,800	20,870.00	705,406,000
ジャストシステム	15,300	5,370.00	82,161,000
TDCソフト	9,500	1,109.00	10,535,500
Zホールディングス	1,560,100	714.50	1,114,691,450
トレンドマイクロ	57,400	6,810.00	390,894,000
IDホールディングス	6,900	852.00	5,878,800
日本オラクル	21,800	10,340.00	225,412,000
アルファシステムズ	2,900	3,995.00	11,585,500
フューチャー	11,400	3,660.00	41,724,000
CAC Holdings	6,400	1,538.00	9,843,200
SBテクノロジー	4,700	2,611.00	12,271,700
トーセ	3,100	729.00	2,259,900
オービックビジネスコンサルタント	10,300	4,985.00	51,345,500
伊藤忠テクノソリューションズ	48,900	3,830.00	187,287,000
アイティフォー	13,100	803.00	10,519,300
東計電算	1,300	4,945.00	6,428,500
エクスネット	1,800	995.00	1,791,000
大塚商会	58,100	5,220.00	303,282,000
サイボウズ	14,400	2,069.00	29,793,600
電通国際情報サービス	15,500	3,690.00	57,195,000
ACCESS	12,300	740.00	9,102,000
デジタルガレージ	17,800	5,040.00	89,712,000
EMシステムズ	17,900	763.00	13,657,700
ウェザーニューズ	3,200	10,040.00	32,128,000
CIJ	7,100	852.00	6,049,200
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,565.00	4,634,500
日本エンタープライズ	11,600	182.00	2,111,200
WOWOW	5,200	1,992.00	10,358,400
スカラ	9,800	656.00	6,428,800
インテリジェント ウェイブ	6,500	544.00	3,536,000
IMAGICA GROUP	9,300	647.00	6,017,100
ネットワンシステムズ	40,900	3,350.00	137,015,000
システムソフト	23,900	119.00	2,844,100
アルゴグラフィックス	8,400	3,175.00	26,670,000
マーベラス	17,100	745.00	12,739,500
エイベックス	18,600	1,665.00	30,969,000

日本ユニシス	33,600	3,255.00	109,368,000
兼松エレクトロニクス	5,900	3,940.00	23,246,000
都築電気	5,600	1,798.00	10,068,800
TBSホールディングス	65,300	1,737.00	113,426,100
日本テレビホールディングス	89,700	1,186.00	106,384,200
朝日放送グループホールディングス	10,800	707.00	7,635,600
テレビ朝日ホールディングス	25,900	1,470.00	38,073,000
スカパーJSATホールディングス	91,200	424.00	38,668,800
テレビ東京ホールディングス	7,700	1,979.00	15,238,300
日本BS放送	3,700	1,105.00	4,088,500
ビジョン	18,400	1,296.00	23,846,400
スマートバリュー	3,100	473.00	1,466,300
USEN-NEXT HOLDINGS	10,200	2,990.00	30,498,000
ワイヤレスゲート	4,800	322.00	1,545,600
コネクシオ	7,700	1,438.00	11,072,600
クロップス	2,100	1,050.00	2,205,000
日本電信電話	1,255,300	3,086.00	3,873,855,800
KDDI	782,500	3,334.00	2,608,855,000
ソフトバンク	1,625,600	1,490.00	2,422,144,000
光通信	12,700	17,770.00	225,679,000
エムティーアイ	10,600	638.00	6,762,800
GMOインターネット	38,000	2,822.00	107,236,000
ファイバーゲート	3,600	1,147.00	4,129,200
アйдママーケティングコミュニケーション	2,700	310.00	837,000
KADOKAWA	31,300	5,710.00	178,723,000
学研ホールディングス	15,300	1,014.00	15,514,200
ゼンリン	17,600	990.00	17,424,000
昭文社ホールディングス	4,600	483.00	2,221,800
インプレスホールディングス	8,900	224.00	1,993,600
アイネット	5,600	1,394.00	7,806,400
松竹	7,100	11,290.00	80,159,000
東宝	63,400	5,030.00	318,902,000
東映	3,500	18,350.00	64,225,000
エヌ・ティ・ティ・データ	285,800	2,389.00	682,776,200
ピー・シー・エー	6,400	1,555.00	9,952,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,942.00	7,185,400
DTS	20,600	2,562.00	52,777,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,900	5,930.00	295,907,000
シーイーシー	11,600	1,288.00	14,940,800
カブコン	101,200	2,780.00	281,336,000
アイ・エス・ビー	5,100	1,015.00	5,176,500
ジャステック	6,300	1,044.00	6,577,200

S C S K	74,300	2,304.00	171,187,200
日本システムウエア	4,100	2,176.00	8,921,600
アイネス	9,800	1,432.00	14,033,600
T K C	18,200	3,290.00	59,878,000
富士ソフト	11,500	5,530.00	63,595,000
N S D	34,500	2,242.00	77,349,000
コナミホールディングス	39,000	5,870.00	228,930,000
福井コンピュータホールディングス	5,000	3,415.00	17,075,000
J B C Cホールディングス	7,300	1,830.00	13,359,000
ミロク情報サービス	9,500	1,464.00	13,908,000
ソフトバンクグループ	643,600	5,518.00	3,551,384,800
ハウスイ	900	909.00	818,100
高千穂交易	4,200	1,318.00	5,535,600
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,491.00	2,683,800
伊藤忠食品	2,600	4,915.00	12,779,000
エレマテック	8,600	1,048.00	9,012,800
J A L U X	3,000	2,547.00	7,641,000
あらた	8,600	3,970.00	34,142,000
トーメンデバイス	1,600	6,610.00	10,576,000
東京エレクトロン デバイス	3,200	6,580.00	21,056,000
フィールズ	9,400	578.00	5,433,200
双日	119,000	1,649.00	196,231,000
アルフレッサ ホールディングス	119,700	1,615.00	193,315,500
横浜冷凍	30,200	847.00	25,579,400
ラサ商事	5,700	905.00	5,158,500
アルコニックス	11,500	1,207.00	13,880,500
神戸物産	83,600	4,050.00	338,580,000
ハイパー	2,700	546.00	1,474,200
あい ホールディングス	15,400	1,999.00	30,784,600
ディーブイエックス	3,700	1,117.00	4,132,900
ダイワボウホールディングス	52,400	1,869.00	97,935,600
マクニカ・富士エレホールディングス	25,700	2,691.00	69,158,700
ラクト・ジャパン	3,700	2,411.00	8,920,700
グリムス	4,800	2,422.00	11,625,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,700	800.00	14,960,000
八洲電機	7,800	942.00	7,347,600
メディアスホールディングス	6,100	936.00	5,709,600
レスターホールディングス	10,200	1,905.00	19,431,000
ジュテックホールディングス	2,500	1,082.00	2,705,000
大光	4,100	698.00	2,861,800
O C H Iホールディングス	3,100	1,270.00	3,937,000
T O K A Iホールディングス	52,200	856.00	44,683,200

黒谷	3,000	624.00	1,872,000
C o m i n i x	1,900	722.00	1,371,800
三洋貿易	10,900	1,003.00	10,932,700
ビューティガレージ	1,700	3,080.00	5,236,000
ウイン・パートナーズ	7,800	966.00	7,534,800
ミタチ産業	3,000	910.00	2,730,000
シップヘルスケアホールディングス	34,500	2,555.00	88,147,500
明治電機工業	3,400	1,268.00	4,311,200
デリカフーズホールディングス	4,200	606.00	2,545,200
スターティアホールディングス	2,500	1,216.00	3,040,000
コメダホールディングス	23,500	2,023.00	47,540,500
ピーバンドットコム	1,500	580.00	870,000
アセンテック	3,700	1,176.00	4,351,200
富士興産	2,700	1,080.00	2,916,000
協栄産業	1,100	1,523.00	1,675,300
フルサト・マルカホールディングス	10,400	2,136.00	22,214,400
ヤマエグループホールディングス	7,300	1,042.00	7,606,600
小野建	10,400	1,647.00	17,128,800
南陽	2,200	1,906.00	4,193,200
佐島電機	6,700	926.00	6,204,200
エコートレーディング	2,300	625.00	1,437,500
伯東	6,600	2,337.00	15,424,200
コンドーテック	8,300	992.00	8,233,600
中山福	5,700	365.00	2,080,500
ナガイレーベン	14,300	2,353.00	33,647,900
三菱食品	10,400	2,740.00	28,496,000
松田産業	7,900	2,630.00	20,777,000
第一興商	20,500	3,630.00	74,415,000
メディバルホールディングス	116,300	2,089.00	242,950,700
S P K	4,300	1,376.00	5,916,800
萩原電気ホールディングス	4,000	2,057.00	8,228,000
アズワン	7,700	14,590.00	112,343,000
スズデン	3,700	1,695.00	6,271,500
尾家産業	2,800	1,062.00	2,973,600
シモジマ	6,600	1,148.00	7,576,800
ドウシシャ	10,200	1,575.00	16,065,000
小津産業	2,400	1,913.00	4,591,200
高速	6,400	1,579.00	10,105,600
たけびし	4,000	1,443.00	5,772,000
リックス	2,400	1,499.00	3,597,600
丸文	9,600	825.00	7,920,000
ハピネット	9,000	1,514.00	13,626,000

橋本総業ホールディングス	2,200	2,021.00	4,446,200
日本ライフライン	31,900	1,081.00	34,483,900
タカショー	8,200	750.00	6,150,000
I D O M	32,700	724.00	23,674,800
進和	6,400	2,078.00	13,299,200
エスケイジャパン	2,600	447.00	1,162,200
ダイترون	4,600	2,100.00	9,660,000
シークス	15,400	1,383.00	21,298,200
田中商事	3,300	629.00	2,075,700
オーハシテクニカ	6,000	1,444.00	8,664,000
白銅	3,500	2,890.00	10,115,000
ダイコー通産	1,300	1,230.00	1,599,000
伊藤忠商事	753,400	3,460.00	2,606,764,000
丸紅	1,062,600	1,047.50	1,113,073,500
高島	1,600	2,212.00	3,539,200
長瀬産業	59,200	1,848.00	109,401,600
蝶理	6,000	1,761.00	10,566,000
豊田通商	108,200	4,960.00	536,672,000
三共生興	14,300	560.00	8,008,000
兼松	40,200	1,266.00	50,893,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,313.00	2,363,400
三井物産	836,500	2,570.00	2,149,805,000
日本紙パルプ商事	5,600	3,905.00	21,868,000
カメイ	12,800	1,007.00	12,889,600
東都水産	500	4,505.00	2,252,500
O U Gホールディングス	1,600	2,601.00	4,161,600
スターゼン	8,000	1,951.00	15,608,000
山善	45,300	1,029.00	46,613,700
椿本興業	2,200	4,140.00	9,108,000
住友商事	679,900	1,639.00	1,114,356,100
内田洋行	4,600	5,210.00	23,966,000
三菱商事	807,200	3,542.00	2,859,102,400
第一実業	4,900	5,170.00	25,333,000
キャノンマーケティングジャパン	26,700	2,273.00	60,689,100
西華産業	5,700	1,594.00	9,085,800
佐藤商事	8,900	1,130.00	10,057,000
菱洋エレクトロ	6,400	2,257.00	14,444,800
東京産業	9,800	773.00	7,575,400
ユアサ商事	10,200	2,925.00	29,835,000
神鋼商事	2,400	3,270.00	7,848,000
トルク	5,800	208.00	1,206,400
阪和興業	21,600	3,155.00	68,148,000

正栄食品工業	7,000	3,935.00	27,545,000
カナデン	8,800	1,048.00	9,222,400
菱電商事	8,500	1,766.00	15,011,000
岩谷産業	25,900	5,780.00	149,702,000
ナイス	3,700	1,712.00	6,334,400
ニチモウ	1,600	1,997.00	3,195,200
極東貿易	3,100	2,457.00	7,616,700
アステナホールディングス	15,200	488.00	7,417,600
三愛石油	26,500	1,314.00	34,821,000
稲畑産業	23,700	1,620.00	38,394,000
G S I クレオス	5,200	1,063.00	5,527,600
明和産業	10,000	855.00	8,550,000
クワザワホールディングス	4,300	596.00	2,562,800
ワキタ	23,000	1,078.00	24,794,000
東邦ホールディングス	34,600	1,808.00	62,556,800
サンゲツ	28,500	1,606.00	45,771,000
ミツウロコグループホールディングス	15,900	1,293.00	20,558,700
シナネンホールディングス	4,000	3,555.00	14,220,000
伊藤忠エネクス	23,800	985.00	23,443,000
サンリオ	33,300	2,523.00	84,015,900
サンワテクノス	6,600	1,726.00	11,391,600
リョーサン	11,900	2,178.00	25,918,200
新光商事	16,200	905.00	14,661,000
トーヨー	4,900	1,331.00	6,521,900
三信電気	5,000	1,435.00	7,175,000
東陽テクニカ	10,600	1,112.00	11,787,200
モスフードサービス	14,100	3,165.00	44,626,500
加賀電子	9,800	3,050.00	29,890,000
ソーダニッカ	11,100	755.00	8,380,500
立花エレテック	8,600	1,583.00	13,613,800
フォーバル	4,700	1,073.00	5,043,100
P A L T A C	15,100	4,530.00	68,403,000
三谷産業	12,700	321.00	4,076,700
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,195.00	7,668,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,961.00	1,961,000
コア商事ホールディングス	8,100	636.00	5,151,600
国際紙パルプ商事	22,800	299.00	6,817,200
ヤマタネ	5,000	1,643.00	8,215,000
丸紅建材リース	900	1,798.00	1,618,200
日鉄物産	7,700	4,810.00	37,037,000
泉州電業	3,000	5,630.00	16,890,000
トラスコ中山	22,400	2,701.00	60,502,400

オートバックスセブン	36,200	1,365.00	49,413,000
モリト	7,900	681.00	5,379,900
加藤産業	15,600	3,265.00	50,934,000
北恵	2,700	874.00	2,359,800
イノテック	6,500	1,385.00	9,002,500
イエローハット	18,700	1,615.00	30,200,500
J Kホールディングス	8,700	1,133.00	9,857,100
日伝	8,900	2,278.00	20,274,200
北沢産業	7,400	247.00	1,827,800
杉本商事	5,000	2,213.00	11,065,000
因幡電機産業	28,700	2,678.00	76,858,600
東テク	3,600	2,673.00	9,622,800
ミスミグループ本社	135,200	4,755.00	642,876,000
アルテック	7,300	303.00	2,211,900
タキヒヨー	3,200	1,751.00	5,603,200
蔵王産業	2,100	1,904.00	3,998,400
スズケン	42,100	3,340.00	140,614,000
ジェコス	7,500	802.00	6,015,000
グローセル	12,600	408.00	5,140,800
ローソン	23,900	5,740.00	137,186,000
サンエー	8,200	4,225.00	34,645,000
カワチ薬品	8,500	2,226.00	18,921,000
エービーシー・マート	16,900	5,290.00	89,401,000
ハードオフコーポレーション	5,100	718.00	3,661,800
アスクル	17,600	1,395.00	24,552,000
ゲオホールディングス	14,600	1,270.00	18,542,000
アダストリア	11,700	1,880.00	21,996,000
くら寿司	11,300	3,560.00	40,228,000
キャンドゥ	5,200	2,465.00	12,818,000
アイケイ	3,700	435.00	1,609,500
パルグループホールディングス	9,600	1,636.00	15,705,600
エディオン	49,700	1,042.00	51,787,400
サーラコーポレーション	22,300	621.00	13,848,300
ワッツ	5,500	758.00	4,169,000
ハローズ	5,000	2,790.00	13,950,000
フジオフードグループ本社	9,100	1,424.00	12,958,400
あみやき亭	2,600	2,952.00	7,675,200
大黒天物産	3,500	6,050.00	21,175,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,011.00	8,896,800
ファーマライズホールディングス	3,000	740.00	2,220,000
アルペン	8,400	2,161.00	18,152,400
ハブ	3,800	682.00	2,591,600

クオールホールディングス	13,400	1,422.00	19,054,800
ジーンズホールディングス	7,400	6,530.00	48,322,000
ビックカメラ	64,100	966.00	61,920,600
D C Mホールディングス	66,700	1,085.00	72,369,500
M o n o t a R O	136,300	2,244.00	305,857,200
東京一番フーズ	3,200	585.00	1,872,000
きちりホールディングス	2,900	458.00	1,328,200
アークランドサービスホールディングス	8,000	2,339.00	18,712,000
J . フロント リテイリング	128,900	965.00	124,388,500
ドトール・日レスホールディングス	18,700	1,584.00	29,620,800
マツキヨココカラ & カンパニー	66,300	4,285.00	284,095,500
ブロンコビリー	6,300	2,402.00	15,132,600
Z O Z O	74,100	3,505.00	259,720,500
トレジャー・ファクトリー	3,400	912.00	3,100,800
物語コーポレーション	5,800	7,100.00	41,180,000
三越伊勢丹ホールディングス	188,900	809.00	152,820,100
H a m e e	3,000	1,088.00	3,264,000
マーケットエンタープライズ	1,000	819.00	819,000
ウエルシアホールディングス	57,000	3,910.00	222,870,000
クリエイトSDホールディングス	16,000	3,225.00	51,600,000
丸善C H I ホールディングス	12,600	373.00	4,699,800
ミサワ	2,600	665.00	1,729,000
ティーライフ	1,600	1,329.00	2,126,400
チムニー	3,300	1,255.00	4,141,500
シュッピン	9,200	1,028.00	9,457,600
オイシックス・ラ・大地	15,600	3,140.00	48,984,000
ネクステージ	21,900	2,363.00	51,749,700
ジョイフル本田	31,700	1,483.00	47,011,100
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,691.00	6,933,100
ホットランド	8,200	1,330.00	10,906,000
すかいらーくホールディングス	139,200	1,552.00	216,038,400
S F Pホールディングス	5,300	1,359.00	7,202,700
綿半ホールディングス	8,300	1,269.00	10,532,700
ヨシックスホールディングス	2,200	2,018.00	4,439,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,500	1,052.00	33,138,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,194.00	6,925,200
B E E N O S	5,500	2,851.00	15,680,500
あさひ	9,100	1,349.00	12,275,900
日本調剤	6,700	1,347.00	9,024,900
コスモス薬品	10,900	17,740.00	193,366,000
トーエル	5,500	823.00	4,526,500
セブン & アイ・ホールディングス	421,400	4,971.00	2,094,779,400

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	57,400	713.00	40,926,200
ツルハホールディングス	23,500	11,940.00	280,590,000
サンマルクホールディングス	8,700	1,439.00	12,519,300
フェリシモ	2,600	1,352.00	3,515,200
トリドールホールディングス	26,900	2,462.00	66,227,800
TOKYO BASE	10,200	644.00	6,568,800
ウイルプラスホールディングス	2,000	918.00	1,836,000
JMホールディングス	7,400	1,751.00	12,957,400
サツドラホールディングス	5,200	647.00	3,364,400
アレンザホールディングス	8,400	1,073.00	9,013,200
串カツ田中ホールディングス	3,000	2,084.00	6,252,000
パロックジャパンリミテッド	7,800	841.00	6,559,800
クスリのアオキホールディングス	10,700	7,120.00	76,184,000
力の源ホールディングス	5,500	602.00	3,311,000
FOOD & LIFE COMPANIES	63,100	4,380.00	276,378,000
メディカルシステムネットワーク	10,800	609.00	6,577,200
はるやまホールディングス	5,500	507.00	2,788,500
ノジマ	17,500	2,340.00	40,950,000
カップ・クリエイト	15,100	1,340.00	20,234,000
ライトオン	8,000	734.00	5,872,000
良品計画	124,100	1,820.00	225,862,000
三城ホールディングス	14,300	232.00	3,317,600
アドヴァングループ	11,200	972.00	10,886,400
アルピス	3,600	2,199.00	7,916,400
コナカ	12,700	327.00	4,152,900
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,666.00	2,499,000
G - 7ホールディングス	12,100	1,734.00	20,981,400
イオン北海道	19,000	1,380.00	26,220,000
コジマ	19,000	570.00	10,830,000
ヒマラヤ	4,000	950.00	3,800,000
コーナン商事	15,400	3,375.00	51,975,000
エコス	4,100	1,883.00	7,720,300
ワタミ	13,000	911.00	11,843,000
マルシェ	2,600	418.00	1,086,800
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	215,500	1,761.00	379,495,500
西松屋チェーン	23,800	1,520.00	36,176,000
ゼンショーホールディングス	52,700	2,674.00	140,919,800
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,465.00	9,962,000
ハークスレイ	5,100	456.00	2,325,600
サイゼリヤ	16,100	3,030.00	48,783,000

VTホールディングス	41,100	456.00	18,741,600
魚力	3,100	2,028.00	6,286,800
フジ・コーポレーション	5,900	1,172.00	6,914,800
ユナイテッドアローズ	11,400	1,868.00	21,295,200
ハイデイ日高	15,700	1,660.00	26,062,000
YU-WA Creation Holdings	7,500	207.00	1,552,500
コロワイド	44,300	1,631.00	72,253,300
ピーシーデポコーポレーション	13,300	317.00	4,216,100
壱番屋	7,600	4,600.00	34,960,000
PLANT	3,100	700.00	2,170,000
スギホールディングス	21,500	7,010.00	150,715,000
薬王堂ホールディングス	5,500	2,286.00	12,573,000
スクロール	16,900	779.00	13,165,100
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,676.00	16,927,600
木曽路	14,400	2,177.00	31,348,800
SRSホールディングス	15,000	779.00	11,685,000
リテールパートナーズ	13,300	1,285.00	17,090,500
ケーヨー	20,100	843.00	16,944,300
上新電機	12,500	2,138.00	26,725,000
日本瓦斯	52,500	1,575.00	82,687,500
ロイヤルホールディングス	18,500	1,906.00	35,261,000
いなげや	13,400	1,402.00	18,786,800
チヨダ	10,800	760.00	8,208,000
ライフコーポレーション	10,100	3,400.00	34,340,000
リンガーハット	13,300	2,209.00	29,379,700
MrMaxHD	13,900	579.00	8,048,100
AOKIホールディングス	21,200	628.00	13,313,600
オークワ	17,000	993.00	16,881,000
コメリ	16,700	2,548.00	42,551,600
青山商事	22,600	716.00	16,181,600
しまむら	12,600	10,010.00	126,126,000
はせがわ	6,800	246.00	1,672,800
高島屋	78,600	1,047.00	82,294,200
松屋	21,900	871.00	19,074,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,200	811.00	41,523,200
近鉄百貨店	4,200	2,563.00	10,764,600
丸井グループ	91,200	2,202.00	200,822,400
アクシアル リテイリング	8,400	3,385.00	28,434,000
イオン	414,600	2,789.50	1,156,526,700
イズミ	19,500	3,220.00	62,790,000
平和堂	19,900	1,935.00	38,506,500
フジ	13,100	1,936.00	25,361,600

ヤオコー	12,200	6,860.00	83,692,000
ゼビオホールディングス	14,900	908.00	13,529,200
ケーズホールディングス	99,500	1,106.00	110,047,000
Olympicグループ	6,000	645.00	3,870,000
日産東京販売ホールディングス	16,900	231.00	3,903,900
シルバーライフ	2,400	1,377.00	3,304,800
Genky DrugStores	4,800	5,280.00	25,344,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,700	1,021.00	2,756,700
ブックオフグループホールディングス	6,300	994.00	6,262,200
ギフト	1,800	2,776.00	4,996,800
アインホールディングス	15,700	6,240.00	97,968,000
元気寿司	3,100	2,507.00	7,771,700
ヤマダホールディングス	394,500	384.00	151,488,000
アークランドサカモト	17,000	1,718.00	29,206,000
ニトリホールディングス	42,800	18,520.00	792,656,000
グルメ杵屋	8,800	1,030.00	9,064,000
愛眼	7,900	180.00	1,422,000
ケーユーホールディングス	5,900	1,041.00	6,141,900
吉野家ホールディングス	37,700	2,337.00	88,104,900
松屋フーズホールディングス	5,200	3,560.00	18,512,000
サガミホールディングス	16,700	1,060.00	17,702,000
関西スーパーマーケット	8,300	1,545.00	12,823,500
王将フードサービス	7,200	6,120.00	44,064,000
プレナス	12,200	1,981.00	24,168,200
ミニストップ	8,100	1,414.00	11,453,400
アークス	20,700	2,143.00	44,360,100
パローホールディングス	23,900	2,168.00	51,815,200
ベルク	4,800	5,530.00	26,544,000
大庄	6,000	952.00	5,712,000
ファーストリテイリング	14,400	68,000.00	979,200,000
サンドラッグ	40,600	3,110.00	126,266,000
サクスパー ホールディングス	10,600	531.00	5,628,600
ヤマザワ	2,700	1,641.00	4,430,700
やまや	2,200	2,429.00	5,343,800
ベルーナ	23,500	711.00	16,708,500
島根銀行	3,400	575.00	1,955,000
じもとホールディングス	7,700	611.00	4,704,700
めぶきフィナンシャルグループ	560,500	233.00	130,596,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	1,441.00	19,453,500
九州フィナンシャルグループ	220,300	408.00	89,882,400
ゆうちょ銀行	254,600	965.00	245,689,000
富山第一銀行	25,700	277.00	7,118,900

コンコルディア・フィナンシャルグループ	616,100	423.00	260,610,300
西日本フィナンシャルホールディングス	70,500	719.00	50,689,500
三十三フィナンシャルグループ	10,000	1,456.00	14,560,000
第四北越フィナンシャルグループ	17,600	2,455.00	43,208,000
ひろぎんホールディングス	159,100	664.00	105,642,400
おきなわフィナンシャルグループ	9,700	2,253.00	21,854,100
十六フィナンシャルグループ	14,500	2,124.00	30,798,000
北國フィナンシャルホールディングス	10,000	2,345.00	23,450,000
新生銀行	70,400	1,870.00	131,648,000
あおぞら銀行	60,300	2,565.00	154,669,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,918,000	627.00	4,337,586,000
りそなホールディングス	1,234,700	437.10	539,687,370
三井住友トラスト・ホールディングス	203,900	3,826.00	780,121,400
三井住友フィナンシャルグループ	746,700	3,864.00	2,885,248,800
千葉銀行	360,000	673.00	242,280,000
群馬銀行	207,200	344.00	71,276,800
武蔵野銀行	16,100	1,693.00	27,257,300
千葉興業銀行	25,400	254.00	6,451,600
筑波銀行	42,000	162.00	6,804,000
七十七銀行	33,800	1,233.00	41,675,400
青森銀行	8,400	1,760.00	14,784,000
秋田銀行	6,900	1,538.00	10,612,200
山形銀行	12,100	857.00	10,369,700
岩手銀行	7,100	1,771.00	12,574,100
東邦銀行	90,000	207.00	18,630,000
東北銀行	5,200	987.00	5,132,400
みちのく銀行	6,900	809.00	5,582,100
ふくおかフィナンシャルグループ	90,900	1,894.00	172,164,600
静岡銀行	262,700	829.00	217,778,300
スルガ銀行	94,600	515.00	48,719,000
八十二銀行	243,000	375.00	91,125,000
山梨中央銀行	11,700	834.00	9,757,800
大垣共立銀行	21,300	1,910.00	40,683,000
福井銀行	9,200	1,376.00	12,659,200
清水銀行	4,400	1,560.00	6,864,000
富山銀行	1,900	1,771.00	3,364,900
滋賀銀行	20,300	1,957.00	39,727,100
南都銀行	16,800	1,900.00	31,920,000
百五銀行	103,500	337.00	34,879,500
京都銀行	38,600	5,000.00	193,000,000
紀陽銀行	38,200	1,417.00	54,129,400
ほくほくフィナンシャルグループ	67,300	806.00	54,243,800

山陰合同銀行	64,000	620.00	39,680,000
中国銀行	86,200	895.00	77,149,000
鳥取銀行	3,400	1,113.00	3,784,200
伊予銀行	142,900	562.00	80,309,800
百十四銀行	11,500	1,469.00	16,893,500
四国銀行	16,400	745.00	12,218,000
阿波銀行	16,500	2,200.00	36,300,000
大分銀行	6,200	1,781.00	11,042,200
宮崎銀行	6,700	2,018.00	13,520,600
佐賀銀行	6,100	1,447.00	8,826,700
琉球銀行	23,400	751.00	17,573,400
セブン銀行	320,400	235.00	75,294,000
みずほフィナンシャルグループ	1,379,600	1,446.50	1,995,591,400
高知銀行	3,900	711.00	2,772,900
山口フィナンシャルグループ	125,700	649.00	81,579,300
長野銀行	3,500	1,168.00	4,088,000
名古屋銀行	8,100	2,535.00	20,533,500
北洋銀行	162,600	251.00	40,812,600
愛知銀行	3,900	3,770.00	14,703,000
中京銀行	3,900	1,390.00	5,421,000
大光銀行	3,700	1,270.00	4,699,000
愛媛銀行	15,100	776.00	11,717,600
トマト銀行	3,900	1,055.00	4,114,500
京葉銀行	46,000	443.00	20,378,000
栃木銀行	52,100	186.00	9,690,600
北日本銀行	3,400	1,476.00	5,018,400
東和銀行	18,900	513.00	9,695,700
福島銀行	12,400	211.00	2,616,400
大東銀行	5,200	719.00	3,738,800
トモニホールディングス	83,400	298.00	24,853,200
フィデアホールディングス	9,900	1,251.00	12,384,900
池田泉州ホールディングス	124,000	162.00	20,088,000
F P G	36,500	574.00	20,951,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,400	1,252.00	10,516,800
マーキュリアホールディングス	3,800	680.00	2,584,000
S B I ホールディングス	133,100	2,998.00	399,033,800
ジャフコ グループ	13,800	7,200.00	99,360,000
大和証券グループ本社	808,100	657.00	530,921,700
野村ホールディングス	1,647,200	503.70	829,694,640
岡三証券グループ	85,100	384.00	32,678,400
丸三証券	32,300	513.00	16,569,900
東洋証券	36,400	150.00	5,460,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124,200	388.00	48,189,600
光世証券	2,500	518.00	1,295,000
水戸証券	29,200	278.00	8,117,600
いちよし証券	20,400	640.00	13,056,000
松井証券	53,000	788.00	41,764,000
マネックスグループ	88,100	798.00	70,303,800
極東証券	14,600	765.00	11,169,000
岩井コスモホールディングス	10,300	1,334.00	13,740,200
アイザワ証券グループ	17,900	1,082.00	19,367,800
マネーパートナーズグループ	12,000	223.00	2,676,000
スパークス・グループ	50,200	321.00	16,114,200
かんぽ生命保険	108,600	1,800.00	195,480,000
S O M P Oホールディングス	190,200	4,935.00	938,637,000
アニコム ホールディングス	33,100	767.00	25,387,700
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	241,900	3,383.00	818,347,700
第一生命ホールディングス	531,000	2,399.50	1,274,134,500
東京海上ホールディングス	355,300	6,050.00	2,149,565,000
T & Dホールディングス	280,000	1,454.00	407,120,000
アドバンスクリエイト	5,200	1,060.00	5,512,000
全国保証	25,800	5,080.00	131,064,000
あんしん保証	4,300	300.00	1,290,000
イントラスト	5,000	723.00	3,615,000
日本モーゲージサービス	6,300	1,077.00	6,785,100
C a s a	4,100	910.00	3,731,000
アルヒ	16,200	1,007.00	16,313,400
プレミアグループ	5,500	3,710.00	20,405,000
クレディセゾン	69,500	1,168.00	81,176,000
芙蓉総合リース	11,400	7,670.00	87,438,000
みずほリース	16,700	3,135.00	52,354,500
東京センチュリー	20,900	5,630.00	117,667,000
日本証券金融	42,700	847.00	36,166,900
アイフル	181,800	361.00	65,629,800
リコーリース	9,600	3,810.00	36,576,000
イオンフィナンシャルサービス	58,900	1,264.00	74,449,600
アコム	213,700	336.00	71,803,200
ジャックス	12,000	2,899.00	34,788,000
オリエントコーポレーション	294,200	126.00	37,069,200
オリックス	655,000	2,249.00	1,473,095,000
三菱HCキャピタル	399,000	551.00	219,849,000
九州リースサービス	5,800	595.00	3,451,000
日本取引所グループ	273,300	2,392.00	653,733,600
イー・ギャランティ	16,000	2,525.00	40,400,000

アサックス	6,000	706.00	4,236,000
NECキャピタルソリューション	4,500	1,975.00	8,887,500
いちご	123,200	295.00	36,344,000
日本駐車場開発	124,900	138.00	17,236,200
スター・マイカ・ホールディングス	6,500	1,306.00	8,489,000
SREホールディングス	2,700	8,370.00	22,599,000
ADワークスグループ	21,700	159.00	3,450,300
ヒューリック	258,400	1,102.00	284,756,800
三栄建築設計	4,900	1,695.00	8,305,500
野村不動産ホールディングス	56,100	2,567.00	144,008,700
三重交通グループホールディングス	23,800	478.00	11,376,400
サムティ	17,800	2,254.00	40,121,200
ディア・ライフ	15,600	531.00	8,283,600
日本商業開発	7,300	1,850.00	13,505,000
プレサンスコーポレーション	14,500	1,940.00	28,130,000
ハウスコム	2,600	1,296.00	3,369,600
日本管理センター	6,000	1,069.00	6,414,000
サンセイランディック	4,300	830.00	3,569,000
フージャースホールディングス	13,800	666.00	9,190,800
オープンハウス	34,400	6,370.00	219,128,000
東急不動産ホールディングス	319,300	603.00	192,537,900
飯田グループホールディングス	90,300	2,588.00	233,696,400
イーランド	2,300	1,609.00	3,700,700
ムゲンエステート	8,500	499.00	4,241,500
ハウズドゥ	5,300	960.00	5,088,000
シーアールイー	3,500	1,690.00	5,915,000
ケイアイスター不動産	5,000	8,470.00	42,350,000
グッドコムアセット	5,400	1,126.00	6,080,400
ジェイ・エス・ビー	2,500	2,897.00	7,242,500
テンポイノベーション	4,000	892.00	3,568,000
フェイスネットワーク	1,800	1,269.00	2,284,200
パーク24	58,500	1,679.00	98,221,500
パラカ	3,400	1,560.00	5,304,000
三井不動産	492,100	2,387.50	1,174,888,750
三菱地所	709,300	1,569.00	1,112,891,700
平和不動産	18,700	3,725.00	69,657,500
東京建物	107,100	1,683.00	180,249,300
ダイビル	27,800	2,240.00	62,272,000
京阪神ビルディング	17,800	1,566.00	27,874,800
住友不動産	226,600	3,452.00	782,223,200
テーオーシー	20,900	615.00	12,853,500
東京楽天地	2,000	4,025.00	8,050,000

スターツコーポレーション	15,000	2,528.00	37,920,000
フジ住宅	13,900	675.00	9,382,500
空港施設	12,500	558.00	6,975,000
明和地所	6,700	574.00	3,845,800
ゴールドクレスト	9,100	1,603.00	14,587,300
エスリード	4,700	1,652.00	7,764,400
日神グループホールディングス	19,400	483.00	9,370,200
日本エスコン	20,100	811.00	16,301,100
タカラレーベン	45,200	282.00	12,746,400
A V A N T I A	6,600	868.00	5,728,800
イオンモール	54,600	1,643.00	89,707,800
毎日コムネット	4,900	729.00	3,572,100
ファースト住建	4,800	1,231.00	5,908,800
カチタス	26,900	4,510.00	121,319,000
トーセイ	15,800	1,036.00	16,368,800
穴吹興産	2,800	1,907.00	5,339,600
サンフロンティア不動産	15,800	1,006.00	15,894,800
F Jネクストホールディングス	11,500	1,016.00	11,684,000
インテリックス	2,400	652.00	1,564,800
ランドビジネス	4,500	260.00	1,170,000
サンネクスタグループ	4,400	1,074.00	4,725,600
グランディハウス	9,200	479.00	4,406,800
日本空港ビルデング	41,300	5,000.00	206,500,000
明豊ファシリティワークス	5,000	825.00	4,125,000
日本工営	6,200	3,295.00	20,429,000
L I F U L L	32,700	259.00	8,469,300
ミクシィ	24,000	2,042.00	49,008,000
ジェイエシーリクルートメント	8,500	2,175.00	18,487,500
日本M & Aセンターホールディングス	171,500	3,240.00	555,660,000
メンバーズ	3,200	2,385.00	7,632,000
中広	2,200	393.00	864,600
UTグループ	15,100	4,155.00	62,740,500
アイティメディア	5,000	1,935.00	9,675,000
E・Jホールディングス	5,600	1,197.00	6,703,200
夢真ビーネックスグループ	27,900	1,735.00	48,406,500
コシダカホールディングス	28,300	636.00	17,998,800
アルトナー	2,800	847.00	2,371,600
パソナグループ	11,400	3,735.00	42,579,000
C D S	2,700	1,640.00	4,428,000
リンクアンドモチベーション	23,000	638.00	14,674,000
エス・エム・エス	35,500	4,630.00	164,365,000
サニーサイドアップグループ	3,900	760.00	2,964,000

パーソルホールディングス	104,600	3,395.00	355,117,000	
リニカル	6,100	824.00	5,026,400	
クックパッド	33,600	250.00	8,400,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,400	644.00	3,477,600	
学情	4,400	1,135.00	4,994,000	
スタジオアリス	4,800	2,093.00	10,046,400	
シミックホールディングス	5,900	1,543.00	9,103,700	
エプロ	2,500	833.00	2,082,500	
N J S	2,400	1,873.00	4,495,200	
総合警備保障	41,600	4,660.00	193,856,000	
カカクコム	76,700	3,285.00	251,959,500	
アイロムグループ	3,800	1,691.00	6,425,800	
セントケア・ホールディング	7,100	761.00	5,403,100	
サイネックス	2,100	600.00	1,260,000	
ルネサンス	7,400	1,143.00	8,458,200	
ディップ	18,400	4,070.00	74,888,000	
デジタルホールディングス	7,400	1,439.00	10,648,600	
新日本科学	12,800	1,535.00	19,648,000	
キャリアデザインセンター	2,800	966.00	2,704,800	
ベネフィット・ワン	38,100	5,050.00	192,405,000	
エムスリー	184,400	5,813.00	1,071,917,200	
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	300.00	2,010,000	
アウトソーシング	60,000	1,638.00	98,280,000	
ウェルネット	11,000	464.00	5,104,000	
ワールドホールディングス	4,300	2,661.00	11,442,300	
ディー・エヌ・エー	39,900	1,739.00	69,386,100	
博報堂D Yホールディングス	145,600	1,889.00	275,038,400	
ぐるなび	17,600	467.00	8,219,200	
タカミヤ	13,100	448.00	5,868,800	
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	1,009.00	7,163,900	
ファンコミュニケーションズ	26,600	418.00	11,118,800	
ライク	2,900	1,765.00	5,118,500	
ビジネス・ブレークスルー	4,400	438.00	1,927,200	
エスプール	29,700	1,230.00	36,531,000	
W D Bホールディングス	4,800	3,225.00	15,480,000	
手間いらず	1,400	5,440.00	7,616,000	
ティア	6,500	446.00	2,899,000	
C D G	1,300	1,373.00	1,784,900	
アドウェイズ	15,800	959.00	15,152,200	
バリューコマース	8,200	4,750.00	38,950,000	
インフォマート	114,700	1,009.00	115,732,300	
J Pホールディングス	27,700	248.00	6,869,600	

エコナックホールディングス	21,000	95.00	1,995,000	
レッグス	2,300	1,463.00	3,364,900	
プレステージ・インターナショナル	39,500	708.00	27,966,000	
アミューズ	5,800	2,062.00	11,959,600	
ドリームインキュベータ	3,100	1,265.00	3,921,500	
クイック	7,300	1,468.00	10,716,400	
T A C	6,600	226.00	1,491,600	
電通グループ	107,800	3,990.00	430,122,000	
イオンファンタジー	4,100	1,827.00	7,490,700	
シーティーエス	12,000	807.00	9,684,000	
ネクシィーズグループ	3,900	740.00	2,886,000	
H . U . グループホールディングス	27,400	2,806.00	76,884,400	
アルプス技研	9,300	1,952.00	18,153,600	
ダイオーズ	2,300	1,024.00	2,355,200	
日本空調サービス	11,200	794.00	8,892,800	
オリエンタルランド	123,500	18,825.00	2,324,887,500	
ダスキン	24,300	2,808.00	68,234,400	
明光ネットワークジャパン	12,600	562.00	7,081,200	
ファルコホールディングス	5,100	1,881.00	9,593,100	
ラウンドワン	29,300	1,455.00	42,631,500	
リゾートトラスト	48,000	1,916.00	91,968,000	
ビー・エム・エル	13,500	3,600.00	48,600,000	
りらいあコミュニケーションズ	16,100	985.00	15,858,500	
リソー教育	48,200	402.00	19,376,400	
早稲田アカデミー	6,000	1,046.00	6,276,000	
ユー・エス・エス	117,100	1,804.00	211,248,400	
東京個別指導学院	9,500	636.00	6,042,000	
サイバーエージェント	257,700	1,984.00	511,276,800	
楽天グループ	536,900	1,145.00	614,750,500	
クリーク・アンド・リバー社	5,600	2,147.00	12,023,200	
モーニングスター	18,600	651.00	12,108,600	
テー・オー・ダブリュー	18,900	318.00	6,010,200	
山田コンサルティンググループ	5,600	1,144.00	6,406,400	
セントラルスポーツ	4,000	2,424.00	9,696,000	
フルキャストホールディングス	9,000	2,564.00	23,076,000	
エン・ジャパン	16,900	3,420.00	57,798,000	
リソルホールディングス	1,200	4,175.00	5,010,000	
テクノプロ・ホールディングス	62,600	3,330.00	208,458,000	
アトラグループ	2,300	296.00	680,800	
インターワークス	3,500	426.00	1,491,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	7,080.00	34,692,000	
K e e P e r 技研	6,800	2,404.00	16,347,200	

ファーストロジック	2,300	750.00	1,725,000
三機サービス	2,200	1,001.00	2,202,200
Gunosy	6,900	840.00	5,796,000
デザインワン・ジャパン	3,600	190.00	684,000
イー・ガーディアン	4,300	3,585.00	15,415,500
リブセンス	6,800	185.00	1,258,000
ジャパンマテリアル	32,300	1,788.00	57,752,400
ベクトル	14,800	1,280.00	18,944,000
ウチヤマホールディングス	5,800	303.00	1,757,400
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,510.00	11,929,000
キャリアリンク	4,000	1,326.00	5,304,000
I B J	8,800	983.00	8,650,400
アサンテ	4,700	1,723.00	8,098,100
バリューHR	4,300	2,679.00	11,519,700
M&Aキャピタルパートナーズ	8,700	5,590.00	48,633,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,693.00	7,110,600
E R Iホールディングス	3,100	1,459.00	4,522,900
アビスト	1,700	2,810.00	4,777,000
シグマクシス・ホールディングス	6,400	2,702.00	17,292,800
ウィルグループ	7,800	1,313.00	10,241,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,000	184.00	2,760,000
メドピア	8,100	3,855.00	31,225,500
レアジョブ	2,200	976.00	2,147,200
リクルートホールディングス	806,300	6,911.00	5,572,339,300
エラン	14,600	1,253.00	18,293,800
土木管理総合試験所	5,400	335.00	1,809,000
ネットマーケティング	5,500	447.00	2,458,500
日本郵政	1,365,000	881.20	1,202,838,000
ベルシステム24ホールディングス	15,200	1,279.00	19,440,800
鎌倉新書	12,200	683.00	8,332,600
S MN	2,600	622.00	1,617,200
グローバルキッズCOMPANY	2,200	781.00	1,718,200
エアトリ	6,800	3,505.00	23,834,000
アトラエ	7,400	2,538.00	18,781,200
ストライク	4,000	5,520.00	22,080,000
ソラスト	25,800	1,210.00	31,218,000
セラク	3,400	1,713.00	5,824,200
インソース	10,200	2,861.00	29,182,200
ベイカレント・コンサルティング	7,400	48,650.00	360,010,000
Orchestra Holdings	2,000	3,795.00	7,590,000
アイモバイル	3,100	1,317.00	4,082,700
キャリアインデックス	3,800	986.00	3,746,800

MS - J a p a n	4,500	920.00	4,140,000
船場	2,300	790.00	1,817,000
グレイステクノロジー	14,000	411.00	5,754,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	33,200	2,279.00	75,662,800
フルテック	1,600	1,466.00	2,345,600
GameWith	3,500	495.00	1,732,500
ソウルドアウト	2,700	1,153.00	3,113,100
MS&Consulting	1,800	727.00	1,308,600
ウェルビー	7,000	1,340.00	9,380,000
エル・ティー・エス	1,400	2,723.00	3,812,200
ミダックホールディングス	4,600	4,295.00	19,757,000
日総工産	8,400	891.00	7,484,400
キュービーネットホールディングス	4,900	1,721.00	8,432,900
RPAホールディングス	15,200	388.00	5,897,600
スプリックス	3,100	1,760.00	5,456,000
マネジメントソリューションズ	5,200	3,110.00	16,172,000
プロレド・パートナーズ	2,500	1,222.00	3,055,000
テノ・ホールディングス	1,600	631.00	1,009,600
フロンティア・マネジメント	3,000	759.00	2,277,000
ピアラ	2,000	623.00	1,246,000
コプロ・ホールディングス	2,200	1,236.00	2,719,200
ギークス	1,900	1,979.00	3,760,100
カーブスホールディングス	28,900	818.00	23,640,200
フォーラムエンジニアリング	7,500	841.00	6,307,500
ダイレクトマーケティングミックス	5,700	3,810.00	21,717,000
ポピンズホールディングス	2,500	3,095.00	7,737,500
LITALICO	8,500	4,395.00	37,357,500
アドバンテッジリスクマネジメント	5,600	750.00	4,200,000
リログループ	57,200	2,100.00	120,120,000
東祥	7,900	1,705.00	13,469,500
TREホールディングス	14,400	1,759.00	25,329,600
人・夢・技術グループ	4,300	1,947.00	8,372,100
エイチ・アイ・エス	23,300	1,803.00	42,009,900
ラックランド	3,100	3,065.00	9,501,500
共立メンテナンス	18,700	4,040.00	75,548,000
イチネンホールディングス	10,900	1,347.00	14,682,300
建設技術研究所	6,300	2,398.00	15,107,400
スペース	7,700	943.00	7,261,100
燦ホールディングス	4,700	1,519.00	7,139,300
スバル興業	700	8,520.00	5,964,000
東京テアトル	4,100	1,228.00	5,034,800
タナベ経営	4,300	712.00	3,061,600

ナガワ	3,400	11,610.00	39,474,000	
東京都競馬	7,900	4,175.00	32,982,500	
カナモト	18,500	2,266.00	41,921,000	
西尾レントオール	9,700	2,685.00	26,044,500	
トランス・コスモス	13,300	3,250.00	43,225,000	
乃村工藝社	45,000	1,014.00	45,630,000	
藤田観光	4,600	2,435.00	11,201,000	
KNT-CTホールディングス	6,500	1,480.00	9,620,000	
日本管財	11,300	2,770.00	31,301,000	
トーカイ	9,300	2,020.00	18,786,000	
セコム	103,000	7,790.00	802,370,000	
セントラル警備保障	5,100	2,465.00	12,571,500	
丹青社	21,600	823.00	17,776,800	
メイテック	12,700	6,900.00	87,630,000	
応用地質	11,900	1,991.00	23,692,900	
船井総研ホールディングス	21,500	2,572.00	55,298,000	
進学会ホールディングス	4,000	281.00	1,124,000	
オオバ	7,600	775.00	5,890,000	
いであ	2,900	1,911.00	5,541,900	
学究社	3,500	1,546.00	5,411,000	
ベネッセホールディングス	34,900	2,332.00	81,386,800	
イオンディライト	12,900	3,670.00	47,343,000	
ナック	5,200	962.00	5,002,400	
ダイセキ	19,300	5,110.00	98,623,000	
ステップ	3,900	1,852.00	7,222,800	
合計	119,001,100		296,073,141,580	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドA】

【純資産額計算書】

(2021年12月30日現在)

資産総額	1,516,205,577円
負債総額	708,834円
純資産総額（ - ）	1,515,496,743円
発行済口数	487,610,676口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1080円
（1万口当たり純資産額）	（31,080円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2021年12月30日現在)

資産総額	302,314,745,575円
負債総額	171,212,643円
純資産総額（ - ）	302,143,532,932円
発行済口数	134,071,021,479口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2536円
（1万口当たり純資産額）	（22,536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12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	15,077,635
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	73	253,073
単位型公社債投資信託	54	309,924
合計	659	15,640,633

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（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。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (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		
金		
その他有価証券評価差額	587	791
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】

(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)
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 （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いません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		39,182
利益剰余金合計		41,782
株主資本合計		61,022
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		995
繰延ヘッジ損益		78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

(単位：百万円)

第36期中間会計期間		
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	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	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
市場価格のない株式等以外のもの	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。)
市場価格のない株式等	移動平均法による原価法によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。
	ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法

によっております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. 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、ヘッジ対象は子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。

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。

（会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針 6. 引当金の計上基準（2）退職給付引当金をご参照ください。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	90百万円
無形固定資産	376百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	738百万円
投資有価証券償還益	219百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,012百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(*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)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

(*4)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。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（１年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

（有価証券関係）

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計		5,729	-	103	103

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(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	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
	合計		7,900	-	79

（収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
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）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

（関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(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。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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

2022年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2020年12月11日から2021年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2021年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。