

【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6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DC日本株式インデックスファンドL
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンドL

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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 7月 1日から2022年12月28日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

< ファンドの特色 >

わが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、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。

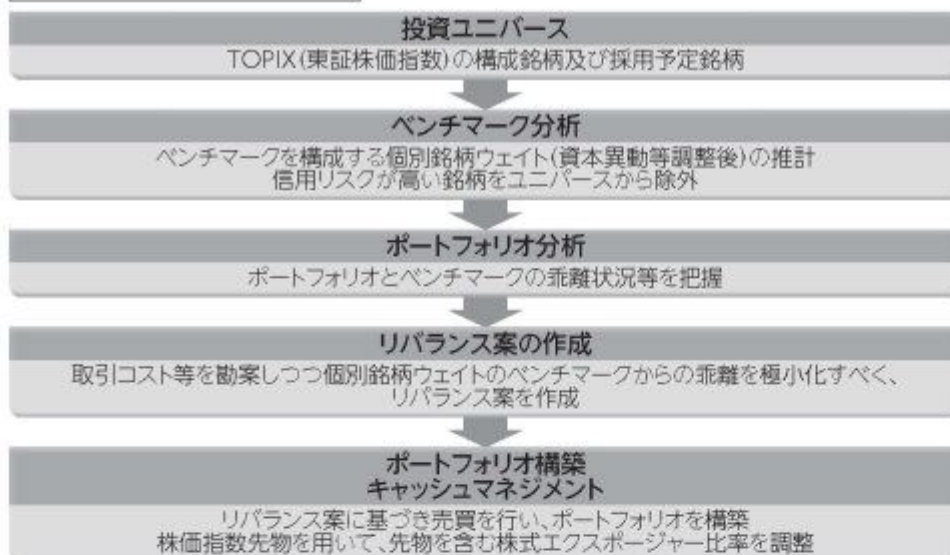
TOPIX（東証株価指数、配当込み）^(注)とは

株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
2. JPXは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
3. JPXは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は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. JPX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、JPX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. 本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではありません。
6. JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
7. JPXは、当社又は本件商品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及び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、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

マザーファンドの投資プロセス



※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ペビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



分配方針

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

主な投資制限

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

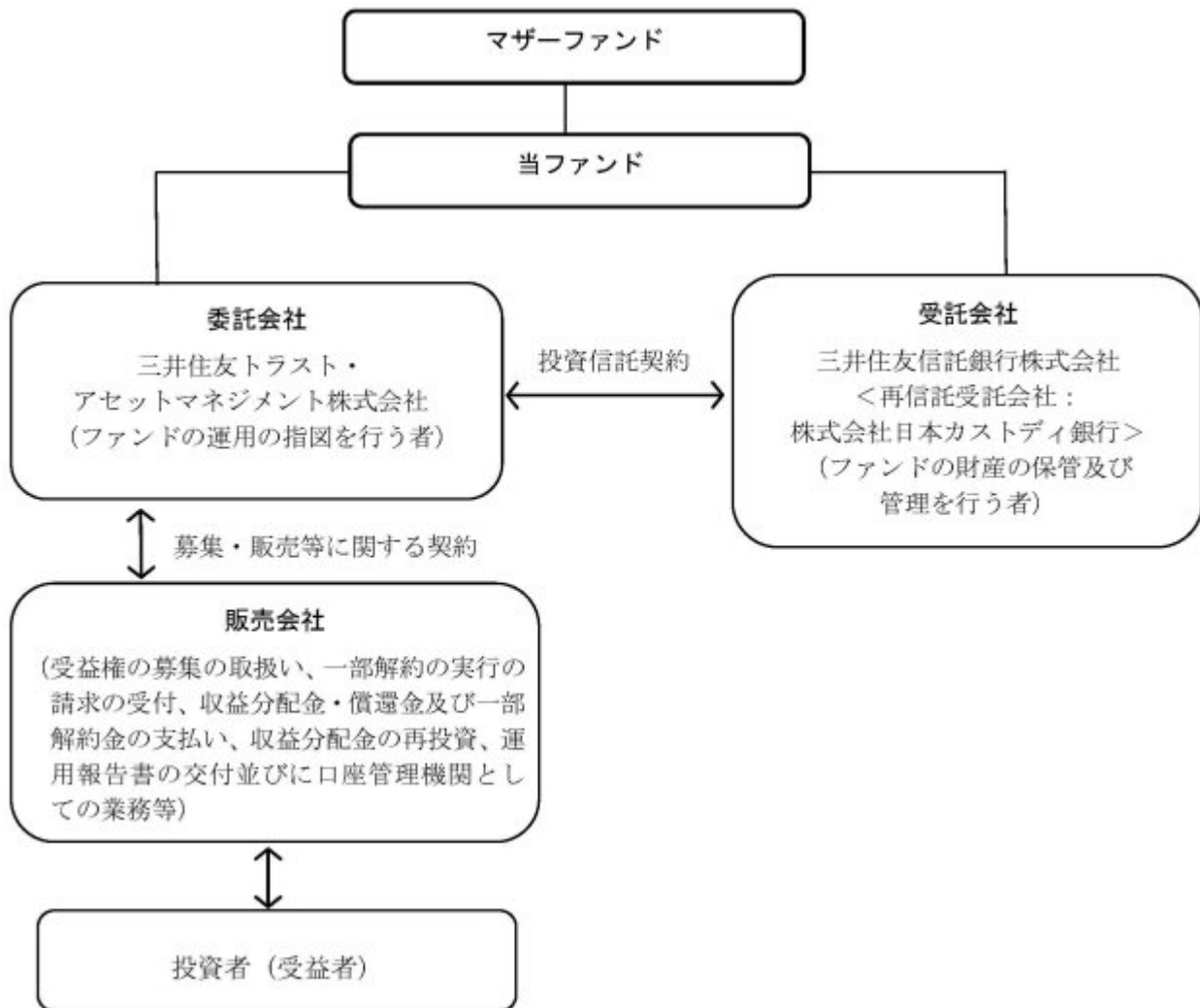
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 4月28日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

運用指図できる金融商品

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

することを指図することができます。

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

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場し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、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

K．スワップ取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｑ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｐ．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｒ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｓ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ｔ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

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。

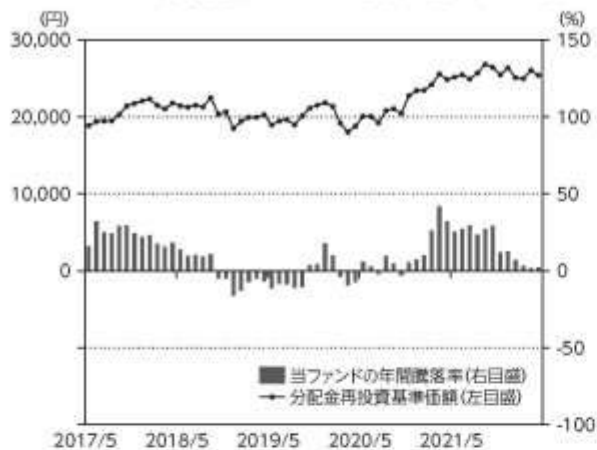
（２）リスクの管理体制

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】

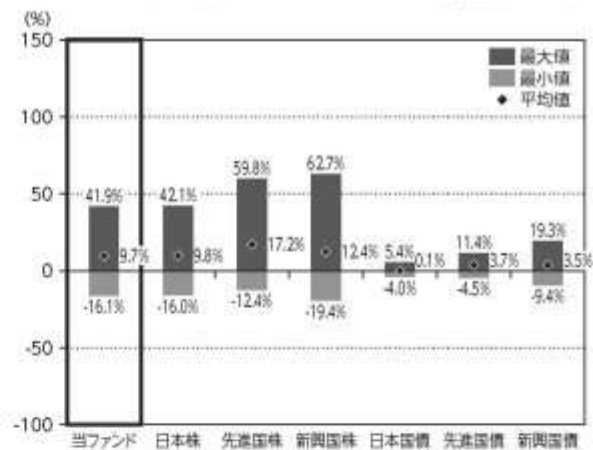
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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5月～2022年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての優位性を有するマーケットベンチマークで、浮動価ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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。同指数の数値及び同指数に係る権利又は債権は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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すべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は債権に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の数値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。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEムガバンク・グローバル・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・過用することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

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

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

（4）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2022年 4月28日現在のもので、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、2022年4月28日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドL】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	116,858,281,785	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		57,261,487	0.05
合計(純資産総額)		116,915,543,272	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	53,757,605,017	2.2265	119,692,632,307	2.1738	116,858,281,785	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11期計算期間末	(2013年 4月 1日)	47,541,549,876	47,541,549,876	11,141	11,141
第12期計算期間末	(2014年 3月31日)	56,643,451,778	56,643,451,778	13,652	13,652
第13期計算期間末	(2015年 3月31日)	73,026,107,098	73,026,107,098	17,815	17,815
第14期計算期間末	(2016年 3月31日)	69,315,595,697	69,315,595,697	15,862	15,862
第15期計算期間末	(2017年 3月31日)	79,513,820,774	79,513,820,774	18,169	18,169
第16期計算期間末	(2018年 4月 2日)	94,197,935,571	94,197,935,571	20,938	20,938
第17期計算期間末	(2019年 4月 1日)	93,580,494,253	93,580,494,253	20,237	20,237
第18期計算期間末	(2020年 3月31日)	82,302,972,845	82,302,972,845	18,017	18,017
第19期計算期間末	(2021年 3月31日)	117,130,660,109	117,130,660,109	25,563	25,563
第20期計算期間末	(2022年 3月31日)	119,653,547,033	119,653,547,033	26,026	26,026
	2021年 4月末日	113,954,111,696		24,839	
	5月末日	115,908,222,582		25,175	
	6月末日	117,555,014,315		25,470	
	7月末日	114,625,240,682		24,911	
	8月末日	117,316,100,554		25,695	
	9月末日	122,175,341,271		26,810	
	10月末日	121,195,712,576		26,426	
	11月末日	116,783,351,334		25,464	
	12月末日	120,963,771,210		26,347	

2022年 1月末日	115,224,609,075		25,071	
2月末日	114,058,773,131		24,958	
3月末日	119,653,547,033		26,026	
4月末日	116,915,543,272		25,399	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	0
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	0
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	0
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	0
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	0
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	0
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	19.4
第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	22.5
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	30.5
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	11.0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	14.5
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	15.2
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	3.3
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	11.0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	41.9
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	1.8

(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11期計算期間	2012年 4月 3日～2013年 4月 1日	9,677,054,316	6,526,059,313	42,672,706,666

第12期計算期間	2013年 4月 2日～2014年 3月31日	12,128,505,388	13,309,747,403	41,491,464,651
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	9,661,910,614	10,162,747,005	40,990,628,260
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	12,364,658,702	9,655,862,890	43,699,424,072
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	8,332,373,769	8,267,206,141	43,764,591,700
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	9,068,541,994	7,843,419,871	44,989,713,823
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	7,404,869,734	6,151,695,641	46,242,887,916
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	7,667,675,777	8,228,600,168	45,681,963,525
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	7,900,549,624	7,762,885,703	45,819,627,446
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	8,057,883,165	7,902,852,295	45,974,658,316

(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	287,596,368,470	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,830,503,396	1.99
合計(純資産総額)		293,426,871,866	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	5,785,120,000	1.97

(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	5,535,300	2,277.50	12,606,679,028	2,235.50	12,374,163,150	4.22
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	708,100	12,787.38	9,054,750,430	11,220.00	7,944,882,000	2.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	102,400	59,809.66	6,124,509,397	52,850.00	5,411,840,000	1.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,836,800	686.17	4,691,254,306	754.30	5,156,998,240	1.76
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,187,900	3,288.91	3,906,903,460	3,847.00	4,569,851,300	1.56
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	71,700	58,346.10	4,183,415,456	55,480.00	3,977,916,000	1.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	813,500	5,946.67	4,837,616,961	4,818.00	3,919,443,000	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	63,800	54,101.60	3,451,682,477	59,910.00	3,822,258,000	1.30
日本	株式	KDDI	情報・通信業	808,600	3,594.90	2,906,839,164	4,335.00	3,505,281,000	1.19
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	665,100	5,349.79	3,558,149,979	5,269.00	3,504,411,900	1.19
日本	株式	三菱商事	卸売業	799,500	3,870.58	3,094,534,560	4,383.00	3,504,208,500	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	888,400	3,349.21	2,975,438,994	3,769.00	3,348,379,600	1.14
日本	株式	信越化学工業	化学	185,200	18,731.36	3,469,048,634	17,985.00	3,330,822,000	1.14
日本	株式	日立製作所	電気機器	543,700	6,279.11	3,413,956,586	6,072.00	3,301,346,400	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	868,900	3,384.95	2,941,183,124	3,419.00	2,970,769,100	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	755,700	4,167.17	3,149,135,334	3,915.00	2,958,565,500	1.01
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	741,600	3,684.46	2,732,395,617	3,932.00	2,915,971,200	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	220,600	14,749.68	3,253,779,688	12,990.00	2,865,594,000	0.98
日本	株式	第一三共	医薬品	865,600	2,601.80	2,252,120,248	3,262.00	2,823,587,200	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	137,200	24,794.16	3,401,760,018	20,045.00	2,750,174,000	0.94
日本	株式	三井物産	卸売業	845,400	2,850.36	2,409,694,380	3,150.00	2,663,010,000	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,680,000	1,446.29	2,429,781,694	1,515.00	2,545,200,000	0.87
日本	株式	村田製作所	電気機器	324,200	8,578.71	2,781,218,448	7,794.00	2,526,814,800	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	123,400	18,897.00	2,331,890,450	19,775.00	2,440,235,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	342,100	6,789.18	2,322,578,940	7,019.00	2,401,199,900	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	279,100	11,016.31	3,074,653,706	8,539.00	2,383,234,900	0.81
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	414,800	5,264.22	2,183,601,200	5,718.00	2,371,826,400	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,396,200	1,585.12	2,213,156,505	1,578.50	2,203,901,700	0.75
日本	株式	S M C	機械	33,100	65,410.74	2,165,095,789	63,050.00	2,086,955,000	0.71
日本	株式	ファナック	電気機器	99,200	23,053.09	2,286,867,244	20,165.00	2,000,368,000	0.68

(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	0.10
		鉱業	0.33
		建設業	2.14

食料品	3.28
繊維製品	0.43
パルプ・紙	0.20
化学	6.33
医薬品	5.19
石油・石炭製品	0.46
ゴム製品	0.66
ガラス・土石製品	0.70
鉄鋼	0.80
非鉄金属	0.77
金属製品	0.55
機械	5.10
電気機器	17.13
輸送用機器	8.17
精密機器	2.50
その他製品	2.37
電気・ガス業	1.19
陸運業	3.04
海運業	0.57
空運業	0.40
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.65
卸売業	5.84
小売業	4.09
銀行業	5.32
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.16
その他金融業	1.11
不動産業	1.97
サービス業	5.53
小計	98.01
合計	98.01

(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	304円	5,746,697,600	5,785,120,000	1.97
--------------	-------	---------	----	------	---------------	---------------	------

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2002年4月1日

作成基準日：2022年4月28日

基準価額・純資産の推移



基準価額 25,399円

純資産総額 1,169.16億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年4月	0円
2019年4月	0円
2020年3月	0円
2021年3月	0円
2022年3月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

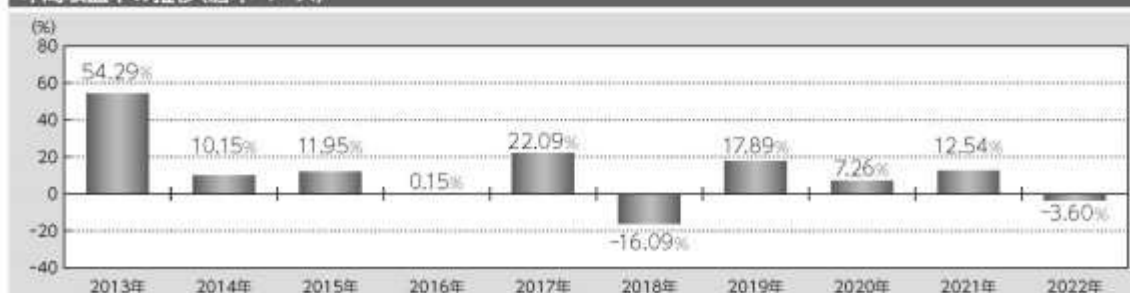
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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	4.2%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.7%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.8%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.4%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.3%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.2%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	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)



※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づき、支払は翌営業日に行われます。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年 4月 1日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、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。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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、委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20期計算期間(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドL】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2021年 3月31日現在)	第20期 (2022年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	368,810,104	365,969,959
親投資信託受益証券	117,071,379,855	119,593,068,170
未収入金	-	158,373,431
流動資産合計	117,440,189,959	120,117,411,560
資産合計	117,440,189,959	120,117,411,560
負債の部		
流動負債		
未払解約金	198,468,522	340,195,086
未払受託者報酬	17,535,872	19,526,711
未払委託者報酬	93,524,601	104,142,373
未払利息	855	357
流動負債合計	309,529,850	463,864,527
負債合計	309,529,850	463,864,527
純資産の部		
元本等		
元本	45,819,627,446	45,974,658,316
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	71,311,032,663	73,678,888,717
(分配準備積立金)	37,309,480,761	34,009,471,950
元本等合計	117,130,660,109	119,653,547,033
純資産合計	117,130,660,109	119,653,547,033
負債純資産合計	117,440,189,959	120,117,411,560

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2020年 4月 1日	自	2021年 4月 1日
	至	2021年 3月31日	至	2022年 3月31日
営業収益				
受取利息		1,540		1,624
有価証券売買等損益		34,698,577,183		2,321,791,449
営業収益合計		34,698,578,723		2,321,793,073
営業費用				
支払利息		90,220		114,878
受託者報酬		32,574,158		38,916,822
委託者報酬		173,728,747		207,556,230
その他費用		411		-
営業費用合計		206,393,536		246,587,930
営業利益又は営業損失（ ）		34,492,185,187		2,075,205,143
経常利益又は経常損失（ ）		34,492,185,187		2,075,205,143
当期純利益又は当期純損失（ ）		34,492,185,187		2,075,205,143
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（ ）		2,644,943,814		133,359,258
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		36,621,009,320		71,311,032,663
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,192,623,457		12,699,860,310
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,192,623,457		12,699,860,310
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,349,841,487		12,273,850,141
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,349,841,487		12,273,850,141
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		71,311,032,663		73,678,888,717

(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19期 (2021年 3月31日現在)	第20期 (2022年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	45,819,627,446口	45,974,658,316口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5563円 (25,563円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6026円 (26,026円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日			第20期 自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,138,196,682円	費用控除後の配当等収益額	A	2,580,997,071円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	16,111,220,386円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	63,654,551,946円	収益調整金額	C	69,957,720,158円
分配準備積立金額	D	19,060,063,693円	分配準備積立金額	D	31,428,474,879円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,964,032,707円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	103,967,192,108円
当ファンドの期末残存口数	F	45,819,627,446口	当ファンドの期末残存口数	F	45,974,658,316口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,035円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,614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20期 自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2022年 3月31日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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19期	第20期
	自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日	自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	45,681,963,525円	45,819,627,446円
期中追加設定元本額	7,900,549,624円	8,057,883,165円
期中一部解約元本額	7,762,885,703円	7,902,852,295円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第19期	第20期
	(2021年 3月31日現在)	(2022年 3月31日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	33,626,308,109	2,400,238,032
合計	33,626,308,109	2,400,238,032

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	53,696,600,292	119,593,068,170	
	合計	53,696,600,292	119,593,068,170	

(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	2022年 3月31日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,865,420,341
株式	293,028,485,430
派生商品評価勘定	146,596,350
未収入金	97,601,860
未収配当金	3,447,057,787
差入委託証拠金	226,479,000
流動資産合計	299,811,640,768
資産合計	299,811,640,768
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,491,000
前受金	104,112,500
未払解約金	210,219,718
未払利息	2,798
流動負債合計	356,826,016
負債合計	356,826,016
純資産の部	
元本等	
元本	134,453,798,374
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	165,001,016,378
元本等合計	299,454,814,752
純資産合計	299,454,814,752
負債純資産合計	299,811,640,768

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2022年 3月31日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,453,798,374口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2272円 (1万口当たり純資産額) (22,272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

2022年 3月31日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 3月31日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 3月31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	2022年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 4月 1日
期首元本額	134,006,418,790円
期中追加設定元本額	9,800,188,243円
期中一部解約元本額	9,352,808,659円
期末元本額	134,453,798,374円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	613,597,837円
D C日本株式インデックスファンド	306,297,615円
D C日本株式インデックスファンドL	53,696,600,292円
D C日本株式インデックスファンドA	661,502,842円
D Cバランスファンド30	2,277,821,114円
D Cバランスファンド50	3,603,206,501円
D Cバランスファンド70	2,138,192,565円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	569,624,522円
日本株式インデックスe	1,466,695,989円
インデックスコレクション（国内株式）	20,880,995,612円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,144,755,626円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,809,252,922円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,468,358,250円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,483,741,974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）	2,741,411,379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）	996,168,325円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	48,802,373円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	562,880,770円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	68,288,076円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	134,333,591円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	125,840,609円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	725,384,624円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	428,335,140円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	7,514,347,566円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	726,631,941円

区分	2022年 3月31日現在
V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	74,940,765円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,226,267,023円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	27,111,633円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	152,227,866円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,980,666,485円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	55,992,768円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	57,602,265円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	21,530,343円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	591,828,960円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	266,984,263円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	4,547,271,934円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	84,997,789円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	36,188,603円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	8,179,081円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	125,855,324円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	3,085,217円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 3月31日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,515,863,923	
合計	2,515,863,923	

(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

（2022年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,222,012,500	-	6,326,125,000	104,112,500
	合計	6,222,012,500	-	6,326,125,000	104,112,500

(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	3,330.00	17,316,000	
日本水産	149,700	548.00	82,035,600	
マルハニチロ	23,400	2,397.00	56,089,800	
雪国まいたけ	10,900	1,141.00	12,436,900	
カネコ種苗	4,200	1,597.00	6,707,400	
サカタのタネ	17,800	3,710.00	66,038,000	
ホクト	12,600	1,906.00	24,015,600	
ホクリヨウ	2,000	693.00	1,386,000	
住石ホールディングス	26,200	169.00	4,427,800	
日鉄鉱業	3,400	7,080.00	24,072,000	
三井松島ホールディングス	6,300	1,911.00	12,039,300	
I N P E X	569,500	1,440.00	820,080,000	
石油資源開発	17,600	2,571.00	45,249,600	
K & O エナジーグループ	6,800	1,678.00	11,410,400	
ヒノキヤグループ	3,300	2,354.00	7,768,200	
ショーボンドホールディングス	21,400	5,330.00	114,062,000	
ミライト・ホールディングス	48,200	1,949.00	93,941,800	
タマホーム	9,100	2,554.00	23,241,400	
サンヨーホームズ	1,700	748.00	1,271,600	
日本アクア	5,900	657.00	3,876,300	
ファーストコーポレーション	3,700	786.00	2,908,200	
ベステラ	3,000	1,206.00	3,618,000	
R o b o t H o m e	24,900	213.00	5,303,700	
キャンディル	2,600	506.00	1,315,600	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	1,271.00	3,685,900	
第一カッター興業	3,700	1,352.00	5,002,400	
安藤・間	74,300	904.00	67,167,200	
東急建設	43,800	672.00	29,433,600	
コムシスホールディングス	48,200	2,668.00	128,597,600	
ピーアールホールディングス	20,400	320.00	6,528,000	
高松コンストラクショングループ	9,300	2,060.00	19,158,000	
東建コーポレーション	4,100	9,050.00	37,105,000	
ソネック	1,500	1,076.00	1,614,000	
ヤマウラ	7,200	951.00	6,847,200	

オリエンタル白石	50,300	237.00	11,921,100	
大成建設	99,900	3,535.00	353,146,500	
大林組	345,600	900.00	311,040,000	
清水建設	323,800	735.00	237,993,000	
飛鳥建設	9,300	1,032.00	9,597,600	
長谷工コーポレーション	102,900	1,407.00	144,780,300	
松井建設	13,600	661.00	8,989,600	
銭高組	1,500	4,145.00	6,217,500	
鹿島建設	253,200	1,491.00	377,521,200	
不動テトラ	7,300	1,522.00	11,110,600	
大末建設	3,600	1,255.00	4,518,000	
鉄建建設	7,500	1,839.00	13,792,500	
西松建設	20,900	3,670.00	76,703,000	
三井住友建設	77,900	417.00	32,484,300	
大豊建設	5,000	4,530.00	22,650,000	
佐田建設	7,400	462.00	3,418,800	
ナカノフドー建設	8,300	335.00	2,780,500	
奥村組	20,400	2,970.00	60,588,000	
東鉄工業	16,100	2,268.00	36,514,800	
イチケン	2,500	1,860.00	4,650,000	
富士ピー・エス	4,500	503.00	2,263,500	
浅沼組	3,900	4,990.00	19,461,000	
戸田建設	143,500	741.00	106,333,500	
熊谷組	17,600	2,710.00	47,696,000	
北野建設	2,100	2,133.00	4,479,300	
植木組	3,100	1,471.00	4,560,100	
矢作建設工業	15,300	802.00	12,270,600	
ピーエス三菱	11,400	585.00	6,669,000	
日本ハウスホールディングス	23,600	454.00	10,714,400	
大東建託	35,400	12,990.00	459,846,000	
新日本建設	14,700	729.00	10,716,300	
東亜道路工業	1,800	4,820.00	8,676,000	
日本道路	3,300	8,320.00	27,456,000	
東亜建設工業	8,500	2,495.00	21,207,500	
日本国土開発	33,600	552.00	18,547,200	
若築建設	5,800	1,953.00	11,327,400	
東洋建設	38,700	775.00	29,992,500	
五洋建設	137,000	613.00	83,981,000	
世紀東急工業	16,600	746.00	12,383,600	
福田組	3,700	4,500.00	16,650,000	
住友林業	88,400	2,168.00	191,651,200	
日本基礎技術	9,500	730.00	6,935,000	

巴コーポレーション	15,300	486.00	7,435,800
大和ハウス工業	319,200	3,201.00	1,021,759,200
ライト工業	21,800	1,953.00	42,575,400
積水ハウス	374,800	2,371.00	888,650,800
日特建設	7,100	703.00	4,991,300
北陸電気工事	7,200	786.00	5,659,200
ユアテック	19,800	692.00	13,701,600
日本リーテック	7,200	1,290.00	9,288,000
四電工	3,800	1,722.00	6,543,600
中電工	15,900	2,067.00	32,865,300
関電工	56,200	834.00	46,870,800
きんでん	77,200	1,578.00	121,821,600
東京エネシス	11,500	973.00	11,189,500
トーエネック	3,500	3,285.00	11,497,500
住友電設	8,500	2,227.00	18,929,500
日本電設工業	19,000	1,583.00	30,077,000
エクシオグループ	52,000	2,261.00	117,572,000
新日本空調	9,100	1,929.00	17,553,900
九電工	26,700	2,866.00	76,522,200
三機工業	22,500	1,398.00	31,455,000
日揮ホールディングス	106,500	1,464.00	155,916,000
中外炉工業	3,500	1,605.00	5,617,500
ヤマト	10,100	754.00	7,615,400
太平電業	7,700	2,644.00	20,358,800
高砂熱学工業	31,200	1,735.00	54,132,000
三晃金属工業	1,400	2,536.00	3,550,400
朝日工業社	4,600	1,602.00	7,369,200
明星工業	22,400	690.00	15,456,000
大気社	16,800	3,045.00	51,156,000
ダイダン	7,700	2,099.00	16,162,300
日比谷総合設備	11,100	1,834.00	20,357,400
フィル・カンパニー	2,000	1,269.00	2,538,000
テスホールディングス	7,200	1,585.00	11,412,000
インフロニア・ホールディングス	147,400	1,042.00	153,590,800
東洋エンジニアリング	14,500	637.00	9,236,500
レイズネクスト	16,700	1,072.00	17,902,400
ニッポン	32,400	1,663.00	53,881,200
日清製粉グループ本社	125,000	1,706.00	213,250,000
日東富士製粉	1,600	4,520.00	7,232,000
昭和産業	10,500	2,618.00	27,489,000
鳥越製粉	9,800	659.00	6,458,200
中部飼料	12,500	986.00	12,325,000

フィード・ワン	14,900	670.00	9,983,000
東洋精糖	1,900	1,022.00	1,941,800
日本甜菜製糖	5,800	1,611.00	9,343,800
D M三井製糖ホールディングス	10,100	1,923.00	19,422,300
塩水港精糖	13,200	211.00	2,785,200
日新製糖	5,200	1,686.00	8,767,200
森永製菓	26,000	3,810.00	99,060,000
中村屋	2,700	3,140.00	8,478,000
江崎グリコ	30,500	3,720.00	113,460,000
名糖産業	4,900	1,590.00	7,791,000
井村屋グループ	6,300	2,260.00	14,238,000
不二家	6,200	2,435.00	15,097,000
山崎製パン	82,900	1,499.00	124,267,100
第一屋製パン	2,100	545.00	1,144,500
モロゾフ	3,500	3,015.00	10,552,500
亀田製菓	6,300	3,975.00	25,042,500
寿スピリッツ	10,600	6,520.00	69,112,000
カルビー	50,400	2,355.00	118,692,000
森永乳業	20,500	5,230.00	107,215,000
六甲バター	8,100	1,509.00	12,222,900
ヤクルト本社	81,900	6,520.00	533,988,000
明治ホールディングス	73,100	6,610.00	483,191,000
雪印メグミルク	26,600	1,980.00	52,668,000
プリマハム	13,800	2,202.00	30,387,600
日本ハム	42,300	4,150.00	175,545,000
林兼産業	3,400	512.00	1,740,800
丸大食品	10,900	1,481.00	16,142,900
S Foods	9,900	3,280.00	32,472,000
柿安本店	3,800	2,432.00	9,241,600
伊藤ハム米久ホールディングス	71,200	649.00	46,208,800
サッポロホールディングス	37,700	2,307.00	86,973,900
アサヒグループホールディングス	260,200	4,461.00	1,160,752,200
キリンホールディングス	406,600	1,829.00	743,671,400
宝ホールディングス	75,200	1,101.00	82,795,200
オエノンホールディングス	31,400	323.00	10,142,200
養命酒製造	3,400	1,756.00	5,970,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,600	1,442.00	111,899,200
サントリー食品インターナショナル	74,000	4,660.00	344,840,000
ダイトーグループホールディングス	5,700	4,710.00	26,847,000
伊藤園	33,600	6,010.00	201,936,000
キーコーヒー	10,900	2,005.00	21,854,500
ユニカフェ	3,300	968.00	3,194,400

ジャパンフーズ	1,600	1,180.00	1,888,000
日清オイリオグループ	13,800	2,849.00	39,316,200
不二製油グループ本社	24,000	1,980.00	47,520,000
かどや製油	1,200	3,725.00	4,470,000
J・オイルミルズ	10,300	1,607.00	16,552,100
キッコーマン	79,600	8,130.00	647,148,000
味の素	244,300	3,475.00	848,942,500
ブルドックソース	4,700	2,136.00	10,039,200
キューピー	58,100	2,342.00	136,070,200
ハウス食品グループ本社	41,400	2,894.00	119,811,600
カゴメ	42,000	3,120.00	131,040,000
焼津水産化学工業	5,400	909.00	4,908,600
アリアケジャパン	10,100	5,190.00	52,419,000
ピエトロ	1,400	1,778.00	2,489,200
エバラ食品工業	2,400	2,812.00	6,748,800
やまみ	1,000	1,788.00	1,788,000
ニチレイ	50,400	2,369.00	119,397,600
東洋水産	53,100	4,370.00	232,047,000
イトアンドホールディングス	4,200	2,116.00	8,887,200
大冷	1,200	1,891.00	2,269,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,700	549.00	3,129,300
日清食品ホールディングス	42,800	8,570.00	366,796,000
永谷園ホールディングス	4,900	1,932.00	9,466,800
一正蒲鉾	4,800	845.00	4,056,000
フジッコ	10,300	1,929.00	19,868,700
ロック・フィールド	11,900	1,486.00	17,683,400
日本たばこ産業	593,100	2,087.50	1,238,096,250
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,387.00	8,599,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,778.00	12,801,600
なとり	6,200	1,949.00	12,083,800
イフジ産業	1,900	985.00	1,871,500
ピククルスコーポレーション	5,300	1,623.00	8,601,900
ファーマフーズ	10,400	1,982.00	20,612,800
ユーグレナ	56,300	822.00	46,278,600
紀文食品	6,400	1,135.00	7,264,000
ミヨシ油脂	4,200	1,158.00	4,863,600
理研ビタミン	11,500	1,677.00	19,285,500
片倉工業	12,200	2,229.00	27,193,800
ゲンゼ	7,000	3,745.00	26,215,000
東洋紡	42,900	1,093.00	46,889,700
ユニチカ	30,600	291.00	8,904,600
富士紡ホールディングス	4,900	3,460.00	16,954,000

倉敷紡績	9,400	1,757.00	16,515,800
シキボウ	5,700	891.00	5,078,700
日本毛織	32,900	892.00	29,346,800
トーア紡コーポレーション	4,000	392.00	1,568,000
帝国繊維	12,300	1,730.00	21,279,000
帝人	101,800	1,363.00	138,753,400
東レ	782,000	638.80	499,541,600
住江織物	2,100	1,898.00	3,985,800
日本フェルト	6,700	518.00	3,470,600
イチカワ	1,600	1,399.00	2,238,400
日東製網	1,200	1,725.00	2,070,000
アツギ	8,500	608.00	5,168,000
ダイニック	4,100	740.00	3,034,000
セーレン	22,200	2,224.00	49,372,800
ソトー	4,100	852.00	3,493,200
東海染工	1,300	1,159.00	1,506,700
小松マテーレ	17,800	1,406.00	25,026,800
ワコールホールディングス	27,000	1,842.00	49,734,000
ホギメディカル	14,600	3,240.00	47,304,000
T S Iホールディングス	36,400	336.00	12,230,400
マツオカコーポレーション	3,500	1,172.00	4,102,000
ワールド	14,200	1,240.00	17,608,000
三陽商会	5,200	764.00	3,972,800
ナイガイ	4,000	290.00	1,160,000
オンワードホールディングス	65,200	256.00	16,691,200
ルックホールディングス	3,500	1,528.00	5,348,000
ゴールドウイン	19,500	6,210.00	121,095,000
デサント	21,100	3,095.00	65,304,500
キング	5,300	536.00	2,840,800
ヤマトインターナショナル	9,800	297.00	2,910,600
特種東海製紙	6,600	3,170.00	20,922,000
王子ホールディングス	451,200	607.00	273,878,400
日本製紙	51,700	1,039.00	53,716,300
三菱製紙	15,300	313.00	4,788,900
北越コーポレーション	70,800	695.00	49,206,000
中越パルプ工業	4,100	949.00	3,890,900
巴川製紙所	3,200	849.00	2,716,800
大王製紙	52,000	1,583.00	82,316,000
阿波製紙	2,800	340.00	952,000
レンゴー	102,000	782.00	79,764,000
トーモク	6,600	1,591.00	10,500,600
ザ・パックス	8,200	2,573.00	21,098,600

北の達人コーポレーション	38,600	225.00	8,685,000	
クラレ	157,900	1,057.00	166,900,300	
旭化成	715,400	1,062.50	760,112,500	
共和レザー	6,700	652.00	4,368,400	
昭和電工	93,600	2,430.00	227,448,000	
住友化学	793,000	562.00	445,666,000	
住友精化	4,800	3,095.00	14,856,000	
日産化学	58,700	7,230.00	424,401,000	
ラサ工業	3,800	1,580.00	6,004,000	
クレハ	8,500	9,810.00	83,385,000	
多木化学	4,200	5,200.00	21,840,000	
テイカ	7,900	1,291.00	10,198,900	
石原産業	18,000	1,077.00	19,386,000	
片倉コープアグリ	2,400	1,270.00	3,048,000	
日本曹達	13,800	3,370.00	46,506,000	
東ソー	155,700	1,814.00	282,439,800	
トクヤマ	34,500	1,718.00	59,271,000	
セントラル硝子	17,600	2,087.00	36,731,200	
東亜合成	60,000	1,079.00	64,740,000	
大阪ソーダ	10,100	3,125.00	31,562,500	
関東電化工業	23,600	1,081.00	25,511,600	
デンカ	39,400	3,400.00	133,960,000	
信越化学工業	185,300	18,790.00	3,481,787,000	
日本カーバイド工業	3,900	1,384.00	5,397,600	
堺化学工業	7,600	1,942.00	14,759,200	
第一稀元素化学工業	10,000	1,012.00	10,120,000	
エア・ウォーター	102,200	1,720.00	175,784,000	
日本酸素ホールディングス	103,700	2,331.00	241,724,700	
日本化学工業	3,400	2,413.00	8,204,200	
東邦アセチレン	1,800	1,166.00	2,098,800	
日本パーカラライジング	54,400	932.00	50,700,800	
高压ガス工業	17,100	661.00	11,303,100	
チタン工業	1,200	1,857.00	2,228,400	
四国化成工業	14,100	1,340.00	18,894,000	
戸田工業	2,300	2,891.00	6,649,300	
ステラ ケミファ	5,400	2,596.00	14,018,400	
保土谷化学工業	3,500	4,395.00	15,382,500	
日本触媒	18,100	5,330.00	96,473,000	
大日精化工業	8,900	2,060.00	18,334,000	
カネカ	27,900	3,545.00	98,905,500	
三菱瓦斯化学	100,400	2,081.00	208,932,400	
三井化学	98,000	3,090.00	302,820,000	

J S R	100,600	3,630.00	365,178,000
東京応化工業	17,500	7,360.00	128,800,000
大阪有機化学工業	9,200	3,065.00	28,198,000
三菱ケミカルホールディングス	721,600	817.10	589,619,360
K Hネオケム	17,800	2,761.00	49,145,800
ダイセル	155,500	817.00	127,043,500
住友ベークライト	17,000	4,990.00	84,830,000
積水化学工業	225,900	1,759.00	397,358,100
日本ゼオン	97,300	1,364.00	132,717,200
アイカ工業	30,100	2,989.00	89,968,900
宇部興産	50,900	1,997.00	101,647,300
積水樹脂	16,300	1,771.00	28,867,300
タキロンシーアイ	23,400	545.00	12,753,000
旭有機材	6,100	2,007.00	12,242,700
ニチバン	6,400	1,700.00	10,880,000
リケンテクノス	26,300	457.00	12,019,100
大倉工業	5,500	1,819.00	10,004,500
積水化成成品工業	14,500	437.00	6,336,500
群栄化学工業	2,500	2,997.00	7,492,500
タイガースポリマー	5,700	457.00	2,604,900
ミライアル	3,500	1,751.00	6,128,500
ダイキアクシス	4,200	758.00	3,183,600
ダイキョーニシカワ	22,800	540.00	12,312,000
竹本容器	3,900	848.00	3,307,200
森六ホールディングス	5,800	1,808.00	10,486,400
恵和	2,900	5,310.00	15,399,000
日本化薬	85,000	1,161.00	98,685,000
カーリットホールディングス	10,700	663.00	7,094,100
日本精化	8,700	2,218.00	19,296,600
扶桑化学工業	9,700	4,510.00	43,747,000
トリケミカル研究所	11,100	2,866.00	31,812,600
A D E K A	49,700	2,704.00	134,388,800
日油	36,800	5,020.00	184,736,000
新日本理化	17,900	242.00	4,331,800
ハリマ化成グループ	8,000	798.00	6,384,000
花王	243,800	5,025.00	1,225,095,000
第一工業製薬	4,000	2,759.00	11,036,000
石原ケミカル	5,400	1,250.00	6,750,000
日華化学	3,600	752.00	2,707,200
ニイタカ	2,200	2,418.00	5,319,600
三洋化成工業	6,400	5,040.00	32,256,000
有機合成薬品工業	7,500	274.00	2,055,000

大日本塗料	13,200	784.00	10,348,800
日本ペイントホールディングス	405,600	1,082.00	438,859,200
関西ペイント	111,900	1,973.00	220,778,700
神東塗料	8,500	156.00	1,326,000
中国塗料	25,500	904.00	23,052,000
日本特殊塗料	8,100	838.00	6,787,800
藤倉化成	13,400	456.00	6,110,400
太陽ホールディングス	15,900	3,250.00	51,675,000
D I C	45,600	2,507.00	114,319,200
サカタインクス	21,400	967.00	20,693,800
東洋インキＳＣホールディングス	22,800	1,903.00	43,388,400
T & K T O K A	8,700	889.00	7,734,300
富士フィルムホールディングス	193,700	7,502.00	1,453,137,400
資生堂	205,300	6,218.00	1,276,555,400
ライオン	133,100	1,362.00	181,282,200
高砂香料工業	7,600	2,746.00	20,869,600
マンダム	23,100	1,315.00	30,376,500
ミルボン	13,600	5,480.00	74,528,000
ファンケル	44,600	2,734.00	121,936,400
コーセー	20,700	12,890.00	266,823,000
コタ	7,700	1,420.00	10,934,000
シーボン	1,400	1,728.00	2,419,200
ポーラ・オルビスホールディングス	47,000	1,599.00	75,153,000
ノエビアホールディングス	9,300	4,945.00	45,988,500
アジュバンホールディングス	2,500	1,102.00	2,755,000
新日本製薬	3,000	1,447.00	4,341,000
エステー	7,100	1,527.00	10,841,700
アグロ カネショウ	3,700	1,161.00	4,295,700
コニシ	18,100	1,565.00	28,326,500
長谷川香料	19,000	2,607.00	49,533,000
星光P M C	6,200	593.00	3,676,600
小林製薬	30,900	9,820.00	303,438,000
荒川化学工業	9,200	1,068.00	9,825,600
メック	8,200	3,375.00	27,675,000
日本高純度化学	3,000	2,403.00	7,209,000
タカラバイオ	28,800	2,241.00	64,540,800
J C U	12,400	4,150.00	51,460,000
新田ゼラチン	6,900	666.00	4,595,400
O A T アグリオ	4,500	1,146.00	5,157,000
デクセリアルズ	28,700	3,345.00	96,001,500
アース製薬	9,100	5,580.00	50,778,000
北興化学工業	10,300	936.00	9,640,800

大成ラミック	3,400	2,680.00	9,112,000
クミアイ化学工業	41,000	885.00	36,285,000
日本農薬	19,600	611.00	11,975,600
アキレス	7,100	1,266.00	8,988,600
有沢製作所	16,100	957.00	15,407,700
日東電工	66,600	8,820.00	587,412,000
レック	14,400	880.00	12,672,000
三光合成	12,600	352.00	4,435,200
きもと	16,900	217.00	3,667,300
藤森工業	9,900	3,740.00	37,026,000
前澤化成工業	7,000	1,277.00	8,939,000
未来工業	3,900	1,571.00	6,126,900
ウェーブロックホールディングス	4,200	678.00	2,847,600
J S P	6,400	1,537.00	9,836,800
エフピコ	20,300	2,916.00	59,194,800
天馬	8,700	2,419.00	21,045,300
信越ポリマー	19,800	1,132.00	22,413,600
東リ	27,400	221.00	6,055,400
ニフコ	36,800	2,790.00	102,672,000
バルカー	9,000	2,659.00	23,931,000
ユニ・チャーム	212,400	4,359.00	925,851,600
ショーエイコーポレーション	3,000	621.00	1,863,000
協和キリン	129,300	2,848.00	368,246,400
武田薬品工業	866,200	3,498.00	3,029,967,600
アステラス製薬	955,600	1,911.00	1,826,151,600
大日本住友製薬	68,100	1,208.00	82,264,800
塩野義製薬	138,600	7,530.00	1,043,658,000
わかもと製薬	13,100	289.00	3,785,900
日本新薬	28,800	8,330.00	239,904,000
中外製薬	344,700	4,097.00	1,412,235,900
科研製薬	17,300	3,890.00	67,297,000
エーザイ	131,900	5,670.00	747,873,000
ロート製薬	56,600	3,695.00	209,137,000
小野薬品工業	253,100	3,066.00	776,004,600
久光製薬	29,100	3,660.00	106,506,000
持田製薬	13,900	3,735.00	51,916,500
参天製薬	205,600	1,227.00	252,271,200
扶桑薬品工業	3,900	2,186.00	8,525,400
日本ケミファ	1,300	2,084.00	2,709,200
ツムラ	34,100	3,200.00	109,120,000
日医工	34,200	776.00	26,539,200
キッセイ薬品工業	19,500	2,555.00	49,822,500

生化学工業	19,400	875.00	16,975,000
栄研化学	19,400	1,727.00	33,503,800
日水製薬	4,100	977.00	4,005,700
鳥居薬品	5,900	3,135.00	18,496,500
JCRファーマ	31,100	2,257.00	70,192,700
東和薬品	15,900	2,748.00	43,693,200
富士製薬工業	6,800	983.00	6,684,400
ゼリア新薬工業	20,000	1,904.00	38,080,000
第一三共	866,100	2,680.00	2,321,148,000
キョーリン製薬ホールディングス	22,100	1,777.00	39,271,700
大幸薬品	16,600	596.00	9,893,600
ダイト	7,200	2,860.00	20,592,000
大塚ホールディングス	229,000	4,232.00	969,128,000
大正製薬ホールディングス	26,200	5,680.00	148,816,000
ペプチドリーム	57,800	2,186.00	126,350,800
あすか製薬ホールディングス	12,500	1,263.00	15,787,500
サワイグループホールディングス	24,100	4,460.00	107,486,000
日本コークス工業	93,100	144.00	13,406,400
ニチレキ	14,100	1,235.00	17,413,500
ユシロ化学工業	5,700	1,032.00	5,882,400
ビーピー・カストロール	3,900	1,234.00	4,812,600
富士石油	29,400	265.00	7,791,000
MORESCO	3,600	1,138.00	4,096,800
出光興産	122,300	3,375.00	412,762,500
ENEOSホールディングス	1,658,000	458.00	759,364,000
コスモエネルギーホールディングス	31,900	2,630.00	83,897,000
横浜ゴム	63,800	1,692.00	107,949,600
TOYO TIRE	58,000	1,563.00	90,654,000
ブリヂストン	317,500	4,758.00	1,510,665,000
住友ゴム工業	99,000	1,124.00	111,276,000
藤倉コンポジット	8,800	725.00	6,380,000
オカモト	6,500	3,905.00	25,382,500
フコク	4,800	926.00	4,444,800
ニッタ	11,400	2,764.00	31,509,600
住友理工	21,400	601.00	12,861,400
三ツ星ベルト	13,400	2,027.00	27,161,800
バンドー化学	17,800	883.00	15,717,400
日東紡績	16,400	2,821.00	46,264,400
AGC	101,200	4,905.00	496,386,000
日本板硝子	52,900	428.00	22,641,200
石塚硝子	1,900	2,019.00	3,836,100
日本山村硝子	4,300	819.00	3,521,700

日本電気硝子	44,300	2,716.00	120,318,800
オハラ	4,400	1,271.00	5,592,400
住友大阪セメント	20,400	3,360.00	68,544,000
太平洋セメント	62,600	2,019.00	126,389,400
日本ヒューム	11,100	691.00	7,670,100
日本コンクリート工業	22,000	291.00	6,402,000
三谷セキサン	5,100	6,660.00	33,966,000
アジアパイルホールディングス	17,100	427.00	7,301,700
東海カーボン	92,400	1,151.00	106,352,400
日本カーボン	5,700	4,190.00	23,883,000
東洋炭素	7,200	3,160.00	22,752,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,460.00	27,206,000
TOTO	78,700	4,940.00	388,778,000
日本碍子	119,400	1,753.00	209,308,200
日本特殊陶業	83,900	1,977.00	165,870,300
MARUWA	3,800	16,340.00	62,092,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,795.00	9,867,000
黒崎播磨	1,900	4,130.00	7,847,000
ヨータイ	7,100	1,259.00	8,938,900
東京窯業	14,200	294.00	4,174,800
ニッカトー	5,100	540.00	2,754,000
フジインコーポレーテッド	8,800	6,720.00	59,136,000
クニミネ工業	3,500	1,001.00	3,503,500
エーアンドエーマテリアル	1,900	885.00	1,681,500
ニチアス	25,600	2,527.00	64,691,200
ニチハ	15,400	2,510.00	38,654,000
日本製鉄	487,800	2,171.00	1,059,013,800
神戸製鋼所	203,500	591.00	120,268,500
中山製鋼所	17,400	446.00	7,760,400
合同製鐵	5,900	1,326.00	7,823,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	294,400	1,723.00	507,251,200
東京製鐵	37,200	1,164.00	43,300,800
共英製鋼	12,300	1,339.00	16,469,700
大和工業	20,800	3,715.00	77,272,000
東京鐵鋼	4,800	1,335.00	6,408,000
大阪製鐵	5,800	1,553.00	9,007,400
淀川製鋼所	14,300	2,628.00	37,580,400
丸一鋼管	34,500	2,760.00	95,220,000
モリ工業	3,200	2,563.00	8,201,600
大同特殊鋼	17,800	3,690.00	65,682,000
日本高周波鋼業	4,100	352.00	1,443,200
日本冶金工業	8,000	2,810.00	22,480,000

山陽特殊製鋼	11,200	2,123.00	23,777,600
愛知製鋼	6,100	2,403.00	14,658,300
日立金属	117,400	2,041.00	239,613,400
日本金属	2,800	1,422.00	3,981,600
大太平洋金属	6,700	4,130.00	27,671,000
新日本電工	70,500	339.00	23,899,500
栗本鐵工所	5,000	1,570.00	7,850,000
虹技	1,500	981.00	1,471,500
三菱製鋼	7,000	1,135.00	7,945,000
日亜鋼業	14,300	269.00	3,846,700
日本精線	1,800	4,450.00	8,010,000
エンビプロ・ホールディングス	3,600	2,078.00	7,480,800
シンニッタン	13,300	224.00	2,979,200
新家工業	2,700	1,635.00	4,414,500
大紀アルミニウム工業所	16,500	1,575.00	25,987,500
日本軽金属ホールディングス	27,600	1,713.00	47,278,800
三井金属鉱業	29,400	3,355.00	98,637,000
東邦亜鉛	6,100	2,946.00	17,970,600
三菱マテリアル	72,000	2,143.00	154,296,000
住友金属鉱山	139,300	6,163.00	858,505,900
D O W Aホールディングス	29,700	5,610.00	166,617,000
古河機械金属	18,000	1,289.00	23,202,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,600	1,438.00	18,118,800
東邦チタニウム	19,600	1,455.00	28,518,000
U A C J	16,600	2,337.00	38,794,200
C Kサンエツ	2,300	3,820.00	8,786,000
古河電気工業	33,900	2,176.00	73,766,400
住友電気工業	407,500	1,462.00	595,765,000
フジクラ	121,600	625.00	76,000,000
昭和電線ホールディングス	9,500	1,879.00	17,850,500
東京特殊電線	1,700	2,734.00	4,647,800
タツタ電線	19,300	462.00	8,916,600
カナレ電気	1,700	1,582.00	2,689,400
平河ヒューテック	6,100	1,160.00	7,076,000
リョービ	13,500	1,070.00	14,445,000
アーレスティ	11,700	377.00	4,410,900
アサヒホールディングス	43,700	2,265.00	98,980,500
稲葉製作所	6,100	1,322.00	8,064,200
宮地エンジニアリンググループ	3,300	3,460.00	11,418,000
トーカロ	28,100	1,360.00	38,216,000
アルファC o	4,200	1,020.00	4,284,000
S U M C O	167,700	2,027.00	339,927,900

川田テクノロジーズ	2,200	3,610.00	7,942,000	
RS Technologies	3,500	6,440.00	22,540,000	
ジェイテックコーポレーション	1,400	1,884.00	2,637,600	
信和	6,800	788.00	5,358,400	
東洋製罐グループホールディングス	69,400	1,406.00	97,576,400	
ホッカンホールディングス	6,000	1,303.00	7,818,000	
コロナ	6,000	851.00	5,106,000	
横河ブリッジホールディングス	18,700	1,942.00	36,315,400	
駒井ハルテック	2,000	2,174.00	4,348,000	
高田機工	1,000	2,907.00	2,907,000	
三和ホールディングス	102,800	1,244.00	127,883,200	
文化シャッター	34,600	984.00	34,046,400	
三協立山	14,000	641.00	8,974,000	
アルインコ	7,900	867.00	6,849,300	
東洋シャッター	2,400	583.00	1,399,200	
LIXIL	171,500	2,290.00	392,735,000	
日本フィルコン	7,600	523.00	3,974,800	
ノーリツ	20,900	1,468.00	30,681,200	
長府製作所	11,100	1,987.00	22,055,700	
リンナイ	20,500	9,170.00	187,985,000	
ダイニチ工業	5,200	662.00	3,442,400	
日東精工	13,700	503.00	6,891,100	
三洋工業	1,300	1,861.00	2,419,300	
岡部	20,800	690.00	14,352,000	
ジーテクト	13,500	1,277.00	17,239,500	
東プレ	20,300	1,175.00	23,852,500	
高周波熱錬	19,500	591.00	11,524,500	
東京製綱	6,700	905.00	6,063,500	
サンコール	9,300	495.00	4,603,500	
モリテック スチール	8,500	332.00	2,822,000	
パイオラックス	15,600	1,554.00	24,242,400	
エイチワン	10,700	608.00	6,505,600	
日本発條	100,200	885.00	88,677,000	
中央発條	5,200	764.00	3,972,800	
アドバネクス	1,400	1,623.00	2,272,200	
立川ブラインド工業	4,800	1,065.00	5,112,000	
三益半導体工業	8,500	2,564.00	21,794,000	
日本ドライケミカル	2,700	1,740.00	4,698,000	
日本製鋼所	33,100	3,820.00	126,442,000	
三浦工業	47,200	3,035.00	143,252,000	
タクマ	37,000	1,429.00	52,873,000	
ツガミ	24,100	1,330.00	32,053,000	

オークマ	12,700	5,100.00	64,770,000
芝浦機械	12,400	3,420.00	42,408,000
アマダ	172,200	1,084.00	186,664,800
アイダエンジニアリング	28,700	1,057.00	30,335,900
滝澤鉄工所	3,200	1,187.00	3,798,400
F U J I	50,200	2,223.00	111,594,600
牧野フライス製作所	12,000	3,875.00	46,500,000
オーエスジー	50,500	1,879.00	94,889,500
ダイジェット工業	1,400	1,069.00	1,496,600
旭ダイヤモンド工業	28,900	591.00	17,079,900
D M G 森精機	64,700	1,674.00	108,307,800
ソディック	24,000	785.00	18,840,000
ディスコ	16,100	34,400.00	553,840,000
日東工器	6,000	1,556.00	9,336,000
日進工具	8,600	1,450.00	12,470,000
パンチ工業	9,200	499.00	4,590,800
富士ダイス	5,600	649.00	3,634,400
豊和工業	5,800	802.00	4,651,600
O K K	3,900	1,091.00	4,254,900
東洋機械金属	7,200	632.00	4,550,400
津田駒工業	2,100	560.00	1,176,000
エンシュウ	2,600	717.00	1,864,200
島精機製作所	16,000	1,870.00	29,920,000
オプトラン	13,700	2,105.00	28,838,500
N C ホールディングス	3,100	2,000.00	6,200,000
イワキポンプ	7,000	1,094.00	7,658,000
フリー	9,700	1,106.00	10,728,200
ヤマシンフィルタ	22,100	349.00	7,712,900
日阪製作所	13,500	794.00	10,719,000
やまびこ	21,200	1,496.00	31,715,200
野村マイクロ・サイエンス	2,900	4,255.00	12,339,500
平田機工	5,200	5,400.00	28,080,000
ペガサスミシン製造	11,200	595.00	6,664,000
マルマエ	4,500	2,422.00	10,899,000
タツモ	5,100	1,662.00	8,476,200
ナプテスコ	62,200	3,260.00	202,772,000
三井海洋開発	11,600	1,275.00	14,790,000
レオン自動機	11,700	1,018.00	11,910,600
S M C	32,300	68,840.00	2,223,532,000
ホソカワミクロン	7,700	2,683.00	20,659,100
ユニオンツール	4,100	3,810.00	15,621,000
オイレス工業	15,300	1,515.00	23,179,500

日精エー・エス・ピー機械	3,700	3,115.00	11,525,500
サトーホールディングス	14,400	1,719.00	24,753,600
技研製作所	9,700	3,715.00	36,035,500
日本エアージェット	5,100	1,082.00	5,518,200
カワタ	3,500	1,049.00	3,671,500
日精樹脂工業	7,800	1,009.00	7,870,200
オカダアイヨン	3,500	1,439.00	5,036,500
ワイエイシイホールディングス	4,300	1,682.00	7,232,600
小松製作所	499,500	2,943.00	1,470,028,500
住友重機械工業	63,100	2,818.00	177,815,800
日立建機	44,200	3,195.00	141,219,000
日工	15,300	607.00	9,287,100
巴工業	4,300	2,413.00	10,375,900
井関農機	10,400	1,300.00	13,520,000
TOWA	9,400	2,459.00	23,114,600
丸山製作所	2,300	1,560.00	3,588,000
北川鉄工所	5,100	1,337.00	6,818,700
ローツェ	5,400	12,290.00	66,366,000
タカキタ	3,900	615.00	2,398,500
クボタ	534,000	2,303.00	1,229,802,000
荏原実業	5,100	2,457.00	12,530,700
三菱化工機	3,600	2,007.00	7,225,200
月島機械	20,500	1,083.00	22,201,500
帝国電機製作所	7,700	1,574.00	12,119,800
新東工業	24,500	689.00	16,880,500
澁谷工業	9,700	2,439.00	23,658,300
アイチ コーポレーション	15,900	882.00	14,023,800
小森コーポレーション	28,100	727.00	20,428,700
鶴見製作所	8,600	1,819.00	15,643,400
住友精密工業	1,700	2,323.00	3,949,100
日本ギア工業	4,100	276.00	1,131,600
酒井重工業	2,000	3,200.00	6,400,000
荏原製作所	44,100	6,840.00	301,644,000
石井鐵工所	1,600	2,940.00	4,704,000
西島製作所	10,100	1,026.00	10,362,600
北越工業	10,400	874.00	9,089,600
ダイキン工業	140,400	22,410.00	3,146,364,000
オルガノ	3,200	10,130.00	32,416,000
トーヨーカネツ	4,200	2,452.00	10,298,400
栗田工業	59,700	4,545.00	271,336,500
椿本チエイン	14,500	3,055.00	44,297,500
大同工業	5,000	933.00	4,665,000

木村化工機	9,400	867.00	8,149,800
アネスト岩田	17,200	830.00	14,276,000
ダイフク	60,700	8,790.00	533,553,000
サムコ	2,800	2,600.00	7,280,000
加藤製作所	5,400	783.00	4,228,200
油研工業	1,900	1,757.00	3,338,300
タダノ	57,800	1,030.00	59,534,000
フジテック	40,900	3,150.00	128,835,000
C K D	32,600	1,885.00	61,451,000
キトー	9,400	1,775.00	16,685,000
平和	30,800	1,822.00	56,117,600
理想科学工業	9,300	1,984.00	18,451,200
S A N K Y O	23,800	3,395.00	80,801,000
日本金銭機械	11,300	675.00	7,627,500
マースグループホールディングス	7,000	1,699.00	11,893,000
フクシマガリレイ	7,600	3,845.00	29,222,000
オーイズミ	4,000	420.00	1,680,000
ダイコク電機	5,100	1,213.00	6,186,300
竹内製作所	16,800	2,642.00	44,385,600
アマノ	28,900	2,197.00	63,493,300
J U K I	15,300	839.00	12,836,700
ジャノメ	9,400	735.00	6,909,000
マックス	14,700	1,703.00	25,034,100
グローリー	28,300	2,072.00	58,637,600
新晃工業	10,300	1,728.00	17,798,400
大和冷機工業	16,000	1,090.00	17,440,000
セガサミーホールディングス	109,300	2,113.00	230,950,900
日本ピストンリング	4,100	1,308.00	5,362,800
リケン	4,800	2,443.00	11,726,400
T P R	14,900	1,301.00	19,384,900
ツバキ・ナカシマ	24,200	967.00	23,401,400
ホシザキ	32,200	8,410.00	270,802,000
大豊工業	9,100	706.00	6,424,600
日本精工	207,600	736.00	152,793,600
N T N	236,900	214.00	50,696,600
ジェイテクト	105,800	964.00	101,991,200
不二越	9,400	4,190.00	39,386,000
日本トムソン	30,300	541.00	16,392,300
T H K	62,200	2,721.00	169,246,200
ユースン精機	8,600	672.00	5,779,200
前澤給装工業	8,300	973.00	8,075,900
イーグル工業	13,700	976.00	13,371,200

前澤工業	7,400	665.00	4,921,000
日本ピラー工業	11,200	3,080.00	34,496,000
キッツ	37,200	687.00	25,556,400
マキタ	134,200	3,935.00	528,077,000
三井E & Sホールディングス	39,800	366.00	14,566,800
日立造船	93,400	746.00	69,676,400
三菱重工業	173,200	4,020.00	696,264,000
I H I	68,900	2,950.00	203,255,000
スター精密	16,600	1,540.00	25,564,000
日清紡ホールディングス	67,400	1,063.00	71,646,200
イビデン	57,900	6,050.00	350,295,000
コニカミノルタ	242,000	516.00	124,872,000
ブラザー工業	134,900	2,237.00	301,771,300
ミネベアミツミ	190,200	2,694.00	512,398,800
日立製作所	530,100	6,165.00	3,268,066,500
東芝	192,600	4,650.00	895,590,000
三菱電機	1,102,100	1,410.00	1,553,961,000
富士電機	66,400	6,160.00	409,024,000
東洋電機製造	4,000	1,003.00	4,012,000
安川電機	118,600	4,815.00	571,059,000
シンフォニアテクノロジー	13,300	1,332.00	17,715,600
明電舎	18,700	2,541.00	47,516,700
オリジン	2,800	1,217.00	3,407,600
山洋電気	5,000	4,925.00	24,625,000
デンヨー	9,400	1,636.00	15,378,400
PHCホールディングス	13,100	1,808.00	23,684,800
東芝テック	11,800	4,915.00	57,997,000
芝浦メカトロニクス	2,000	8,620.00	17,240,000
マブチモーター	25,700	3,825.00	98,302,500
日本電産	285,700	9,748.00	2,785,003,600
トレックス・セミコンダクター	5,800	2,678.00	15,532,400
東光高岳	6,500	1,479.00	9,613,500
ダイヘン	12,100	4,230.00	51,183,000
ヤーマン	18,600	1,149.00	21,371,400
JVCケンウッド	92,900	178.00	16,536,200
ミマキエンジニアリング	10,700	686.00	7,340,200
I - P E X	5,500	1,468.00	8,074,000
日新電機	25,800	1,476.00	38,080,800
大崎電気工業	20,200	468.00	9,453,600
オムロン	91,700	8,214.00	753,223,800
日東工業	14,700	1,576.00	23,167,200
I D E C	13,600	2,573.00	34,992,800

正興電機製作所	4,000	1,274.00	5,096,000
不二電機工業	2,600	1,109.00	2,883,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,100	2,341.00	84,510,100
サクサホールディングス	2,600	1,535.00	3,991,000
メルコホールディングス	2,600	3,905.00	10,153,000
テクノメディカ	2,800	1,561.00	4,370,800
日本電気	140,000	5,150.00	721,000,000
富士通	99,200	18,415.00	1,826,768,000
沖電気工業	44,800	846.00	37,900,800
岩崎通信機	4,500	875.00	3,937,500
電気興業	5,800	2,255.00	13,079,000
サンケン電気	10,300	5,200.00	53,560,000
ナカヨ	2,000	1,143.00	2,286,000
アイホン	6,200	2,049.00	12,703,800
ルネサスエレクトロニクス	598,500	1,432.00	857,052,000
セイコーエプソン	136,700	1,841.00	251,664,700
ワコム	86,200	943.00	81,286,600
アルバック	22,000	6,300.00	138,600,000
アクセル	5,100	1,064.00	5,426,400
E I Z O	8,600	3,590.00	30,874,000
日本信号	28,100	882.00	24,784,200
京三製作所	23,700	437.00	10,356,900
能美防災	14,900	1,954.00	29,114,600
ホーチキ	8,500	1,234.00	10,489,000
星和電機	6,200	531.00	3,292,200
エレコム	25,600	1,472.00	37,683,200
パナソニック	1,175,500	1,188.50	1,397,081,750
シャープ	125,600	1,149.00	144,314,400
アンリツ	71,000	1,553.00	110,263,000
富士通ゼネラル	29,900	2,390.00	71,461,000
ソニーグループ	690,400	12,730.00	8,788,792,000
T D K	159,800	4,460.00	712,708,000
帝国通信工業	5,300	1,442.00	7,642,600
タムラ製作所	42,500	616.00	26,180,000
アルプスアルパイン	98,000	1,211.00	118,678,000
池上通信機	3,200	631.00	2,019,200
日本電波工業	10,400	1,260.00	13,104,000
鈴木	6,100	797.00	4,861,700
メイコー	9,100	4,055.00	36,900,500
日本トリム	2,300	2,574.00	5,920,200
ローランド ディー . ジー .	6,700	3,380.00	22,646,000
フォスター電機	11,100	723.00	8,025,300

S M K	2,600	2,231.00	5,800,600
ヨコオ	8,400	2,588.00	21,739,200
ホシデン	27,100	1,157.00	31,354,700
ヒロセ電機	17,000	17,860.00	303,620,000
日本航空電子工業	25,300	1,991.00	50,372,300
T O A	11,800	680.00	8,024,000
マクセル	22,400	1,202.00	26,924,800
古野電気	13,700	1,014.00	13,891,800
ユニデンホールディングス	2,400	3,445.00	8,268,000
スミダコーポレーション	11,000	939.00	10,329,000
アイコム	4,100	2,474.00	10,143,400
リオン	4,500	2,332.00	10,494,000
本多通信工業	9,700	480.00	4,656,000
横河電機	110,300	2,099.00	231,519,700
新電元工業	4,200	3,125.00	13,125,000
アズビル	64,600	4,090.00	264,214,000
東亜ディーケーケー	6,100	918.00	5,599,800
日本光電工業	45,700	2,951.00	134,860,700
チノー	3,500	1,619.00	5,666,500
共和電業	10,600	366.00	3,879,600
日本電子材料	5,600	2,105.00	11,788,000
堀場製作所	20,400	6,700.00	136,680,000
アドバンテスト	81,900	9,670.00	791,973,000
小野測器	5,800	472.00	2,737,600
エスベック	9,200	1,968.00	18,105,600
キーエンス	99,900	57,250.00	5,719,275,000
日置電機	5,400	7,050.00	38,070,000
シスメックス	93,300	8,923.00	832,515,900
日本マイクロニクス	19,500	1,674.00	32,643,000
メガチップス	10,400	3,780.00	39,312,000
O B A R A G R O U P	5,200	2,988.00	15,537,600
澤藤電機	1,700	1,616.00	2,747,200
原田工業	5,800	955.00	5,539,000
コーセル	12,900	805.00	10,384,500
イリソ電子工業	9,400	3,340.00	31,396,000
オブテックスグループ	18,400	1,734.00	31,905,600
千代田インテグレ	4,900	2,109.00	10,334,100
レーザーテック	48,400	20,785.00	1,005,994,000
スタンレー電気	77,200	2,324.00	179,412,800
岩崎電気	4,300	2,277.00	9,791,100
ウシオ電機	56,800	1,826.00	103,716,800
岡谷電機産業	9,700	299.00	2,900,300

ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	293.00	3,340,200
エノモト	3,500	1,602.00	5,607,000
日本セラミック	10,500	2,445.00	25,672,500
遠藤照明	5,600	937.00	5,247,200
古河電池	8,300	1,284.00	10,657,200
双信電機	6,300	598.00	3,767,400
山一電機	8,300	1,877.00	15,579,100
図研	7,300	3,020.00	22,046,000
日本電子	23,000	6,870.00	158,010,000
カシオ計算機	79,800	1,408.00	112,358,400
ファナック	96,700	21,645.00	2,093,071,500
日本シイエムケイ	22,500	623.00	14,017,500
エンプラス	2,900	2,715.00	7,873,500
大真空	15,400	1,209.00	18,618,600
ローム	49,400	9,590.00	473,746,000
浜松ホトニクス	79,200	6,550.00	518,760,000
三井ハイテック	10,900	12,450.00	135,705,000
新光電気工業	32,500	5,850.00	190,125,000
京セラ	155,100	6,882.00	1,067,398,200
太陽誘電	53,600	5,550.00	297,480,000
村田製作所	323,800	8,117.00	2,628,284,600
双葉電子工業	19,800	659.00	13,048,200
北陸電気工業	4,600	1,188.00	5,464,800
ニチコン	35,200	1,175.00	41,360,000
日本ケミコン	10,800	1,893.00	20,444,400
K O A	17,000	1,437.00	24,429,000
市光工業	14,300	412.00	5,891,600
小糸製作所	60,600	4,975.00	301,485,000
ミツバ	20,300	370.00	7,511,000
S C R E E Nホールディングス	19,100	12,360.00	236,076,000
キャノン電子	10,500	1,604.00	16,842,000
キャノン	547,600	2,993.00	1,638,966,800
リコー	305,900	1,062.00	324,865,800
象印マホービン	30,200	1,452.00	43,850,400
M U T O Hホールディングス	1,700	2,120.00	3,604,000
東京エレクトロン	69,900	63,250.00	4,421,175,000
トヨタ紡織	44,900	2,002.00	89,889,800
芦森工業	2,100	900.00	1,890,000
ユニプレス	16,400	705.00	11,562,000
豊田自動織機	89,200	8,470.00	755,524,000
モリタホールディングス	17,700	1,236.00	21,877,200
三櫻工業	15,200	700.00	10,640,000

デンソー	242,700	7,860.00	1,907,622,000
東海理化電機製作所	29,000	1,505.00	43,645,000
川崎重工業	80,400	2,226.00	178,970,400
名村造船所	33,100	328.00	10,856,800
日本車輛製造	4,000	2,174.00	8,696,000
三菱ロジスネクスト	14,600	932.00	13,607,200
近畿車輛	1,700	1,193.00	2,028,100
日産自動車	1,299,800	547.80	712,030,440
いすゞ自動車	345,800	1,588.00	549,130,400
トヨタ自動車	5,582,500	2,222.50	12,407,106,250
日野自動車	137,600	720.00	99,072,000
三菱自動車工業	407,900	331.00	135,014,900
エフテック	7,700	545.00	4,196,500
レシップホールディングス	4,400	568.00	2,499,200
G M B	2,000	744.00	1,488,000
ファルテック	1,900	651.00	1,236,900
武蔵精密工業	24,600	1,512.00	37,195,200
日産車体	16,100	556.00	8,951,600
新明和工業	31,100	905.00	28,145,500
極東開発工業	20,500	1,388.00	28,454,000
トピー工業	9,100	1,050.00	9,555,000
ティラド	3,200	2,498.00	7,993,600
曙ブレーキ工業	60,500	157.00	9,498,500
タチエス	19,300	995.00	19,203,500
N O K	53,300	1,147.00	61,135,100
フタバ産業	27,600	364.00	10,046,400
K Y B	11,500	2,975.00	34,212,500
大同メタル工業	21,100	571.00	12,048,100
プレス工業	54,600	378.00	20,638,800
ミクニ	14,000	403.00	5,642,000
太平洋工業	23,100	948.00	21,898,800
河西工業	13,500	279.00	3,766,500
アイシン	80,700	4,195.00	338,536,500
マツダ	345,900	909.00	314,423,100
今仙電機製作所	7,200	600.00	4,320,000
本田技研工業	867,700	3,487.00	3,025,669,900
スズキ	252,100	4,213.00	1,062,097,300
S U B A R U	315,800	1,948.00	615,178,400
安永	5,300	830.00	4,399,000
ヤマハ発動機	143,800	2,756.00	396,312,800
T B K	12,100	372.00	4,501,200
エクセディ	16,600	1,575.00	26,145,000

豊田合成	35,600	2,026.00	72,125,600
愛三工業	17,300	730.00	12,629,000
盟和産業	1,600	1,019.00	1,630,400
日本プラスト	8,600	504.00	4,334,400
ヨロズ	10,300	889.00	9,156,700
エフ・シー・シー	18,000	1,343.00	24,174,000
シマノ	44,100	28,155.00	1,241,635,500
テイ・エス テック	46,500	1,375.00	63,937,500
ジャムコ	6,400	809.00	5,177,600
テルモ	311,900	3,724.00	1,161,515,600
クリエートメディック	3,300	993.00	3,276,900
日機装	33,100	916.00	30,319,600
日本エム・ディ・エム	6,400	1,638.00	10,483,200
島津製作所	141,800	4,235.00	600,523,000
JMS	9,300	610.00	5,673,000
長野計器	8,000	1,265.00	10,120,000
ブイ・テクノロジー	4,800	3,300.00	15,840,000
東京計器	7,000	1,187.00	8,309,000
愛知時計電機	4,800	1,552.00	7,449,600
インターアクション	5,500	2,165.00	11,907,500
オーバル	9,900	283.00	2,801,700
東京精密	18,600	4,880.00	90,768,000
マニー	43,900	1,468.00	64,445,200
ニコン	168,300	1,314.00	221,146,200
トプコン	51,800	1,565.00	81,067,000
オリンパス	578,000	2,339.00	1,351,942,000
理研計器	8,900	4,900.00	43,610,000
タムロン	8,600	2,381.00	20,476,600
HOYA	215,100	14,030.00	3,017,853,000
シード	5,200	521.00	2,709,200
ノーリツ鋼機	9,900	2,340.00	23,166,000
エー・アンド・デイ	10,100	968.00	9,776,800
朝日インテック	120,800	2,406.00	290,644,800
シチズン時計	129,100	521.00	67,261,100
リズム	3,500	1,492.00	5,222,000
大研医器	8,800	510.00	4,488,000
メニコン	36,600	2,937.00	107,494,200
シンシア	1,200	492.00	590,400
松風	4,600	1,561.00	7,180,600
セイコーホールディングス	15,600	2,294.00	35,786,400
ニプロ	82,200	1,024.00	84,172,800
中本パックス	3,100	1,585.00	4,913,500

スノーピーク	14,400	3,305.00	47,592,000
パラマウントベッドホールディングス	21,100	1,995.00	42,094,500
トランザクション	6,000	994.00	5,964,000
粧美堂	3,200	425.00	1,360,000
ニホンフラッシュ	9,400	986.00	9,268,400
前田工織	12,100	3,215.00	38,901,500
永大産業	14,400	291.00	4,190,400
アートネイチャー	9,400	719.00	6,758,600
バンダイナムコホールディングス	98,800	9,292.00	918,049,600
アイフィスジャパン	2,800	670.00	1,876,000
共立印刷	18,500	144.00	2,664,000
S H O E I	10,300	4,585.00	47,225,500
フランスベッドホールディングス	14,200	865.00	12,283,000
パイロットコーポレーション	18,600	5,260.00	97,836,000
萩原工業	7,100	1,128.00	8,008,800
フジシールインターナショナル	26,800	1,683.00	45,104,400
タカラトミー	46,100	1,221.00	56,288,100
広済堂ホールディングス	6,800	802.00	5,453,600
エステールホールディングス	2,600	641.00	1,666,600
タカノ	3,800	725.00	2,755,000
プロネクサス	8,500	1,060.00	9,010,000
ホクシン	7,800	187.00	1,458,600
ウッドワン	3,400	1,359.00	4,620,600
大建工業	6,500	2,172.00	14,118,000
凸版印刷	167,500	2,166.00	362,805,000
大日本印刷	130,300	2,878.00	375,003,400
共同印刷	3,200	2,761.00	8,835,200
N I S S H A	22,600	1,453.00	32,837,800
光村印刷	1,000	1,480.00	1,480,000
T A K A R A & C O M P A N Y	6,800	1,968.00	13,382,400
アシックス	97,500	2,374.00	231,465,000
ツツミ	2,700	1,882.00	5,081,400
ローランド	7,700	4,035.00	31,069,500
小松ウオール工業	3,400	1,833.00	6,232,200
ヤマハ	64,100	5,350.00	342,935,000
河合楽器製作所	3,100	3,270.00	10,137,000
クリナップ	10,200	530.00	5,406,000
ピジョン	66,600	2,153.00	143,389,800
兼松サステック	700	1,750.00	1,225,000
キングジム	9,700	915.00	8,875,500
リンテック	23,600	2,431.00	57,371,600
イトーキ	20,300	347.00	7,044,100

任天堂	62,200	61,670.00	3,835,874,000	
三菱鉛筆	18,100	1,267.00	22,932,700	
タカスタンダード	22,800	1,269.00	28,933,200	
コクヨ	52,900	1,615.00	85,433,500	
ナカバヤシ	9,900	495.00	4,900,500	
グロープライド	9,900	2,898.00	28,690,200	
オカムラ	37,900	1,212.00	45,934,800	
美津濃	10,900	2,111.00	23,009,900	
東京電力ホールディングス	824,800	403.00	332,394,400	
中部電力	337,200	1,263.00	425,883,600	
関西電力	417,600	1,149.00	479,822,400	
中国電力	172,200	847.00	145,853,400	
北陸電力	100,800	531.00	53,524,800	
東北電力	258,100	712.00	183,767,200	
四国電力	99,200	788.00	78,169,600	
九州電力	227,200	817.00	185,622,400	
北海道電力	95,800	484.00	46,367,200	
沖縄電力	23,400	1,378.00	32,245,200	
電源開発	94,000	1,748.00	164,312,000	
エフオン	6,700	592.00	3,966,400	
イーレックス	16,200	1,732.00	28,058,400	
レノバ	21,600	1,715.00	37,044,000	
東京瓦斯	211,300	2,232.00	471,621,600	
大阪瓦斯	199,600	2,092.00	417,563,200	
東邦瓦斯	50,400	2,725.00	137,340,000	
北海道瓦斯	5,500	1,472.00	8,096,000	
広島ガス	21,000	335.00	7,035,000	
西部ガスホールディングス	12,400	1,995.00	24,738,000	
静岡ガス	28,700	851.00	24,423,700	
メタウォーター	11,400	2,002.00	22,822,800	
SBSホールディングス	8,200	3,345.00	27,429,000	
東武鉄道	107,700	2,979.00	320,838,300	
相鉄ホールディングス	35,300	2,291.00	80,872,300	
東急	278,000	1,592.00	442,576,000	
京浜急行電鉄	141,500	1,254.00	177,441,000	
小田急電鉄	163,900	2,037.00	333,864,300	
京王電鉄	57,200	4,785.00	273,702,000	
京成電鉄	76,700	3,415.00	261,930,500	
富士急行	13,100	3,910.00	51,221,000	
新京成電鉄	2,500	2,048.00	5,120,000	
東日本旅客鉄道	194,000	7,110.00	1,379,340,000	
西日本旅客鉄道	133,600	5,091.00	680,157,600	

東海旅客鉄道	91,600	15,965.00	1,462,394,000
西武ホールディングス	143,900	1,272.00	183,040,800
鴻池運輸	17,500	1,155.00	20,212,500
西日本鉄道	30,500	2,683.00	81,831,500
ハマキョウレックス	7,800	2,869.00	22,378,200
サカイ引越センター	5,100	4,230.00	21,573,000
近鉄グループホールディングス	104,400	3,505.00	365,922,000
阪急阪神ホールディングス	130,500	3,545.00	462,622,500
南海電気鉄道	46,600	2,363.00	110,115,800
京阪ホールディングス	46,500	3,010.00	139,965,000
神戸電鉄	2,500	3,295.00	8,237,500
名古屋鉄道	85,800	2,170.00	186,186,000
山陽電気鉄道	8,000	2,037.00	16,296,000
アルプス物流	7,300	1,074.00	7,840,200
ヤマトホールディングス	146,300	2,293.00	335,465,900
山九	27,500	3,990.00	109,725,000
丸運	5,900	245.00	1,445,500
丸全昭和運輸	8,500	3,165.00	26,902,500
センコーグループホールディングス	52,300	898.00	46,965,400
トナミホールディングス	2,500	3,755.00	9,387,500
ニッコンホールディングス	35,000	2,045.00	71,575,000
日本石油輸送	1,100	2,649.00	2,913,900
福山通運	17,200	3,650.00	62,780,000
セイノーホールディングス	71,100	1,114.00	79,205,400
エスライン	3,100	911.00	2,824,100
神奈川中央交通	2,600	3,470.00	9,022,000
日立物流	20,100	6,720.00	135,072,000
丸和運輸機関	22,000	1,123.00	24,706,000
C & F ロジホールディングス	10,500	1,204.00	12,642,000
九州旅客鉄道	80,700	2,507.00	202,314,900
S Gホールディングス	197,200	2,312.00	455,926,400
NIPPON EXPRESSホールディングス	36,100	8,420.00	303,962,000
日本郵船	87,500	10,760.00	941,500,000
商船三井	174,000	3,420.00	595,080,000
川崎汽船	32,100	8,020.00	257,442,000
NSユナイテッド海運	6,300	4,210.00	26,523,000
飯野海運	51,000	826.00	42,126,000
共栄タンカー	4,000	1,200.00	4,800,000
乾汽船	7,100	2,008.00	14,256,800
日本航空	239,300	2,290.00	547,997,000
ANAホールディングス	265,100	2,566.00	680,246,600
パスコ	2,000	1,330.00	2,660,000

トランコム	2,900	7,050.00	20,445,000
日新	8,300	1,634.00	13,562,200
三菱倉庫	33,100	3,040.00	100,624,000
三井倉庫ホールディングス	11,100	2,511.00	27,872,100
住友倉庫	36,900	2,300.00	84,870,000
澁澤倉庫	6,200	2,312.00	14,334,400
東陽倉庫	17,500	326.00	5,705,000
日本トランスシティ	23,000	605.00	13,915,000
ケイヒン	1,800	1,485.00	2,673,000
中央倉庫	6,400	990.00	6,336,000
川西倉庫	1,900	1,109.00	2,107,100
安田倉庫	8,600	969.00	8,333,400
ファイズホールディングス	2,200	675.00	1,485,000
東洋埠頭	3,200	1,504.00	4,812,800
上組	57,400	2,200.00	126,280,000
サンリツ	2,900	825.00	2,392,500
キムラユニティー	2,700	1,342.00	3,623,400
キューソー流通システム	5,200	1,000.00	5,200,000
近鉄エクスプレス	19,700	3,135.00	61,759,500
東海運	5,900	297.00	1,752,300
エーアイティー	6,500	1,525.00	9,912,500
内外トランスライン	4,000	1,914.00	7,656,000
日本コンセプト	3,300	1,530.00	5,049,000
NEC ネットエスアイ	35,800	1,786.00	63,938,800
クロスキャット	5,800	1,207.00	7,000,600
システナ	154,500	431.00	66,589,500
デジタルアーツ	5,800	7,420.00	43,036,000
日鉄ソリューションズ	15,700	3,680.00	57,776,000
キューブシステム	5,600	932.00	5,219,200
WOW WORLD	1,600	1,173.00	1,876,800
コア	4,600	1,590.00	7,314,000
ラクーンホールディングス	9,300	1,270.00	11,811,000
ソリトンシステムズ	5,500	1,642.00	9,031,000
ソフトクリエイトホールディングス	4,700	4,665.00	21,925,500
T I S	103,200	2,877.00	296,906,400
J N S ホールディングス	5,000	430.00	2,150,000
グリー	49,300	1,087.00	53,589,100
G M O ペパボ	1,200	2,285.00	2,742,000
コーエーテクモホールディングス	34,500	4,015.00	138,517,500
三菱総合研究所	4,700	4,000.00	18,800,000
電算	1,200	2,319.00	2,782,800
A G S	5,600	795.00	4,452,000

ファインデックス	9,300	707.00	6,575,100
ブレインパッド	9,300	1,308.00	12,164,400
K L a b	19,800	446.00	8,830,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,800	1,130.00	17,854,000
ネクソン	244,100	2,932.00	715,701,200
アイスタイル	28,500	184.00	5,244,000
エムアップホールディングス	12,600	1,033.00	13,015,800
エイチーム	7,600	776.00	5,897,600
エニグモ	11,800	649.00	7,658,200
テクノスジャパン	8,600	463.00	3,981,800
コロプラ	35,700	637.00	22,740,900
ブロードリーフ	53,900	369.00	19,889,100
クロス・マーケティンググループ	4,200	1,000.00	4,200,000
デジタルハーツホールディングス	5,000	1,794.00	8,970,000
システム情報	8,200	906.00	7,429,200
メディアドゥ	3,800	2,559.00	9,724,200
じげん	30,900	301.00	9,300,900
ブイキューブ	11,100	910.00	10,101,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	556.00	1,445,600
サイバーリンクス	3,700	1,018.00	3,766,600
フィックスターズ	11,700	831.00	9,722,700
C A R T A H O L D I N G S	4,400	2,402.00	10,568,800
オブティム	7,700	1,026.00	7,900,200
セレス	4,100	1,641.00	6,728,100
S H I F T	5,500	21,660.00	119,130,000
ティーガイア	9,700	1,637.00	15,878,900
セック	1,600	2,262.00	3,619,200
テクマトリックス	18,300	2,138.00	39,125,400
プロシップ	3,600	1,430.00	5,148,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,100	2,604.00	73,172,400
G M O ペイメントゲートウェイ	21,000	12,580.00	264,180,000
ザッパラス	4,400	474.00	2,085,600
システムリサーチ	3,200	1,873.00	5,993,600
インターネットイニシアティブ	28,800	4,105.00	118,224,000
さくらインターネット	11,800	570.00	6,726,000
ヴィンクス	3,100	1,158.00	3,589,800
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,400	6,210.00	14,904,000
S R A ホールディングス	5,300	2,779.00	14,728,700
システムインテグレータ	3,600	556.00	2,001,600
朝日ネット	10,000	588.00	5,880,000
e B A S E	13,100	568.00	7,440,800
アバント	11,700	1,355.00	15,853,500

アドソル日進	3,900	1,655.00	6,454,500
ODKソリューションズ	2,400	628.00	1,507,200
フリービット	5,700	878.00	5,004,600
コムチュア	12,200	3,100.00	37,820,000
サイバーコム	1,800	1,146.00	2,062,800
アステリア	7,900	972.00	7,678,800
アイル	6,100	1,548.00	9,442,800
マークラインズ	5,500	2,879.00	15,834,500
メディカル・データ・ビジョン	13,800	1,203.00	16,601,400
gumi	15,200	645.00	9,804,000
ショーケース	2,600	483.00	1,255,800
モバイルファクトリー	2,600	1,080.00	2,808,000
テラスカイ	4,000	1,568.00	6,272,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,285.00	6,296,500
PCIホールディングス	4,900	1,091.00	5,345,900
パイプドHD	2,000	2,748.00	5,496,000
アイビーシー	2,000	638.00	1,276,000
ネオジャパン	3,200	1,218.00	3,897,600
PR TIMES	2,300	3,255.00	7,486,500
ラクス	37,300	1,669.00	62,253,700
ランドコンピュータ	2,600	878.00	2,282,800
ダブルスタンダード	3,300	2,155.00	7,111,500
オープンドア	6,500	1,893.00	12,304,500
マイネット	3,900	548.00	2,137,200
アカツキ	4,900	2,906.00	14,239,400
ベネフィットジャパン	900	2,238.00	2,014,200
Ubicomホールディングス	2,900	2,486.00	7,209,400
カナミックネットワーク	11,800	522.00	6,159,600
ノムラシステムコーポレーション	6,000	251.00	1,506,000
チェンジ	20,000	1,987.00	39,740,000
シンクロ・フード	5,900	302.00	1,781,800
オークネット	5,800	1,597.00	9,262,600
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	742.00	1,706,600
セグエグループ	3,000	627.00	1,881,000
エイトレッド	1,600	2,283.00	3,652,800
マクロミル	23,600	1,178.00	27,800,800
ビーグリー	2,600	1,639.00	4,261,400
オロ	3,500	2,329.00	8,151,500
ユーザーローカル	3,300	1,776.00	5,860,800
テモナ	2,600	460.00	1,196,000
ニーズウェル	2,600	667.00	1,734,200
マネーフォワード	16,500	5,490.00	90,585,000

サインポスト	3,500	951.00	3,328,500
電算システムホールディングス	4,500	2,584.00	11,628,000
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,000	689.00	2,067,000
プロトコーポレーション	11,600	1,034.00	11,994,400
ハイマックス	3,000	1,285.00	3,855,000
野村総合研究所	209,000	4,020.00	840,180,000
サイバネットシステム	7,800	742.00	5,787,600
C Eホールディングス	5,900	510.00	3,009,000
日本システム技術	2,200	2,550.00	5,610,000
インタージホールディングス	12,500	1,717.00	21,462,500
東邦システムサイエンス	3,000	919.00	2,757,000
ソースネクスト	47,300	172.00	8,135,600
インフォコム	11,900	2,118.00	25,204,200
シンプレクス・ホールディングス	12,800	1,928.00	24,678,400
HEROZ	3,200	1,021.00	3,267,200
ラクスル	11,900	3,025.00	35,997,500
I P S	3,000	2,094.00	6,282,000
F I G	12,100	293.00	3,545,300
システムサポート	4,000	1,116.00	4,464,000
イーソル	6,800	623.00	4,236,400
アルテリア・ネットワークス	13,800	1,312.00	18,105,600
東海ソフト	1,800	988.00	1,778,400
ウイングアーク1st	6,300	1,419.00	8,939,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,811.00	4,527,500
サーバーワークス	1,900	2,760.00	5,244,000
東名	1,100	802.00	882,200
ヴィッツ	1,100	1,300.00	1,430,000
トピラシステムズ	2,300	810.00	1,863,000
S a n s a n	38,600	1,391.00	53,692,600
L i n k - U	2,100	751.00	1,577,100
ギフティ	10,000	1,286.00	12,860,000
ベース	1,900	6,320.00	12,008,000
J M D C	10,200	6,760.00	68,952,000
フォーカスシステムズ	7,400	946.00	7,000,400
クレスコ	7,900	1,966.00	15,531,400
フジ・メディア・ホールディングス	104,300	1,173.00	122,343,900
オービック	34,100	18,420.00	628,122,000
ジャストシステム	15,400	5,790.00	89,166,000
T D C ソフト	9,500	1,168.00	11,096,000
Zホールディングス	1,560,200	536.40	836,891,280
トレンドマイクロ	57,800	7,160.00	413,848,000

I Dホールディングス	6,900	846.00	5,837,400
日本オラクル	17,600	8,500.00	149,600,000
アルファシステムズ	2,900	4,210.00	12,209,000
フューチャー	22,900	1,744.00	39,937,600
C A C Holdings	6,400	1,410.00	9,024,000
S Bテクノロジー	4,700	2,533.00	11,905,100
トーセ	3,100	710.00	2,201,000
オービックビジネスコンサルタント	10,300	4,270.00	43,981,000
伊藤忠テクノソリューションズ	49,300	3,140.00	154,802,000
アイティフォー	13,200	787.00	10,388,400
東計電算	1,300	5,090.00	6,617,000
エクスネット	1,800	988.00	1,778,400
大塚商会	58,500	4,345.00	254,182,500
サイボウズ	14,500	1,395.00	20,227,500
電通国際情報サービス	15,600	3,910.00	60,996,000
A C C E S S	12,400	577.00	7,154,800
デジタルガレージ	17,900	4,600.00	82,340,000
E Mシステムズ	18,000	782.00	14,076,000
ウェザーニューズ	3,700	9,060.00	33,522,000
C I J	8,520	758.00	6,458,160
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,875.00	5,037,500
日本エンタープライズ	11,600	173.00	2,006,800
WOWOW	5,200	1,605.00	8,346,000
スカラ	9,200	755.00	6,946,000
インテリジェント ウェイブ	5,600	580.00	3,248,000
I M A G I C A GROUP	9,400	716.00	6,730,400
ネットワンシステムズ	41,200	2,861.00	117,873,200
システムソフト	24,400	109.00	2,659,600
アルゴグラフィックス	8,400	3,060.00	25,704,000
マーベラス	17,200	722.00	12,418,400
エイベックス	18,700	1,334.00	24,945,800
日本ユニシス	33,800	3,115.00	105,287,000
兼松エレクトロニクス	5,900	3,835.00	22,626,500
都築電気	5,600	1,480.00	8,288,000
T B Sホールディングス	65,800	1,787.00	117,584,600
日本テレビホールディングス	90,400	1,274.00	115,169,600
朝日放送グループホールディングス	10,900	714.00	7,782,600
テレビ朝日ホールディングス	26,100	1,508.00	39,358,800
スカパーJ S A Tホールディングス	91,800	414.00	38,005,200
テレビ東京ホールディングス	7,800	1,990.00	15,522,000
日本BS放送	3,800	1,037.00	3,940,600
ビジョン	18,600	1,159.00	21,557,400

スマートバリュー	2,700	552.00	1,490,400
USEN-NEXT HOLDINGS	10,300	2,551.00	26,275,300
ワイヤレスゲート	4,800	332.00	1,593,600
コネクシオ	7,700	1,405.00	10,818,500
クロップス	2,100	986.00	2,070,600
日本電信電話	1,131,400	3,545.00	4,010,813,000
KDDI	788,400	4,005.00	3,157,542,000
ソフトバンク	1,638,100	1,428.00	2,339,206,800
光通信	12,500	13,970.00	174,625,000
エムティーアイ	10,700	456.00	4,879,200
GMOインターネット	38,300	2,802.00	107,316,600
ファイバーゲート	5,000	1,312.00	6,560,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,700	295.00	796,500
KADOKAWA	59,100	3,220.00	190,302,000
学研ホールディングス	15,400	955.00	14,707,000
ゼンリン	17,700	997.00	17,646,900
昭文社ホールディングス	4,600	429.00	1,973,400
インプレスホールディングス	9,000	220.00	1,980,000
アイネット	5,600	1,276.00	7,145,600
松竹	7,200	12,280.00	88,416,000
東宝	63,800	4,635.00	295,713,000
東映	3,500	16,950.00	59,325,000
エヌ・ティ・ティ・データ	288,000	2,418.00	696,384,000
ピー・シー・エー	6,400	1,537.00	9,836,800
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	1,483.00	5,635,400
DTS	20,800	2,678.00	55,702,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,300	5,430.00	273,129,000
シーイーシー	11,700	1,284.00	15,022,800
カブコン	102,000	2,968.00	302,736,000
アイ・エス・ビー	5,200	1,130.00	5,876,000
ジャステック	6,400	1,104.00	7,065,600
SCSK	74,900	2,101.00	157,364,900
日本システムウエア	4,100	2,191.00	8,983,100
アイネス	9,900	1,631.00	16,146,900
TKC	18,300	3,320.00	60,756,000
富士ソフト	11,600	6,160.00	71,456,000
NSD	34,800	2,192.00	76,281,600
コナミホールディングス	39,300	7,750.00	304,575,000
福井コンピュータホールディングス	5,000	3,250.00	16,250,000
JBCホールディングス	7,400	1,552.00	11,484,800
ミロク情報サービス	9,600	1,424.00	13,670,400
ソフトバンクグループ	648,500	5,559.00	3,605,011,500

ハウスイ	900	1,219.00	1,097,100
高千穂交易	4,200	1,483.00	6,228,600
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,681.00	3,025,800
伊藤忠食品	2,600	4,855.00	12,623,000
エレマテック	8,700	1,044.00	9,082,800
あらた	8,600	3,645.00	31,347,000
トーメンデバイス	1,600	6,380.00	10,208,000
東京エレクトロン デバイス	3,200	5,210.00	16,672,000
フィールズ	9,500	900.00	8,550,000
双日	119,900	2,017.00	241,838,300
アルフレッサ ホールディングス	120,600	1,699.00	204,899,400
横浜冷凍	30,400	857.00	26,052,800
ラサ商事	5,400	996.00	5,378,400
アルコニックス	13,500	1,399.00	18,886,500
神戸物産	84,300	3,775.00	318,232,500
ハイパー	2,700	479.00	1,293,300
あい ホールディングス	15,500	1,713.00	26,551,500
ディーブイエックス	3,700	1,036.00	3,833,200
ダイワボウホールディングス	52,800	1,649.00	87,067,200
マクニカ・富士エレホールディングス	25,900	2,642.00	68,427,800
ラクト・ジャパン	3,700	2,086.00	7,718,200
グリムス	4,800	2,252.00	10,809,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,900	735.00	13,891,500
八洲電機	7,900	935.00	7,386,500
メディアスホールディングス	6,200	965.00	5,983,000
レスターホールディングス	10,300	1,977.00	20,363,100
ジューテックホールディングス	2,500	1,232.00	3,080,000
大光	4,600	713.00	3,279,800
O C H Iホールディングス	3,200	1,282.00	4,102,400
T O K A Iホールディングス	52,600	862.00	45,341,200
黒谷	3,000	769.00	2,307,000
C o m i n i x	1,900	721.00	1,369,900
三洋貿易	10,900	987.00	10,758,300
ビューティガレージ	1,800	2,373.00	4,271,400
ウイン・パートナーズ	7,900	999.00	7,892,100
ミタチ産業	2,700	929.00	2,508,300
シップヘルスケアホールディングス	34,800	1,988.00	69,182,400
明治電機工業	3,400	1,030.00	3,502,000
デリカフーズホールディングス	4,200	542.00	2,276,400
スターティアホールディングス	2,500	631.00	1,577,500
コメダホールディングス	23,700	2,036.00	48,253,200
ピーバンドットコム	1,500	566.00	849,000

アセンテック	3,700	831.00	3,074,700
富士興産	2,700	923.00	2,492,100
協栄産業	1,100	1,510.00	1,661,000
フルサト・マルカホールディングス	10,400	2,960.00	30,784,000
ヤマエグループホールディングス	7,300	1,032.00	7,533,600
小野建	10,500	1,542.00	16,191,000
南陽	2,200	1,884.00	4,144,800
佐島電機	6,800	992.00	6,745,600
エコートレーディング	2,300	590.00	1,357,000
伯東	6,600	2,452.00	16,183,200
コンドーテック	8,100	1,017.00	8,237,700
中山福	5,800	356.00	2,064,800
ナガイレーベン	14,400	1,999.00	28,785,600
三菱食品	10,400	3,010.00	31,304,000
松田産業	7,900	2,476.00	19,560,400
第一興商	20,600	3,480.00	71,688,000
メディパルホールディングス	117,100	2,015.00	235,956,500
S P K	4,300	1,335.00	5,740,500
萩原電気ホールディングス	4,000	2,020.00	8,080,000
アズワン	15,600	7,240.00	112,944,000
スズデン	3,800	2,192.00	8,329,600
尾家産業	2,900	969.00	2,810,100
シモジマ	6,700	946.00	6,338,200
ドウシシャ	10,200	1,499.00	15,289,800
小津産業	2,400	2,123.00	5,095,200
高速	6,500	1,598.00	10,387,000
たけびし	4,100	1,427.00	5,850,700
リックス	2,500	1,647.00	4,117,500
丸文	9,600	714.00	6,854,400
ハビネット	9,100	1,510.00	13,741,000
橋本総業ホールディングス	2,200	1,902.00	4,184,400
日本ライフライン	32,200	1,027.00	33,069,400
タカショー	8,300	694.00	5,760,200
I D O M	33,000	728.00	24,024,000
進和	6,400	1,961.00	12,550,400
エスケイジャパン	2,700	453.00	1,223,100
ダイトロン	4,600	1,887.00	8,680,200
シークス	15,500	1,064.00	16,492,000
田中商事	3,400	653.00	2,220,200
オーハシテクニカ	5,800	1,293.00	7,499,400
白銅	3,500	2,582.00	9,037,000
ダイコー通産	1,300	1,249.00	1,623,700

伊藤忠商事	759,200	4,144.00	3,146,124,800
丸紅	1,070,700	1,426.00	1,526,818,200
高島	1,600	2,263.00	3,620,800
長瀬産業	59,600	1,821.00	108,531,600
蝶理	6,100	1,759.00	10,729,900
豊田通商	109,000	5,060.00	551,540,000
三共生興	14,400	523.00	7,531,200
兼松	40,500	1,342.00	54,351,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,290.00	2,322,000
三井物産	842,900	3,328.00	2,805,171,200
日本紙パルプ商事	5,700	3,880.00	22,116,000
カメイ	12,900	1,008.00	13,003,200
東都水産	600	4,715.00	2,829,000
OUGホールディングス	1,600	2,739.00	4,382,400
スターゼン	8,000	2,000.00	16,000,000
山善	45,700	944.00	43,140,800
椿本興業	2,200	3,660.00	8,052,000
住友商事	685,100	2,119.00	1,451,726,900
内田洋行	4,600	4,860.00	22,356,000
三菱商事	813,400	4,601.00	3,742,453,400
第一実業	4,900	4,270.00	20,923,000
キャノンマーケティングジャパン	26,900	2,523.00	67,868,700
西華産業	5,700	1,599.00	9,114,300
佐藤商事	9,000	1,153.00	10,377,000
菱洋エレクトロ	6,400	1,984.00	12,697,600
東京産業	9,800	724.00	7,095,200
ユアサ商事	10,300	2,896.00	29,828,800
神鋼商事	2,400	3,560.00	8,544,000
トルク	5,900	220.00	1,298,000
阪和興業	21,700	3,240.00	70,308,000
正栄食品工業	7,000	4,085.00	28,595,000
カナデン	8,800	991.00	8,720,800
菱電商事	8,600	1,704.00	14,654,400
岩谷産業	26,100	5,170.00	134,937,000
ナイス	3,700	1,956.00	7,237,200
ニチモウ	1,600	2,890.00	4,624,000
極東貿易	3,100	2,197.00	6,810,700
アステナホールディングス	15,300	445.00	6,808,500
三愛石油	26,700	939.00	25,071,300
稲畑産業	23,900	2,063.00	49,305,700
G S I クレオス	5,200	1,138.00	5,917,600
明和産業	10,000	916.00	9,160,000

クワザワホールディングス	4,300	550.00	2,365,000
ワキタ	23,200	1,000.00	23,200,000
東邦ホールディングス	34,800	1,850.00	64,380,000
サンゲツ	28,700	1,529.00	43,882,300
ミツウロコグループホールディングス	16,000	1,035.00	16,560,000
シナネンホールディングス	4,000	3,295.00	13,180,000
伊藤忠エネクス	24,000	1,027.00	24,648,000
サンリオ	33,500	2,508.00	84,018,000
サンワテクノス	6,600	1,348.00	8,896,800
リョーサン	12,000	2,197.00	26,364,000
新光商事	16,300	911.00	14,849,300
トーホー	4,900	1,140.00	5,586,000
三信電気	5,000	1,607.00	8,035,000
東陽テクニカ	10,700	1,065.00	11,395,500
モスフードサービス	14,200	2,890.00	41,038,000
加賀電子	9,800	3,255.00	31,899,000
ソーダニッカ	10,700	646.00	6,912,200
立花エレテック	8,700	1,647.00	14,328,900
フォーバル	4,800	896.00	4,300,800
PALTAC	15,200	4,550.00	69,160,000
三谷産業	12,800	319.00	4,083,200
西本Wismettacホールディングス	2,500	2,840.00	7,100,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,122.00	2,122,000
コア商事ホールディングス	6,800	880.00	5,984,000
国際紙パルプ商事	22,600	318.00	7,186,800
ヤマタネ	5,100	1,691.00	8,624,100
丸紅建材リース	1,000	1,750.00	1,750,000
日鉄物産	7,700	5,310.00	40,887,000
泉州電業	3,000	5,870.00	17,610,000
トラスコ中山	22,600	2,399.00	54,217,400
オートバックスセブン	36,500	1,345.00	49,092,500
モリト	7,900	776.00	6,130,400
加藤産業	15,700	3,170.00	49,769,000
北恵	2,800	902.00	2,525,600
イノテック	6,600	1,384.00	9,134,400
イエローハット	18,800	1,572.00	29,553,600
JKホールディングス	8,700	1,202.00	10,457,400
日伝	9,000	2,157.00	19,413,000
北沢産業	7,400	235.00	1,739,000
杉本商事	5,100	2,079.00	10,602,900
因幡電機産業	29,000	2,484.00	72,036,000
東テク	3,600	2,284.00	8,222,400

ミスミグループ本社	136,200	3,665.00	499,173,000
アルテック	7,400	269.00	1,990,600
タキヒヨー	3,300	1,206.00	3,979,800
蔵王産業	2,100	1,930.00	4,053,000
スズケン	42,400	3,630.00	153,912,000
ジェコス	7,500	803.00	6,022,500
グローセル	12,700	427.00	5,422,900
ローソン	24,100	4,675.00	112,667,500
サンエー	8,300	4,135.00	34,320,500
カワチ薬品	8,500	2,247.00	19,099,500
エービーシー・マート	17,000	4,615.00	78,455,000
ハードオフコーポレーション	5,100	773.00	3,942,300
アスクル	24,700	1,604.00	39,618,800
ゲオホールディングス	14,700	1,252.00	18,404,400
アダストリア	11,800	1,917.00	22,620,600
くら寿司	11,400	3,360.00	38,304,000
キャンドウ	4,100	2,234.00	9,159,400
アイケイ	4,000	502.00	2,008,000
パルグループホールディングス	9,700	1,552.00	15,054,400
エディオン	50,000	1,135.00	56,750,000
サーラコーポレーション	22,400	639.00	14,313,600
ワッツ	5,600	752.00	4,211,200
ハローズ	5,000	3,030.00	15,150,000
フジオフードグループ本社	9,200	1,374.00	12,640,800
あみやき亭	2,700	2,953.00	7,973,100
大黒天物産	3,500	5,190.00	18,165,000
ハニーズホールディングス	9,800	1,045.00	10,241,000
ファーマライズホールディングス	3,000	763.00	2,289,000
アルペン	8,200	2,047.00	16,785,400
ハブ	3,900	565.00	2,203,500
クオールホールディングス	13,500	1,167.00	15,754,500
ジーンズホールディングス	7,400	5,770.00	42,698,000
ビックカメラ	64,600	1,082.00	69,897,200
DCMホールディングス	67,200	1,054.00	70,828,800
Monotaro	137,300	2,634.00	361,648,200
東京一番フーズ	3,200	595.00	1,904,000
きちりホールディングス	2,900	390.00	1,131,000
アーランドサービスホールディングス	8,000	2,183.00	17,464,000
J．フロント リテイリング	129,900	997.00	129,510,300
ドトール・日レスホールディングス	18,900	1,523.00	28,784,700
マツキヨココカラ&カンパニー	66,800	4,335.00	289,578,000
ブロンコビリー	6,300	2,271.00	14,307,300

Z O Z O	74,700	3,285.00	245,389,500
トレジャー・ファクトリー	3,400	1,049.00	3,566,600
物語コーポレーション	5,400	5,820.00	31,428,000
三越伊勢丹ホールディングス	190,300	967.00	184,020,100
H a m e e	4,100	1,177.00	4,825,700
マーケットエンタープライズ	1,100	880.00	968,000
ウエルシアホールディングス	57,500	3,005.00	172,787,500
クリエイティブSDホールディングス	16,100	3,215.00	51,761,500
丸善C H Iホールディングス	12,700	382.00	4,851,400
ミサワ	2,600	620.00	1,612,000
ティーライフ	1,600	1,361.00	2,177,600
チムニー	3,300	1,146.00	3,781,800
シュッピン	9,200	1,318.00	12,125,600
オイシックス・ラ・大地	15,700	3,015.00	47,335,500
ネクステージ	22,100	2,219.00	49,039,900
ジョイフル本田	32,800	1,500.00	49,200,000
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,874.00	7,683,400
ホットランド	8,300	1,324.00	10,989,200
すかいらーくホールディングス	140,300	1,579.00	221,533,700
S F Pホールディングス	5,300	1,340.00	7,102,000
綿半ホールディングス	8,300	1,337.00	11,097,100
ヨシックスホールディングス	2,200	2,187.00	4,811,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,800	1,054.00	33,517,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,900	994.00	5,864,600
B E E N O S	5,600	2,346.00	13,137,600
あさひ	9,200	1,327.00	12,208,400
日本調剤	6,800	1,330.00	9,044,000
コスモス薬品	11,000	14,830.00	163,130,000
トーエル	5,500	916.00	5,038,000
セブン&アイ・ホールディングス	424,700	5,813.00	2,468,781,100
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	57,800	723.00	41,789,400
ツルハホールディングス	23,700	7,760.00	183,912,000
サンマルクホールディングス	8,700	1,553.00	13,511,100
フェリシモ	2,600	1,313.00	3,413,800
トリドールホールディングス	27,100	2,540.00	68,834,000
T O K Y O B A S E	10,500	426.00	4,473,000
ウイルプラスホールディングス	2,300	952.00	2,189,600
J Mホールディングス	7,400	1,745.00	12,913,000
サツドラホールディングス	5,200	728.00	3,785,600
アレンザホールディングス	8,500	974.00	8,279,000
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,956.00	5,868,000

パロックジャパンリミテッド	7,800	782.00	6,099,600
クスリのアオキホールディングス	10,800	6,800.00	73,440,000
力の源ホールディングス	5,600	572.00	3,203,200
FOOD & LIFE COMPANIES	63,600	3,435.00	218,466,000
メディカルシステムネットワーク	11,000	547.00	6,017,000
はるやまホールディングス	5,500	530.00	2,915,000
ノジマ	17,600	2,317.00	40,779,200
カッパ・クリエイト	15,200	1,353.00	20,565,600
ライトオン	8,100	726.00	5,880,600
良品計画	125,000	1,431.00	178,875,000
三城ホールディングス	14,400	267.00	3,844,800
アドヴァングループ	11,300	900.00	10,170,000
アルビス	3,600	2,234.00	8,042,400
コナカ	12,800	337.00	4,313,600
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,686.00	2,529,000
G - 7ホールディングス	12,200	1,654.00	20,178,800
イオン北海道	19,200	1,124.00	21,580,800
コジマ	19,100	575.00	10,982,500
ヒマラヤ	4,100	987.00	4,046,700
コーナン商事	15,500	3,495.00	54,172,500
エコス	4,100	2,033.00	8,335,300
ワタミ	13,100	935.00	12,248,500
マルシェ	2,600	449.00	1,167,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	217,100	1,964.00	426,384,400
西松屋チェーン	24,000	1,578.00	37,872,000
ゼンショーホールディングス	53,100	2,861.00	151,919,100
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,317.00	9,087,300
ハークスレイ	5,100	483.00	2,463,300
サイゼリヤ	16,200	2,690.00	43,578,000
V Tホールディングス	41,300	446.00	18,419,800
魚力	3,100	2,147.00	6,655,700
フジ・コーポレーション	5,900	1,190.00	7,021,000
ユナイテッドアローズ	11,500	1,821.00	20,941,500
ハイデイ日高	15,800	1,793.00	28,329,400
YU-WA Creation Holdings	7,600	199.00	1,512,400
コロワイド	44,600	1,776.00	79,209,600
ピーシーデポコーポレーション	13,400	303.00	4,060,200
壱番屋	7,700	4,625.00	35,612,500
PLANT	3,100	667.00	2,067,700
スギホールディングス	21,700	6,050.00	131,285,000

薬王堂ホールディングス	5,500	2,265.00	12,457,500
スクロール	17,000	833.00	14,161,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,640.00	16,564,000
木曽路	14,800	2,088.00	30,902,400
S R S ホールディングス	15,400	807.00	12,427,800
千趣会	20,100	390.00	7,839,000
リテールパートナーズ	13,400	1,436.00	19,242,400
ケーヨー	20,200	889.00	17,957,800
上新電機	12,600	1,922.00	24,217,200
日本瓦斯	52,900	1,491.00	78,873,900
ロイヤルホールディングス	18,600	2,104.00	39,134,400
いなげや	13,500	1,350.00	18,225,000
チヨダ	10,900	736.00	8,022,400
ライフコーポレーション	10,200	3,150.00	32,130,000
リンガーハット	13,400	2,254.00	30,203,600
MrMaxHD	14,000	584.00	8,176,000
AOKIホールディングス	21,400	583.00	12,476,200
オークワ	17,200	921.00	15,841,200
コメリ	16,800	2,629.00	44,167,200
青山商事	22,800	676.00	15,412,800
しまむら	12,700	10,870.00	138,049,000
はせがわ	6,600	287.00	1,894,200
高島屋	79,200	1,162.00	92,030,400
松屋	22,100	767.00	16,950,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,600	847.00	43,705,200
近鉄百貨店	4,200	2,554.00	10,726,800
丸井グループ	85,700	2,250.00	192,825,000
アクシアル リテイリング	8,500	3,200.00	27,200,000
イオン	417,700	2,609.50	1,089,988,150
イズミ	19,700	3,220.00	63,434,000
平和堂	20,100	1,896.00	38,109,600
フジ	29,800	2,310.00	68,838,000
ヤオコー	12,300	6,640.00	81,672,000
ゼビオホールディングス	15,000	947.00	14,205,000
ケースホールディングス	100,300	1,263.00	126,678,900
Olympicグループ	5,900	714.00	4,212,600
日産東京販売ホールディングス	17,000	227.00	3,859,000
シルバーライフ	2,400	1,526.00	3,662,400
Genky DrugStores	4,800	4,545.00	21,816,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,700	947.00	2,556,900
ブックオフグループホールディングス	6,300	1,104.00	6,955,200
ギフトホールディングス	1,800	2,403.00	4,325,400

アインホールディングス	14,600	6,360.00	92,856,000
元気寿司	3,100	2,547.00	7,895,700
ヤマダホールディングス	397,500	380.00	151,050,000
アークランドサカモト	17,100	1,515.00	25,906,500
ニトリホールディングス	43,100	15,360.00	662,016,000
グルメ杵屋	8,900	1,044.00	9,291,600
愛眼	7,900	195.00	1,540,500
ケーユーホールディングス	5,900	1,079.00	6,366,100
吉野家ホールディングス	38,000	2,360.00	89,680,000
松屋フーズホールディングス	5,300	3,620.00	19,186,000
サガミホールディングス	16,800	1,194.00	20,059,200
関西フードマーケット	8,400	1,225.00	10,290,000
王将フードサービス	7,200	6,000.00	43,200,000
プレナス	12,300	2,010.00	24,723,000
ミニストップ	8,100	1,451.00	11,753,100
アークス	20,800	2,116.00	44,012,800
パローホールディングス	24,100	2,115.00	50,971,500
ベルク	4,900	5,430.00	26,607,000
大庄	6,000	1,054.00	6,324,000
ファーストリテイリング	14,500	62,990.00	913,355,000
サンドラッグ	40,900	2,975.00	121,677,500
サクスパー ホールディングス	10,700	499.00	5,339,300
ヤマザワ	2,700	1,637.00	4,419,900
やまや	2,200	2,490.00	5,478,000
ベルーナ	23,600	726.00	17,133,600
島根銀行	3,500	533.00	1,865,500
じもとホールディングス	7,700	621.00	4,781,700
めぶきフィナンシャルグループ	564,800	256.00	144,588,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,600	1,754.00	23,854,400
九州フィナンシャルグループ	222,000	401.00	89,022,000
ゆうちょ銀行	256,600	985.00	252,751,000
富山第一銀行	25,900	316.00	8,184,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	620,800	458.00	284,326,400
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	757.00	53,747,000
三十三フィナンシャルグループ	10,100	1,476.00	14,907,600
第四北越フィナンシャルグループ	17,700	2,505.00	44,338,500
ひろぎんホールディングス	160,300	648.00	103,874,400
おきなわフィナンシャルグループ	9,800	2,054.00	20,129,200
十六フィナンシャルグループ	14,600	2,171.00	31,696,600
北國フィナンシャルホールディングス	10,100	3,060.00	30,906,000
新生銀行	70,900	2,237.00	158,603,300
あおぞら銀行	60,700	2,589.00	157,152,300

三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,817,100	760.30	5,183,041,130	
りそなホールディングス	1,232,300	524.10	645,848,430	
三井住友トラスト・ホールディングス	205,500	4,001.00	822,205,500	
三井住友フィナンシャルグループ	752,400	3,907.00	2,939,626,800	
千葉銀行	362,800	725.00	263,030,000	
群馬銀行	204,000	354.00	72,216,000	
武蔵野銀行	16,200	1,758.00	28,479,600	
千葉興業銀行	25,500	263.00	6,706,500	
筑波銀行	42,400	203.00	8,607,200	
七十七銀行	34,100	1,548.00	52,786,800	
青森銀行	8,400	1,885.00	15,834,000	
秋田銀行	7,000	1,682.00	11,774,000	
山形銀行	12,200	867.00	10,577,400	
岩手銀行	7,100	1,848.00	13,120,800	
東邦銀行	90,700	205.00	18,593,500	
東北銀行	5,200	1,018.00	5,293,600	
みちのく銀行	7,000	882.00	6,174,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	91,600	2,374.00	217,458,400	
静岡銀行	264,700	863.00	228,436,100	
スルガ銀行	95,300	409.00	38,977,700	
八十二銀行	244,800	407.00	99,633,600	
山梨中央銀行	11,800	952.00	11,233,600	
大垣共立銀行	21,500	1,904.00	40,936,000	
福井銀行	9,300	1,410.00	13,113,000	
清水銀行	4,500	1,574.00	7,083,000	
富山銀行	2,000	2,118.00	4,236,000	
滋賀銀行	20,400	2,211.00	45,104,400	
南都銀行	17,000	1,978.00	33,626,000	
百五銀行	104,300	335.00	34,940,500	
京都銀行	38,900	5,350.00	208,115,000	
紀陽銀行	36,800	1,378.00	50,710,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	67,800	893.00	60,545,400	
山陰合同銀行	64,500	627.00	40,441,500	
中国銀行	86,900	875.00	76,037,500	
鳥取銀行	3,500	1,191.00	4,168,500	
伊予銀行	144,000	600.00	86,400,000	
百十四銀行	11,500	1,659.00	19,078,500	
四国銀行	16,500	747.00	12,325,500	
阿波銀行	16,600	2,171.00	36,038,600	
大分銀行	6,300	1,917.00	12,077,100	
宮崎銀行	6,800	2,063.00	14,028,400	
佐賀銀行	6,200	1,462.00	9,064,400	

琉球銀行	23,600	797.00	18,809,200
セブン銀行	322,800	239.00	77,149,200
みずほフィナンシャルグループ	1,390,200	1,567.00	2,178,443,400
高知銀行	3,900	757.00	2,952,300
山口フィナンシャルグループ	126,600	680.00	86,088,000
長野銀行	3,600	1,277.00	4,597,200
名古屋銀行	8,100	2,891.00	23,417,100
北洋銀行	163,900	240.00	39,336,000
愛知銀行	3,900	4,540.00	17,706,000
中京銀行	3,900	1,599.00	6,236,100
大光銀行	3,700	1,391.00	5,146,700
愛媛銀行	15,200	934.00	14,196,800
トマト銀行	3,900	1,044.00	4,071,600
京葉銀行	46,300	495.00	22,918,500
栃木銀行	52,500	221.00	11,602,500
北日本銀行	3,400	1,577.00	5,361,800
東和銀行	19,100	539.00	10,294,900
福島銀行	12,500	229.00	2,862,500
大東銀行	5,200	685.00	3,562,000
トモニホールディングス	84,000	328.00	27,552,000
フィデアホールディングス	9,900	1,273.00	12,602,700
池田泉州ホールディングス	125,000	173.00	21,625,000
F P G	36,700	863.00	31,672,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,500	1,231.00	10,463,500
マーキュリアホールディングス	4,500	501.00	2,254,500
S B I ホールディングス	134,200	3,100.00	416,020,000
ジャフコ グループ	41,600	1,875.00	78,000,000
大和証券グループ本社	814,200	692.70	563,996,340
野村ホールディングス	1,659,900	515.20	855,180,480
岡三証券グループ	85,800	370.00	31,746,000
丸三証券	32,500	498.00	16,185,000
東洋証券	36,600	150.00	5,490,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,100	403.00	50,415,300
光世証券	2,500	481.00	1,202,500
水戸証券	29,400	275.00	8,085,000
いちよし証券	20,500	619.00	12,689,500
松井証券	53,400	807.00	43,093,800
マネックスグループ	88,700	656.00	58,187,200
極東証券	14,700	733.00	10,775,100
岩井コスモホールディングス	10,400	1,332.00	13,852,800
アイザワ証券グループ	18,000	734.00	13,212,000
マネーパートナーズグループ	12,000	297.00	3,564,000

スパークス・グループ	50,600	274.00	13,864,400
かんぽ生命保険	109,400	2,136.00	233,678,400
S O M P Oホールディングス	178,500	5,381.00	960,508,500
アニコム ホールディングス	33,400	652.00	21,776,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	243,700	3,978.00	969,438,600
第一生命ホールディングス	535,100	2,499.00	1,337,214,900
東京海上ホールディングス	358,000	7,128.00	2,551,824,000
T & Dホールディングス	282,200	1,671.00	471,556,200
アドバンスクリエイト	5,200	951.00	4,945,200
全国保証	26,000	4,710.00	122,460,000
あんしん保証	4,000	296.00	1,184,000
イントラスト	5,000	568.00	2,840,000
日本モーゲージサービス	6,300	945.00	5,953,500
C a s a	4,100	840.00	3,444,000
アルヒ	16,300	997.00	16,251,100
プレミアグループ	5,500	4,045.00	22,247,500
ネットプロテクションズホールディングス	25,200	709.00	17,866,800
クレディセゾン	70,000	1,303.00	91,210,000
芙蓉総合リース	11,400	6,990.00	79,686,000
みずほリース	16,800	2,976.00	49,996,800
東京センチュリー	21,100	4,515.00	95,266,500
日本証券金融	43,000	921.00	39,603,000
アイフル	183,000	359.00	65,697,000
リコーリース	9,700	3,330.00	32,301,000
イオンフィナンシャルサービス	59,300	1,217.00	72,168,100
アコム	215,200	319.00	68,648,800
ジャックス	12,100	3,080.00	37,268,000
オリエントコーポレーション	295,900	124.00	36,691,600
オリックス	645,900	2,447.50	1,580,840,250
三菱H C キャピタル	401,900	570.00	229,083,000
九州リースサービス	5,700	585.00	3,334,500
日本取引所グループ	271,500	2,286.00	620,649,000
イー・ギャランティ	16,100	2,051.00	33,021,100
アサックス	6,000	648.00	3,888,000
N E C キャピタルソリューション	4,500	2,076.00	9,342,000
いちご	124,300	315.00	39,154,500
日本駐車場開発	125,400	154.00	19,311,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,322.00	8,725,200
S R E ホールディングス	2,900	3,395.00	9,845,500
A Dワークスグループ	22,600	150.00	3,390,000
ヒューリック	260,400	1,101.00	286,700,400
三栄建築設計	4,900	1,593.00	7,805,700

野村不動産ホールディングス	56,500	2,933.00	165,714,500
三重交通グループホールディングス	23,900	456.00	10,898,400
サムティ	17,900	2,200.00	39,380,000
ディア・ライフ	15,700	530.00	8,321,000
地主	7,400	1,886.00	13,956,400
プレサンスコーポレーション	14,700	1,827.00	26,856,900
ハウスコム	2,600	1,232.00	3,203,200
日本管理センター	6,000	1,027.00	6,162,000
サンセイランディック	4,300	820.00	3,526,000
フージャースホールディングス	13,900	652.00	9,062,800
オープンハウスグループ	34,700	5,420.00	188,074,000
東急不動産ホールディングス	321,500	674.00	216,691,000
飯田グループホールディングス	91,100	2,115.00	192,676,500
イーランド	2,400	1,352.00	3,244,800
ムゲンエステート	8,500	506.00	4,301,000
And Doホールディングス	5,400	961.00	5,189,400
シーアールイー	3,500	1,792.00	6,272,000
ケイアイスター不動産	5,100	5,270.00	26,877,000
グッドコムアセット	5,400	1,047.00	5,653,800
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,435.00	8,587,500
テンポイノベーション	4,100	839.00	3,439,900
フェイスネットワーク	1,700	1,329.00	2,259,300
パーク24	58,900	2,013.00	118,565,700
パラカ	3,300	1,708.00	5,636,400
三井不動産	492,900	2,620.00	1,291,398,000
三菱地所	714,700	1,819.00	1,300,039,300
平和不動産	18,800	3,955.00	74,354,000
東京建物	107,800	1,834.00	197,705,200
京阪神ビルディング	17,400	1,499.00	26,082,600
住友不動産	228,300	3,389.00	773,708,700
テーオーシー	20,800	666.00	13,852,800
東京楽天地	2,000	4,145.00	8,290,000
スターツコーポレーション	15,100	2,399.00	36,224,900
フジ住宅	13,900	617.00	8,576,300
空港施設	12,400	542.00	6,720,800
明和地所	6,500	604.00	3,926,000
ゴールドクレスト	9,000	1,686.00	15,174,000
エスリード	4,700	1,675.00	7,872,500
日神グループホールディングス	19,400	462.00	8,962,800
日本エスコン	20,200	816.00	16,483,200
タカラレーベン	45,500	299.00	13,604,500
A V A N T I A	6,700	845.00	5,661,500

イオンモール	55,000	1,627.00	89,485,000
毎日コムネット	5,000	717.00	3,585,000
ファースト住建	4,800	1,237.00	5,937,600
カチタス	27,200	3,380.00	91,936,000
トーセイ	15,800	1,166.00	18,422,800
穴吹興産	2,800	2,238.00	6,266,400
サンフロンティア不動産	15,800	1,050.00	16,590,000
FJネクストホールディングス	11,500	989.00	11,373,500
インテリックス	2,400	701.00	1,682,400
ランドビジネス	4,600	250.00	1,150,000
サンネクスタグループ	4,300	1,118.00	4,807,400
グランディハウス	8,900	522.00	4,645,800
日本空港ビルデング	41,600	5,590.00	232,544,000
明豊ファシリティワークス	5,100	718.00	3,661,800
日本工営	6,800	3,000.00	20,400,000
LIFULL	33,000	247.00	8,151,000
ミクシィ	24,200	2,203.00	53,312,600
ジェイエシーリクルートメント	8,600	1,853.00	15,935,800
日本M&Aセンターホールディングス	172,900	1,727.00	298,598,300
メンバーズ	3,200	3,205.00	10,256,000
中広	2,200	394.00	866,800
UTグループ	15,200	3,105.00	47,196,000
アイティメディア	5,100	1,808.00	9,220,800
E・Jホールディングス	6,200	1,231.00	7,632,200
夢真ビーネックスグループ	34,400	1,667.00	57,344,800
コシダカホールディングス	28,500	693.00	19,750,500
アルトナー	2,800	903.00	2,528,400
パソナグループ	11,500	2,465.00	28,347,500
CDS	2,700	1,646.00	4,444,200
リンクアンドモチベーション	23,200	545.00	12,644,000
エス・エム・エス	35,800	3,395.00	121,541,000
サニーサイドアップグループ	3,900	780.00	3,042,000
パーソルホールディングス	105,400	2,764.00	291,325,600
リニカル	6,200	913.00	5,660,600
クックパッド	33,800	295.00	9,971,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,500	620.00	3,410,000
学情	4,400	996.00	4,382,400
スタジオアリス	4,800	2,181.00	10,468,800
シミックホールディングス	6,000	1,530.00	9,180,000
エプコ	2,500	730.00	1,825,000
NJS	2,400	2,016.00	4,838,400
総合警備保障	41,900	4,000.00	167,600,000

カカクコム	77,300	2,757.00	213,116,100
アイロムグループ	3,800	1,927.00	7,322,600
セントケア・ホールディング	7,100	832.00	5,907,200
サイネックス	2,100	593.00	1,245,300
ルネサンス	7,500	988.00	7,410,000
ディップ	18,600	3,360.00	62,496,000
デジタルホールディングス	7,500	1,397.00	10,477,500
新日本科学	12,900	1,696.00	21,878,400
キャリアデザインセンター	2,800	1,186.00	3,320,800
ベネフィット・ワン	38,400	2,590.00	99,456,000
エムスリー	185,900	4,469.00	830,787,100
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	315.00	2,110,500
アウトソーシング	60,500	1,271.00	76,895,500
ウェルネット	11,000	554.00	6,094,000
ワールドホールディングス	4,300	2,350.00	10,105,000
ディー・エヌ・エー	40,200	1,860.00	74,772,000
博報堂D Yホールディングス	146,800	1,545.00	226,806,000
ぐるなび	17,700	428.00	7,575,600
タカミヤ	13,200	371.00	4,897,200
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	1,008.00	7,156,800
ファンコミュニケーションズ	26,800	434.00	11,631,200
ライク	3,600	2,052.00	7,387,200
ビジネス・ブレークスルー	4,400	420.00	1,848,000
エスプール	29,900	1,247.00	37,285,300
WDBホールディングス	4,900	2,716.00	13,308,400
手間いらず	1,600	4,775.00	7,640,000
ティア	6,600	439.00	2,897,400
C D G	1,300	1,267.00	1,647,100
アドウェイズ	16,000	762.00	12,192,000
バリューコマース	8,300	3,735.00	31,000,500
インフォマート	115,700	661.00	76,477,700
J Pホールディングス	27,900	217.00	6,054,300
エコナックホールディングス	21,100	92.00	1,941,200
C Lホールディングス	2,400	1,114.00	2,673,600
プレステージ・インターナショナル	39,700	725.00	28,782,500
アミューズ	5,800	1,956.00	11,344,800
ドリームインキュベータ	2,900	2,519.00	7,305,100
クイック	7,300	1,584.00	11,563,200
T A C	6,600	219.00	1,445,400
電通グループ	108,600	5,020.00	545,172,000
イオンファンタジー	4,200	1,924.00	8,080,800
シーティーエス	12,100	841.00	10,176,100

ネクシィーズグループ	4,000	589.00	2,356,000
H.U.グループホールディングス	27,600	2,905.00	80,178,000
アルプス技研	9,400	1,881.00	17,681,400
ダイオーズ	2,300	1,020.00	2,346,000
日本空調サービス	11,300	792.00	8,949,600
オリエンタルランド	124,500	23,510.00	2,926,995,000
ダスキン	24,500	2,689.00	65,880,500
明光ネットワークジャパン	12,700	580.00	7,366,000
ファルコホールディングス	5,100	2,007.00	10,235,700
ラウンドワン	29,500	1,350.00	39,825,000
リゾートトラスト	48,400	2,093.00	101,301,200
ビー・エム・エル	13,600	3,090.00	42,024,000
りらいあコミュニケーションズ	15,700	1,064.00	16,704,800
リソー教育	48,600	380.00	18,468,000
早稲田アカデミー	6,000	1,018.00	6,108,000
ユー・エス・エス	118,000	2,059.00	242,962,000
東京個別指導学院	9,600	606.00	5,817,600
サイバーエージェント	259,700	1,526.00	396,302,200
楽天グループ	541,500	967.00	523,630,500
クリーク・アンド・リバー社	5,600	2,054.00	11,502,400
モーニングスター	18,700	586.00	10,958,200
テー・オー・ダブリュー	20,700	318.00	6,582,600
山田コンサルティンググループ	5,600	1,181.00	6,613,600
セントラルスポーツ	4,000	2,342.00	9,368,000
フルキャストホールディングス	9,100	2,621.00	23,851,100
エン・ジャパン	17,100	2,952.00	50,479,200
リソルホールディングス	1,200	4,390.00	5,268,000
テクノプロ・ホールディングス	63,100	3,330.00	210,123,000
アトラグループ	2,300	260.00	598,000
インターワークス	3,500	392.00	1,372,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	4,355.00	21,339,500
Keeper 技研	6,900	2,490.00	17,181,000
ファーストロジック	2,300	879.00	2,021,700
三機サービス	2,000	1,091.00	2,182,000
Gunosy	6,000	1,091.00	6,546,000
デザインワン・ジャパン	3,600	182.00	655,200
イー・ガーディアン	4,300	3,065.00	13,179,500
リブセンス	6,900	172.00	1,186,800
ジャパンマテリアル	32,500	1,740.00	56,550,000
ベクトル	14,900	1,259.00	18,759,100
ウチヤマホールディングス	5,800	326.00	1,890,800
チャーム・ケア・コーポレーション	8,000	1,112.00	8,896,000

キャリアリンク	4,000	1,466.00	5,864,000
I B J	8,900	803.00	7,146,700
アサンテ	4,800	1,459.00	7,003,200
バリューHR	8,600	1,374.00	11,816,400
M & Aキャピタルパートナーズ	8,700	4,370.00	38,019,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,240.00	5,208,000
E R Iホールディングス	3,100	1,546.00	4,792,600
アビスト	1,700	2,844.00	4,834,800
シグマクシス・ホールディングス	12,800	1,152.00	14,745,600
ウィルグループ	7,900	1,278.00	10,096,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,200	186.00	2,827,200
メドピア	8,200	4,000.00	32,800,000
レアジョブ	2,200	900.00	1,980,000
リクルートホールディングス	812,500	5,414.00	4,398,875,000
エラン	14,700	1,084.00	15,934,800
土木管理総合試験所	5,500	339.00	1,864,500
ネットマーケティング	5,600	509.00	2,850,400
日本郵政	1,375,400	898.40	1,235,659,360
ベルシステム24ホールディングス	15,300	1,375.00	21,037,500
鎌倉新書	12,400	631.00	7,824,400
S M N	2,600	607.00	1,578,200
グローバルキッズCOMPANY	2,200	759.00	1,669,800
エアトリ	6,900	3,020.00	20,838,000
アトラエ	7,400	1,935.00	14,319,000
ストライク	4,000	4,715.00	18,860,000
ソラスト	26,000	988.00	25,688,000
セラク	3,500	1,429.00	5,001,500
インソース	10,300	2,334.00	24,040,200
ベйкаレント・コンサルティング	7,400	44,800.00	331,520,000
Orchestra Holdings	2,100	3,080.00	6,468,000
アイモバイル	3,100	1,261.00	3,909,100
キャリアインデックス	3,800	625.00	2,375,000
MS - Japan	4,500	851.00	3,829,500
船場	2,400	723.00	1,735,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	33,500	1,599.00	53,566,500
フルテック	1,600	1,442.00	2,307,200
GameWith	3,600	492.00	1,771,200
MS & Consulting	1,800	738.00	1,328,400
ウェルビー	7,100	1,038.00	7,369,800
エル・ティー・エス	1,400	2,928.00	4,099,200
ミダックホールディングス	4,800	2,741.00	13,156,800
日総工産	8,400	757.00	6,358,800

キュービーネットホールディングス	5,000	1,500.00	7,500,000
R P Aホールディングス	15,400	357.00	5,497,800
スプリックス	3,100	1,336.00	4,141,600
マネジメントソリューションズ	5,200	3,765.00	19,578,000
プロレド・パートナーズ	2,500	766.00	1,915,000
テノ・ホールディングス	1,600	654.00	1,046,400
フロンティア・マネジメント	2,900	1,105.00	3,204,500
ピアラ	2,100	887.00	1,862,700
コプロ・ホールディングス	2,200	1,057.00	2,325,400
ギークス	2,000	1,372.00	2,744,000
カーブスホールディングス	29,200	708.00	20,673,600
フォーラムエンジニアリング	7,500	815.00	6,112,500
Fast Fitness Japan	1,500	1,854.00	2,781,000
ダイレクトマーケティングミックス	12,300	1,826.00	22,459,800
ポピンズホールディングス	2,500	2,071.00	5,177,500
L I T A L I C O	8,600	2,857.00	24,570,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,600	621.00	3,477,600
リログループ	57,700	1,833.00	105,764,100
東祥	8,000	1,767.00	14,136,000
T R Eホールディングス	14,500	1,988.00	28,826,000
人・夢・技術グループ	4,300	2,048.00	8,806,400
エイチ・アイ・エス	23,500	2,137.00	50,219,500
ラックランド	3,100	2,962.00	9,182,200
共立メンテナンス	18,800	4,620.00	86,856,000
イチネンホールディングス	10,900	1,304.00	14,213,600
建設技術研究所	6,400	2,277.00	14,572,800
スペース	7,700	962.00	7,407,400
燦ホールディングス	4,700	1,566.00	7,360,200
スバル興業	700	8,540.00	5,978,000
東京テアトル	4,100	1,238.00	5,075,800
タナベ経営	4,300	693.00	2,979,900
ナガワ	3,400	10,060.00	34,204,000
東京都競馬	7,900	4,360.00	34,444,000
カナモト	18,600	2,002.00	37,237,200
西尾レントオール	9,800	2,797.00	27,410,600
トランス・コスモス	13,400	3,190.00	42,746,000
乃村工藝社	45,300	918.00	41,585,400
藤田観光	4,600	2,357.00	10,842,200
K N T - C Tホールディングス	6,500	1,589.00	10,328,500
日本管財	11,300	2,825.00	31,922,500
トーカイ	9,400	1,724.00	16,205,600
セコム	103,800	8,868.00	920,498,400

セントラル警備保障	5,200	2,505.00	13,026,000	
丹青社	21,800	799.00	17,418,200	
メイテック	12,800	6,650.00	85,120,000	
応用地質	12,000	2,306.00	27,672,000	
船井総研ホールディングス	21,600	2,209.00	47,714,400	
進学会ホールディングス	4,000	341.00	1,364,000	
オオバ	7,700	760.00	5,852,000	
いであ	2,900	1,790.00	5,191,000	
学究社	3,500	1,550.00	5,425,000	
ベネッセホールディングス	35,200	2,247.00	79,094,400	
イオンディライト	13,000	3,045.00	39,585,000	
ナック	5,200	952.00	4,950,400	
ダイセキ	19,200	4,620.00	88,704,000	
ステップ	4,000	1,753.00	7,012,000	
合 計	119,655,720		293,028,485,430	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドL】

【純資産額計算書】

(2022年 4月28日現在)

資産総額	117,121,696,832円
負債総額	206,153,560円
純資産総額（ - ）	116,915,543,272円
発行済口数	46,032,360,806口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5399円
（1万口当たり純資産額）	（25,399円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 4月28日現在)

資産総額	297,249,094,164円
負債総額	3,822,222,298円
純資産総額（ - ）	293,426,871,866円
発行済口数	134,980,520,850口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1738円
（1万口当たり純資産額）	（21,738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（2022年 4月28日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年4月28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	545	14,288,273
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	72	235,344
単位型公社債投資信託	51	236,285
合計	668	14,759,902

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	301
器具備品	1	576	692
その他	1	0	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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> 子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p> 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。）</p> <p> 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(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</p>

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称： 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(2021年3月末日現在)

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

(2)販売会社

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載すること

があります。

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

独立監査人の監査報告書

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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6月13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Lの2021年4月1日から2022年3月31日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドLの2022年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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、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드는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。