

【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10月24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
【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

（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10月25日から2023年 4月21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又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情が

あるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、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	年1回	グローバル	ファミリーファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般						
大型株	年2回				TOPIX	
中小型株		日本		なし		条件付運用型
債券	年4回	北米	ファンド・オブ・ファンズ		その他 ()	
一般	年6回	欧州				ロング・ショート型/ 絶対収益追求型
公債	(隔月)					
社債						
その他債券	年12回	アジア				
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア				その他 ()
不動産投信	日々					
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ()	中南米				
資産複合 ()		アフリカ				
資産配分 固定型		中近東 (中東)				
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。

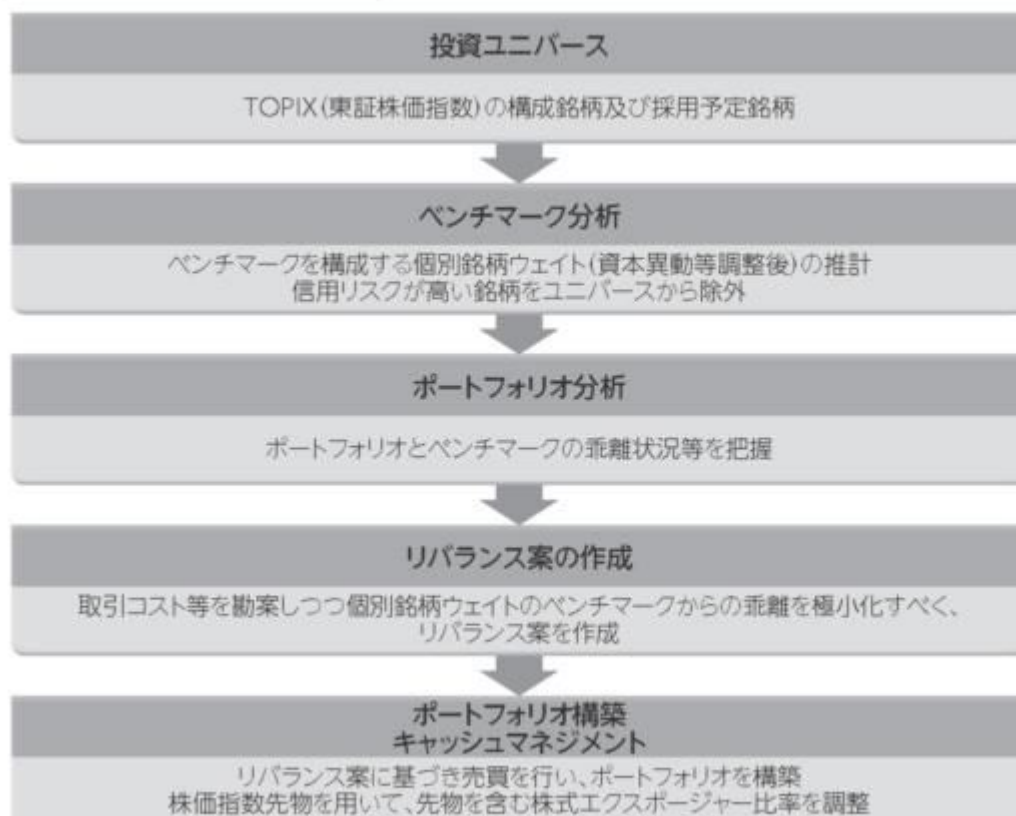
TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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。

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



分配方針

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

主な投資制限

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

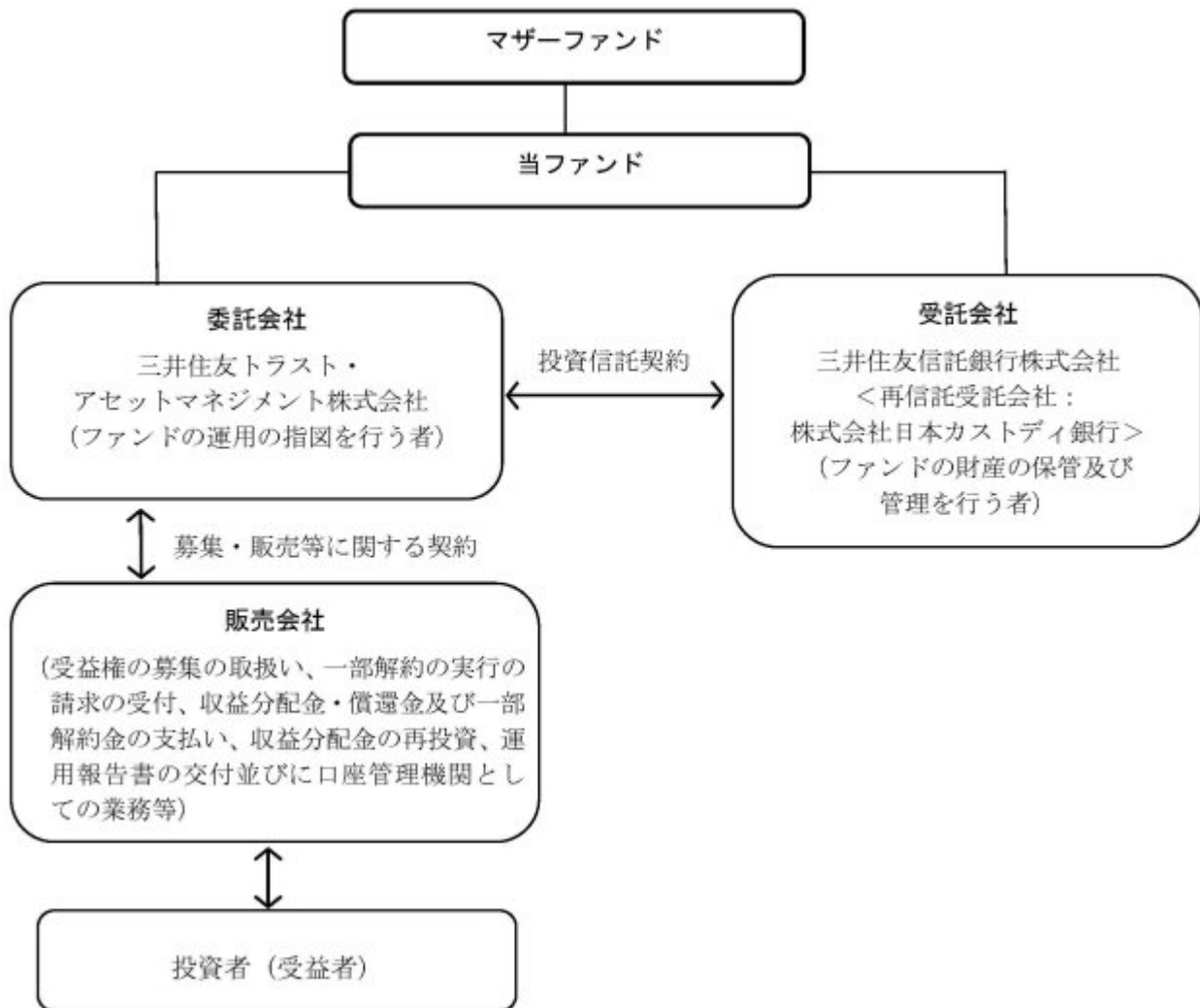
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2002年1月25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からDC日本株式インデックスファンドに変更 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 8月31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（以下「マザーファンド」という場合があります。）を主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．株式への実質投資は、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、投資信託約款第23条、第24条及び第25条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者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限りません。）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書で、上記1.から11.までの証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
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せん。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場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（「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

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

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

3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において

信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

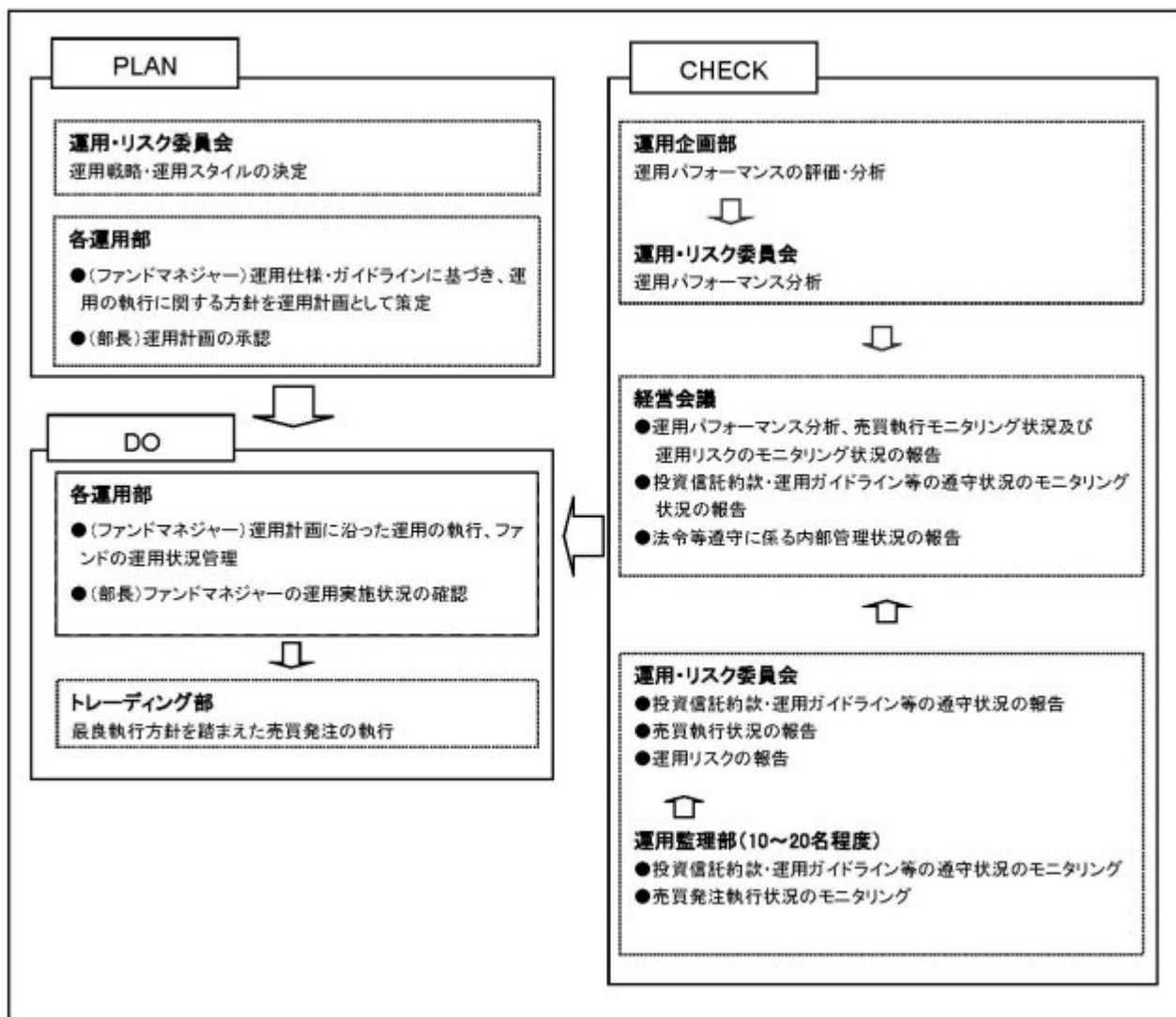
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は1月22日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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。）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。

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。

- 二．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 二．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。

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｓ．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。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。

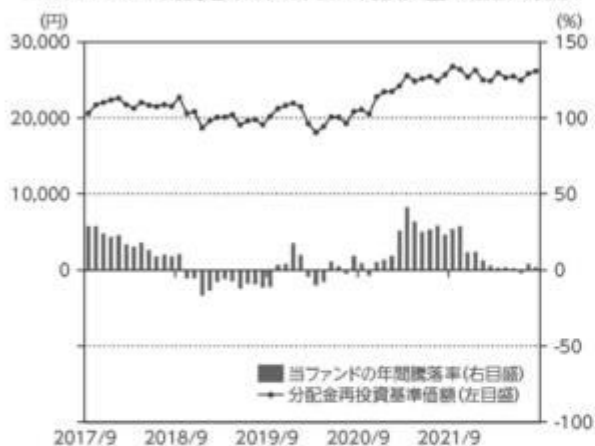
(2) リスクの管理体制

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】

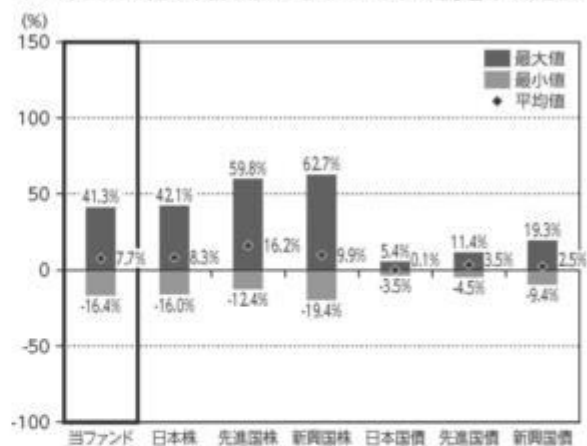
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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9月～2022年8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、投資対象としての可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。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、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権利又は商標に關するすべての権利はJPXが有します。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。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付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに關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、遅延又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 JPEL Global Government Bond Index - Emerging Markets (除く日本、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成されていますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜 0.55%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.242% （税抜 0.22%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.286% （税抜 0.26%）	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 0.077% （税抜 0.07%）	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 8月31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8月31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】

（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	645,732,613	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		323,885	0.05
合計(純資産総額)		646,056,498	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	286,711,932	2.1814	625,433,409	2.2522	645,732,613	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 1月22日)	312,815,977	312,815,977	10,284	10,284
第12期計算期間末 (2014年 1月22日)	450,716,817	450,716,817	15,048	15,048
第13期計算期間末 (2015年 1月22日)	469,174,845	469,174,845	16,330	16,330
第14期計算期間末 (2016年 1月22日)	458,945,200	458,945,200	16,379	16,379
第15期計算期間末 (2017年 1月23日)	516,320,280	516,320,280	18,348	18,348
第16期計算期間末 (2018年 1月22日)	671,479,746	671,479,746	23,282	23,282
第17期計算期間末 (2019年 1月22日)	555,028,301	555,028,301	19,471	19,471
第18期計算期間末 (2020年 1月22日)	593,005,814	593,005,814	22,238	22,238
第19期計算期間末 (2021年 1月22日)	646,584,760	646,584,760	24,119	24,119
第20期計算期間末 (2022年 1月24日)	664,869,350	664,869,350	25,453	25,453
2021年 8月末日	683,332,956		25,672	
9月末日	719,591,645		26,777	
10月末日	702,082,306		26,384	
11月末日	672,686,478		25,414	
12月末日	695,744,454		26,287	

2022年 1月末日	660,605,820		25,005
2月末日	651,658,659		24,884
3月末日	682,531,034		25,940
4月末日	656,009,583		25,307
5月末日	648,250,266		25,486
6月末日	626,436,952		24,949
7月末日	645,733,888		25,868
8月末日	646,056,498		26,165

【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 1月24日～2013年 1月22日	0
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	0
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	0
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	0
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第11期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	21.3
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	46.3
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.5
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.3
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	26.9
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	16.4
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	14.2
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	8.5
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	5.5
第21期中間計算期間	2022年 1月25日～2022年 7月24日	2.5

(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 1月24日～2013年 1月22日	75,246,735	57,833,743	304,175,860
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	86,542,453	91,200,205	299,518,108
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	68,722,554	80,938,767	287,301,895
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	65,174,696	72,268,642	280,207,949
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	50,222,504	49,029,004	281,401,449
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	42,547,977	35,534,313	288,415,113
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	57,375,711	60,736,637	285,054,187
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	35,270,298	53,663,276	266,661,209
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	57,380,336	55,962,546	268,078,999
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	36,855,417	43,720,133	261,214,283
第21期中間計算期間	2022年 1月25日～2022年 7月24日	15,020,184	27,485,727	248,748,740

(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	301,943,311,620	99.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,722,919,615	0.89
合計(純資産総額)		304,666,231,235	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,727,180,000	0.90

(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	5,481,800	2,273.13	12,460,844,034	2,101.50	11,520,002,700	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	753,300	12,706.75	9,571,994,775	11,135.00	8,387,995,500	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,000	59,071.81	6,438,827,290	52,840.00	5,759,560,000	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,942,000	687.43	4,772,139,060	721.10	5,005,876,200	1.64
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,322,600	3,359.97	4,443,896,322	3,769.00	4,984,879,400	1.64
日本	株式	日立製作所	電気機器	578,300	6,302.25	3,644,591,175	6,996.00	4,045,786,800	1.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	707,600	5,348.79	3,784,803,804	5,562.00	3,935,671,200	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	67,900	54,403.84	3,694,020,736	56,990.00	3,869,621,000	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	823,100	5,904.74	4,860,191,494	4,483.00	3,689,957,300	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	860,300	3,650.16	3,140,232,648	4,277.00	3,679,503,100	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	872,300	2,622.52	2,287,624,196	4,197.00	3,661,043,100	1.20
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	945,100	3,377.94	3,192,491,094	3,850.00	3,638,635,000	1.19
日本	株式	三菱商事	卸売業	776,500	3,875.60	3,009,403,400	4,564.00	3,543,946,000	1.16
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	76,300	57,824.85	4,412,036,055	44,160.00	3,369,408,000	1.11
日本	株式	HOYA	精密機器	232,100	14,619.74	3,393,241,654	14,250.00	3,307,425,000	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	879,100	3,382.05	2,973,160,155	3,724.00	3,273,768,400	1.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	769,600	4,163.38	3,204,137,248	4,194.00	3,227,702,400	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,300	24,714.71	3,245,041,423	24,485.00	3,214,880,500	1.06
日本	株式	信越化学工業	化学	186,700	18,675.99	3,486,807,333	16,315.00	3,046,010,500	1.00
日本	株式	三井物産	卸売業	858,500	2,854.30	2,450,416,550	3,266.00	2,803,861,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,787,300	1,450.25	2,592,031,825	1,529.50	2,733,675,350	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	710,000	3,685.58	2,616,761,800	3,843.00	2,728,530,000	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	330,000	6,813.62	2,248,494,600	7,792.00	2,571,360,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	122,200	18,894.29	2,308,882,238	20,850.00	2,547,870,000	0.84
日本	株式	日本電産	電気機器	267,200	10,954.49	2,927,039,728	9,324.00	2,491,372,800	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	328,000	8,557.28	2,806,787,840	7,554.00	2,477,712,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	105,500	22,956.52	2,421,912,860	22,535.00	2,377,442,500	0.78
日本	株式	S M C	機械	35,200	65,272.65	2,297,597,280	66,600.00	2,344,320,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,422,000	1,583.89	2,252,291,580	1,593.50	2,265,957,000	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	397,100	5,266.23	2,091,219,933	5,533.00	2,197,154,300	0.72

(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	0.32
		建設業	2.16
		食料品	3.35
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.11
		医薬品	5.28
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.72
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.60
		機械	5.32
		電気機器	17.33
		輸送用機器	7.98
		精密機器	2.82
		その他製品	2.39
		電気・ガス業	1.26
		陸運業	3.08
		海運業	0.68
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	8.97
		卸売業	5.71
		小売業	4.36
		銀行業	5.17
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.19
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.92
サービス業	5.36		
	小計	99.11	
合計		99.11	

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	139	円	2,725,919,900	2,727,180,000	0.90

(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。

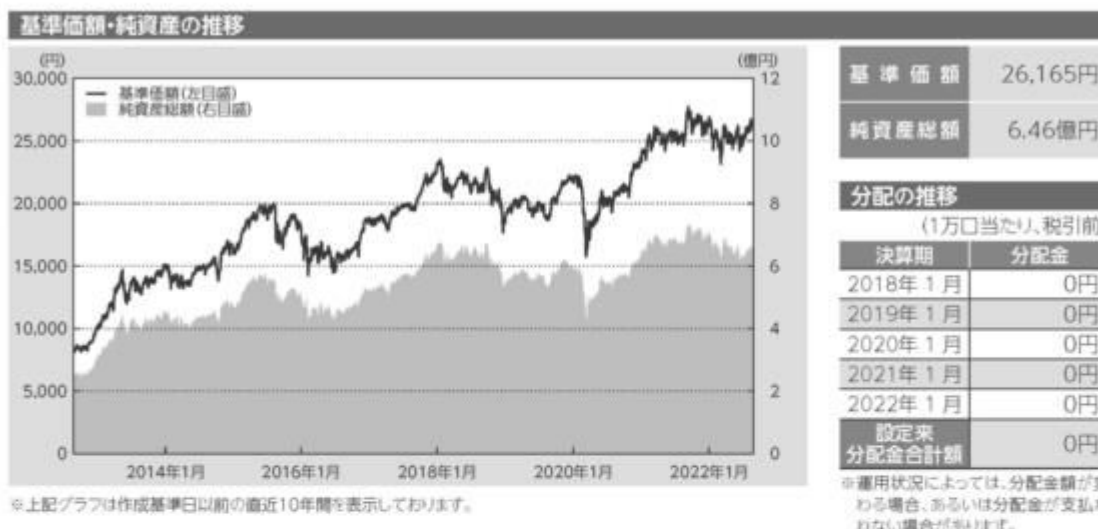
参考情報

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1月25日

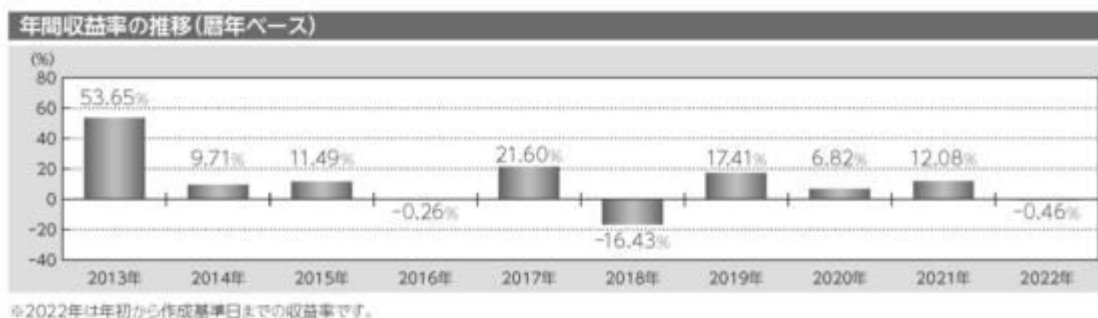
作成基準日：2022年8月31日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.8%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.8%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.3%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.2%
KDDI	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。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手續等】

< 一部解約手續 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一

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 1月25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 1月23日から翌年 1月22日までとすることを原則とします。

ただし、第 1 計算期間は2002年 1月25日から2003年 1月22日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨

を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任し

た場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に依りて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2021年1月23日から2022年1月24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】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2021年 1月22日現在)	第20期 (2022年 1月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,074,620	2,680,594
親投資信託受益証券	646,260,776	664,537,394
未収入金	286,568	1,580,194
流動資産合計	648,621,964	668,798,182
資産合計	648,621,964	668,798,182
負債の部		
流動負債		
未払解約金	264,682	1,786,112
未払受託者報酬	225,597	272,718
未払委託者報酬	1,546,925	1,869,999
未払利息	-	3
流動負債合計	2,037,204	3,928,832
負債合計	2,037,204	3,928,832
純資産の部		
元本等		
元本	268,078,999	261,214,283
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	378,505,761	403,655,067
(分配準備積立金)	186,079,870	187,375,572
元本等合計	646,584,760	664,869,350
純資産合計	646,584,760	664,869,350
負債純資産合計	648,621,964	668,798,182

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2020年 1月23日 至 2021年 1月22日	自	2021年 1月23日 至 2022年 1月24日
営業収益				
受取利息		5		6
有価証券売買等損益		54,958,335		39,733,154
営業収益合計		54,958,340		39,733,160
営業費用				
支払利息		507		567
受託者報酬		426,302		530,055
委託者報酬		2,923,102		3,634,515
その他費用		3		-
営業費用合計		3,349,914		4,165,137
営業利益又は営業損失（ ）		51,608,426		35,568,023
経常利益又は経常損失（ ）		51,608,426		35,568,023
当期純利益又は当期純損失（ ）		51,608,426		35,568,023
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（ ）		7,879,761		6,293,950
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		326,344,605		378,505,761
剰余金増加額又は欠損金減少額		59,445,502		57,839,846
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		59,445,502		57,839,846
剰余金減少額又は欠損金増加額		66,772,533		61,964,613
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		66,772,533		61,964,613
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		378,505,761		403,655,067

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 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。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月23日から翌年1月22日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2021年 1月23日から2022年 1月24日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2021年 1月22日現在)	第20期 (2022年 1月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	268,078,999口	261,214,283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) 2.4119円 (24,119円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5453円 (25,453円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日			第20期 自 2021年 1月23日 至 2022年 1月24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	12,020,229円	費用控除後の配当等収益額	A	12,611,113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	20,550,769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	16,662,960円
収益調整金額	C	387,926,456円	収益調整金額	C	401,583,080円
分配準備積立金額	D	153,508,872円	分配準備積立金額	D	158,101,499円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	574,006,326円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	588,958,652円
当ファンドの期末残存口数	F	268,078,999口	当ファンドの期末残存口数	F	261,214,283口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	21,411円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,546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 1月23日 至 2022年 1月24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 1月24日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第19期	第20期
	自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日	自 2021年 1月23日 至 2022年 1月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	266,661,209円	268,078,999円
期中追加設定元本額	57,380,336円	36,855,417円
期中一部解約元本額	55,962,546円	43,720,133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 1月22日現在)	(2022年 1月24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	61,525,067	34,794,604
合計	61,525,067	34,794,604

（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	304,414,748	664,537,394	
	合計	304,414,748	664,537,394	

(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

	2022年 1月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,435,855,177
株式	290,353,066,160
派生商品評価勘定	38,900
未収入金	66,745,000
未収配当金	409,492,321
前払金	45,301,500
差入委託証拠金	68,738,200
流動資産合計	292,379,237,258
資産合計	292,379,237,258
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,343,150
未払金	693,750
未払解約金	152,833,979
未払利息	2,079
流動負債合計	198,872,958
負債合計	198,872,958
純資産の部	
元本等	
元本	133,845,048,512
剰余金	
剰余金又は欠損金()	158,335,315,788
元本等合計	292,180,364,300
純資産合計	292,180,364,300

	2022年 1月24日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	292,379,237,258

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 1月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,845,048,512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 2.1830円 (1万口当たり純資産額) (21,830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 1月24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。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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

	2022年 1月24日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月23日
期首元本額	135,654,719,286円
期中追加設定元本額	9,176,862,109円
期中一部解約元本額	10,986,532,883円
期末元本額	133,845,048,512円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,419,810円
D C 日本株式インデックスファンド	304,414,748円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,423,214,523円
D C 日本株式インデックスファンド A	663,882,406円
D C バランスファンド 3 0	2,254,780,200円
D C バランスファンド 5 0	3,550,624,718円
D C バランスファンド 7 0	2,092,064,337円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	571,046,083円
日本株式インデックス e	1,468,826,497円
インデックスコレクション（国内株式）	20,520,348,920円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	12,018,270,330円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,717,536,277円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,418,900,790円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,488,352,848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）	2,742,351,449円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,025,085,146円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	50,385,334円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	586,684,080円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	69,340,895円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	133,090,283円

区分	2022年 1月24日現在
V Aバランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	147,535,156円
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	753,202,453円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	442,127,175円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	7,690,812,448円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	741,203,651円
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）	76,194,709円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,248,608,764円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	27,517,329円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	156,346,824円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	2,007,960,587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）	57,630,022円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	57,787,609円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	21,548,384円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	602,738,620円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	269,611,663円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	4,575,585,624円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	86,865,293円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	35,564,611円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	7,827,604円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	126,795,159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）	3,965,153円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 1月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,697,594,334
合計	10,697,594,334

(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 1月24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	1,645,541,500	-	1,600,240,000	45,301,500
合計		1,645,541,500	-	1,600,240,000	45,301,500

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,200	3,145.00	16,354,000	
日本水産	149,500	543.00	81,178,500	
マルハニチロ	23,400	2,426.00	56,768,400	
雪国まいたけ	10,900	1,207.00	13,156,300	
カネコ種苗	4,500	1,490.00	6,705,000	
サカタのタネ	17,800	3,300.00	58,740,000	
ホクト	12,500	1,941.00	24,262,500	
ホクリヨウ	2,000	699.00	1,398,000	
住石ホールディングス	26,200	140.00	3,668,000	
日鉄鉱業	3,400	6,460.00	21,964,000	
三井松島ホールディングス	6,300	1,695.00	10,678,500	
I N P E X	599,700	1,099.00	659,070,300	
石油資源開発	17,600	2,698.00	47,484,800	
K & O エナジーグループ	7,200	1,490.00	10,728,000	
ヒノキヤグループ	3,200	2,059.00	6,588,800	
ショーボンドホールディングス	21,300	5,110.00	108,843,000	
ミライト・ホールディングス	48,100	1,864.00	89,658,400	
タマホーム	9,100	2,420.00	22,022,000	
サンヨーホームズ	1,700	740.00	1,258,000	
日本アクア	5,900	650.00	3,835,000	
ファーストコーポレーション	4,600	692.00	3,183,200	
ベステラ	3,000	1,307.00	3,921,000	
R o b o t H o m e	24,900	227.00	5,652,300	
キャンディル	2,600	490.00	1,274,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	1,237.00	3,587,300	
第一カッター興業	3,700	1,323.00	4,895,100	
安藤・間	74,200	874.00	64,850,800	
東急建設	43,800	701.00	30,703,800	
コムシスホールディングス	48,200	2,728.00	131,489,600	

ビーアールホールディングス	20,300	358.00	7,267,400	
高松コンストラクショングループ	9,300	1,975.00	18,367,500	
東建コーポレーション	4,600	9,390.00	43,194,000	
ソネック	1,500	1,029.00	1,543,500	
ヤマウラ	7,200	976.00	7,027,200	
オリエンタル白石	50,200	239.00	11,997,800	
大成建設	99,800	3,755.00	374,749,000	
大林組	345,200	932.00	321,726,400	
清水建設	323,400	778.00	251,605,200	
飛島建設	9,200	1,043.00	9,595,600	
長谷工コーポレーション	102,800	1,439.00	147,929,200	
松井建設	13,600	715.00	9,724,000	
銭高組	1,500	4,070.00	6,105,000	
鹿島建設	253,000	1,375.00	347,875,000	
不動テトラ	7,300	1,614.00	11,782,200	
大末建設	3,600	1,299.00	4,676,400	
鉄建建設	7,500	1,820.00	13,650,000	
西松建設	20,900	3,840.00	80,256,000	
三井住友建設	77,800	432.00	33,609,600	
大豊建設	5,000	3,725.00	18,625,000	
佐田建設	7,400	461.00	3,411,400	
ナカノフドー建設	8,300	336.00	2,788,800	
奥村組	20,300	3,260.00	66,178,000	
東鉄工業	16,000	2,467.00	39,472,000	
イチケン	2,500	1,850.00	4,625,000	
富士ピー・エス	4,500	483.00	2,173,500	
浅沼組	3,900	5,360.00	20,904,000	
戸田建設	143,400	744.00	106,689,600	
熊谷組	17,600	2,965.00	52,184,000	
北野建設	2,100	2,130.00	4,473,000	
植木組	3,100	1,410.00	4,371,000	
矢作建設工業	15,200	769.00	11,688,800	
ピーエス三菱	11,400	603.00	6,874,200	
日本ハウスホールディングス	23,600	433.00	10,218,800	
大東建託	35,300	13,420.00	473,726,000	
新日本建設	14,700	765.00	11,245,500	
東亜道路工業	1,800	4,930.00	8,874,000	
日本道路	3,300	8,440.00	27,852,000	
東亜建設工業	8,500	2,422.00	20,587,000	
日本国土開発	33,600	544.00	18,278,400	
若築建設	5,800	1,692.00	9,813,600	
東洋建設	38,700	560.00	21,672,000	

五洋建設	136,900	643.00	88,026,700
世紀東急工業	16,600	804.00	13,346,400
福田組	3,700	4,275.00	15,817,500
住友林業	88,300	2,044.00	180,485,200
日本基礎技術	9,500	592.00	5,624,000
巴コーポレーション	15,300	495.00	7,573,500
大和ハウス工業	318,800	3,395.00	1,082,326,000
ライト工業	21,700	1,889.00	40,991,300
積水ハウス	374,400	2,363.00	884,707,200
日特建設	7,100	657.00	4,664,700
北陸電気工事	7,100	836.00	5,935,600
ユアテック	19,700	649.00	12,785,300
日本リーテック	7,200	1,472.00	10,598,400
四電工	3,800	1,660.00	6,308,000
中電工	15,900	2,127.00	33,819,300
関電工	56,100	862.00	48,358,200
きんでん	77,100	1,704.00	131,378,400
東京エネシス	11,500	960.00	11,040,000
トーエネック	3,500	3,170.00	11,095,000
住友電設	8,500	2,053.00	17,450,500
日本電設工業	18,900	1,496.00	28,274,400
エクシオグループ	52,100	2,375.00	123,737,500
新日本空調	9,100	2,037.00	18,536,700
九電工	26,600	3,375.00	89,775,000
三機工業	22,400	1,430.00	32,032,000
日揮ホールディングス	106,400	1,108.00	117,891,200
中外炉工業	3,500	1,624.00	5,684,000
ヤマト	10,100	712.00	7,191,200
太平電業	7,600	2,781.00	21,135,600
高砂熱学工業	31,200	1,924.00	60,028,800
三晃金属工業	1,400	2,359.00	3,302,600
朝日工業社	2,300	2,930.00	6,739,000
明星工業	22,300	701.00	15,632,300
大気社	16,800	2,972.00	49,929,600
ダイダン	7,700	2,291.00	17,640,700
日比谷総合設備	11,100	1,895.00	21,034,500
フィル・カンパニー	2,000	1,037.00	2,074,000
テスホールディングス	6,300	1,388.00	8,744,400
インフロニア・ホールディングス	147,200	1,077.00	158,534,400
東洋エンジニアリング	14,500	678.00	9,831,000
レイズネクスト	16,700	1,167.00	19,488,900
ニッポン	32,300	1,656.00	53,488,800

日清製粉グループ本社	124,800	1,601.00	199,804,800
日東富士製粉	1,600	3,755.00	6,008,000
昭和産業	10,500	2,734.00	28,707,000
鳥越製粉	9,800	664.00	6,507,200
中部飼料	12,500	1,006.00	12,575,000
フィード・ワン	14,800	705.00	10,434,000
東洋精糖	1,900	1,035.00	1,966,500
日本甜菜製糖	5,800	1,700.00	9,860,000
D M三井製糖ホールディングス	10,000	1,986.00	19,860,000
塩水港精糖	13,200	214.00	2,824,800
日新製糖	5,200	1,736.00	9,027,200
森永製菓	25,900	3,700.00	95,830,000
中村屋	2,700	3,510.00	9,477,000
江崎グリコ	30,400	3,765.00	114,456,000
名糖産業	4,900	1,652.00	8,094,800
井村屋グループ	6,300	2,242.00	14,124,600
不二家	6,200	2,225.00	13,795,000
山崎製パン	82,800	1,577.00	130,575,600
第一屋製パン	2,100	541.00	1,136,100
モロゾフ	1,800	5,680.00	10,224,000
亀田製菓	6,300	4,185.00	26,365,500
寿スピリッツ	10,600	4,860.00	51,516,000
カルビー	50,400	2,708.00	136,483,200
森永乳業	20,400	5,570.00	113,628,000
六甲バター	8,100	1,504.00	12,182,400
ヤクルト本社	81,800	6,000.00	490,800,000
明治ホールディングス	73,100	7,130.00	521,203,000
雪印メグミルク	26,600	2,048.00	54,476,800
プリマハム	13,800	2,525.00	34,845,000
日本ハム	42,200	4,430.00	186,946,000
林兼産業	3,300	505.00	1,666,500
丸大食品	10,900	1,563.00	17,036,700
S Foods	9,900	3,300.00	32,670,000
柿安本店	3,800	2,561.00	9,731,800
伊藤ハム米久ホールディングス	71,100	670.00	47,637,000
サッポロホールディングス	37,700	2,235.00	84,259,500
アサヒグループホールディングス	259,900	4,821.00	1,252,977,900
キリンホールディングス	406,100	1,870.50	759,610,050
宝ホールディングス	75,100	1,140.00	85,614,000
オエノンホールディングス	31,400	338.00	10,613,200
養命酒製造	3,400	1,766.00	6,004,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	77,500	1,340.00	103,850,000

サントリー食品インターナショナル	73,900	4,370.00	322,943,000
ダイドーグループホールディングス	5,700	4,700.00	26,790,000
伊藤園	33,500	6,300.00	211,050,000
キーコーヒー	10,900	2,047.00	22,312,300
ユニカフェ	3,300	947.00	3,125,100
ジャパンフーズ	1,600	1,204.00	1,926,400
日清オイリオグループ	13,800	3,010.00	41,538,000
不二製油グループ本社	23,900	2,348.00	56,117,200
かどや製油	1,200	4,015.00	4,818,000
J - オイルミルズ	10,300	1,730.00	17,819,000
キッコーマン	79,500	8,680.00	690,060,000
味の素	244,000	3,233.00	788,852,000
ブルドックソース	4,700	2,006.00	9,428,200
キューピー	58,000	2,331.00	135,198,000
ハウス食品グループ本社	41,300	2,956.00	122,082,800
カゴメ	41,900	3,035.00	127,166,500
焼津水産化学工業	5,400	917.00	4,951,800
アリアケジャパン	10,100	6,140.00	62,014,000
ピエトロ	1,400	1,799.00	2,518,600
エバラ食品工業	2,400	2,784.00	6,681,600
やまみ	1,200	1,663.00	1,995,600
ニチレイ	50,400	2,583.00	130,183,200
東洋水産	53,100	4,785.00	254,083,500
イトアンドホールディングス	4,200	2,312.00	9,710,400
大冷	1,200	1,914.00	2,296,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,700	491.00	2,798,700
日清食品ホールディングス	43,400	8,120.00	352,408,000
永谷園ホールディングス	4,900	1,939.00	9,501,100
一正蒲鉾	4,300	773.00	3,323,900
フジッコ	11,900	1,945.00	23,145,500
ロック・フィールド	11,900	1,540.00	18,326,000
日本たばこ産業	592,400	2,349.50	1,391,843,800
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,340.00	8,308,000
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,931.00	13,903,200
なとり	6,200	2,004.00	12,424,800
イフジ産業	1,900	911.00	1,730,900
ピクルスコーポレーション	5,300	1,536.00	8,140,800
ファーマフーズ	10,400	1,692.00	17,596,800
ユーグレナ	56,300	750.00	42,225,000
紀文食品	6,400	940.00	6,016,000
ミヨシ油脂	4,200	1,156.00	4,855,200
理研ビタミン	11,500	1,711.00	19,676,500

片倉工業	12,100	2,267.00	27,430,700
グンゼ	7,300	4,025.00	29,382,500
東洋紡	42,800	1,287.00	55,083,600
ユニチカ	30,600	309.00	9,455,400
富士紡ホールディングス	4,900	4,100.00	20,090,000
倉敷紡績	9,400	1,893.00	17,794,200
シキボウ	5,700	921.00	5,249,700
日本毛織	32,800	917.00	30,077,600
トーア紡コーポレーション	4,000	407.00	1,628,000
帝国繊維	12,300	1,940.00	23,862,000
帝人	101,700	1,457.00	148,176,900
東レ	781,100	745.00	581,919,500
住江織物	2,400	1,784.00	4,281,600
日本フェルト	6,800	438.00	2,978,400
イチカワ	1,600	1,360.00	2,176,000
日東製網	1,200	1,448.00	1,737,600
アツギ	8,500	547.00	4,649,500
ダイニック	4,100	708.00	2,902,800
セーレン	22,200	2,332.00	51,770,400
ソトー	4,100	818.00	3,353,800
東海染工	1,300	1,141.00	1,483,300
小松マテーレ	17,800	1,229.00	21,876,200
ワコールホールディングス	27,000	2,120.00	57,240,000
ホギメディカル	14,600	3,060.00	44,676,000
T S Iホールディングス	36,300	334.00	12,124,200
マツオカコーポレーション	3,500	1,204.00	4,214,000
ワールド	14,200	1,145.00	16,259,000
三陽商会	5,200	899.00	4,674,800
ナイガイ	4,000	285.00	1,140,000
オンワードホールディングス	65,100	304.00	19,790,400
ルックホールディングス	3,500	1,194.00	4,179,000
ゴールドウイン	19,500	6,110.00	119,145,000
デサント	21,100	3,885.00	81,973,500
キング	5,300	525.00	2,782,500
ヤマトインターナショナル	9,900	288.00	2,851,200
特種東海製紙	6,600	4,140.00	27,324,000
王子ホールディングス	450,700	601.00	270,870,700
日本製紙	51,700	1,159.00	59,920,300
三菱製紙	15,300	317.00	4,850,100
北越コーポレーション	70,700	728.00	51,469,600
中越パルプ工業	4,100	977.00	4,005,700
巴川製紙所	3,200	813.00	2,601,600

大王製紙	52,000	1,894.00	98,488,000
阿波製紙	2,800	334.00	935,200
レンゴー	101,900	873.00	88,958,700
トーモク	6,600	1,727.00	11,398,200
ザ・パック	8,200	2,698.00	22,123,600
北の達人コーポレーション	38,600	248.00	9,572,800
クラレ	157,700	1,039.00	163,850,300
旭化成	714,600	1,147.50	820,003,500
共和レザー	6,700	650.00	4,355,000
昭和電工	93,500	2,384.00	222,904,000
住友化学	792,100	585.00	463,378,500
住友精化	4,800	3,145.00	15,096,000
日産化学	58,600	6,160.00	360,976,000
ラサ工業	3,800	1,589.00	6,038,200
クレハ	8,500	8,460.00	71,910,000
多木化学	4,200	5,410.00	22,722,000
テイカ	7,900	1,293.00	10,214,700
石原産業	17,900	1,172.00	20,978,800
片倉コープアグリ	2,400	1,127.00	2,704,800
日本曹達	13,800	3,225.00	44,505,000
東ソー	155,500	1,787.00	277,878,500
トクヤマ	34,500	1,847.00	63,721,500
セントラル硝子	17,600	2,130.00	37,488,000
東亜合成	61,400	1,131.00	69,443,400
大阪ソーダ	10,000	2,996.00	29,960,000
関東電化工業	23,600	1,073.00	25,322,800
デンカ	39,300	4,010.00	157,593,000
信越化学工業	185,100	18,740.00	3,468,774,000
日本カーバイド工業	3,800	1,302.00	4,947,600
堺化学工業	7,600	2,144.00	16,294,400
第一稀元素化学工業	10,000	1,123.00	11,230,000
エア・ウォーター	102,100	1,774.00	181,125,400
日本酸素ホールディングス	103,600	2,399.00	248,536,400
日本化学工業	3,400	2,682.00	9,118,800
東邦アセチレン	1,800	1,271.00	2,287,800
日本パーカラライジング	54,400	1,061.00	57,718,400
高压ガス工業	17,100	757.00	12,944,700
チタン工業	1,200	1,695.00	2,034,000
四国化成工業	14,100	1,406.00	19,824,600
戸田工業	2,300	3,465.00	7,969,500
ステラ ケミファ	5,400	2,514.00	13,575,600
保土谷化学工業	3,500	5,640.00	19,740,000

日本触媒	18,100	5,360.00	97,016,000
大日精化工業	8,900	2,258.00	20,096,200
カネカ	27,900	3,760.00	104,904,000
三菱瓦斯化学	100,300	2,127.00	213,338,100
三井化学	97,900	3,230.00	316,217,000
J S R	100,500	3,925.00	394,462,500
東京応化工業	18,500	6,720.00	124,320,000
大阪有機化学工業	9,200	3,230.00	29,716,000
三菱ケミカルホールディングス	720,700	896.30	645,963,410
K Hネオケム	17,800	2,965.00	52,777,000
ダイセル	155,300	857.00	133,092,100
住友ベークライト	16,900	5,720.00	96,668,000
積水化学工業	225,600	1,945.00	438,792,000
日本ゼオン	97,200	1,356.00	131,803,200
アイカ工業	30,000	3,225.00	96,750,000
宇部興産	50,800	2,078.00	105,562,400
積水樹脂	16,300	2,065.00	33,659,500
タキロンシーアイ	23,300	558.00	13,001,400
旭有機材	6,100	1,726.00	10,528,600
ニチバン	6,400	1,791.00	11,462,400
リケンテクノス	26,300	490.00	12,887,000
大倉工業	5,500	1,985.00	10,917,500
積水化成成品工業	14,500	475.00	6,887,500
群栄化学工業	2,500	3,620.00	9,050,000
タイガースポリマー	5,700	441.00	2,513,700
ミライアル	3,500	1,584.00	5,544,000
ダイキアクシス	4,200	698.00	2,931,600
ダイキョーニシカワ	22,700	606.00	13,756,200
竹本容器	3,900	760.00	2,964,000
森六ホールディングス	5,800	1,931.00	11,199,800
恵和	2,900	5,600.00	16,240,000
日本化薬	84,900	1,120.00	95,088,000
カーリットホールディングス	10,700	685.00	7,329,500
日本精化	8,700	2,288.00	19,905,600
扶桑化学工業	9,700	4,525.00	43,892,500
トリケミカル研究所	11,100	3,160.00	35,076,000
A D E K A	49,700	2,444.00	121,466,800
日油	36,800	5,270.00	193,936,000
新日本理化	17,800	251.00	4,467,800
ハリマ化成グループ	8,000	821.00	6,568,000
花王	243,500	5,908.00	1,438,598,000
第一工業製薬	4,000	3,040.00	12,160,000

石原ケミカル	5,400	1,321.00	7,133,400
日華化学	3,600	806.00	2,901,600
ニイタカ	2,200	2,174.00	4,782,800
三洋化成工業	6,400	5,280.00	33,792,000
有機合成薬品工業	7,500	272.00	2,040,000
大日本塗料	13,200	817.00	10,784,400
日本ペイントホールディングス	405,100	909.00	368,235,900
関西ペイント	111,800	2,453.00	274,245,400
神東塗料	8,500	155.00	1,317,500
中国塗料	25,400	949.00	24,104,600
日本特殊塗料	8,100	896.00	7,257,600
藤倉化成	13,400	494.00	6,619,600
太陽ホールディングス	15,900	3,340.00	53,106,000
D I C	45,500	2,972.00	135,226,000
サカタインクス	21,400	975.00	20,865,000
東洋インキＳＣホールディングス	22,800	1,915.00	43,662,000
T & K T O K A	8,700	805.00	7,003,500
富士フィルムホールディングス	193,500	7,773.00	1,504,075,500
資生堂	205,100	5,906.00	1,211,320,600
ライオン	132,900	1,540.00	204,666,000
高砂香料工業	7,600	2,795.00	21,242,000
マンダム	23,100	1,392.00	32,155,200
ミルボン	13,600	5,610.00	76,296,000
ファンケル	44,600	2,923.00	130,365,800
コーセー	20,700	10,940.00	226,458,000
コタ	7,000	1,600.00	11,200,000
シーボン	1,400	1,716.00	2,402,400
ポーラ・オルビスホールディングス	47,000	1,769.00	83,143,000
ノエビアホールディングス	9,300	5,080.00	47,244,000
アジュバンホールディングス	2,500	1,065.00	2,662,500
新日本製薬	3,000	1,126.00	3,378,000
エステー	7,100	1,520.00	10,792,000
アグロ カネショウ	3,700	1,197.00	4,428,900
コニシ	18,100	1,651.00	29,883,100
長谷川香料	19,000	2,479.00	47,101,000
星光 P M C	6,200	667.00	4,135,400
小林製薬	30,800	8,740.00	269,192,000
荒川化学工業	9,200	1,155.00	10,626,000
メック	8,200	3,275.00	26,855,000
日本高純度化学	3,000	2,548.00	7,644,000
タカラバイオ	28,800	2,346.00	67,564,800
J C U	12,400	4,975.00	61,690,000

新田ゼラチン	6,900	656.00	4,526,400
O A T アグリオ	2,300	1,912.00	4,397,600
デクセリアルズ	28,600	3,180.00	90,948,000
アース製薬	9,100	5,930.00	53,963,000
北興化学工業	10,200	825.00	8,415,000
大成ラミック	3,400	2,759.00	9,380,600
クミアイ化学工業	41,000	780.00	31,980,000
日本農薬	19,600	517.00	10,133,200
アキレス	7,000	1,248.00	8,736,000
有沢製作所	16,100	1,030.00	16,583,000
日東電工	66,500	8,960.00	595,840,000
レック	14,300	886.00	12,669,800
三光合成	11,500	347.00	3,990,500
きもと	16,800	226.00	3,796,800
藤森工業	9,900	4,105.00	40,639,500
前澤化成工業	7,000	1,273.00	8,911,000
未来工業	3,900	1,570.00	6,123,000
ウェーブロックホールディングス	4,200	729.00	3,061,800
J S P	6,400	1,612.00	10,316,800
エフピコ	20,200	3,725.00	75,245,000
天馬	9,000	2,574.00	23,166,000
信越ポリマー	19,800	1,068.00	21,146,400
東リ	27,400	216.00	5,918,400
ニフコ	36,700	3,775.00	138,542,500
バルカー	8,900	2,548.00	22,677,200
ユニ・チャーム	212,200	4,814.00	1,021,530,800
ショーエイコーポレーション	3,000	656.00	1,968,000
協和キリン	129,200	2,951.00	381,269,200
武田薬品工業	865,200	3,340.00	2,889,768,000
アステラス製薬	954,500	1,925.50	1,837,889,750
大日本住友製薬	68,000	1,338.00	90,984,000
塩野義製薬	138,400	6,910.00	956,344,000
わかもと製薬	13,100	302.00	3,956,200
日本新薬	28,800	7,450.00	214,560,000
中外製薬	344,300	3,692.00	1,271,155,600
科研製薬	17,300	4,275.00	73,957,500
エーザイ	131,800	6,048.00	797,126,400
ロート製薬	56,500	3,185.00	179,952,500
小野薬品工業	252,800	2,708.50	684,708,800
久光製薬	29,100	3,600.00	104,760,000
持田製薬	13,900	3,550.00	49,345,000
参天製薬	205,300	1,327.00	272,433,100

扶桑薬品工業	3,900	2,225.00	8,677,500
日本ケミファ	1,300	2,007.00	2,609,100
ツムラ	34,100	3,375.00	115,087,500
日医工	34,200	741.00	25,342,200
キッセイ薬品工業	19,500	2,337.00	45,571,500
生化学工業	19,400	943.00	18,294,200
栄研化学	19,300	1,822.00	35,164,600
日水製薬	4,000	999.00	3,996,000
鳥居薬品	5,900	2,907.00	17,151,300
JCRファーマ	31,000	2,063.00	63,953,000
東和薬品	15,800	2,755.00	43,529,000
富士製薬工業	6,800	995.00	6,766,000
ゼリア新薬工業	20,000	1,954.00	39,080,000
第一三共	865,100	2,599.50	2,248,827,450
キョーリン製薬ホールディングス	22,100	1,845.00	40,774,500
大幸薬品	16,600	632.00	10,491,200
ダイト	7,100	2,786.00	19,780,600
大塚ホールディングス	228,800	4,201.00	961,188,800
大正製薬ホールディングス	26,200	5,560.00	145,672,000
ペプチドリーム	57,800	2,213.00	127,911,400
あすか製薬ホールディングス	12,500	995.00	12,437,500
サワイグループホールディングス	24,100	4,420.00	106,522,000
日本コークス工業	93,000	135.00	12,555,000
ニチレキ	14,100	1,283.00	18,090,300
ユシロ化学工業	5,700	1,099.00	6,264,300
ビーピー・カストロール	3,900	1,310.00	5,109,000
富士石油	29,400	258.00	7,585,200
MORESCO	3,600	1,170.00	4,212,000
出光興産	122,200	3,210.00	392,262,000
ENEOSホールディングス	1,656,000	454.20	752,155,200
コスモエネルギーホールディングス	31,900	2,331.00	74,358,900
横浜ゴム	63,700	1,740.00	110,838,000
TOYO TIRE	57,900	1,666.00	96,461,400
ブリヂストン	317,100	5,111.00	1,620,698,100
住友ゴム工業	98,900	1,198.00	118,482,200
藤倉コンポジット	8,800	836.00	7,356,800
オカモト	6,500	4,190.00	27,235,000
フコク	4,800	1,007.00	4,833,600
ニッタ	11,400	2,839.00	32,364,600
住友理工	21,300	593.00	12,630,900
三ツ星ベルト	13,400	2,134.00	28,595,600
バンドー化学	17,700	881.00	15,593,700

日東紡績	16,400	2,845.00	46,658,000
A G C	101,100	5,200.00	525,720,000
日本板硝子	52,800	526.00	27,772,800
石塚硝子	1,900	2,100.00	3,990,000
日本山村硝子	4,300	794.00	3,414,200
日本電気硝子	44,200	2,825.00	124,865,000
オハラ	4,400	1,104.00	4,857,600
住友大阪セメント	20,400	3,585.00	73,134,000
太平洋セメント	62,600	2,348.00	146,984,800
日本ヒューム	11,100	716.00	7,947,600
日本コンクリート工業	21,900	286.00	6,263,400
三谷セキサン	5,100	6,390.00	32,589,000
アジアパイルホールディングス	17,100	445.00	7,609,500
東海カーボン	92,300	1,224.00	112,975,200
日本カーボン	5,700	4,060.00	23,142,000
東洋炭素	7,200	2,951.00	21,247,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,595.00	28,029,500
T O T O	78,600	5,060.00	397,716,000
日本碍子	119,300	1,932.00	230,487,600
日本特殊陶業	83,800	1,978.00	165,756,400
M A R U W A	3,800	15,340.00	58,292,000
品川リフラクトリーズ	2,600	3,780.00	9,828,000
黒崎播磨	1,900	4,695.00	8,920,500
ヨータイ	7,000	1,240.00	8,680,000
イソライト工業	4,900	1,198.00	5,870,200
東京窯業	14,200	309.00	4,387,800
ニッカトー	5,100	677.00	3,452,700
フジミインコーポレーテッド	8,800	6,940.00	61,072,000
クニミネ工業	3,500	1,029.00	3,601,500
エーアンドエーマテリアル	1,900	915.00	1,738,500
ニチアス	25,500	2,654.00	67,677,000
ニチハ	15,300	2,834.00	43,360,200
日本製鉄	487,200	1,896.50	923,974,800
神戸製鋼所	203,300	558.00	113,441,400
中山製鋼所	17,300	430.00	7,439,000
合同製鐵	5,900	1,405.00	8,289,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	294,000	1,486.00	436,884,000
東京製鐵	37,100	1,203.00	44,631,300
共英製鋼	12,300	1,518.00	18,671,400
大和工業	20,800	3,510.00	73,008,000
東京鐵鋼	4,800	1,353.00	6,494,400
大阪製鐵	5,800	1,183.00	6,861,400

淀川製鋼所	14,300	2,479.00	35,449,700
丸一鋼管	38,600	2,571.00	99,240,600
モリ工業	3,200	2,634.00	8,428,800
大同特殊鋼	17,800	4,210.00	74,938,000
日本高周波鋼業	4,100	350.00	1,435,000
日本冶金工業	8,000	2,268.00	18,144,000
山陽特殊製鋼	11,200	1,950.00	21,840,000
愛知製鋼	6,100	2,541.00	15,500,100
日立金属	117,300	2,093.00	245,508,900
日本金属	2,700	983.00	2,654,100
大太平洋金属	6,700	2,218.00	14,860,600
新日本電工	70,400	293.00	20,627,200
栗本鐵工所	4,900	1,543.00	7,560,700
虹技	1,500	986.00	1,479,000
三菱製鋼	7,000	1,048.00	7,336,000
日亜鋼業	14,300	283.00	4,046,900
日本精線	1,800	4,620.00	8,316,000
エンビプロ・ホールディングス	4,700	1,585.00	7,449,500
シンニッタン	13,300	225.00	2,992,500
新家工業	2,700	1,666.00	4,498,200
大紀アルミニウム工業所	16,400	1,601.00	26,256,400
日本軽金属ホールディングス	27,600	1,797.00	49,597,200
三井金属鉱業	29,400	3,210.00	94,374,000
東邦亜鉛	6,100	2,420.00	14,762,000
三菱マテリアル	71,900	2,043.00	146,891,700
住友金属鉱山	139,200	5,117.00	712,286,400
D O W A ホールディングス	29,700	5,000.00	148,500,000
古河機械金属	18,000	1,267.00	22,806,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,600	828.00	10,432,800
東邦チタニウム	19,500	938.00	18,291,000
U A C J	16,500	2,673.00	44,104,500
C K サンエツ	2,300	4,040.00	9,292,000
古河電気工業	33,800	2,357.00	79,666,600
住友電気工業	407,100	1,575.50	641,386,050
フジクラ	121,400	589.00	71,504,600
昭和電線ホールディングス	9,500	1,848.00	17,556,000
東京特殊電線	1,600	2,901.00	4,641,600
タツタ電線	19,300	484.00	9,341,200
カナレ電気	1,700	1,606.00	2,730,200
平河ヒューテック	6,100	1,152.00	7,027,200
リョービ	13,400	1,149.00	15,396,600
アーレスティ	11,700	391.00	4,574,700

アサヒホールディングス	43,600	2,078.00	90,600,800
稲葉製作所	6,100	1,306.00	7,966,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	3,160.00	10,428,000
トーカロ	28,100	1,369.00	38,468,900
アルファC o	4,200	1,094.00	4,594,800
SUMCO	167,600	2,250.00	377,100,000
川田テクノロジーズ	2,200	3,995.00	8,789,000
RS Technologies	3,500	5,940.00	20,790,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	1,645.00	1,974,000
信和	6,700	833.00	5,581,100
東洋製罐グループホールディングス	69,300	1,372.00	95,079,600
ホッカンホールディングス	6,000	1,433.00	8,598,000
コロナ	6,000	894.00	5,364,000
横河ブリッジホールディングス	18,700	2,181.00	40,784,700
駒井ハルテック	2,000	2,338.00	4,676,000
高田機工	1,000	2,875.00	2,875,000
三和ホールディングス	102,600	1,260.00	129,276,000
文化シャッター	34,500	1,058.00	36,501,000
三協立山	14,000	626.00	8,764,000
アルインコ	7,900	964.00	7,615,600
東洋シャッター	2,400	561.00	1,346,400
LIXIL	171,300	2,678.00	458,741,400
日本フィルコン	7,600	518.00	3,936,800
ノーリツ	20,800	1,688.00	35,110,400
長府製作所	11,100	2,002.00	22,222,200
リンナイ	20,500	10,520.00	215,660,000
ダイニチ工業	5,200	705.00	3,666,000
日東精工	13,700	575.00	7,877,500
三洋工業	1,300	1,827.00	2,375,100
岡部	22,100	744.00	16,442,400
ジーテクト	13,500	1,424.00	19,224,000
東ブレ	20,300	1,242.00	25,212,600
高周波熱錬	19,500	602.00	11,739,000
東京製綱	6,700	862.00	5,775,400
サンコール	9,300	587.00	5,459,100
モリテック スチール	8,500	327.00	2,779,500
パイオラックス	16,000	1,769.00	28,304,000
エイチワン	10,700	672.00	7,190,400
日本発條	100,100	925.00	92,592,500
中央発條	5,200	795.00	4,134,000
アドバネクス	1,400	1,441.00	2,017,400
立川ブラインド工業	4,800	1,066.00	5,116,800

三益半導体工業	8,500	2,461.00	20,918,500
日本ドライケミカル	2,700	1,816.00	4,903,200
日本製鋼所	33,100	4,035.00	133,558,500
三浦工業	47,100	3,505.00	165,085,500
タクマ	37,000	1,424.00	52,688,000
ツガミ	26,000	1,494.00	38,844,000
オークマ	12,700	5,090.00	64,643,000
芝浦機械	12,300	3,710.00	45,633,000
アマダ	172,000	1,151.00	197,972,000
アイダエンジニアリング	28,600	1,074.00	30,716,400
滝澤鉄工所	3,200	1,187.00	3,798,400
F U J I	50,200	2,522.00	126,604,400
牧野フライス製作所	12,000	3,945.00	47,340,000
オーエスジー	50,400	2,068.00	104,227,200
ダイジェット工業	1,400	977.00	1,367,800
旭ダイヤモンド工業	28,800	605.00	17,424,000
D M G 森精機	64,700	1,861.00	120,406,700
ソディック	24,200	818.00	19,795,600
ディスコ	16,000	32,350.00	517,600,000
日東工器	6,000	1,676.00	10,056,000
日進工具	8,600	1,414.00	12,160,400
パンチ工業	9,200	500.00	4,600,000
富士ダイス	5,600	631.00	3,533,600
豊和工業	5,800	782.00	4,535,600
O K K	4,200	986.00	4,141,200
東洋機械金属	7,200	505.00	3,636,000
津田駒工業	2,100	587.00	1,232,700
エンシュウ	2,700	606.00	1,636,200
島精機製作所	16,000	1,917.00	30,672,000
オプトラン	13,700	2,352.00	32,222,400
N C ホールディングス	3,100	1,568.00	4,860,800
イワキポンプ	7,000	1,007.00	7,049,000
フリュー	9,700	1,245.00	12,076,500
ヤマシンフィルタ	22,100	432.00	9,547,200
日阪製作所	13,500	831.00	11,218,500
やまびこ	21,200	1,075.00	22,790,000
野村マイクロ・サイエンス	2,900	4,475.00	12,977,500
平田機工	5,200	6,160.00	32,032,000
ペガサスミシン製造	11,100	477.00	5,294,700
マルマエ	4,500	2,542.00	11,439,000
タツモ	5,100	1,384.00	7,058,400
ナブテスコ	62,100	3,560.00	221,076,000

三井海洋開発	11,600	1,141.00	13,235,600
レオン自動機	11,700	1,076.00	12,589,200
S M C	32,200	65,480.00	2,108,456,000
ホソカワミクロン	7,700	3,015.00	23,215,500
ユニオンツール	4,100	3,810.00	15,621,000
オイレス工業	15,300	1,606.00	24,571,800
日精エー・エス・ビー機械	3,700	3,175.00	11,747,500
サトーホールディングス	14,400	2,055.00	29,592,000
技研製作所	9,700	3,935.00	38,169,500
日本エアージェット	5,100	1,079.00	5,502,900
カワタ	3,500	1,055.00	3,692,500
日精樹脂工業	7,800	1,061.00	8,275,800
オカダアイヨン	3,500	1,455.00	5,092,500
ワイエイシーホールディングス	4,300	1,147.00	4,932,100
小松製作所	499,000	2,901.00	1,447,599,000
住友重機械工業	63,100	3,005.00	189,615,500
日立建機	44,200	3,005.00	132,821,000
日工	15,300	620.00	9,486,000
巴工業	4,300	2,181.00	9,378,300
井関農機	10,300	1,347.00	13,874,100
T O W A	9,400	2,580.00	24,252,000
丸山製作所	2,300	1,529.00	3,516,700
北川鉄工所	5,100	1,384.00	7,058,400
ローツェ	5,400	10,710.00	57,834,000
タカキタ	3,900	610.00	2,379,000
クボタ	537,000	2,530.00	1,358,610,000
荏原実業	5,100	2,226.00	11,352,600
三菱化工機	3,600	2,155.00	7,758,000
月島機械	20,400	1,066.00	21,746,400
帝国電機製作所	7,700	1,374.00	10,579,800
新東工業	24,500	699.00	17,125,500
澁谷工業	9,700	2,590.00	25,123,000
アイチ コーポレーション	16,200	823.00	13,332,600
小森コーポレーション	28,100	695.00	19,529,500
鶴見製作所	8,600	1,692.00	14,551,200
住友精密工業	1,700	1,943.00	3,303,100
日本ギア工業	4,100	263.00	1,078,300
酒井重工業	2,000	2,704.00	5,408,000
荏原製作所	45,700	5,820.00	265,974,000
石井鐵工所	1,600	2,998.00	4,796,800
西島製作所	10,100	933.00	9,423,300
北越工業	10,400	965.00	10,036,000

ダイキン工業	140,300	24,830.00	3,483,649,000
オルガノ	3,200	8,530.00	27,296,000
トーヨーカネツ	4,200	2,510.00	10,542,000
栗田工業	59,600	4,965.00	295,914,000
椿本チエイン	14,400	3,180.00	45,792,000
大同工業	5,000	959.00	4,795,000
木村化工機	9,400	745.00	7,003,000
アネスト岩田	17,200	736.00	12,659,200
ダイフク	60,600	8,220.00	498,132,000
サムコ	2,800	2,310.00	6,468,000
加藤製作所	5,400	824.00	4,449,600
油研工業	1,900	1,730.00	3,287,000
タダノ	57,700	1,160.00	66,932,000
フジテック	40,800	2,700.00	110,160,000
C K D	32,500	2,093.00	68,022,500
キトー	9,400	1,755.00	16,497,000
平和	30,700	1,873.00	57,501,100
理想科学工業	9,300	2,146.00	19,957,800
S A N K Y O	23,800	3,050.00	72,590,000
日本金銭機械	11,200	636.00	7,123,200
マースグループホールディングス	7,000	1,639.00	11,473,000
フクシマガリレイ	7,600	4,260.00	32,376,000
オーイズミ	4,000	397.00	1,588,000
ダイコク電機	5,100	1,240.00	6,324,000
竹内製作所	16,800	2,914.00	48,955,200
アマノ	28,800	2,420.00	69,696,000
J U K I	15,300	795.00	12,163,500
ジャノメ	9,400	736.00	6,918,400
マックス	14,700	1,833.00	26,945,100
グローリー	28,300	2,169.00	61,382,700
新晃工業	10,300	1,830.00	18,849,000
大和冷機工業	16,000	1,129.00	18,064,000
セガサミーホールディングス	109,200	1,927.00	210,428,400
日本ピストンリング	4,100	1,327.00	5,440,700
リケン	4,800	2,621.00	12,580,800
T P R	14,800	1,465.00	21,682,000
ツバキ・ナカシマ	24,200	1,417.00	34,291,400
ホシザキ	32,200	8,480.00	273,056,000
大豊工業	9,000	816.00	7,344,000
日本精工	207,300	783.00	162,315,900
N T N	236,600	234.00	55,364,400
ジェイテクト	105,700	973.00	102,846,100

不二越	9,400	4,265.00	40,091,000
日本トムソン	30,200	621.00	18,754,200
T H K	63,800	2,865.00	182,787,000
ユーシン精機	8,600	722.00	6,209,200
前澤給装工業	8,300	1,005.00	8,341,500
イーグル工業	13,700	1,110.00	15,207,000
前澤工業	6,700	636.00	4,261,200
日本ピラー工業	11,100	3,205.00	35,575,500
キッツ	37,200	665.00	24,738,000
マキタ	134,000	4,644.00	622,296,000
三井E & Sホールディングス	39,800	354.00	14,089,200
日立造船	93,300	793.00	73,986,900
三菱重工業	173,000	3,055.00	528,515,000
I H I	68,800	2,281.00	156,932,800
スター精密	16,900	1,470.00	24,843,000
日清紡ホールディングス	67,300	941.00	63,329,300
イビデン	57,800	6,200.00	358,360,000
コニカミノルタ	241,500	521.00	125,821,500
ブラザー工業	134,700	2,207.00	297,282,900
ミネベアミツミ	189,900	2,761.00	524,313,900
日立製作所	529,500	6,290.00	3,330,555,000
東芝	192,400	4,787.00	921,018,800
三菱電機	1,100,800	1,484.50	1,634,137,600
富士電機	66,300	5,680.00	376,584,000
東洋電機製造	4,300	979.00	4,209,700
安川電機	118,500	4,900.00	580,650,000
シンフォニアテクノロジー	13,200	1,205.00	15,906,000
明電舎	18,700	2,568.00	48,021,600
オリジン	2,700	1,242.00	3,353,400
山洋電気	5,000	5,330.00	26,650,000
デンヨー	9,400	1,707.00	16,045,800
P H Cホールディングス	12,900	1,731.00	22,329,900
東芝テック	11,800	4,270.00	50,386,000
芝浦メカトロニクス	2,000	8,650.00	17,300,000
マブチモーター	25,900	3,655.00	94,664,500
日本電産	285,300	11,035.00	3,148,285,500
トレックス・セミコンダクター	5,700	2,726.00	15,538,200
東光高岳	6,600	1,400.00	9,240,000
ダイヘン	12,000	4,275.00	51,300,000
ヤーマン	18,500	909.00	16,816,500
J V Cケンウッド	93,100	181.00	16,851,100
ミマキエンジニアリング	10,600	769.00	8,151,400

I - P E X	5,400	1,789.00	9,660,600
日新電機	25,800	1,512.00	39,009,600
大崎電気工業	20,200	469.00	9,473,800
オムロン	91,600	9,467.00	867,177,200
日東工業	14,700	1,551.00	22,799,700
I D E C	13,600	2,462.00	33,483,200
正興電機製作所	4,000	1,028.00	4,112,000
不二電機工業	2,600	1,188.00	3,088,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,800	2,557.00	94,097,600
サクサホールディングス	2,600	1,288.00	3,348,800
メルコホールディングス	3,200	3,830.00	12,256,000
テクノメディカ	2,900	1,638.00	4,750,200
日本電気	139,900	5,120.00	716,288,000
富士通	99,000	18,295.00	1,811,205,000
沖電気工業	44,700	914.00	40,855,800
岩崎通信機	4,500	814.00	3,663,000
電気興業	5,800	2,373.00	13,763,400
サンケン電気	10,300	4,960.00	51,088,000
ナカヨ	2,000	1,191.00	2,382,000
アイホン	6,200	2,179.00	13,509,800
ルネサスエレクトロニクス	597,300	1,329.00	793,811,700
セイコーエプソン	136,600	2,017.00	275,522,200
ワコム	86,000	868.00	74,648,000
アルバック	20,200	6,040.00	122,008,000
アクセル	5,500	1,076.00	5,918,000
E I Z O	8,500	3,920.00	33,320,000
日本信号	28,000	892.00	24,976,000
京三製作所	23,600	424.00	10,006,400
能美防災	14,800	2,095.00	31,006,000
ホーチキ	8,500	1,243.00	10,565,500
星和電機	6,400	608.00	3,891,200
エレコム	25,600	1,400.00	35,840,000
パナソニック	1,174,100	1,307.00	1,534,548,700
シャープ	125,500	1,273.00	159,761,500
アンリツ	70,900	1,627.00	115,354,300
富士通ゼネラル	29,900	2,555.00	76,394,500
ソニーグループ	689,600	12,835.00	8,851,016,000
T D K	159,600	4,135.00	659,946,000
帝国通信工業	5,400	1,328.00	7,171,200
タムラ製作所	42,400	665.00	28,196,000
アルプスアルパイン	97,900	1,106.00	108,277,400
池上通信機	3,200	648.00	2,073,600

日本電波工業	10,200	1,336.00	13,627,200
鈴木	5,700	853.00	4,862,100
メイコー	9,000	3,995.00	35,955,000
日本トリム	2,300	3,000.00	6,900,000
ローランド ディー・ジー	6,700	2,853.00	19,115,100
フォスター電機	11,100	748.00	8,302,800
S M K	2,600	2,192.00	5,699,200
ヨコオ	8,300	2,587.00	21,472,100
ホシデン	27,000	1,133.00	30,591,000
ヒロセ電機	17,000	17,270.00	293,590,000
日本航空電子工業	25,200	1,902.00	47,930,400
T O A	11,800	789.00	9,310,200
マクセル	22,300	1,332.00	29,703,600
古野電気	13,600	1,024.00	13,926,400
ユニデンホールディングス	2,400	3,540.00	8,496,000
スミダコーポレーション	10,900	1,035.00	11,281,500
アイコム	4,100	2,340.00	9,594,000
リオン	4,500	2,096.00	9,432,000
本多通信工業	10,200	423.00	4,314,600
横河電機	110,200	1,984.00	218,636,800
新電元工業	4,200	3,420.00	14,364,000
アズビル	64,500	4,810.00	310,245,000
東亜ディーケーケー	6,200	874.00	5,418,800
日本光電工業	45,700	3,125.00	142,812,500
チノー	3,500	1,612.00	5,642,000
共和電業	10,500	380.00	3,990,000
日本電子材料	5,500	2,395.00	13,172,500
堀場製作所	20,400	6,060.00	123,624,000
アドバンテスト	81,800	9,810.00	802,458,000
小野測器	6,000	475.00	2,850,000
エスベック	9,200	2,025.00	18,630,000
キーエンス	99,700	60,050.00	5,986,985,000
日置電機	5,300	7,480.00	39,644,000
シスメックス	93,200	11,175.00	1,041,510,000
日本マイクロニクス	19,400	1,585.00	30,749,000
メガチップス	10,300	4,445.00	45,783,500
O B A R A G R O U P	5,200	3,330.00	17,316,000
澤藤電機	1,700	1,615.00	2,745,500
原田工業	5,900	945.00	5,575,500
コーセル	14,100	810.00	11,421,000
イリソ電子工業	9,400	4,535.00	42,629,000
オプテックスグループ	18,400	1,545.00	28,428,000

千代田インテグレ	4,900	1,841.00	9,020,900
アイ・オー・データ機器	5,000	741.00	3,705,000
レーザーテック	48,400	27,100.00	1,311,640,000
スタンレー電気	77,200	2,811.00	217,009,200
岩崎電気	4,300	2,276.00	9,786,800
ウシオ電機	56,700	1,800.00	102,060,000
岡谷電機産業	10,000	320.00	3,200,000
ハリオス テクノ ホールディング	11,800	296.00	3,492,800
エノモト	3,500	1,730.00	6,055,000
日本セラミック	10,400	2,488.00	25,875,200
遠藤照明	5,700	989.00	5,637,300
古河電池	8,300	1,284.00	10,657,200
双信電機	5,900	669.00	3,947,100
山一電機	8,200	2,032.00	16,662,400
図研	7,300	2,934.00	21,418,200
日本電子	23,000	6,330.00	145,590,000
カシオ計算機	79,700	1,456.00	116,043,200
ファナック	96,600	23,140.00	2,235,324,000
日本シイエムケイ	22,800	556.00	12,676,800
エンプラス	3,000	2,864.00	8,592,000
大真空	15,200	1,258.00	19,121,600
ローム	49,300	9,990.00	492,507,000
浜松ホトニクス	79,000	5,960.00	470,840,000
三井ハイテック	10,800	8,660.00	93,528,000
新光電気工業	32,400	4,890.00	158,436,000
京セラ	154,900	6,838.00	1,059,206,200
太陽誘電	53,500	5,620.00	300,670,000
村田製作所	323,400	8,586.00	2,776,712,400
双葉電子工業	19,700	689.00	13,573,300
北陸電気工業	4,700	1,280.00	6,016,000
ニチコン	35,100	1,235.00	43,348,500
日本ケミコン	10,400	1,677.00	17,440,800
K O A	16,900	1,455.00	24,589,500
市光工業	14,500	517.00	7,496,500
小糸製作所	60,500	6,070.00	367,235,000
ミツバ	20,300	404.00	8,201,200
S C R E E Nホールディングス	19,100	11,650.00	222,515,000
キャノン電子	10,500	1,555.00	16,327,500
キャノン	547,000	2,804.00	1,533,788,000
リコー	305,500	1,060.00	323,830,000
象印マホービン	30,100	1,392.00	41,899,200
M U T O Hホールディングス	1,800	2,098.00	3,776,400

東京エレクトロン	69,800	58,440.00	4,079,112,000
トヨタ紡織	44,900	2,148.00	96,445,200
芦森工業	2,100	915.00	1,921,500
ユニプレス	16,400	835.00	13,694,000
豊田自動織機	89,100	9,030.00	804,573,000
モリタホールディングス	17,600	1,291.00	22,721,600
三櫻工業	15,200	854.00	12,980,800
デンソー	242,400	8,802.00	2,133,604,800
東海理化電機製作所	29,000	1,510.00	43,790,000
川崎重工業	80,300	2,278.00	182,923,400
名村造船所	33,100	199.00	6,586,900
日本車輛製造	4,000	2,036.00	8,144,000
三菱ロジスネクスト	14,600	1,043.00	15,227,800
近畿車輛	1,700	1,011.00	1,718,700
日産自動車	1,298,300	599.90	778,850,170
いすゞ自動車	345,400	1,398.00	482,869,200
トヨタ自動車	5,576,000	2,278.50	12,704,916,000
日野自動車	137,500	952.00	130,900,000
三菱自動車工業	407,500	311.00	126,732,500
エフテック	7,700	564.00	4,342,800
レシップホールディングス	4,400	533.00	2,345,200
G M B	2,000	790.00	1,580,000
ファルテック	1,900	700.00	1,330,000
武蔵精密工業	24,500	1,839.00	45,055,500
日産車体	16,100	684.00	11,012,400
新明和工業	31,100	890.00	27,679,000
極東開発工業	20,400	1,451.00	29,600,400
トピー工業	9,100	1,106.00	10,064,600
ティラド	3,200	2,715.00	8,688,000
曙ブレーキ工業	60,400	179.00	10,811,600
タチエス	19,300	1,232.00	23,777,600
N O K	53,300	1,246.00	66,411,800
フタバ産業	27,600	428.00	11,812,800
K Y B	11,400	3,020.00	34,428,000
大同メタル工業	21,100	624.00	13,166,400
プレス工業	54,600	382.00	20,857,200
ミクニ	14,000	454.00	6,356,000
太平洋工業	23,100	1,133.00	26,172,300
河西工業	13,500	301.00	4,063,500
アイシン	80,600	4,305.00	346,983,000
マツダ	345,500	902.00	311,641,000
今仙電機製作所	7,200	584.00	4,204,800

本田技研工業	866,700	3,385.00	2,933,779,500
スズキ	251,800	4,672.00	1,176,409,600
S U B A R U	315,500	2,106.00	664,443,000
安永	5,300	857.00	4,542,100
ヤマハ発動機	143,600	2,737.00	393,033,200
T B K	12,100	404.00	4,888,400
エクセディ	16,600	1,680.00	27,888,000
豊田合成	35,600	2,443.00	86,970,800
愛三工業	17,200	703.00	12,091,600
盟和産業	1,600	1,016.00	1,625,600
日本プラスト	8,600	566.00	4,867,600
ヨロズ	10,300	1,019.00	10,495,700
エフ・シー・シー	18,000	1,493.00	26,874,000
シマノ	44,200	26,665.00	1,178,593,000
テイ・エス テック	46,500	1,460.00	67,890,000
ジャムコ	6,400	855.00	5,472,000
テルモ	311,500	4,232.00	1,318,268,000
クリエートメディック	3,300	974.00	3,214,200
日機装	33,000	851.00	28,083,000
日本エム・ディ・エム	6,300	1,578.00	9,941,400
島津製作所	141,700	4,095.00	580,261,500
J M S	9,300	620.00	5,766,000
長野計器	8,000	1,343.00	10,744,000
ブイ・テクノロジー	4,800	3,485.00	16,728,000
東京計器	7,000	1,001.00	7,007,000
愛知時計電機	1,600	5,510.00	8,816,000
インターアクション	5,500	2,033.00	11,181,500
オーバル	9,900	255.00	2,524,500
東京精密	18,600	4,950.00	92,070,000
マニー	43,900	1,674.00	73,488,600
ニコン	168,100	1,247.00	209,620,700
トプコン	51,800	1,393.00	72,157,400
オリンパス	577,300	2,470.00	1,425,931,000
理研計器	8,900	5,480.00	48,772,000
タムロン	8,600	2,565.00	22,059,000
H O Y A	214,800	14,800.00	3,179,040,000
シード	5,200	531.00	2,761,200
ノーリツ鋼機	9,900	2,222.00	21,997,800
エー・アンド・デイ	10,100	1,014.00	10,241,400
朝日インテック	120,700	2,064.00	249,124,800
シチズン時計	129,000	488.00	62,952,000
リズム	3,500	1,264.00	4,424,000

大研医器	8,700	529.00	4,602,300
メニコン	36,500	2,763.00	100,849,500
シンシア	1,200	499.00	598,800
松風	4,600	1,848.00	8,500,800
セイコーホールディングス	15,600	2,121.00	33,087,600
ニプロ	82,100	1,067.00	87,600,700
中本パックス	3,100	1,720.00	5,332,000
スノーピーク	14,300	2,336.00	33,404,800
パラマウントベッドホールディングス	21,100	1,966.00	41,482,600
トランザクション	6,000	1,088.00	6,528,000
粧美堂	3,200	399.00	1,276,800
ニホンフラッシュ	9,400	1,043.00	9,804,200
前田工織	12,100	3,455.00	41,805,500
永大産業	14,400	303.00	4,363,200
アートネイチャー	9,400	707.00	6,645,800
バンダイナムコホールディングス	98,600	8,040.00	792,744,000
アイフィスジャパン	2,800	663.00	1,856,400
共立印刷	18,400	137.00	2,520,800
S H O E I	10,300	4,150.00	42,745,000
フランスベッドホールディングス	14,100	887.00	12,506,700
パイロットコーポレーション	18,600	4,125.00	76,725,000
萩原工業	7,100	1,223.00	8,683,300
フジシールインターナショナル	26,700	2,235.00	59,674,500
タカラトミー	46,100	1,132.00	52,185,200
広済堂ホールディングス	6,800	771.00	5,242,800
エステールホールディングス	2,600	637.00	1,656,200
タカノ	3,800	661.00	2,511,800
プロネクサス	8,500	1,098.00	9,333,000
ホクシン	7,800	161.00	1,255,800
ウッドワン	3,400	1,015.00	3,451,000
大建工業	6,500	2,113.00	13,734,500
凸版印刷	167,300	2,186.00	365,717,800
大日本印刷	130,100	2,860.00	372,086,000
共同印刷	3,400	2,738.00	9,309,200
N I S S H A	22,600	1,482.00	33,493,200
光村印刷	1,000	1,382.00	1,382,000
T A K A R A & C O M P A N Y	5,400	1,837.00	9,919,800
アシックス	97,300	2,178.00	211,919,400
ツツミ	2,700	1,800.00	4,860,000
ローランド	7,600	4,110.00	31,236,000
小松ウオール工業	3,400	1,899.00	6,456,600
ヤマハ	65,500	5,200.00	340,600,000

河合楽器製作所	3,100	3,135.00	9,718,500
クリナップ	10,200	538.00	5,487,600
ピジョン	66,500	2,399.00	159,533,500
兼松サステック	700	1,619.00	1,133,300
キングジム	8,900	889.00	7,912,100
リンテック	23,600	2,652.00	62,587,200
イトーキ	20,300	347.00	7,044,100
任天堂	62,100	53,900.00	3,347,190,000
三菱鉛筆	18,100	1,194.00	21,611,400
タカラスタANDARD	22,700	1,369.00	31,076,300
コクヨ	52,800	1,655.00	87,384,000
ナカバヤシ	9,800	516.00	5,056,800
グローブライド	9,800	2,884.00	28,263,200
オカムラ	37,800	1,191.00	45,019,800
美津濃	10,900	2,174.00	23,696,600
東京電力ホールディングス	823,800	301.00	247,963,800
中部電力	336,800	1,235.00	415,948,000
関西電力	417,100	1,096.00	457,141,600
中国電力	172,000	954.00	164,088,000
北陸電力	100,600	592.00	59,555,200
東北電力	257,800	822.00	211,911,600
四国電力	99,100	817.00	80,964,700
九州電力	226,900	861.00	195,360,900
北海道電力	95,700	504.00	48,232,800
沖縄電力	23,300	1,419.00	33,062,700
電源開発	93,800	1,495.00	140,231,000
エフオン	6,700	555.00	3,718,500
イーレックス	16,200	1,611.00	26,098,200
レノバ	21,500	1,763.00	37,904,500
東京瓦斯	211,000	2,222.00	468,842,000
大阪瓦斯	199,400	1,948.00	388,431,200
東邦瓦斯	50,500	2,977.00	150,338,500
北海道瓦斯	5,500	1,489.00	8,189,500
広島ガス	21,000	365.00	7,665,000
西部ガスホールディングス	12,400	2,217.00	27,490,800
静岡ガス	28,600	983.00	28,113,800
メタウォーター	12,300	1,921.00	23,628,300
SBSホールディングス	8,100	3,620.00	29,322,000
東武鉄道	107,600	2,686.00	289,013,600
相鉄ホールディングス	35,200	2,136.00	75,187,200
東急	277,600	1,516.00	420,841,600
京浜急行電鉄	141,400	1,170.00	165,438,000

小田急電鉄	163,700	2,063.00	337,713,100
京王電鉄	57,100	5,200.00	296,920,000
京成電鉄	76,600	3,105.00	237,843,000
富士急行	13,100	4,135.00	54,168,500
新京成電鉄	2,500	2,009.00	5,022,500
東日本旅客鉄道	193,700	6,762.00	1,309,799,400
西日本旅客鉄道	133,400	4,865.00	648,991,000
東海旅客鉄道	91,500	15,025.00	1,374,787,500
西武ホールディングス	143,700	1,122.00	161,231,400
鴻池運輸	17,500	1,175.00	20,562,500
西日本鉄道	30,500	2,594.00	79,117,000
ハマキョウレックス	7,800	2,885.00	22,503,000
サカイ引越センター	5,100	4,420.00	22,542,000
近鉄グループホールディングス	104,300	3,330.00	347,319,000
阪急阪神ホールディングス	130,400	3,320.00	432,928,000
南海電気鉄道	46,500	2,232.00	103,788,000
京阪ホールディングス	46,400	2,670.00	123,888,000
神戸電鉄	2,500	3,165.00	7,912,500
名古屋鉄道	85,700	1,841.00	157,773,700
山陽電気鉄道	8,000	1,997.00	15,976,000
アルプス物流	7,300	1,014.00	7,402,200
ヤマトホールディングス	146,100	2,380.00	347,718,000
山九	27,400	4,665.00	127,821,000
丸運	5,900	245.00	1,445,500
丸全昭和運輸	8,500	3,150.00	26,775,000
センコーグループホールディングス	52,300	929.00	48,586,700
トナミホールディングス	2,500	3,835.00	9,587,500
ニッコンホールディングス	35,000	2,146.00	75,110,000
日本石油輸送	1,100	2,646.00	2,910,600
福山通運	17,200	3,615.00	62,178,000
セイノーホールディングス	71,000	1,102.00	78,242,000
エスライン	3,100	880.00	2,728,000
神奈川中央交通	2,600	3,330.00	8,658,000
日立物流	20,100	5,250.00	105,525,000
丸和運輸機関	22,000	1,419.00	31,218,000
C & F ロジホールディングス	10,500	1,407.00	14,773,500
九州旅客鉄道	80,600	2,397.00	193,198,200
S Gホールディングス	197,000	2,488.00	490,136,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	36,100	6,680.00	241,148,000
日本郵船	87,400	8,660.00	756,884,000
商船三井	57,900	8,560.00	495,624,000
川崎汽船	32,100	6,980.00	224,058,000

N Sユニテッド海運	6,200	3,065.00	19,003,000
飯野海運	51,600	535.00	27,606,000
共栄タンカー	3,900	896.00	3,494,400
乾汽船	7,100	2,417.00	17,160,700
日本航空	239,000	2,202.00	526,278,000
A N Aホールディングス	264,800	2,433.00	644,258,400
パスコ	2,000	1,301.00	2,602,000
ランコム	2,900	8,460.00	24,534,000
日新	8,300	1,581.00	13,122,300
三菱倉庫	33,100	2,754.00	91,157,400
三井倉庫ホールディングス	11,100	2,364.00	26,240,400
住友倉庫	36,800	2,016.00	74,188,800
澁澤倉庫	6,200	2,174.00	13,478,800
東陽倉庫	17,500	317.00	5,547,500
日本トランスシティ	22,900	670.00	15,343,000
ケイヒン	1,800	1,345.00	2,421,000
中央倉庫	6,400	992.00	6,348,800
川西倉庫	1,900	1,083.00	2,057,700
安田倉庫	8,600	974.00	8,376,400
ファイズホールディングス	2,200	565.00	1,243,000
東洋埠頭	3,200	1,429.00	4,572,800
上組	57,300	2,244.00	128,581,200
サンリツ	2,900	845.00	2,450,500
キムラユニティー	2,800	1,265.00	3,542,000
キューソー流通システム	5,200	852.00	4,430,400
近鉄エクスプレス	19,700	2,841.00	55,967,700
東海運	5,900	306.00	1,805,400
エーアイティー	6,500	1,503.00	9,769,500
内外トランスライン	4,000	1,905.00	7,620,000
日本コンセプト	3,300	1,391.00	4,590,300
N E C ネットズエスアイ	35,800	1,811.00	64,833,800
クロスキャット	2,900	1,470.00	4,263,000
システナ	154,400	366.00	56,510,400
デジタルアーツ	5,800	6,910.00	40,078,000
日鉄ソリューションズ	15,700	3,415.00	53,615,500
キューブシステム	5,600	955.00	5,348,000
W O W W O R L D	1,600	1,509.00	2,414,400
コア	4,600	1,549.00	7,125,400
ラクーンホールディングス	7,700	1,227.00	9,447,900
ソリトンシステムズ	5,500	1,339.00	7,364,500
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	3,750.00	17,625,000
T I S	103,000	3,110.00	320,330,000

JNSホールディングス	5,000	436.00	2,180,000
グリー	66,400	906.00	60,158,400
GMOペパボ	1,200	2,247.00	2,696,400
コーエーテクモホールディングス	34,500	4,065.00	140,242,500
三菱総合研究所	4,700	3,890.00	18,283,000
電算	1,200	2,273.00	2,727,600
AGS	5,600	846.00	4,737,600
ファインデックス	9,200	951.00	8,749,200
ブレインパッド	8,500	1,171.00	9,953,500
KLab	19,800	457.00	9,048,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,800	928.00	14,662,400
ネクソン	243,700	2,030.00	494,711,000
アイスタイル	33,400	207.00	6,913,800
エムアップホールディングス	12,600	799.00	10,067,400
エイチーム	7,600	754.00	5,730,400
エニグモ	11,800	634.00	7,481,200
テクノスジャパン	8,600	501.00	4,308,600
コロプラ	35,700	673.00	24,026,100
ブロードリーフ	53,800	365.00	19,637,000
クロス・マーケティンググループ	4,200	876.00	3,679,200
デジタルハーツホールディングス	4,900	1,768.00	8,663,200
システム情報	8,200	901.00	7,388,200
メディアドゥ	3,800	2,844.00	10,807,200
じげん	30,900	290.00	8,961,000
ブイキューブ	11,100	841.00	9,335,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	570.00	1,482,000
サイバーリンクス	3,700	900.00	3,330,000
フィックスターズ	11,600	789.00	9,152,400
CARTA HOLDINGS	4,400	1,915.00	8,426,000
オブティム	7,600	1,063.00	8,078,800
セレス	4,000	1,989.00	7,956,000
SHIFT	5,500	20,340.00	111,870,000
ティーガイア	9,700	1,664.00	16,140,800
セック	1,600	2,242.00	3,587,200
テクマトリックス	18,300	1,695.00	31,018,500
プロシップ	3,600	1,440.00	5,184,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,300	2,466.00	72,253,800
GMOペイメントゲートウェイ	20,900	10,520.00	219,868,000
ザッパラス	4,400	490.00	2,156,000
システムリサーチ	3,200	1,799.00	5,756,800
インターネットイニシアティブ	28,800	3,980.00	114,624,000
さくらインターネット	11,800	524.00	6,183,200

ヴィンクス	3,200	890.00	2,848,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	3,675.00	8,820,000
SRAホールディングス	5,200	2,801.00	14,565,200
システムインテグレータ	3,600	525.00	1,890,000
朝日ネット	10,000	603.00	6,030,000
eBASE	13,100	541.00	7,087,100
アバント	11,700	1,033.00	12,086,100
アドソル日進	3,900	1,673.00	6,524,700
ODKソリューションズ	2,400	639.00	1,533,600
フリービット	6,500	893.00	5,804,500
コムチュア	12,200	2,893.00	35,294,600
サイバーコム	1,700	1,153.00	1,960,100
アステリア	7,900	903.00	7,133,700
アイル	6,100	1,282.00	7,820,200
マークライنز	5,500	2,618.00	14,399,000
メディカル・データ・ビジョン	13,800	1,099.00	15,166,200
gumi	15,100	602.00	9,090,200
ショーケース	2,600	474.00	1,232,400
モバイルファクトリー	2,600	830.00	2,158,000
テラスカイ	4,000	1,518.00	6,072,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,228.00	6,017,200
PCIホールディングス	4,900	1,062.00	5,203,800
パイプドHD	2,000	2,365.00	4,730,000
アイビーシー	1,900	676.00	1,284,400
ネオジャパン	3,100	1,119.00	3,468,900
PR TIMES	2,300	2,915.00	6,704,500
ラクス	37,200	2,629.00	97,798,800
ランドコンピュータ	2,600	827.00	2,150,200
ダブルスタンダード	3,300	2,544.00	8,395,200
オープンドア	6,500	1,619.00	10,523,500
マイネット	3,900	500.00	1,950,000
アカツキ	4,900	2,720.00	13,328,000
ベネフィットジャパン	900	2,207.00	1,986,300
Ubicomホールディングス	2,900	2,163.00	6,272,700
カナミックネットワーク	11,800	455.00	5,369,000
ノムラシステムコーポレーション	6,100	253.00	1,543,300
チェンジ	20,000	1,521.00	30,420,000
シンクロ・フード	5,900	304.00	1,793,600
オークネット	5,800	1,534.00	8,897,200
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	757.00	1,741,100
セグエグループ	2,900	647.00	1,876,300
エイトレッド	1,600	2,030.00	3,248,000

マクロミル	22,200	1,126.00	24,997,200
ビーグリー	2,600	1,153.00	2,997,800
オロ	3,400	2,397.00	8,149,800
ユーザーローカル	3,300	1,523.00	5,025,900
テモナ	2,600	418.00	1,086,800
ニーズウェル	2,600	604.00	1,570,400
マネーフォワード	16,400	4,815.00	78,966,000
サインポスト	3,500	905.00	3,167,500
電算システムホールディングス	4,500	2,739.00	12,325,500
ソルクシーズ	9,400	424.00	3,985,600
フェイス	3,000	652.00	1,956,000
プロトコーポレーション	11,500	1,367.00	15,720,500
ハイマックス	3,000	1,151.00	3,453,000
野村総合研究所	208,700	4,365.00	910,975,500
サイバネットシステム	7,800	657.00	5,124,600
C Eホールディングス	6,000	471.00	2,826,000
日本システム技術	2,200	2,344.00	5,156,800
インテージホールディングス	13,500	1,801.00	24,313,500
東邦システムサイエンス	3,000	966.00	2,898,000
ソースネクスト	47,200	163.00	7,693,600
インフォコム	11,900	1,924.00	22,895,600
シンプレクス・ホールディングス	11,600	2,430.00	28,188,000
HEROZ	3,200	1,080.00	3,456,000
ラクスル	11,800	3,980.00	46,964,000
I P S	3,000	1,889.00	5,667,000
F I G	12,100	277.00	3,351,700
システムサポート	3,300	1,000.00	3,300,000
イーソル	6,800	560.00	3,808,000
アルテリア・ネットワークス	13,700	1,393.00	19,084,100
E d u L a b	1,000	770.00	770,000
東海ソフト	1,800	921.00	1,657,800
ウイングアーク1 s t	6,200	1,407.00	8,723,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	2,130.00	5,325,000
サーバーワークス	1,900	2,472.00	4,696,800
東名	1,100	894.00	983,400
ヴィッツ	1,100	1,343.00	1,477,300
トビラシステムズ	2,300	820.00	1,886,000
S a n s a n	38,500	1,566.00	60,291,000
L i n k - U	2,000	756.00	1,512,000
ギフティ	9,800	1,320.00	12,936,000
ベース	1,900	4,020.00	7,638,000
J M D C	10,100	5,730.00	57,873,000

フォーカスシステムズ	7,400	921.00	6,815,400
クレスコ	7,900	1,785.00	14,101,500
フジ・メディア・ホールディングス	104,200	1,179.00	122,851,800
オービック	34,000	18,260.00	620,840,000
ジャストシステム	15,400	4,950.00	76,230,000
TDCソフト	9,500	1,032.00	9,804,000
Zホールディングス	1,570,200	559.40	878,369,880
トレンドマイクロ	57,700	5,950.00	343,315,000
IDホールディングス	6,900	856.00	5,906,400
日本オラクル	21,900	8,700.00	190,530,000
アルファシステムズ	2,900	3,655.00	10,599,500
フューチャー	22,900	1,570.00	35,953,000
CAC Holdings	6,400	1,366.00	8,742,400
SBテクノロジー	4,700	2,378.00	11,176,600
トーセ	3,100	708.00	2,194,800
オービックビジネスコンサルタント	10,300	4,275.00	44,032,500
伊藤忠テクノソリューションズ	49,200	3,360.00	165,312,000
アイティフォー	13,200	788.00	10,401,600
東計電算	1,300	4,725.00	6,142,500
エクスネット	1,800	967.00	1,740,600
大塚商会	58,500	4,810.00	281,385,000
サイボウズ	14,500	1,468.00	21,286,000
電通国際情報サービス	15,600	3,530.00	55,068,000
ACCESS	12,400	596.00	7,390,400
デジタルガレージ	17,900	4,405.00	78,849,500
EMシステムズ	18,000	667.00	12,006,000
ウェザーニューズ	3,300	7,940.00	26,202,000
CIJ	7,100	828.00	5,878,800
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,515.00	4,569,500
日本エンタープライズ	11,600	171.00	1,983,600
WOWOW	5,200	1,696.00	8,819,200
スカラ	9,800	663.00	6,497,400
インテリジェント ウェイブ	6,500	519.00	3,373,500
IMAGICA GROUP	9,400	616.00	5,790,400
ネットワンシステムズ	41,200	2,859.00	117,790,800
システムソフト	24,200	107.00	2,589,400
アルゴグラフィックス	8,400	3,360.00	28,224,000
マーベラス	17,200	747.00	12,848,400
エイベックス	18,700	1,342.00	25,095,400
日本ユニシス	33,800	3,130.00	105,794,000
兼松エレクトロニクス	5,900	3,850.00	22,715,000
都築電気	5,600	1,611.00	9,021,600

TBSホールディングス	65,800	1,721.00	113,241,800
日本テレビホールディングス	90,300	1,235.00	111,520,500
朝日放送グループホールディングス	10,900	713.00	7,771,700
テレビ朝日ホールディングス	26,000	1,509.00	39,234,000
スカパーJ S A Tホールディングス	91,800	436.00	40,024,800
テレビ東京ホールディングス	7,800	2,013.00	15,701,400
日本BS放送	3,800	1,105.00	4,199,000
ビジョン	18,600	982.00	18,265,200
スマートバリュー	3,100	503.00	1,559,300
USEN-NEXT HOLDINGS	10,300	2,540.00	26,162,000
ワイヤレスゲート	4,800	321.00	1,540,800
コネクシオ	7,700	1,401.00	10,787,700
クロップス	2,100	917.00	1,925,700
日本電信電話	1,130,100	3,266.00	3,690,906,600
KDDI	787,500	3,578.00	2,817,675,000
ソフトバンク	1,636,200	1,445.00	2,364,309,000
光通信	12,700	14,770.00	187,579,000
エムティーアイ	10,700	577.00	6,173,900
GMOインターネット	38,300	2,505.00	95,941,500
ファイバーゲート	3,600	1,118.00	4,024,800
アйдママーケティングコミュニケーション	2,700	287.00	774,900
KADOKAWA	59,000	2,489.00	146,851,000
学研ホールディングス	15,400	1,044.00	16,077,600
ゼンリン	17,700	991.00	17,540,700
昭文社ホールディングス	4,600	450.00	2,070,000
インプレスホールディングス	8,900	215.00	1,913,500
アイネット	5,600	1,290.00	7,224,000
松竹	7,200	11,980.00	86,256,000
東宝	63,800	4,555.00	290,609,000
東映	3,500	16,090.00	56,315,000
エヌ・ティ・ティ・データ	287,600	2,255.00	648,538,000
ピー・シー・エー	6,400	1,709.00	10,937,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,717.00	6,352,900
DTS	20,700	2,630.00	54,441,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,300	5,590.00	281,177,000
シーイーシー	11,700	1,076.00	12,589,200
カブコン	101,900	2,603.00	265,245,700
アイ・エス・ビー	5,200	944.00	4,908,800
ジャステック	6,400	1,050.00	6,720,000
SCSK	74,800	2,010.00	150,348,000
日本システムウエア	4,100	2,183.00	8,950,300
アイネス	9,900	1,543.00	15,275,700

TKC	18,300	3,045.00	55,723,500
富士ソフト	11,500	5,040.00	57,960,000
NSD	34,800	1,991.00	69,286,800
コナミホールディングス	39,300	5,930.00	233,049,000
福井コンピュータホールディングス	5,000	3,005.00	15,025,000
JBCホールディングス	7,400	1,667.00	12,335,800
ミロク情報サービス	9,600	1,206.00	11,577,600
ソフトバンクグループ	647,800	5,355.00	3,468,969,000
ハウスイ	900	812.00	730,800
高千穂交易	4,200	1,521.00	6,388,200
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,371.00	2,467,800
伊藤忠食品	2,600	5,000.00	13,000,000
エレマテック	8,700	1,047.00	9,108,900
JALUX	3,100	2,545.00	7,889,500
あらた	8,600	4,090.00	35,174,000
トーメンデバイス	1,600	6,430.00	10,288,000
東京エレクトロン デバイス	3,200	5,670.00	18,144,000
フィールズ	9,500	498.00	4,731,000
双日	119,800	1,795.00	215,041,000
アルフレッサ ホールディングス	120,500	1,616.00	194,728,000
横浜冷凍	30,400	847.00	25,748,800
ラサ商事	5,800	977.00	5,666,600
アルコニックス	13,500	1,301.00	17,563,500
神戸物産	84,200	3,660.00	308,172,000
ハイパー	2,700	485.00	1,309,500
あい ホールディングス	15,500	1,810.00	28,055,000
ディーブイエックス	3,700	1,028.00	3,803,600
ダイワボウホールディングス	52,700	1,690.00	89,063,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,900	2,479.00	64,206,100
ラクト・ジャパン	3,700	1,912.00	7,074,400
グリムス	4,800	2,122.00	10,185,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,900	799.00	15,101,100
八洲電機	7,800	980.00	7,644,000
メディアスホールディングス	6,200	864.00	5,356,800
レスターホールディングス	10,300	1,931.00	19,889,300
ジュテックホールディングス	2,500	1,215.00	3,037,500
大光	4,200	666.00	2,797,200
OCHIホールディングス	3,200	1,341.00	4,291,200
TOKAIホールディングス	52,500	867.00	45,517,500
黒谷	3,000	656.00	1,968,000
Cominix	1,900	728.00	1,383,200
三洋貿易	10,900	998.00	10,878,200

ビューティガレージ	1,800	2,940.00	5,292,000	
ウイン・パートナーズ	7,800	956.00	7,456,800	
ミタチ産業	3,000	969.00	2,907,000	
シップヘルスケアホールディングス	34,800	2,595.00	90,306,000	
明治電機工業	3,400	1,255.00	4,267,000	
デリカフーズホールディングス	4,200	571.00	2,398,200	
スターティアホールディングス	2,500	778.00	1,945,000	
コメダホールディングス	23,700	2,033.00	48,182,100	
ピーバンドットコム	1,500	580.00	870,000	
アセンテック	3,700	766.00	2,834,200	
富士興産	2,700	1,018.00	2,748,600	
協栄産業	1,100	1,687.00	1,855,700	
フルサト・マルカホールディングス	10,400	2,367.00	24,616,800	
ヤマエグループホールディングス	7,300	1,023.00	7,467,900	
小野建	10,500	1,639.00	17,209,500	
南陽	2,200	1,929.00	4,243,800	
佐島電機	6,800	928.00	6,310,400	
エコートレーディング	2,300	604.00	1,389,200	
伯東	6,600	2,459.00	16,229,400	
コンドーテック	8,400	1,028.00	8,635,200	
中山福	5,800	355.00	2,059,000	
ナガイレーベン	14,400	2,186.00	31,478,400	
三菱食品	10,400	2,807.00	29,192,800	
松田産業	7,900	2,340.00	18,486,000	
第一興商	20,600	3,300.00	67,980,000	
メディバルホールディングス	117,000	2,080.00	243,360,000	
S P K	4,300	1,309.00	5,628,700	
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	5,820.00	90,792,000	
スズデン	3,800	1,790.00	6,802,000	
尾家産業	2,900	1,009.00	2,926,100	
シモジマ	6,700	1,069.00	7,162,300	
ドウシシャ	10,200	1,525.00	15,555,000	
小津産業	2,400	1,932.00	4,636,800	
高速	6,500	1,521.00	9,886,500	
たけびし	4,100	1,436.00	5,887,600	
リックス	2,500	1,496.00	3,740,000	
丸文	9,600	780.00	7,488,000	
ハピネット	9,100	1,504.00	13,686,400	
橋本総業ホールディングス	2,200	1,973.00	4,340,600	
日本ライフライン	32,100	1,091.00	35,021,100	
タカショー	8,300	680.00	5,644,000	

I D O M	32,900	680.00	22,372,000
進和	6,400	2,103.00	13,459,200
エスケイジャパン	2,700	437.00	1,179,900
ダイترون	4,600	2,018.00	9,282,800
シークス	15,500	1,325.00	20,537,500
田中商事	3,400	632.00	2,148,800
オーハシテクニカ	6,000	1,359.00	8,154,000
白銅	3,500	2,651.00	9,278,500
ダイコー通産	1,300	1,141.00	1,483,300
伊藤忠商事	758,300	3,683.00	2,792,818,900
丸紅	1,069,500	1,160.00	1,240,620,000
高島	1,600	2,354.00	3,766,400
長瀬産業	59,500	1,834.00	109,123,000
蝶理	6,100	1,785.00	10,888,500
豊田通商	108,900	4,795.00	522,175,500
三共生興	14,400	570.00	8,208,000
兼松	40,400	1,268.00	51,227,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,320.00	2,376,000
三井物産	842,000	2,849.00	2,398,858,000
日本紙パルプ商事	5,700	3,995.00	22,771,500
カメイ	12,900	1,026.00	13,235,400
東都水産	600	3,960.00	2,376,000
O U Gホールディングス	1,600	2,702.00	4,323,200
スターゼン	8,000	2,024.00	16,192,000
山善	45,600	996.00	45,417,600
椿本興業	2,200	4,225.00	9,295,000
住友商事	684,300	1,752.50	1,199,235,750
内田洋行	4,600	4,600.00	21,160,000
三菱商事	812,400	3,868.00	3,142,363,200
第一実業	4,900	4,370.00	21,413,000
キャノンマーケティングジャパン	26,900	2,263.00	60,874,700
西華産業	5,700	1,584.00	9,028,800
佐藤商事	9,000	1,143.00	10,287,000
菱洋エレクトロ	6,400	2,334.00	14,937,600
東京産業	9,800	722.00	7,075,600
ユアサ商事	10,300	2,912.00	29,993,600
神鋼商事	2,400	3,350.00	8,040,000
トルク	5,900	202.00	1,191,800
阪和興業	21,700	3,205.00	69,548,500
正栄食品工業	7,000	3,960.00	27,720,000
カナデン	8,800	1,036.00	9,116,800
菱電商事	8,600	1,712.00	14,723,200

岩谷産業	26,000	5,730.00	148,980,000
ナイス	3,700	1,770.00	6,549,000
ニチモウ	1,600	2,575.00	4,120,000
極東貿易	3,100	2,599.00	8,056,900
アステナホールディングス	15,300	383.00	5,859,900
三愛石油	26,700	964.00	25,738,800
稲畑産業	23,900	1,715.00	40,988,500
G S I クレオス	5,200	1,186.00	6,167,200
明和産業	10,000	1,095.00	10,950,000
クワザワホールディングス	4,300	608.00	2,614,400
ワキタ	23,100	1,009.00	23,307,900
東邦ホールディングス	34,800	1,733.00	60,308,400
サンゲツ	28,700	1,597.00	45,833,900
ミツウロコグループホールディングス	16,000	1,093.00	17,488,000
シナネンホールディングス	4,000	3,115.00	12,460,000
伊藤忠エネクス	24,000	1,009.00	24,216,000
サンリオ	33,500	2,238.00	74,973,000
サンワテクノス	6,600	1,330.00	8,778,000
リョーサン	12,000	2,226.00	26,712,000
新光商事	16,300	875.00	14,262,500
トーヨー	4,900	1,070.00	5,243,000
三信電気	5,000	1,483.00	7,415,000
東陽テクニカ	10,700	1,072.00	11,470,400
モスフードサービス	14,200	3,015.00	42,813,000
加賀電子	9,800	2,995.00	29,351,000
ソーダニッカ	11,200	825.00	9,240,000
立花エレテック	8,700	1,553.00	13,511,100
フォーバル	4,800	873.00	4,190,400
P A L T A C	15,200	4,165.00	63,308,000
三谷産業	12,700	313.00	3,975,100
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,500	2,973.00	7,432,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,017.00	2,017,000
コア商事ホールディングス	8,200	600.00	4,920,000
国際紙パルプ商事	22,800	311.00	7,090,800
ヤマタネ	5,100	1,621.00	8,267,100
丸紅建材リース	1,000	1,772.00	1,772,000
日鉄物産	7,700	5,110.00	39,347,000
泉州電業	3,000	6,200.00	18,600,000
トラスコ中山	22,600	2,557.00	57,788,200
オートバックスセブン	36,500	1,390.00	50,735,000
モリト	7,900	695.00	5,490,500
加藤産業	15,700	3,260.00	51,182,000

北恵	2,800	850.00	2,380,000
イノテック	6,600	1,437.00	9,484,200
イエローハット	18,800	1,613.00	30,324,400
J Kホールディングス	8,700	1,091.00	9,491,700
日伝	9,000	2,243.00	20,187,000
北沢産業	7,400	233.00	1,724,200
杉本商事	5,100	2,194.00	11,189,400
因幡電機産業	28,900	2,675.00	77,307,500
東テク	3,600	2,462.00	8,863,200
ミスミグループ本社	136,100	3,840.00	522,624,000
アルテック	7,400	251.00	1,857,400
タキヒヨー	3,300	1,405.00	4,636,500
蔵王産業	2,100	1,791.00	3,761,100
スズケン	42,400	3,350.00	142,040,000
ジェコス	7,500	807.00	6,052,500
グローセル	12,700	412.00	5,232,400
ローソン	24,000	4,940.00	118,560,000
サンエー	8,300	4,100.00	34,030,000
カワチ薬品	8,500	2,216.00	18,836,000
エービーシー・マート	17,000	5,410.00	91,970,000
ハードオフコーポレーション	5,100	740.00	3,774,000
アスクル	17,700	1,372.00	24,284,400
ゲオホールディングス	14,700	1,173.00	17,243,100
アダストリア	11,800	1,657.00	19,552,600
くら寿司	11,400	3,395.00	38,703,000
キャンドウ	5,300	2,180.00	11,554,000
アイケイ	3,700	369.00	1,365,300
パルグループホールディングス	9,600	1,597.00	15,331,200
エディオン	50,000	1,078.00	53,900,000
サーラコーポレーション	22,400	631.00	14,134,400
ワッツ	5,600	696.00	3,897,600
ハローズ	5,000	2,799.00	13,995,000
フジオフードグループ本社	9,200	1,260.00	11,592,000
あみやき亭	2,700	2,905.00	7,843,500
大黒天物産	3,500	4,610.00	16,135,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,021.00	8,984,800
ファーマライズホールディングス	3,000	723.00	2,169,000
アルペン	8,400	2,002.00	16,816,800
ハブ	3,900	565.00	2,203,500
クオールホールディングス	13,500	1,316.00	17,766,000
ジーンズホールディングス	7,400	7,000.00	51,800,000
ビックカメラ	64,600	1,008.00	65,116,800

D C Mホールディングス	67,100	1,086.00	72,870,600
M o n o t a R O	137,200	1,958.00	268,637,600
東京一番フーズ	3,200	587.00	1,878,400
きちりホールディングス	2,900	363.00	1,052,700
アークランドサービスホールディングス	8,000	2,167.00	17,336,000
J . フロント リテイリング	129,700	1,028.00	133,331,600
ドトール・日レスホールディングス	18,900	1,568.00	29,635,200
マツキヨココカラ&カンパニー	66,700	3,905.00	260,463,500
ブロンコピリー	6,300	2,198.00	13,847,400
Z O Z O	74,600	2,856.00	213,057,600
トレジャー・ファクトリー	3,400	834.00	2,835,600
物語コーポレーション	5,800	6,190.00	35,902,000
三越伊勢丹ホールディングス	190,100	893.00	169,759,300
H a m e e	3,000	1,055.00	3,165,000
マーケットエンタープライズ	1,000	689.00	689,000
ウエルシアホールディングス	57,400	3,155.00	181,097,000
クリエイティブSDホールディングス	16,100	3,135.00	50,473,500
丸善C H Iホールディングス	12,700	359.00	4,559,300
ミサワ	2,600	711.00	1,848,600
ティーライフ	1,600	1,370.00	2,192,000
チムニー	3,300	1,156.00	3,814,800
シュッピン	9,200	1,181.00	10,865,200
オイシックス・ラ・大地	15,700	2,528.00	39,689,600
ネクステージ	22,000	2,899.00	63,778,000
ジョイフル本田	31,900	1,523.00	48,583,700
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,733.00	7,105,300
ホットランド	8,300	1,230.00	10,209,000
すかいらーくホールディングス	140,100	1,491.00	208,889,100
S F Pホールディングス	5,300	1,415.00	7,499,500
綿半ホールディングス	8,300	1,269.00	10,532,700
ヨシックスホールディングス	2,200	1,931.00	4,248,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,700	1,057.00	33,506,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,072.00	6,217,600
B E E N O S	5,600	1,921.00	10,757,600
あさひ	9,100	1,407.00	12,803,700
日本調剤	6,800	1,339.00	9,105,200
コスモス薬品	11,000	14,840.00	163,240,000
トーエル	5,500	841.00	4,625,500
セブン&アイ・ホールディングス	424,200	5,261.00	2,231,716,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	57,700	744.00	42,928,800
ツルハホールディングス	23,700	9,650.00	228,705,000

サンマルクホールディングス	8,700	1,484.00	12,910,800
フェリシモ	2,600	1,192.00	3,099,200
トリドールホールディングス	27,000	2,259.00	60,993,000
TOKYO BASE	10,300	467.00	4,810,100
ウイルプラスホールディングス	2,000	1,004.00	2,008,000
JMホールディングス	7,400	1,605.00	11,877,000
サツドラホールディングス	5,200	623.00	3,239,600
アレンザホールディングス	8,500	1,068.00	9,078,000
串カツ田中ホールディングス	3,000	2,099.00	6,297,000
パロックジャパンリミテッド	7,800	909.00	7,090,200
クスリのアオキホールディングス	10,800	6,830.00	73,764,000
力の源ホールディングス	5,500	550.00	3,025,000
FOOD & LIFE COMPANIES	63,500	3,440.00	218,440,000
メディカルシステムネットワーク	10,900	525.00	5,722,500
はるやまホールディングス	5,600	498.00	2,788,800
ノジマ	17,600	2,326.00	40,937,600
カップ・クリエイト	15,200	1,339.00	20,352,800
ライトオン	8,100	704.00	5,702,400
良品計画	124,900	1,561.00	194,968,900
三城ホールディングス	14,500	232.00	3,364,000
アドヴァングループ	11,300	977.00	11,040,100
アルビス	3,600	2,176.00	7,833,600
コナカ	12,800	345.00	4,416,000
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,670.00	2,505,000
G-7ホールディングス	12,200	1,434.00	17,494,800
イオン北海道	19,200	1,095.00	21,024,000
コジマ	19,100	531.00	10,142,100
ヒマラヤ	4,000	992.00	3,968,000
コーナン商事	15,500	3,390.00	52,545,000
エコス	4,100	1,988.00	8,150,800
ワタミ	13,100	890.00	11,659,000
マルシェ	2,600	406.00	1,055,600
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	216,900	1,538.00	333,592,200
西松屋チェーン	24,000	1,408.00	33,792,000
ゼンショーホールディングス	53,000	2,746.00	145,538,000
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,346.00	9,287,400
ハークスレイ	5,100	458.00	2,335,800
サイゼリヤ	16,200	2,611.00	42,298,200
VTホールディングス	41,300	458.00	18,915,400
魚力	3,100	2,003.00	6,209,300
フジ・コーポレーション	5,900	1,127.00	6,649,300

ユナイテッドアローズ	11,500	1,840.00	21,160,000
ハイデイ日高	15,800	1,659.00	26,212,200
YU-WA Creation Holdings	7,600	203.00	1,542,800
コロワイド	44,600	1,658.00	73,946,800
ピーシーデポコーポレーション	13,400	292.00	3,912,800
壱番屋	7,700	4,620.00	35,574,000
PLANT	3,100	690.00	2,139,000
スギホールディングス	21,700	6,960.00	151,032,000
薬王堂ホールディングス	5,500	2,292.00	12,606,000
スクロール	17,000	865.00	14,705,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,745.00	17,624,500
木曽路	14,600	2,213.00	32,309,800
SRSホールディングス	15,200	772.00	11,734,400
リテールパートナーズ	13,300	1,231.00	16,372,300
ケーヨー	20,200	857.00	17,311,400
上新電機	12,600	2,066.00	26,031,600
日本瓦斯	52,900	1,533.00	81,095,700
ロイヤルホールディングス	18,600	1,789.00	33,275,400
いなげや	13,500	1,388.00	18,738,000
チヨダ	10,900	763.00	8,316,700
ライフコーポレーション	10,200	3,095.00	31,569,000
リンガーハット	13,400	2,239.00	30,002,600
MrMaxHD	13,900	605.00	8,409,500
AOKIホールディングス	21,400	604.00	12,925,600
オークワ	17,200	911.00	15,669,200
コメリ	16,800	2,547.00	42,789,600
青山商事	22,800	685.00	15,618,000
しまむら	12,600	10,240.00	129,024,000
はせがわ	6,800	284.00	1,931,200
高島屋	79,100	1,076.00	85,111,600
松屋	22,000	725.00	15,950,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,500	796.00	40,994,000
近鉄百貨店	4,200	2,650.00	11,130,000
丸井グループ	85,600	2,167.00	185,495,200
アクシアル リテイリング	8,500	3,250.00	27,625,000
イオン	417,200	2,518.00	1,050,509,600
イズミ	19,600	3,180.00	62,328,000
平和堂	20,100	1,907.00	38,330,700
フジ	13,200	1,888.00	24,921,600
ヤオコー	12,300	6,590.00	81,057,000
ゼビオホールディングス	15,000	897.00	13,455,000
ケースホールディングス	100,200	1,122.00	112,424,400

Olympicグループ	6,000	699.00	4,194,000
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	1,058.00	2,539,200
Genky DrugStores	4,800	4,200.00	20,160,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,700	1,168.00	3,153,600
ブックオフグループホールディングス	6,300	1,019.00	6,419,700
ギフト	1,800	2,380.00	4,284,000
アインホールディングス	15,800	5,770.00	91,166,000
元気寿司	3,100	2,462.00	7,632,200
ヤマダホールディングス	397,100	394.00	156,457,400
アークランドサカモト	17,100	1,578.00	26,983,800
ニトリホールディングス	43,000	17,295.00	743,685,000
グルメ杵屋	8,900	985.00	8,766,500
愛眼	7,900	177.00	1,398,300
ケーユーホールディングス	5,900	982.00	5,793,800
吉野家ホールディングス	37,900	2,411.00	91,376,900
松屋フーズホールディングス	5,300	3,580.00	18,974,000
サガミホールディングス	16,800	1,048.00	17,606,400
関西スーパーマーケット	8,400	1,033.00	8,677,200
王将フードサービス	7,200	5,900.00	42,480,000
プレナス	12,300	1,991.00	24,489,300
ミニストップ	8,100	1,463.00	11,850,300
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	2,187.00	52,706,700
ベルク	4,900	5,440.00	26,656,000
大庄	6,000	1,007.00	6,042,000
ファーストリテイリング	14,500	68,180.00	988,610,000
サンドラッグ	40,900	2,893.00	118,323,700
サックスパーホールディングス	10,700	521.00	5,574,700
ヤマザワ	2,700	1,602.00	4,325,400
やまや	2,200	2,428.00	5,341,600
ベルーナ	23,600	726.00	17,133,600
島根銀行	3,500	554.00	1,939,000
じもとホールディングス	7,700	665.00	5,120,500
めぶきフィナンシャルグループ	564,200	255.00	143,871,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,600	1,577.00	21,447,200
九州フィナンシャルグループ	221,700	442.00	97,991,400
ゆうちょ銀行	256,300	1,116.00	286,030,800
富山第一銀行	25,900	306.00	7,925,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	620,100	469.00	290,826,900
西日本フィナンシャルホールディングス	70,900	798.00	56,578,200
三十三フィナンシャルグループ	10,100	1,515.00	15,301,500

第四北越フィナンシャルグループ	17,700	2,600.00	46,020,000
ひろぎんホールディングス	160,100	700.00	112,070,000
おきなわフィナンシャルグループ	9,800	2,265.00	22,197,000
十六フィナンシャルグループ	14,600	2,259.00	32,981,400
北國フィナンシャルホールディングス	10,100	2,886.00	29,148,600
新生銀行	70,800	2,119.00	150,025,200
あおぞら銀行	60,600	2,584.00	156,590,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,809,100	685.80	4,669,680,780
りそなホールディングス	1,242,700	489.00	607,680,300
三井住友トラスト・ホールディングス	205,200	4,031.00	827,161,200
三井住友フィナンシャルグループ	751,500	4,169.00	3,133,003,500
千葉銀行	362,300	728.00	263,754,400
群馬銀行	208,600	373.00	77,807,800
武蔵野銀行	16,200	1,829.00	29,629,800
千葉興業銀行	25,500	276.00	7,038,000
筑波銀行	42,300	185.00	7,825,500
七十七銀行	34,100	1,393.00	47,501,300
青森銀行	8,400	1,901.00	15,968,400
秋田銀行	7,000	1,711.00	11,977,000
山形銀行	12,200	921.00	11,236,200
岩手銀行	7,100	1,920.00	13,632,000
東邦銀行	90,600	213.00	19,297,800
東北銀行	5,200	1,014.00	5,272,800
みちのく銀行	7,000	866.00	6,062,000
ふくおかフィナンシャルグループ	91,500	2,196.00	200,934,000
静岡銀行	264,400	899.00	237,695,600
スルガ銀行	95,200	499.00	47,504,800
八十二銀行	244,600	409.00	100,041,400
山梨中央銀行	11,800	924.00	10,903,200
大垣共立銀行	21,400	1,993.00	42,650,200
福井銀行	9,300	1,393.00	12,954,900
清水銀行	4,500	1,595.00	7,177,500
富山銀行	2,000	1,924.00	3,848,000
滋賀銀行	20,400	2,168.00	44,227,200
南都銀行	16,900	1,922.00	32,481,800
百五銀行	104,200	351.00	36,574,200
京都銀行	38,900	5,400.00	210,060,000
紀陽銀行	38,300	1,425.00	54,577,500
ほくほくフィナンシャルグループ	67,800	900.00	61,020,000
山陰合同銀行	64,400	639.00	41,151,600
中国銀行	86,800	929.00	80,637,200
鳥取銀行	3,500	1,166.00	4,081,000

伊予銀行	143,900	586.00	84,325,400
百十四銀行	11,500	1,572.00	18,078,000
四国銀行	16,500	790.00	13,035,000
阿波銀行	16,600	2,222.00	36,885,200
大分銀行	6,200	1,931.00	11,972,200
宮崎銀行	6,800	2,083.00	14,164,400
佐賀銀行	6,100	1,493.00	9,107,300
琉球銀行	23,600	788.00	18,596,800
セブン銀行	322,400	245.00	78,988,000
みずほフィナンシャルグループ	1,388,500	1,585.50	2,201,466,750
高知銀行	3,900	756.00	2,948,400
山口フィナンシャルグループ	126,500	704.00	89,056,000
長野銀行	3,600	1,217.00	4,381,200
名古屋銀行	8,100	2,940.00	23,814,000
北洋銀行	163,700	250.00	40,925,000
愛知銀行	3,900	4,725.00	18,427,500
中京銀行	3,900	1,759.00	6,860,100
大光銀行	3,700	1,363.00	5,043,100
愛媛銀行	15,200	895.00	13,604,000
トマト銀行	3,900	1,053.00	4,106,700
京葉銀行	46,300	470.00	21,761,000
栃木銀行	52,400	221.00	11,580,400
北日本銀行	3,400	1,600.00	5,440,000
東和銀行	19,100	539.00	10,294,900
福島銀行	12,400	249.00	3,087,600
大東銀行	5,200	744.00	3,868,800
トモニホールディングス	83,900	325.00	27,267,500
フィデアホールディングス	9,900	1,393.00	13,790,700
池田泉州ホールディングス	124,900	180.00	22,482,000
F P G	36,700	667.00	24,478,900
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,500	1,085.00	9,222,500
マーキュリアホールディングス	4,500	523.00	2,353,500
S B I ホールディングス	134,000	3,040.00	407,360,000
ジャフコ グループ	13,800	6,010.00	82,938,000
大和証券グループ本社	813,300	699.50	568,903,350
野村ホールディングス	1,657,900	512.40	849,507,960
岡三証券グループ	85,700	384.00	32,908,800
丸三証券	32,500	535.00	17,387,500
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	125,000	407.00	50,875,000
光世証券	2,500	495.00	1,237,500
水戸証券	29,400	281.00	8,261,400

いちよし証券	20,500	680.00	13,940,000
松井証券	53,300	798.00	42,533,400
マネックスグループ	88,700	598.00	53,042,600
極東証券	14,700	754.00	11,083,800
岩井コスモホールディングス	10,300	1,373.00	14,141,900
アイザワ証券グループ	18,000	954.00	17,172,000
マネーパートナーズグループ	12,100	220.00	2,662,000
スパークス・グループ	50,500	267.00	13,483,500
かんぽ生命保険	109,300	2,033.00	222,206,900
S O M P Oホールディングス	178,200	5,297.00	943,925,400
アニコム ホールディングス	33,300	692.00	23,043,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	243,500	3,952.00	962,312,000
第一生命ホールディングス	534,400	2,562.50	1,369,400,000
東京海上ホールディングス	357,600	6,789.00	2,427,746,400
T & Dホールディングス	281,800	1,666.00	469,478,800
アドバンスクリエイト	5,200	1,033.00	5,371,600
全国保証	25,900	5,280.00	136,752,000
あんしん保証	4,300	282.00	1,212,600
イントラスト	5,000	701.00	3,505,000
日本モーゲージサービス	6,300	1,102.00	6,942,600
C a s a	4,100	889.00	3,644,900
アルヒ	16,300	1,151.00	18,761,300
プレミアグループ	5,500	3,460.00	19,030,000
クレディセゾン	70,000	1,286.00	90,020,000
芙蓉総合リース	11,400	7,670.00	87,438,000
みずほリース	16,800	3,190.00	53,592,000
東京センチュリー	21,100	5,740.00	121,114,000
日本証券金融	42,900	919.00	39,425,100
アイフル	183,000	343.00	62,769,000
リコーリース	9,700	3,740.00	36,278,000
イオンフィナンシャルサービス	59,300	1,213.00	71,930,900
アコム	215,000	326.00	70,090,000
ジャックス	12,100	3,120.00	37,752,000
オリエントコーポレーション	296,000	128.00	37,888,000
オリックス	659,300	2,472.50	1,630,119,250
三菱HCキャピタル	401,600	600.00	240,960,000
九州リースサービス	5,800	591.00	3,427,800
日本取引所グループ	275,100	2,348.00	645,934,800
イー・ギャランティ	16,100	1,893.00	30,477,300
アサックス	6,000	697.00	4,182,000
N E Cキャピタルソリューション	4,600	2,026.00	9,319,600
いちご	124,000	292.00	36,208,000

日本駐車場開発	125,300	134.00	16,790,200
スター・マイカ・ホールディングス	6,500	1,326.00	8,619,000
S R Eホールディングス	2,800	4,865.00	13,622,000
A Dワークスグループ	22,000	137.00	3,014,000
ヒューリック	260,100	1,067.00	277,526,700
三栄建築設計	4,900	1,566.00	7,673,400
野村不動産ホールディングス	56,500	2,660.00	150,290,000
三重交通グループホールディングス	23,800	470.00	11,186,000
サムティ	17,900	2,136.00	38,234,400
ディア・ライフ	15,600	526.00	8,205,600
地主	7,400	1,705.00	12,617,000
プレサンスコーポレーション	14,600	2,107.00	30,762,200
ハウスコム	2,600	1,230.00	3,198,000
日本管理センター	6,100	971.00	5,923,100
サンセイランディック	4,300	808.00	3,474,400
フージャースホールディングス	13,900	688.00	9,563,200
オープンハウスグループ	34,600	5,850.00	202,410,000
東急不動産ホールディングス	321,200	663.00	212,955,600
飯田グループホールディングス	90,900	2,292.00	208,342,800
イーランド	2,300	1,407.00	3,236,100
ムゲンエステート	8,500	484.00	4,114,000
A n d D oホールディングス	5,300	845.00	4,478,500
シーアールイー	3,500	1,674.00	5,859,000
ケイアイスター不動産	5,000	7,310.00	36,550,000
グッドコムアセット	5,500	1,074.00	5,907,000
ジェイ・エス・ビー	2,500	2,950.00	7,375,000
テンポイノベーション	4,000	830.00	3,320,000
フェイスネットワーク	1,800	1,273.00	2,291,400
パーク24	58,800	1,730.00	101,724,000
パラカ	3,400	1,587.00	5,395,800
三井不動産	495,300	2,369.00	1,173,365,700
三菱地所	713,900	1,656.00	1,182,218,400
平和不動産	18,800	3,925.00	73,790,000
東京建物	107,700	1,689.00	181,905,300
京阪神ビルディング	17,800	1,465.00	26,077,000
住友不動産	228,100	3,492.00	796,525,200
テーオーシー	20,900	718.00	15,006,200
東京楽天地	2,000	3,905.00	7,810,000
スターツコーポレーション	15,100	2,489.00	37,583,900
フジ住宅	13,900	670.00	9,313,000
空港施設	12,500	569.00	7,112,500
明和地所	6,700	607.00	4,066,900

ゴールドクレスト	9,100	1,623.00	14,769,300
エスリード	4,700	1,719.00	8,079,300
日神グループホールディングス	19,400	502.00	9,738,800
日本エスコン	20,200	761.00	15,372,200
タカラレーベン	45,500	300.00	13,650,000
A V A N T I A	6,600	841.00	5,550,600
イオンモール	55,000	1,652.00	90,860,000
毎日コムネット	4,900	696.00	3,410,400
ファースト住建	4,800	1,197.00	5,745,600
カチタス	27,100	3,655.00	99,050,500
トーセイ	15,800	1,077.00	17,016,600
穴吹興産	2,800	1,907.00	5,339,600
サンフロンティア不動産	15,900	1,046.00	16,631,400
F Jネクストホールディングス	11,500	985.00	11,327,500
インテリックス	2,400	632.00	1,516,800
ランドビジネス	4,600	258.00	1,186,800
サンネクスタグループ	4,400	1,033.00	4,545,200
グランディハウス	9,200	492.00	4,526,400
日本空港ビルデング	41,600	4,910.00	204,256,000
明豊ファシリティワークス	5,000	798.00	3,990,000
日本工営	6,200	3,040.00	18,848,000
L I F U L L	32,900	223.00	7,336,700
ミクシィ	24,200	2,142.00	51,836,400
ジェイエシーリクルートメント	8,600	1,982.00	17,045,200
日本M & Aセンターホールディングス	172,600	2,107.00	363,668,200
メンバーズ	3,200	2,172.00	6,950,400
中広	2,200	378.00	831,600
UTグループ	15,200	3,375.00	51,300,000
アイティメディア	5,100	1,539.00	7,848,900
E・Jホールディングス	5,700	1,136.00	6,475,200
夢真ビーネックスグループ	28,100	1,593.00	44,763,300
コシダカホールディングス	28,400	607.00	17,238,800
アルトナー	2,800	904.00	2,531,200
パソナグループ	11,500	2,655.00	30,532,500
C D S	2,700	1,607.00	4,338,900
リンクアンドモチベーション	23,200	475.00	11,020,000
エス・エム・エス	35,800	3,345.00	119,751,000
サニーサイドアップグループ	3,900	710.00	2,769,000
パーソルホールディングス	105,200	3,010.00	316,652,000
リニカル	6,200	652.00	4,042,400
クックパッド	33,800	265.00	8,957,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,400	586.00	3,164,400

学情	4,400	1,018.00	4,479,200
スタジオアリス	4,800	2,148.00	10,310,400
シミックホールディングス	5,900	1,473.00	8,690,700
エプロ	2,500	742.00	1,855,000
N J S	2,400	1,958.00	4,699,200
総合警備保障	41,900	4,355.00	182,474,500
カカクコム	77,200	2,535.00	195,702,000
アイロムグループ	3,800	1,559.00	5,924,200
セントケア・ホールディング	7,100	768.00	5,452,800
サイネックス	2,100	594.00	1,247,400
ルネサンス	7,500	1,035.00	7,762,500
ディップ	18,500	3,600.00	66,600,000
デジタルホールディングス	7,500	1,312.00	9,840,000
新日本科学	12,900	1,242.00	16,021,800
キャリアデザインセンター	2,800	940.00	2,632,000
ベネフィット・ワン	38,300	3,745.00	143,433,500
エムスリー	185,600	4,576.00	849,305,600
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	272.00	1,822,400
アウトソーシング	60,400	1,419.00	85,707,600
ウェルネット	11,000	430.00	4,730,000
ワールドホールディングス	4,300	2,340.00	10,062,000
ディー・エヌ・エー	40,200	1,803.00	72,480,600
博報堂D Yホールディングス	146,600	1,902.00	278,833,200
ぐるなび	17,700	391.00	6,920,700
タカミヤ	13,200	396.00	5,227,200
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	881.00	6,255,100
ファンコミュニケーションズ	26,800	381.00	10,210,800
ライク	2,900	1,846.00	5,353,400
ビジネス・ブレークスルー	4,400	413.00	1,817,200
エスプール	29,900	1,130.00	33,787,000
W D Bホールディングス	4,900	2,779.00	13,617,100
手間いらず	1,400	4,605.00	6,447,000
ティア	6,600	443.00	2,923,800
C D G	1,300	1,356.00	1,762,800
アドウェイズ	15,900	770.00	12,243,000
バリューコマース	8,300	3,680.00	30,544,000
インフォマート	115,500	744.00	85,932,000
J Pホールディングス	27,800	229.00	6,366,200
エコナックホールディングス	21,200	89.00	1,886,800
C Lホールディングス	2,400	1,239.00	2,973,600
プレステージ・インターナショナル	39,700	700.00	27,790,000
アミューズ	5,800	2,065.00	11,977,000

ドリームインキュベータ	3,100	1,755.00	5,440,500
クイック	7,300	1,298.00	9,475,400
T A C	6,600	211.00	1,392,600
電通グループ	108,500	4,140.00	449,190,000
イオンファンタジー	4,200	1,866.00	7,837,200
シーティーエス	12,100	772.00	9,341,200
ネクシィーズグループ	4,000	724.00	2,896,000
H . U . グループホールディングス	27,600	2,937.00	81,061,200
アルプス技研	9,400	1,845.00	17,343,000
ダイオーズ	2,300	994.00	2,286,200
日本空調サービス	11,200	789.00	8,836,800
オリエンタルランド	124,300	18,885.00	2,347,405,500
ダスキン	24,500	2,731.00	66,909,500
明光ネットワークジャパン	12,700	563.00	7,150,100
ファルコホールディングス	5,100	2,047.00	10,439,700
ラウンドワン	29,500	1,372.00	40,474,000
リゾートトラスト	48,300	1,869.00	90,272,700
ビー・エム・エル	13,600	3,670.00	49,912,000
りらいあコミュニケーションズ	16,100	1,002.00	16,132,200
リソー教育	48,500	402.00	19,497,000
早稲田アカデミー	6,000	1,043.00	6,258,000
ユー・エス・エス	117,900	1,902.00	224,245,800
東京個別指導学院	9,600	591.00	5,673,600
サイバーエージェント	259,400	1,778.00	461,213,200
楽天グループ	540,600	1,070.00	578,442,000
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,789.00	10,018,400
モーニングスター	18,700	616.00	11,519,200
テー・オー・ダブリュー	19,000	303.00	5,757,000
山田コンサルティンググループ	5,600	1,040.00	5,824,000
セントラルスポーツ	4,000	2,412.00	9,648,000
フルキャストホールディングス	9,000	2,123.00	19,107,000
エン・ジャパン	17,100	2,836.00	48,495,600
リソルホールディングス	1,200	4,320.00	5,184,000
テクノプロ・ホールディングス	63,000	3,065.00	193,095,000
アトラグループ	2,300	265.00	609,500
インターワークス	3,500	386.00	1,351,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	5,490.00	26,901,000
K e e P e r 技研	6,900	1,823.00	12,578,700
ファーストロジック	2,300	785.00	1,805,500
三機サービス	2,200	967.00	2,127,400
G u n o s y	6,900	745.00	5,140,500
デザインワン・ジャパン	3,600	194.00	698,400

イー・ガーディアン	4,300	2,833.00	12,181,900
リブセンス	6,900	178.00	1,228,200
ジャパンマテリアル	32,400	1,708.00	55,339,200
ベクトル	14,900	1,063.00	15,838,700
ウチヤマホールディングス	5,800	310.00	1,798,000
チャーム・ケア・コーポレーション	8,000	1,244.00	9,952,000
キャリアリンク	4,000	1,710.00	6,840,000
I B J	8,800	762.00	6,705,600
アサンテ	4,800	1,682.00	8,073,600
バリューHR	4,300	2,438.00	10,483,400
M & Aキャピタルパートナーズ	8,700	4,910.00	42,717,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,477.00	6,203,400
E R Iホールディングス	3,100	1,157.00	3,586,700
アビスト	1,700	2,930.00	4,981,000
シグマクシス・ホールディングス	6,400	2,239.00	14,329,600
ウィルグループ	7,900	1,260.00	9,954,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,200	178.00	2,705,600
メドピア	8,200	3,055.00	25,051,000
レアジョブ	2,200	791.00	1,740,200
リクルートホールディングス	811,500	5,956.00	4,833,294,000
エラン	14,700	1,002.00	14,729,400
土木管理総合試験所	5,500	319.00	1,754,500
ネットマーケティング	5,600	417.00	2,335,200
日本郵政	1,373,800	976.70	1,341,790,460
ベルシステム24ホールディングス	15,300	1,437.00	21,986,100
鎌倉新書	12,300	527.00	6,482,100
S M N	2,600	600.00	1,560,000
グローバルキッズCOMPANY	2,200	813.00	1,788,600
エアトリ	6,900	2,710.00	18,699,000
アトラエ	7,400	1,805.00	13,357,000
ストライク	4,000	4,605.00	18,420,000
ソラスト	26,000	1,043.00	27,118,000
セラク	3,400	1,200.00	4,080,000
インソース	10,300	2,103.00	21,660,900
ベイカレント・コンサルティング	7,400	42,950.00	317,830,000
Orchestra Holdings	2,100	2,800.00	5,880,000
アイモバイル	3,100	1,157.00	3,586,700
キャリアインデックス	3,800	757.00	2,876,600
MS - Japan	4,500	846.00	3,807,000
船場	2,400	737.00	1,768,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	33,500	1,682.00	56,347,000
フルテック	1,600	1,365.00	2,184,000

GameWith	3,500	443.00	1,550,500
ソウルドアウト	2,700	1,035.00	2,794,500
MS&Consulting	1,800	671.00	1,207,800
ウェルビー	7,000	1,183.00	8,281,000
エル・ティー・エス	1,400	2,457.00	3,439,800
ミダックホールディングス	4,600	2,830.00	13,018,000
日総工産	8,400	829.00	6,963,600
キュービーネットホールディングス	4,900	1,696.00	8,310,400
RPAホールディングス	15,300	339.00	5,186,700
スプリックス	3,100	1,471.00	4,560,100
マネジメントソリューションズ	5,200	3,295.00	17,134,000
プロレド・パートナーズ	2,500	869.00	2,172,500
テノ・ホールディングス	1,600	634.00	1,014,400
フロンティア・マネジメント	3,000	664.00	1,992,000
ピアラ	2,000	586.00	1,172,000
コプロ・ホールディングス	2,200	1,136.00	2,499,200
ギークス	1,900	1,467.00	2,787,300
カーブスホールディングス	29,100	705.00	20,515,500
フォーラムエンジニアリング	7,500	839.00	6,292,500
ダイレクトマーケティングミックス	12,200	1,379.00	16,823,800
ポピンズホールディングス	2,500	2,544.00	6,360,000
LITALICO	8,600	3,070.00	26,402,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,600	690.00	3,864,000
リログループ	57,600	2,073.00	119,404,800
東祥	8,000	1,436.00	11,488,000
TREホールディングス	14,500	1,487.00	21,561,500
人・夢・技術グループ	4,300	1,814.00	7,800,200
エイチ・アイ・エス	23,500	1,916.00	45,026,000
ラックランド	3,100	2,830.00	8,773,000
共立メンテナンス	18,800	4,045.00	76,046,000
イチネンホールディングス	10,900	1,282.00	13,973,800
建設技術研究所	6,400	2,483.00	15,891,200
スペース	7,700	907.00	6,983,900
燦ホールディングス	4,700	1,551.00	7,289,700
スバル興業	700	8,570.00	5,999,000
東京テアトル	4,100	1,214.00	4,977,400
タナベ経営	4,300	638.00	2,743,400
ナガワ	3,400	10,160.00	34,544,000
東京都競馬	7,900	4,210.00	33,259,000
カナモト	18,600	2,303.00	42,835,800
西尾レントオール	9,800	2,770.00	27,146,000
トランス・コスモス	13,400	3,070.00	41,138,000

乃村工藝社	45,300	1,002.00	45,390,600	
藤田観光	4,600	2,273.00	10,455,800	
KNT-CTホールディングス	6,500	1,352.00	8,788,000	
日本管財	11,300	2,854.00	32,250,200	
トーカイ	9,300	1,942.00	18,060,600	
セコム	103,700	8,010.00	830,637,000	
セントラル警備保障	5,100	2,323.00	11,847,300	
丹青社	21,800	759.00	16,546,200	
メイテック	12,700	6,690.00	84,963,000	
応用地質	11,900	2,140.00	25,466,000	
船井総研ホールディングス	21,600	2,504.00	54,086,400	
進学会ホールディングス	4,100	303.00	1,242,300	
オオバ	7,600	750.00	5,700,000	
いであ	2,900	1,726.00	5,005,400	
学究社	3,500	1,564.00	5,474,000	
ベネッセホールディングス	35,100	2,281.00	80,063,100	
イオンディライト	13,000	3,125.00	40,625,000	
ナック	5,200	953.00	4,955,600	
ダイセキ	19,400	4,625.00	89,725,000	
ステップ	3,900	1,867.00	7,281,300	
合 計	119,417,900		290,353,066,160	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期中間計算期間(2022年1月25日から2022年7月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2022年 1月24日現在)	第21期中間計算期間 (2022年 7月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,680,594	2,228,322
親投資信託受益証券	664,537,394	648,381,651
未収入金	1,580,194	19,499
流動資産合計	668,798,182	650,629,472
資産合計	668,798,182	650,629,472
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,786,112	-
未払受託者報酬	272,718	247,667
未払委託者報酬	1,869,999	1,698,203
未払利息	3	1
流動負債合計	3,928,832	1,945,871
負債合計	3,928,832	1,945,871
純資産の部		
元本等		
元本	261,214,283	248,748,740
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	403,655,067	399,934,861
(分配準備積立金)	187,375,572	168,525,932
元本等合計	664,869,350	648,683,601
純資産合計	664,869,350	648,683,601
負債純資産合計	668,798,182	650,629,472

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 自 2021年 1月23日 至 2021年 7月22日	第21期中間計算期間 自 2022年 1月25日 至 2022年 7月24日
営業収益		
受取利息	-	3
有価証券売買等損益	24,312,965	16,970,399
営業収益合計	24,312,965	16,970,402
営業費用		
支払利息	200	138
受託者報酬	257,337	247,667
委託者報酬	1,764,516	1,698,203
営業費用合計	2,022,053	1,946,008
営業利益又は営業損失（ ）	22,290,912	15,024,394
経常利益又は経常損失（ ）	22,290,912	15,024,394
中間純利益又は中間純損失（ ）	22,290,912	15,024,394
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,877,150	672,180
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	378,505,761	403,655,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,536,887	22,906,760
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,536,887	22,906,760
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,161,469	42,323,540
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,161,469	42,323,540
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	397,294,941	399,934,861

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 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。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月23日から翌年1月22日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第21期中間計算期間は2022年 1月25日から2022年 7月24日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第20期 (2022年 1月24日現在)	第21期中間計算期間 (2022年 7月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,214,283口	248,748,740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) 2.5453円 (25,453円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6078円 (26,078円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第21期中間計算期間 (2022年 7月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第21期中間計算期間 (2022年 7月24日現在)
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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> <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>

（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20期 自 2021年 1月23日 至 2022年 1月24日	第21期中間計算期間 自 2022年 1月25日 至 2022年 7月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	268,078,999円	261,214,283円
期中追加設定元本額	36,855,417円	15,020,184円
期中一部解約元本額	43,720,133円	27,485,727円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2022年 7月24日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,533,898,911
株式	301,680,156,560
派生商品評価勘定	56,300,200
未収入金	759,455,687
未収配当金	427,692,309
差入委託証拠金	61,669,000
流動資産合計	304,519,172,667
資産合計	304,519,172,667
負債の部	
流動負債	
前受金	56,318,900
未払解約金	441,786,229
未払利息	582
流動負債合計	498,105,711
負債合計	498,105,711
純資産の部	
元本等	
元本	135,526,462,708
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	168,494,604,248
元本等合計	304,021,066,956
純資産合計	304,021,066,956
負債純資産合計	304,519,172,667

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月24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。

	2022年 7月24日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 7月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,526,462,708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 2.2433円 (1万口当たり純資産額) (22,433円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月25日
期首元本額	133,845,048,512円
期中追加設定元本額	5,686,952,556円
期中一部解約元本額	4,005,538,360円
期末元本額	135,526,462,708円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	614,362,979円
D C日本株式インデックスファンド	289,030,291円
D C日本株式インデックスファンドL	53,941,999,167円
D C日本株式インデックスファンドA	665,272,268円
D Cバランスファンド3 0	2,433,279,477円
D Cバランスファンド5 0	3,810,389,229円
D Cバランスファンド7 0	2,315,477,173円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	576,228,395円
日本株式インデックスe	1,454,680,691円
インデックスコレクション（国内株式）	21,392,203,916円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	12,363,511,858円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	2,970,071,322円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	2,703,648,644円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,503,627,454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）	2,747,076,401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）	943,303,954円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	47,354,650円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	530,435,125円
VAバランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	65,889,800円
VAバランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	133,317,989円
VAバランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	87,710,306円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	675,977,645円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	416,816,300円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	7,277,671,388円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	700,101,603円
VAバランスファンド（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	67,576,872円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	1,188,492,618円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	24,764,450円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	144,874,181円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,900,184,826円
VAバランスファンド2（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	52,171,958円

区分	2022年 7月24日現在
V A バランス 5 0 - 5 0 (適格機関投資家専用)	53,497,721円
V A ファンド 2 5 (適格機関投資家専用)	20,318,789円
バランスファンド V A 2 (適格機関投資家専用)	586,145,334円
バランス V A 2 5 L (適格機関投資家専用)	262,078,380円
バランスファンド V A 3 (適格機関投資家専用)	4,326,926,745円
世界バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	81,448,785円
国内バランス V A 3 0 (適格機関投資家専用)	34,041,302円
国内バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	8,081,091円
V A バランス 2 0 - 8 0 (適格機関投資家専用)	114,113,728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)	2,307,903円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2022年 7月24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	1,999,056,100	-	2,055,375,000	56,318,900
合計		1,999,056,100	-	2,055,375,000	56,318,900

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

(2022年 8月31日現在)

資産総額	652,760,003円
負債総額	6,703,505円
純資産総額（ - ）	646,056,498円
発行済口数	246,915,636口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6165円
（1万口当たり純資産額）	（26,165円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 8月31日現在)

資産総額	304,753,995,657円
負債総額	87,764,422円
純資産総額（ - ）	304,666,231,235円
発行済口数	135,276,250,663口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2522円
（1万口当たり純資産額）	（22,522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 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[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10月24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8月31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	539	14,041,250
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	221,703
単位型公社債投資信託	51	216,636
合計	660	14,479,589

3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位：百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
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	500	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	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

注記事項

（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

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づ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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、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事業年度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、退職給付に係る当事業年度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」という。）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。

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

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「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）等を当事業年度の期首から適用し、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」等の適用

「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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「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 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

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、退職給付に係る事業年度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、当事業年度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。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
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

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

2022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
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022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 8 . 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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、「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。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
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)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(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。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	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)	-	196	-	196
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	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(*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) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(*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) 時価をもって貸借対照表計上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、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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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（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

当事業年度（2022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	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

（有価証券関係）

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）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（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）上記取引の評価損益は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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式				
	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	

当事業年度（2022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	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は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	17,197	-	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は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	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 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

(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従来簡便法により、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したが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820
退職給付引当金	626	820
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626	820

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
簡便法で計算した退職給付費用	77	8

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

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92百万円、当事業年度100百万円であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	107 百万円	112 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170 "	177 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	191 "	251 "
税務上の収益認識差額	71 "	74 "
税務上の費用認識差額	-	439
繰延ヘッジ損益	28 "	224 "
その他	123 "	76 "
繰延税金資産 合計	693 "	1,357 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	349 "	415 "
その他	32 "	34 "
繰延税金負債 合計	382 "	450 "
繰延税金資産の純額	311 "	907 "

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。

(収益認識関係)

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事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降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〕

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 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(*)	6,372百万円

(*)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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(*)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〕

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。

〔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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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（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）

当事業年度（2022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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年10月24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（2022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） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2022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みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類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。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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3月24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の2021年1月23日から2022年1月24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の2022年1月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドの2022年1月25日から2022年7月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドの2022年7月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年1月25日から2022年7月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。