

【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】	2023年2月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C 日本株式インデックス・オープンS
【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・オープンS

（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】

2023年 3月 1日から2023年 8月29日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3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、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及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品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。

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、わが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指します。

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

(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。

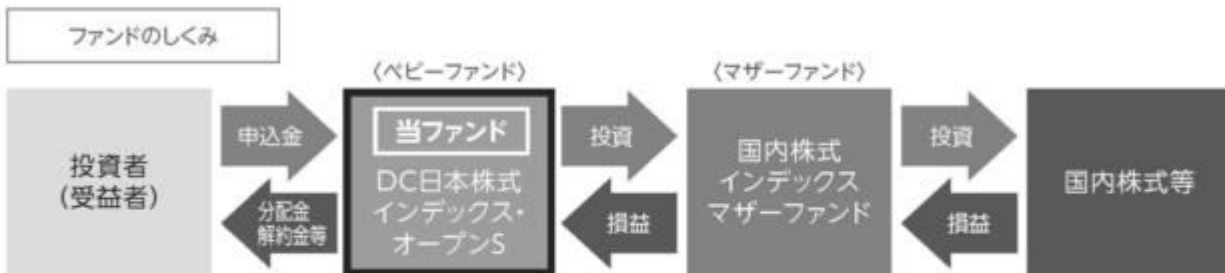
[特殊型]

- (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>

1. わが国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。



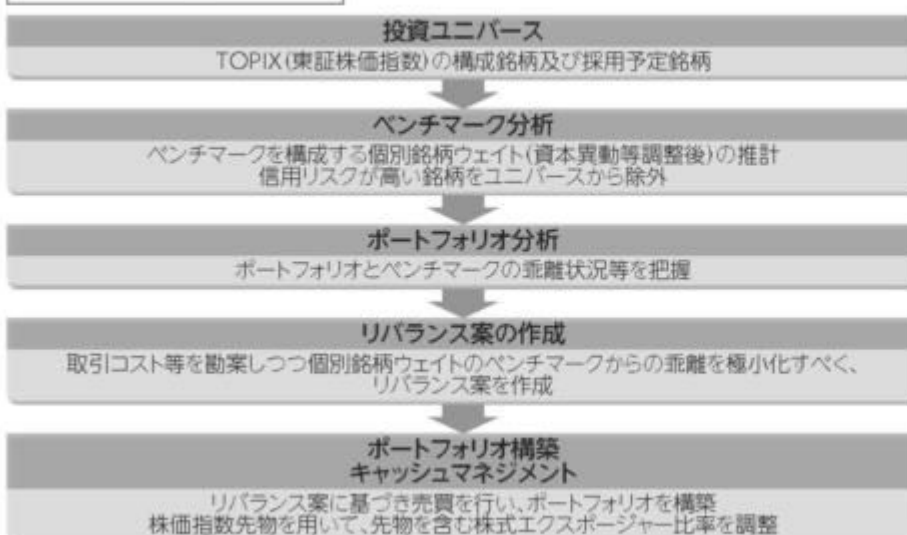
? ファミリーファンド方式とは

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。

<マザーファンドの概要>

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場している株式	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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。

2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。



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。

同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。

「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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

分配方針

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※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。

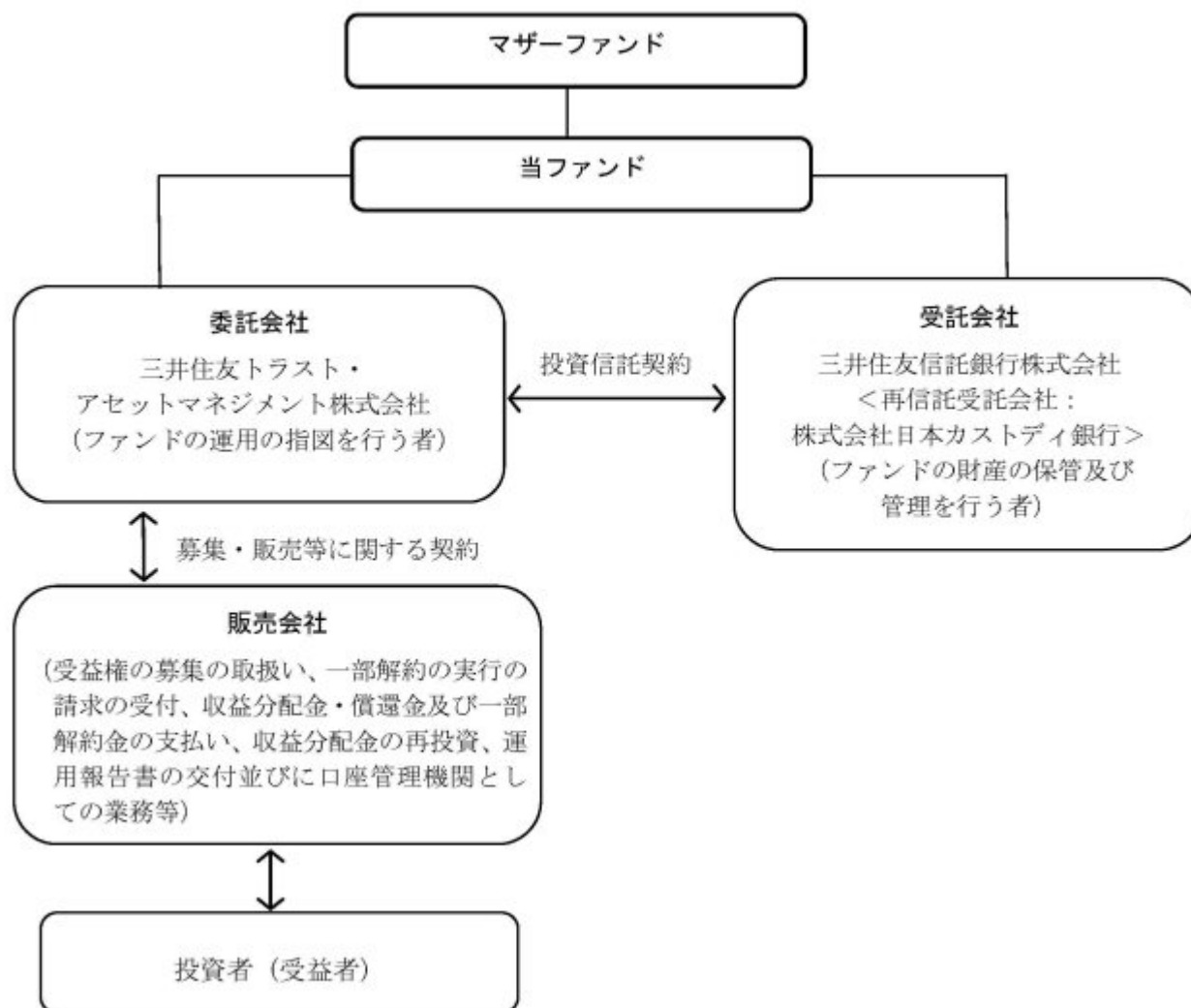
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2007年8月31日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年4月 1日	当ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープンS」から「DC日本株式インデックス・オープンS」に変更 当ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス 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12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資対象

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 5)国内外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を行うことができます。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。）
 - イ．有価証券
 - ロ．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条に定めるものに限りません。）
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形
- 2.次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲

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マザーファンドの受益証券ならびに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くとともに、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規定する特定社債券（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. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定す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、第1号から第11号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又は外国証券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ます。)
14. 投資証券もしくは投資法人債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. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
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第21号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号ならびに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号ならびに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

イ. 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第5号の権利の性質を有するもの

ロ．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、信託金を上記イ．第1号から第4号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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所（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及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品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

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）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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、投資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ならびに投資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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外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を行うことができます。

3. 運用制限

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、取得時において投資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割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%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、取得時において投資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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

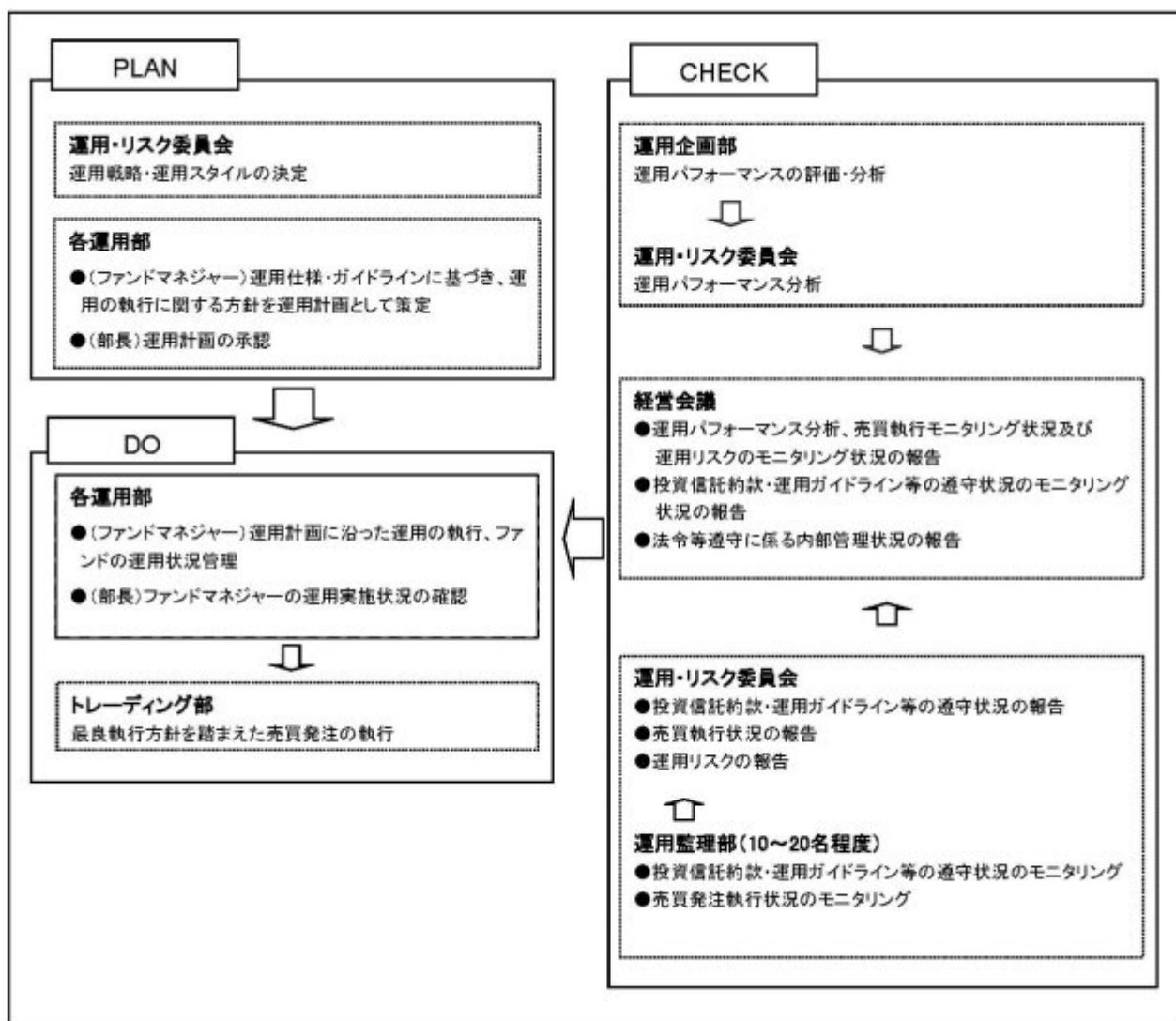
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財

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、投資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（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

- ・留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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>

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。

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、取得時において投資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実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%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実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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、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。前文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ができるものとします。

委託会社は、投資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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、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。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所におけ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。）、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。）及び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。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等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て取扱うものとします。

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

1. 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、投資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。
2. 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、投資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。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用なら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（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り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を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等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投資信託財産で保有する有価証券等の償還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投資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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

前各号の規定にかかわらず、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投資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、投資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、全て投資者の皆様には帰属します。

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）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの出入金、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

が小さかった場合も同様です。

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要がある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。

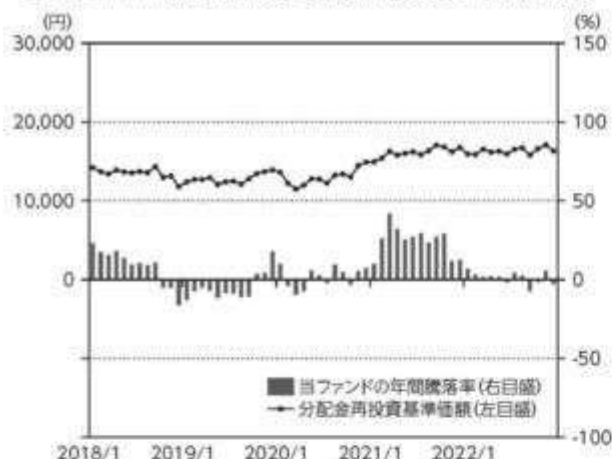
(2) リスクの管理体制

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】

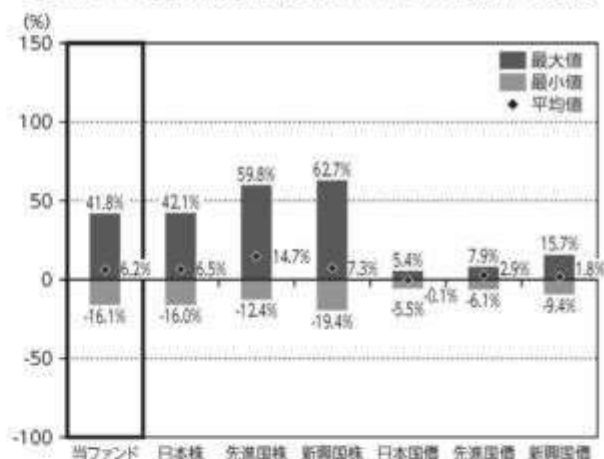
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2018年1月～2022年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機動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権限は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といふ。)の知的財産であり、他者の算出、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権限に関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 Emerging Markets Index (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets Index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指数	NOMURA-BPI指数とは、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募定期付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フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社は、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募集活動サービスに限り一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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 JPMorgan Global Bond Index-Emerging Markets (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.22%（税抜 0.2%）（ ）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 0.121%（税抜 0.11%）	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 0.066%（税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033%（税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ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。

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

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

5【運用状況】

以下は、2022年12月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックス・オープンS】

（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	16,464,284,174	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,251,433	0.05
合計(純資産総額)		16,472,535,607	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	国内株式インデックス マザーファンド	8,687,818,149	1.8980	16,489,478,847	1.8951	16,464,284,174	99.95

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6期計算期間末 (2013年 5月29日)	1,147,627,730	1,147,627,730	8,412	8,412
第7期計算期間末 (2014年 5月29日)	1,866,071,421	1,866,071,421	8,721	8,721
第8期計算期間末 (2015年 5月29日)	3,443,138,694	3,443,138,694	12,356	12,356
第9期計算期間末 (2016年 5月30日)	4,142,221,031	4,142,221,031	10,268	10,268
第10期計算期間末 (2017年 5月29日)	5,687,450,621	5,687,450,621	12,038	12,038
第11期計算期間末 (2018年 5月29日)	8,282,015,684	8,282,015,684	13,768	13,768
第12期計算期間末 (2019年 5月29日)	8,975,168,901	8,975,168,901	12,265	12,265
第13期計算期間末 (2020年 5月29日)	10,382,988,624	10,382,988,624	12,781	12,781
第14期計算期間末 (2021年 5月31日)	13,907,162,032	13,907,162,032	16,022	16,022
第15期計算期間末 (2022年 5月30日)	15,882,560,673	15,882,560,673	16,361	16,361
2021年12月末日	15,557,694,634		16,763	
2022年 1月末日	14,910,500,522		15,951	
2月末日	14,878,932,466		15,878	
3月末日	15,734,722,013		16,557	
4月末日	15,403,372,182		16,158	
5月末日	15,814,187,191		16,278	
6月末日	15,619,679,814		15,939	
7月末日	16,216,536,344		16,531	
8月末日	16,438,414,251		16,725	

9月末日	15,755,005,888		15,807
10月末日	16,660,645,682		16,609
11月末日	17,146,806,011		17,094
12月末日	16,472,535,607		16,310

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	0
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	0
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	0
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	0
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	0
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	0
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	0
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	0
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	0
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	65.4
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	3.7
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	41.7
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	16.9
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	17.2
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	14.4
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	10.9
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	4.2
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	25.4
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	2.1
第16期中間計算期間	2022年 5月31日～2022年11月30日	4.5

(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6期計算期間	2012年 5月30日～2013年 5月29日	463,692,194	306,529,942	1,364,244,305
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	1,119,419,055	344,003,784	2,139,659,576
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	1,337,445,052	690,529,107	2,786,575,521
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	2,058,315,332	810,869,903	4,034,020,950
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	1,869,056,255	1,178,642,386	4,724,434,819
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	2,181,025,603	889,936,203	6,015,524,219
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	2,438,617,340	1,136,275,137	7,317,866,422
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	2,341,470,930	1,535,472,847	8,123,864,505
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	2,130,677,993	1,574,702,169	8,679,840,329
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	2,404,330,297	1,376,710,552	9,707,460,074
第16期中間計算期間	2022年 5月31日～2022年11月30日	1,103,640,577	780,070,479	10,031,030,172

(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)

国内株式インデックス 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	490,165,608,950	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,160,901,770	1.04
合計(純資産総額)		495,326,510,720	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,031,390,000	1.02

(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	9,875,200	2,117.06	20,906,432,545	1,812.50	17,898,800,000	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,272,200	11,938.63	15,188,326,022	10,035.00	12,766,527,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,247,400	738.13	8,302,043,362	889.00	9,998,938,600	2.02
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,900	51,541.91	9,272,390,884	51,420.00	9,250,458,000	1.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,311,300	3,983.17	9,206,316,589	3,762.00	8,695,110,600	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,294,300	3,993.11	5,168,294,612	5,296.00	6,854,612,800	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	1,571,400	3,552.63	5,582,605,919	4,250.00	6,678,450,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,596,300	3,750.59	5,987,067,425	4,111.00	6,562,389,300	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1,135,400	5,833.06	6,622,859,188	5,532.00	6,281,032,800	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	912,000	6,773.07	6,177,048,101	6,691.00	6,102,192,000	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,900	5,368.83	5,599,158,077	5,644.00	5,886,127,600	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,800	4,678.19	6,403,509,909	4,177.00	5,717,477,600	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,393,800	4,532.04	6,316,768,902	3,982.00	5,550,111,600	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,300	3,192.29	4,444,625,807	3,853.00	5,364,531,900	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,700	4,484.17	5,334,828,807	4,283.00	5,095,485,100	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,783,600	2,475.33	4,415,010,147	2,827.50	5,043,129,000	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,900	58,791.72	7,460,670,476	38,880.00	4,933,872,000	1.00
日本	株式	信越化学工業	化学	304,000	18,170.91	5,523,956,640	16,225.00	4,932,400,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	384,200	13,943.27	5,357,004,334	12,705.00	4,881,261,000	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,172,500	3,728.08	4,371,185,186	4,146.00	4,861,185,000	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,561,600	1,537.36	3,938,124,581	1,856.00	4,754,329,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,900	3,189.50	4,662,740,016	3,032.00	4,432,480,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,800	20,710.74	4,490,089,414	20,200.00	4,379,360,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,897,700	1,492.06	4,323,567,057	1,488.00	4,311,777,600	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,700	19,680.58	3,851,489,926	19,160.00	3,749,612,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,800	5,412.40	3,549,453,935	5,660.00	3,711,828,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,500	8,212.80	4,480,087,260	6,588.00	3,593,754,000	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	176,500	21,324.65	3,763,801,308	19,835.00	3,500,877,500	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,728,600	2,045.38	3,535,653,052	2,006.50	3,468,435,900	0.70
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,142.27	3,895,779,745	55,580.00	3,273,662,000	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31

建設業	1.95	
食料品	3.49	
繊維製品	0.46	
パルプ・紙	0.18	
化学	6.06	
医薬品	5.74	
石油・石炭製品	0.48	
ゴム製品	0.71	
ガラス・土石製品	0.69	
鉄鋼	0.76	
非鉄金属	0.73	
金属製品	0.55	
機械	4.98	
電気機器	16.39	
輸送用機器	7.23	
精密機器	2.55	
その他製品	2.32	
電気・ガス業	1.26	
陸運業	3.08	
海運業	0.63	
空運業	0.52	
倉庫・運輸関連業	0.14	
情報・通信業	8.86	
卸売業	5.98	
小売業	4.72	
銀行業	6.40	
証券、商品先物取引業	0.74	
保険業	2.52	
その他金融業	1.13	
不動産業	1.96	
サービス業	5.32	
	小計	98.96
合計		98.96

(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	266	円	5,088,489,700	5,031,390,000	1.02

(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。

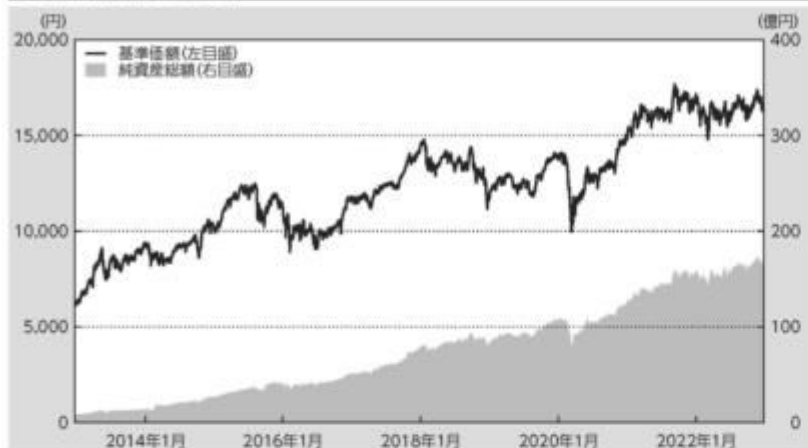
参考情報

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：2007年8月31日

作成基準日：2022年12月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 16,310円

純資産総額 164.73億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年5月	0円
2019年5月	0円
2020年5月	0円
2021年5月	0円
2022年5月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.6%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.6%
三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	2.0%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.4%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.3%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.3%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3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 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2 【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3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（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、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、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、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

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。（2007年 8月31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】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとします。ただし、第1計算期間は、2007年8月31日から2008年5月29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れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、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15期計算期間(2021年6月1日から2022年5月30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・オープンS】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2021年 5月31日現在)	第15期 (2022年 5月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	42,097,189	33,351,418
親投資信託受益証券	13,900,120,110	15,874,764,923
流動資産合計	13,942,217,299	15,908,116,341
資産合計	13,942,217,299	15,908,116,341
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,848,435	8,115,953
未払受託者報酬	2,181,154	2,492,085
未払委託者報酬	12,359,834	14,121,748
未払利息	75	29
その他未払費用	665,769	825,853
流動負債合計	35,055,267	25,555,668
負債合計	35,055,267	25,555,668
純資産の部		
元本等		
元本	8,679,840,329	9,707,460,074
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,227,321,703	6,175,100,599
(分配準備積立金)	3,004,042,583	2,837,490,337
元本等合計	13,907,162,032	15,882,560,673
純資産合計	13,907,162,032	15,882,560,673
負債純資産合計	13,942,217,299	15,908,116,341

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	2020年 5月30日	自	2021年 6月 1日
	至	2021年 5月31日	至	2022年 5月30日
営業収益				
受取利息		98		163
有価証券売買等損益		2,731,068,209		336,245,642
営業収益合計		2,731,068,307		336,245,805
営業費用				
支払利息		8,611		11,523
受託者報酬		3,995,357		4,955,822
委託者報酬		22,640,221		28,082,860
その他費用		665,835		825,853
営業費用合計		27,310,024		33,876,058
営業利益又は営業損失（ ）		2,703,758,283		302,369,747
経常利益又は経常損失（ ）		2,703,758,283		302,369,747
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,703,758,283		302,369,747
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（ ）		248,606,234		50,275,906
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,259,124,119		5,227,321,703
剰余金増加額又は欠損金減少額		967,769,693		1,532,077,230
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		967,769,693		1,532,077,230
剰余金減少額又は欠損金増加額		454,724,158		836,392,175
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		454,724,158		836,392,175
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,227,321,703		6,175,100,599

(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5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第15期計算期間は2021年 6月 1日から2022年 5月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第14期 (2021年 5月31日現在)	第15期 (2022年 5月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,679,840,329口	9,707,460,074口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6022円 (16,022円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6361円 (16,361円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日			第15期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30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	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 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	2,143,760,145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	252,097,674円
収益調整金額	C	5,898,531,946円	収益調整金額	C	7,371,163,886円
分配準備積立金額	D	860,282,438円	分配準備積立金額	D	2,585,392,663円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,902,574,529円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,208,654,223円
当ファンドの期末残存口数	F	8,679,840,329口	当ファンドの期末残存口数	F	9,707,460,074口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,256円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,516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15期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30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15期 (2022年 5月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期	第15期
	自 2020年 5月30日 至 2021年 5月31日	自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,123,864,505円	8,679,840,329円
期中追加設定元本額	2,130,677,993円	2,404,330,297円
期中一部解約元本額	1,574,702,169円	1,376,710,552円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (2021年 5月31日現在)	第15期 (2022年 5月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	2,654,733,614	333,325,877
合計	2,654,733,614	333,325,877

（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	国内株式インデックス マザーファンド	8,361,740,808	15,874,764,923	
合計		8,361,740,808	15,874,764,923	

(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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 5月30日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,696,630,134
株式	488,516,185,770
派生商品評価勘定	258,679,550
未収入金	3,934,683,803
未収配当金	5,495,605,067
差入委託証拠金	545,438,900
流動資産合計	502,447,223,224
資産合計	502,447,223,224
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	39,794,650
前受金	218,973,450
未払金	4,956,801,164
未払解約金	17,747,094
未払利息	3,233
流動負債合計	5,233,319,591
負債合計	5,233,319,591
純資産の部	
元本等	
元本	261,899,870,077
剰余金	
剰余金又は欠損金()	235,314,033,556
元本等合計	497,213,903,633
純資産合計	497,213,903,633
負債純資産合計	502,447,223,224

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 5月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 5月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,899,870,077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 1.8985円 (1万口当たり純資産額) (18,985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 5月30日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 5月30日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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 5月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 5月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月 1日
期首元本額	249,503,103,457円
期中追加設定元本額	35,776,873,459円
期中一部解約元本額	23,380,106,839円
期末元本額	261,899,870,077円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	402,198,610円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,987,438,501円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,307,969円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,780,801,499円
世界経済インデックスファンド	3,846,566,064円
日本株式インデックス・オープン	3,329,539,157円
DCマイセレクション25	6,244,084,567円
DCマイセレクション50	18,942,593,551円
DCマイセレクション75	18,879,688,062円
DC日本株式インデックス・オープン	6,208,866,136円
DCマイセレクションS25	3,101,188,895円
DCマイセレクションS50	9,073,586,435円
DCマイセレクションS75	6,906,288,752円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,361,740,808円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	197,036,199円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	703,995,649円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	515,581,834円
DC世界経済インデックスファンド	3,590,618,326円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,794,542,708円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,350,367円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,158,127円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	186,418,998円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,356,825円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	31,325,672円

区分	2022年 5月30日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	113,885,822円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,967,549円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	74,211,525円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	914,590,374円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	436,434,928円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,827,592,622円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	55,807,407円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,007,286円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	485,200,127円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	278,407,466円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	351,054,666円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	35,139,857円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	586,687,036円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,560,290円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,062,924,464円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	477,819,397円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	419,000,801円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,762,760,621円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,603,259円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,191,188円
SMT インデックスバランス・オープン	57,855,547円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,949,549,876円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	558,843,487円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,605,223円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	175,219,707円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,659,093円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,690,813円
グローバル経済コア	218,176,100円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	27,485,982円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	104,463,510円
DCターゲット・イヤーフンド2055	25,626,792円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,141,170,962円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	192,767,573円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	12,178,371円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	10,489,027円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	4,206,394円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	5,155,303円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,408,751,306円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	939,963,074円

区分	2022年 5月30日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,996,082円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	51,288,288円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	58,692,527円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,649,424,599円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	13,443,001円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	263,400,284円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 5月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	61,943,999	
合計	61,943,999	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス 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 5月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,398,526,550	-	9,617,500,000	218,973,450
合計		9,398,526,550	-	9,617,500,000	218,973,450

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,800	3,355.00	29,524,000	

日本水産	250,300	525.00	131,407,500
マルハニチロ	36,900	2,261.00	83,430,900
雪国まいたけ	19,200	844.00	16,204,800
カネコ種苗	7,400	1,789.00	13,238,600
サカタのタネ	29,400	4,405.00	129,507,000
ホクト	20,700	1,921.00	39,764,700
ホクリヨウ	3,600	636.00	2,289,600
住石ホールディングス	46,000	210.00	9,660,000
日鉄鉱業	5,400	5,930.00	32,022,000
三井松島ホールディングス	11,000	3,025.00	33,275,000
I N P E X	944,200	1,581.00	1,492,780,200
石油資源開発	30,900	2,921.00	90,258,900
K & O エナジーグループ	10,800	1,539.00	16,621,200
ショーボンドホールディングス	33,000	5,750.00	189,750,000
ミライト・ホールディングス	84,600	1,633.00	138,151,800
タマホーム	15,900	2,501.00	39,765,900
サンヨーホームズ	3,000	744.00	2,232,000
日本アクア	10,400	627.00	6,520,800
ファーストコーポレーション	6,400	740.00	4,736,000
ベステラ	5,300	1,224.00	6,487,200
Robot Home	43,800	194.00	8,497,200
キャンディル	4,100	534.00	2,189,400
ダイセキ環境ソリューション	5,100	973.00	4,962,300
第一カッター興業	6,000	1,321.00	7,926,000
安藤・間	123,300	793.00	97,776,900
東急建設	72,700	595.00	43,256,500
コムシスホールディングス	84,700	2,456.00	208,023,200
ビーアールホールディングス	33,900	322.00	10,915,800
高松コンストラクショングループ	16,000	2,053.00	32,848,000
東建コーポレーション	7,300	8,850.00	64,605,000
ソネック	2,700	1,008.00	2,721,600
ヤマウラ	11,800	934.00	11,021,200
オリエンタル白石	88,300	236.00	20,838,800
大成建設	164,900	3,960.00	653,004,000
大林組	578,000	920.00	531,760,000
清水建設	536,900	685.00	367,776,500
飛島建設	16,200	1,016.00	16,459,200
長谷工コーポレーション	168,700	1,547.00	260,978,900
松井建設	21,400	673.00	14,402,200
銭高組	2,400	3,565.00	8,556,000
鹿島建設	423,500	1,394.00	590,359,000
不動テトラ	12,900	1,593.00	20,549,700

大末建設	6,400	1,593.00	10,195,200
鉄建建設	12,600	1,789.00	22,541,400
西松建設	36,700	4,170.00	153,039,000
三井住友建設	136,800	441.00	60,328,800
大豊建設	8,900	4,435.00	39,471,500
佐田建設	13,100	480.00	6,288,000
ナカノフドー建設	14,500	318.00	4,611,000
奥村組	31,700	2,856.00	90,535,200
東鉄工業	25,300	2,182.00	55,204,600
イチケン	4,400	1,859.00	8,179,600
富士ピー・エス	7,800	513.00	4,001,400
浅沼組	6,800	5,260.00	35,768,000
戸田建設	239,100	678.00	162,109,800
熊谷組	30,000	2,680.00	80,400,000
北野建設	3,700	2,235.00	8,269,500
植木組	5,100	1,467.00	7,481,700
矢作建設工業	25,000	794.00	19,850,000
ピーエス三菱	20,000	603.00	12,060,000
日本ハウスホールディングス	41,000	430.00	17,630,000
大東建託	62,100	11,170.00	693,657,000
新日本建設	25,800	741.00	19,117,800
東亜道路工業	3,100	5,340.00	16,554,000
日本道路	5,300	6,530.00	34,609,000
東亜建設工業	14,000	2,371.00	33,194,000
日本国土開発	51,200	514.00	26,316,800
若築建設	9,600	1,981.00	19,017,600
東洋建設	68,000	859.00	58,412,000
五洋建設	229,100	635.00	145,478,500
世紀東急工業	29,100	817.00	23,774,700
福田組	6,500	4,635.00	30,127,500
住友林業	140,400	1,981.00	278,132,400
日本基礎技術	15,400	583.00	8,978,200
巴コーポレーション	23,700	425.00	10,072,500
大和ハウス工業	507,000	3,199.00	1,621,893,000
ライト工業	34,500	1,675.00	57,787,500
積水ハウス	603,300	2,309.50	1,393,321,350
日特建設	12,500	772.00	9,650,000
北陸電気工事	11,400	761.00	8,675,400
ユアテック	34,700	699.00	24,255,300
日本リーテック	11,900	1,068.00	12,709,200
四電工	6,100	1,692.00	10,321,200
中電工	25,600	2,080.00	53,248,000

関電工	98,700	813.00	80,243,100
きんでん	127,400	1,492.00	190,080,800
東京エネシス	18,700	940.00	17,578,000
トーエネック	6,100	3,200.00	19,520,000
住友電設	15,000	2,341.00	35,115,000
日本電設工業	28,300	1,592.00	45,053,600
エクシオグループ	86,600	2,088.00	180,820,800
新日本空調	14,100	1,813.00	25,563,300
九電工	41,200	2,676.00	110,251,200
三機工業	39,400	1,431.00	56,381,400
日揮ホールディングス	176,600	1,787.00	315,584,200
中外炉工業	5,800	1,687.00	9,784,600
ヤマト	15,600	735.00	11,466,000
太平電業	11,800	2,678.00	31,600,400
高砂熱学工業	49,200	1,578.00	77,637,600
三晃金属工業	2,400	2,792.00	6,700,800
朝日工業社	7,600	1,577.00	11,985,200
明星工業	32,700	736.00	24,067,200
大気社	26,700	3,070.00	81,969,000
ダイダン	12,100	2,017.00	24,405,700
日比谷総合設備	17,500	1,884.00	32,970,000
フィル・カンパニー	3,200	1,216.00	3,891,200
テスホールディングス	16,900	1,376.00	23,254,400
インフロニア・ホールディングス	235,400	945.00	222,453,000
東洋エンジニアリング	25,500	636.00	16,218,000
レイズネクスト	27,100	1,153.00	31,246,300
ニッポン	50,500	1,604.00	81,002,000
日清製粉グループ本社	195,100	1,523.00	297,137,300
日東富士製粉	2,800	4,180.00	11,704,000
昭和産業	16,300	2,446.00	39,869,800
鳥越製粉	15,100	639.00	9,648,900
中部飼料	20,700	1,018.00	21,072,600
フィード・ワン	23,900	659.00	15,750,100
東洋精糖	3,300	953.00	3,144,900
日本甜菜製糖	10,100	1,690.00	17,069,000
D M三井製糖ホールディングス	16,300	1,876.00	30,578,800
塩水港精糖	23,100	214.00	4,943,400
日新製糖	9,200	1,781.00	16,385,200
森永製菓	41,200	3,955.00	162,946,000
中村屋	4,200	3,080.00	12,936,000
江崎グリコ	48,000	3,810.00	182,880,000
名糖産業	7,500	1,584.00	11,880,000

井村屋グループ	10,000	2,332.00	23,320,000
不二家	10,800	2,417.00	26,103,600
山崎製パン	127,900	1,513.00	193,512,700
第一屋製パン	3,700	518.00	1,916,600
モロゾフ	5,900	3,290.00	19,411,000
亀田製菓	10,400	4,280.00	44,512,000
寿スピリッツ	17,500	7,300.00	127,750,000
カルビー	88,500	2,414.00	213,639,000
森永乳業	33,900	4,660.00	157,974,000
六甲バター	13,300	1,451.00	19,298,300
ヤクルト本社	130,200	6,990.00	910,098,000
明治ホールディングス	112,900	6,450.00	728,205,000
雪印メグミルク	43,900	1,747.00	76,693,300
プリマハム	24,300	2,133.00	51,831,900
日本ハム	70,100	3,965.00	277,946,500
林兼産業	5,900	503.00	2,967,700
丸大食品	18,000	1,476.00	26,568,000
S Foods	17,400	3,035.00	52,809,000
柿安本店	6,700	2,427.00	16,260,900
伊藤ハム米久ホールディングス	125,000	662.00	82,750,000
サッポロホールディングス	60,000	2,801.00	168,060,000
アサヒグループホールディングス	416,300	4,357.00	1,813,819,100
キリンホールディングス	713,800	1,996.00	1,424,744,800
宝ホールディングス	116,000	958.00	111,128,000
オエノンホールディングス	52,500	297.00	15,592,500
養命酒製造	5,500	1,734.00	9,537,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	128,100	1,402.00	179,596,200
サントリー食品インターナショナル	129,900	4,875.00	633,262,500
ダイトーグループホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000
伊藤園	59,000	5,480.00	323,320,000
キーコーヒー	18,200	2,071.00	37,692,200
ユニカフェ	5,800	943.00	5,469,400
ジャパンフーズ	2,800	1,178.00	3,298,400
日清オイリオグループ	23,000	3,020.00	69,460,000
不二製油グループ本社	42,100	1,780.00	74,938,000
かどや製油	1,800	3,400.00	6,120,000
J - オイルミルズ	18,100	1,538.00	27,837,800
キッコーマン	124,300	6,890.00	856,427,000
味の素	397,900	3,152.00	1,254,180,800
ブルドックソース	7,300	1,806.00	13,183,800
キューピー	90,700	2,156.00	195,549,200
ハウス食品グループ本社	64,600	2,721.00	175,776,600

カゴメ	73,700	3,335.00	245,789,500
焼津水産化学工業	8,400	943.00	7,921,200
アリアケジャパン	17,700	4,875.00	86,287,500
ピエトロ	2,500	1,800.00	4,500,000
エバラ食品工業	4,200	3,035.00	12,747,000
やまみ	1,700	1,589.00	2,701,300
ニチレイ	77,800	2,277.00	177,150,600
東洋水産	88,800	4,800.00	426,240,000
イトアンドホールディングス	7,300	2,326.00	16,979,800
大冷	2,200	1,900.00	4,180,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	547.00	5,470,000
日清食品ホールディングス	66,800	8,470.00	565,796,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,049.00	17,621,400
一正蒲鉾	7,800	824.00	6,427,200
フジッコ	18,100	1,920.00	34,752,000
ロック・フィールド	19,800	1,411.00	27,937,800
日本たばこ産業	1,041,300	2,360.00	2,457,468,000
ケンコーマヨネーズ	10,200	1,353.00	13,800,600
わらべや日洋ホールディングス	12,000	1,653.00	19,836,000
なとり	10,800	2,050.00	22,140,000
イフジ産業	3,400	1,007.00	3,423,800
ピククルスコーポレーション	9,300	1,361.00	12,657,300
ファーマフーズ	24,500	1,605.00	39,322,500
ユーグレナ	99,800	867.00	86,526,600
紀文食品	15,100	993.00	14,994,300
ミヨシ油脂	7,000	1,036.00	7,252,000
理研ビタミン	17,700	1,647.00	29,151,900
片倉工業	18,600	2,104.00	39,134,400
ゲンゼ	11,500	3,665.00	42,147,500
東洋紡	75,400	1,036.00	78,114,400
ユニチカ	54,100	241.00	13,038,100
富士紡ホールディングス	8,100	3,395.00	27,499,500
倉敷紡績	14,800	1,919.00	28,401,200
シキボウ	9,900	905.00	8,959,500
日本毛織	50,800	935.00	47,498,000
トーア紡コーポレーション	7,000	383.00	2,681,000
帝国繊維	20,600	1,476.00	30,405,600
帝人	170,800	1,349.00	230,409,200
東レ	1,242,300	671.20	833,831,760
住江織物	3,400	1,734.00	5,895,600
日本フェルト	11,900	432.00	5,140,800
イチカワ	2,700	1,378.00	3,720,600

日東製網	2,000	1,377.00	2,754,000
アツギ	14,300	532.00	7,607,600
ダイニック	6,500	698.00	4,537,000
セーレン	36,500	2,047.00	74,715,500
ソトー	7,200	876.00	6,307,200
東海染工	2,400	1,176.00	2,822,400
小松マテーレ	29,500	1,360.00	40,120,000
ワコールホールディングス	42,100	2,035.00	85,673,500
ホギメディカル	24,300	3,100.00	75,330,000
T S Iホールディングス	60,100	330.00	19,833,000
マツオカコーポレーション	5,900	1,007.00	5,941,300
ワールド	24,900	1,442.00	35,905,800
三陽商会	8,600	901.00	7,748,600
ナイガイ	7,100	306.00	2,172,600
オンワードホールディングス	108,400	261.00	28,292,400
ルックホールディングス	6,200	1,649.00	10,223,800
ゴールドウイン	32,300	7,870.00	254,201,000
デサント	34,000	2,446.00	83,164,000
キング	9,300	540.00	5,022,000
ヤマトインターナショナル	15,700	285.00	4,474,500
特種東海製紙	10,400	3,190.00	33,176,000
王子ホールディングス	751,600	568.00	426,908,800
日本製紙	81,500	956.00	77,914,000
三菱製紙	25,100	301.00	7,555,100
北越コーポレーション	116,700	608.00	70,953,600
中越パルプ工業	7,200	916.00	6,595,200
巴川製紙所	5,600	634.00	3,550,400
大王製紙	84,600	1,418.00	119,962,800
阿波製紙	4,500	317.00	1,426,500
レンゴー	157,400	705.00	110,967,000
トーモク	10,100	1,461.00	14,756,100
ザ・パック	12,800	2,237.00	28,633,600
北の達人コーポレーション	67,800	185.00	12,543,000
クラレ	262,900	1,095.00	287,875,500
旭化成	1,200,300	1,053.00	1,263,915,900
共和レザー	10,800	572.00	6,177,600
昭和電工	165,900	2,506.00	415,745,400
住友化学	1,326,100	529.00	701,506,900
住友精化	7,800	2,894.00	22,573,200
日産化学	91,600	7,380.00	676,008,000
ラサ工業	6,700	1,920.00	12,864,000
クレハ	14,200	10,210.00	144,982,000

多木化学	6,600	4,440.00	29,304,000
テイカ	11,800	1,198.00	14,136,400
石原産業	33,200	1,041.00	34,561,200
片倉コープアグリ	4,300	1,367.00	5,878,100
日本曹達	21,900	4,015.00	87,928,500
東ソー	247,400	1,885.00	466,349,000
トクヤマ	57,700	1,706.00	98,436,200
セントラル硝子	29,300	2,807.00	82,245,100
東亜合成	95,300	1,033.00	98,444,900
大阪ソーダ	15,500	3,065.00	47,507,500
関東電化工業	36,900	935.00	34,501,500
デンカ	65,600	3,255.00	213,528,000
信越化学工業	308,700	18,250.00	5,633,775,000
日本カーバイド工業	6,800	1,442.00	9,805,600
堺化学工業	12,600	1,904.00	23,990,400
第一稀元素化学工業	16,600	1,057.00	17,546,200
エア・ウォーター	161,000	1,743.00	280,623,000
日本酸素ホールディングス	164,800	2,480.00	408,704,000
日本化学工業	5,500	2,082.00	11,451,000
東邦アセチレン	3,900	1,136.00	4,430,400
日本パーカライズング	85,000	920.00	78,200,000
高压ガス工業	27,800	646.00	17,958,800
チタン工業	2,200	1,800.00	3,960,000
四国化成工業	22,700	1,250.00	28,375,000
戸田工業	4,000	2,636.00	10,544,000
ステラ ケミファ	9,500	2,587.00	24,576,500
保土谷化学工業	5,400	3,600.00	19,440,000
日本触媒	28,600	5,230.00	149,578,000
大日精化工業	14,200	1,849.00	26,255,800
カネカ	43,600	3,345.00	145,842,000
三菱瓦斯化学	158,200	2,081.00	329,214,200
三井化学	155,700	3,145.00	489,676,500
J S R	176,600	4,035.00	712,581,000
東京応化工業	29,000	7,470.00	216,630,000
大阪有機化学工業	14,400	2,781.00	40,046,400
三菱ケミカルホールディングス	1,206,600	774.40	934,391,040
K H ネオケム	29,800	2,511.00	74,827,800
ダイセル	260,900	824.00	214,981,600
住友ベークライト	27,800	4,395.00	122,181,000
積水化学工業	377,700	1,835.00	693,079,500
日本ゼオン	151,900	1,363.00	207,039,700
アイカ工業	47,400	2,865.00	135,801,000

U B E	89,300	2,004.00	178,957,200
積水樹脂	26,900	1,656.00	44,546,400
タキロンシーアイ	41,000	533.00	21,853,000
旭有機材	10,700	2,041.00	21,838,700
ニチバン	10,400	1,612.00	16,764,800
リケンテクノス	41,100	428.00	17,590,800
大倉工業	8,700	1,679.00	14,607,300
積水化成成品工業	23,500	403.00	9,470,500
群栄化学工業	4,000	2,620.00	10,480,000
タイガースポリマー	9,400	424.00	3,985,600
ミライアル	6,100	1,795.00	10,949,500
ダイキアクシス	7,400	770.00	5,698,000
ダイキョーニシカワ	40,000	487.00	19,480,000
竹本容器	6,800	816.00	5,548,800
森六ホールディングス	9,500	1,868.00	17,746,000
恵和	5,200	4,735.00	24,622,000
日本化薬	136,600	1,096.00	149,713,600
カーリットホールディングス	16,900	644.00	10,883,600
日本精化	13,200	2,062.00	27,218,400
扶桑化学工業	15,600	3,915.00	61,074,000
トリケミカル研究所	19,500	2,581.00	50,329,500
A D E K A	79,000	2,518.00	198,922,000
日油	58,100	4,830.00	280,623,000
新日本理化	28,400	254.00	7,213,600
ハリマ化成グループ	13,100	755.00	9,890,500
花王	409,000	5,256.00	2,149,704,000
第一工業製薬	6,600	2,258.00	14,902,800
石原ケミカル	9,100	1,269.00	11,547,900
日華化学	6,400	816.00	5,222,400
ニイタカ	3,700	2,165.00	8,010,500
三洋化成工業	11,300	4,615.00	52,149,500
有機合成薬品工業	13,200	283.00	3,735,600
大日本塗料	22,000	750.00	16,500,000
日本ペイントホールディングス	712,000	976.00	694,912,000
関西ペイント	174,700	1,605.00	280,393,500
神東塗料	14,900	156.00	2,324,400
中国塗料	42,200	868.00	36,629,600
日本特殊塗料	12,300	908.00	11,168,400
藤倉化成	23,600	480.00	11,328,000
太陽ホールディングス	27,900	3,270.00	91,233,000
D I C	72,400	2,501.00	181,072,400
サカティンクス	37,600	947.00	35,607,200

東洋インキSCホールディングス	37,600	1,947.00	73,207,200
T&K TOKA	15,300	853.00	13,050,900
富士フィルムホールディングス	340,100	6,969.00	2,370,156,900
資生堂	360,400	5,493.00	1,979,677,200
ライオン	205,100	1,406.00	288,370,600
高砂香料工業	11,700	2,330.00	27,261,000
マンダム	38,700	1,428.00	55,263,600
ミルボン	23,900	5,190.00	124,041,000
ファンケル	78,300	2,163.00	169,362,900
コーセー	36,400	11,960.00	435,344,000
コタ	13,500	1,453.00	19,615,500
シーボン	2,500	1,769.00	4,422,500
ポーラ・オルビスホールディングス	82,600	1,591.00	131,416,600
ノエビアホールディングス	15,000	5,580.00	83,700,000
アジュバンホールディングス	4,300	1,028.00	4,420,400
新日本製薬	7,900	1,317.00	10,404,300
エステー	12,400	1,463.00	18,141,200
アグロ カネショウ	6,400	1,287.00	8,236,800
コニシ	30,200	1,582.00	47,776,400
長谷川香料	33,400	2,486.00	83,032,400
星光PMC	10,900	571.00	6,223,900
小林製薬	54,200	8,800.00	476,960,000
荒川化学工業	14,500	977.00	14,166,500
メック	13,700	2,918.00	39,976,600
日本高純度化学	4,800	2,302.00	11,049,600
タカラバイオ	50,600	1,820.00	92,092,000
JCU	20,400	3,685.00	75,174,000
新田ゼラチン	11,400	623.00	7,102,200
OATアグリオ	8,000	1,637.00	13,096,000
デクセリアルズ	50,400	4,165.00	209,916,000
アース製薬	15,900	5,180.00	82,362,000
北興化学工業	16,800	1,016.00	17,068,800
大成ラミック	5,400	2,639.00	14,250,600
クミアイ化学工業	72,000	1,009.00	72,648,000
日本農薬	34,500	717.00	24,736,500
アキレス	12,400	1,371.00	17,000,400
有沢製作所	26,900	1,090.00	29,321,000
日東電工	117,000	9,290.00	1,086,930,000
レック	23,700	715.00	16,945,500
三光合成	22,100	346.00	7,646,600
きもと	29,600	234.00	6,926,400
藤森工業	15,800	3,525.00	55,695,000

前澤化成工業	11,700	1,275.00	14,917,500
未来工業	6,900	1,581.00	10,908,900
ウェーブロックホールディングス	7,300	690.00	5,037,000
J S P	11,300	1,409.00	15,921,700
エフピコ	35,600	2,743.00	97,650,800
天馬	15,200	2,239.00	34,032,800
信越ポリマー	34,700	1,098.00	38,100,600
東リ	45,500	206.00	9,373,000
ニフコ	64,600	3,045.00	196,707,000
バルカー	15,700	2,750.00	43,175,000
ユニ・チャーム	373,000	4,499.00	1,678,127,000
ショーエイコーポレーション	5,200	600.00	3,120,000
協和キリン	205,500	2,797.00	574,783,500
武田薬品工業	1,520,900	3,744.00	5,694,249,600
アステラス製薬	1,654,300	2,041.50	3,377,253,450
住友ファーマ	119,500	1,091.00	130,374,500
塩野義製薬	230,900	6,816.00	1,573,814,400
わかもと製薬	20,200	267.00	5,393,400
日本新薬	45,000	8,060.00	362,700,000
中外製薬	605,200	3,514.00	2,126,672,800
科研製薬	28,500	3,640.00	103,740,000
エーザイ	219,700	5,397.00	1,185,720,900
ロート製薬	94,600	3,425.00	324,005,000
小野薬品工業	393,800	3,461.00	1,362,941,800
久光製薬	44,300	3,445.00	152,613,500
持田製薬	22,500	3,115.00	70,087,500
参天製薬	345,100	1,049.00	362,009,900
扶桑薬品工業	6,400	2,257.00	14,444,800
日本ケミファ	2,100	1,920.00	4,032,000
ツムラ	56,900	2,959.00	168,367,100
日医工	57,200	363.00	20,763,600
キッセイ薬品工業	30,100	2,586.00	77,838,600
生化学工業	34,100	762.00	25,984,200
栄研化学	30,500	1,704.00	51,972,000
日水製薬	7,100	990.00	7,029,000
鳥居薬品	10,400	3,020.00	31,408,000
J C R ファーマ	54,500	2,419.00	131,835,500
東和薬品	27,900	2,477.00	69,108,300
富士製薬工業	10,900	923.00	10,060,700
ゼリア新薬工業	30,900	2,036.00	62,912,400
第一三共	1,442,700	3,464.00	4,997,512,800
キョーリン製薬ホールディングス	36,200	1,697.00	61,431,400

大幸薬品	29,200	626.00	18,279,200
ダイト	12,200	2,639.00	32,195,800
大塚ホールディングス	379,800	4,377.00	1,662,384,600
大正製薬ホールディングス	39,200	4,935.00	193,452,000
ペプチドリーム	101,500	1,643.00	166,764,500
あすか製薬ホールディングス	19,600	998.00	19,560,800
サワイグループホールディングス	38,900	3,880.00	150,932,000
日本コークス工業	163,500	127.00	20,764,500
ニチレキ	22,200	1,303.00	28,926,600
ユシロ化学工業	9,500	986.00	9,367,000
ビーピー・カストロール	6,900	1,232.00	8,500,800
富士石油	45,400	311.00	14,119,400
MORESCO	6,400	1,220.00	7,808,000
出光興産	202,800	3,490.00	707,772,000
ENEOSホールディングス	2,910,900	517.40	1,506,099,660
コスモエネルギーホールディングス	69,600	3,475.00	241,860,000
横浜ゴム	98,500	1,663.00	163,805,500
TOYO TIRE	95,700	1,726.00	165,178,200
ブリヂストン	528,800	5,068.00	2,679,958,400
住友ゴム工業	163,300	1,172.00	191,387,600
藤倉コンポジット	15,500	882.00	13,671,000
オカモト	9,900	3,875.00	38,362,500
フコク	8,500	993.00	8,440,500
ニッタ	18,800	2,792.00	52,489,600
住友理工	37,500	563.00	21,112,500
三ツ星ベルト	23,500	2,839.00	66,716,500
バンドー化学	31,200	921.00	28,735,200
日東紡績	25,600	2,629.00	67,302,400
AGC	168,600	4,935.00	832,041,000
日本板硝子	89,300	386.00	34,469,800
石塚硝子	3,100	1,729.00	5,359,900
日本山村硝子	7,100	771.00	5,474,100
日本電気硝子	73,800	2,745.00	202,581,000
オハラ	7,800	1,223.00	9,539,400
住友大阪セメント	32,900	3,330.00	109,557,000
太平洋セメント	110,000	1,950.00	214,500,000
日本ヒューム	17,200	692.00	11,902,400
日本コンクリート工業	36,300	277.00	10,055,100
三谷セキサン	8,300	5,170.00	42,911,000
アジアパイルホールディングス	28,500	460.00	13,110,000
東海カーボン	153,300	1,072.00	164,337,600
日本カーボン	10,000	4,250.00	42,500,000

東洋炭素	11,800	2,879.00	33,972,200
ノリタケカンパニーリミテド	10,100	4,190.00	42,319,000
TOTO	124,100	4,360.00	541,076,000
日本碍子	197,000	1,890.00	372,330,000
日本特殊陶業	139,100	2,445.00	340,099,500
MARUWA	6,700	15,740.00	105,458,000
品川リフラクトリーズ	4,600	3,645.00	16,767,000
黒崎播磨	3,300	4,275.00	14,107,500
ヨータイ	12,400	1,593.00	19,753,200
東京窯業	21,400	279.00	5,970,600
ニッカトー	8,500	480.00	4,080,000
フジインコーポレーテッド	15,500	5,730.00	88,815,000
クニミネ工業	6,200	991.00	6,144,200
エーアンドエーマテリアル	3,300	877.00	2,894,100
ニチアス	42,200	2,250.00	94,950,000
ニチハ	25,500	2,374.00	60,537,000
日本製鉄	818,400	2,218.00	1,815,211,200
神戸製鋼所	341,400	678.00	231,469,200
中山製鋼所	28,000	432.00	12,096,000
合同製鐵	9,700	1,275.00	12,367,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	467,600	1,589.00	743,016,400
東京製鐵	59,100	1,550.00	91,605,000
共英製鋼	19,800	1,308.00	25,898,400
大和工業	32,600	4,335.00	141,321,000
東京鐵鋼	8,100	1,213.00	9,825,300
大阪製鐵	10,200	1,409.00	14,371,800
淀川製鋼所	22,400	2,291.00	51,318,400
丸一鋼管	57,200	2,958.00	169,197,600
モリ工業	5,000	2,402.00	12,010,000
大同特殊鋼	27,900	3,680.00	102,672,000
日本高周波鋼業	7,300	341.00	2,489,300
日本冶金工業	13,400	2,240.00	30,016,000
山陽特殊製鋼	17,500	2,096.00	36,680,000
愛知製鋼	10,800	2,012.00	21,729,600
日立金属	206,200	2,063.00	425,390,600
日本金属	4,800	1,178.00	5,654,400
大平洋金属	11,800	2,908.00	34,314,400
新日本電工	112,000	358.00	40,096,000
栗本鐵工所	8,200	1,608.00	13,185,600
虹技	2,600	979.00	2,545,400
三菱製鋼	12,300	956.00	11,758,800
日亜鋼業	23,100	256.00	5,913,600

日本精線	3,000	4,165.00	12,495,000
エンビプロ・ホールディングス	12,700	936.00	11,887,200
シンニッタン	23,400	222.00	5,194,800
新家工業	4,300	1,461.00	6,282,300
大紀アルミニウム工業所	25,400	1,360.00	34,544,000
日本軽金属ホールディングス	48,500	1,578.00	76,533,000
三井金属鉱業	51,700	3,415.00	176,555,500
東邦亜鉛	10,100	2,387.00	24,108,700
三菱マテリアル	115,900	1,989.00	230,525,100
住友金属鉱山	221,300	5,407.00	1,196,569,100
DOWAホールディングス	47,200	4,715.00	222,548,000
古河機械金属	30,100	1,235.00	37,173,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	22,200	1,888.00	41,913,600
東邦チタニウム	34,300	2,107.00	72,270,100
UACJ	27,200	2,171.00	59,051,200
CKサンエツ	3,800	4,120.00	15,656,000
古河電気工業	56,700	2,170.00	123,039,000
住友電気工業	683,700	1,458.50	997,176,450
フジクラ	213,400	763.00	162,824,200
昭和電線ホールディングス	16,700	1,765.00	29,475,500
東京特殊電線	2,600	2,320.00	6,032,000
タツタ電線	34,000	477.00	16,218,000
カナレ電気	2,900	1,691.00	4,903,900
平河ヒューテック	10,700	1,106.00	11,834,200
リョービ	21,000	1,089.00	22,869,000
アーレスティ	20,700	370.00	7,659,000
アサヒホールディングス	76,700	2,091.00	160,379,700
稲葉製作所	10,000	1,300.00	13,000,000
宮地エンジニアリンググループ	5,500	3,380.00	18,590,000
トーカロ	49,400	1,359.00	67,134,600
アルファC o	6,900	973.00	6,713,700
SUMCO	308,500	2,062.00	636,127,000
川田テクノロジーズ	3,700	3,410.00	12,617,000
RS Technologies	6,200	6,070.00	37,634,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	2,277.00	5,692,500
信和	11,900	793.00	9,436,700
東洋製罐グループホールディングス	105,600	1,365.00	144,144,000
ホッカンホールディングス	9,400	1,222.00	11,486,800
コロナ	9,700	820.00	7,954,000
横河ブリッジホールディングス	29,200	1,934.00	56,472,800
駒井ハルテック	3,200	1,708.00	5,465,600
高田機工	1,700	2,540.00	4,318,000

三和ホールディングス	180,400	1,262.00	227,664,800
文化シャッター	57,800	960.00	55,488,000
三協立山	23,400	582.00	13,618,800
アルインコ	13,100	847.00	11,095,700
東洋シャッター	4,200	643.00	2,700,600
LIXIL	301,200	2,550.00	768,060,000
日本フィルコン	12,400	501.00	6,212,400
ノーリツ	32,600	1,532.00	49,943,200
長府製作所	19,500	1,800.00	35,100,000
リンナイ	34,100	8,740.00	298,034,000
ダイニチ工業	9,200	645.00	5,934,000
日東精工	22,400	501.00	11,222,400
三洋工業	2,300	1,803.00	4,146,900
岡部	31,600	635.00	20,066,000
ジーテクト	22,000	1,274.00	28,028,000
東プレ	31,400	1,016.00	31,902,400
高周波熱錬	30,300	647.00	19,604,100
東京製網	11,700	932.00	10,904,400
サンコール	16,400	640.00	10,496,000
モリテック スチール	14,900	310.00	4,619,000
パイオラックス	25,900	1,680.00	43,512,000
エイチワン	17,600	587.00	10,331,200
日本発條	166,200	937.00	155,729,400
中央発條	9,200	707.00	6,504,400
アドバネクス	2,500	1,636.00	4,090,000
立川ブラインド工業	7,800	1,089.00	8,494,200
三益半導体工業	14,900	2,437.00	36,311,300
日本ドライケミカル	4,500	1,531.00	6,889,500
日本製鋼所	52,200	3,255.00	169,911,000
三浦工業	77,900	2,924.00	227,779,600
タクマ	58,400	1,441.00	84,154,400
ツガミ	40,300	1,223.00	49,286,900
オークマ	19,700	5,360.00	105,592,000
芝浦機械	21,700	3,150.00	68,355,000
アマダ	302,300	1,045.00	315,903,500
アイダエンジニアリング	44,800	929.00	41,619,200
滝澤鉄工所	5,600	1,329.00	7,442,400
F U J I	80,400	2,251.00	180,980,400
牧野フライス製作所	20,000	4,290.00	85,800,000
オーエスジー	85,600	1,706.00	146,033,600
ダイジェット工業	2,400	905.00	2,172,000
旭ダイヤモンド工業	48,400	602.00	29,136,800

DMG森精機	108,600	1,979.00	214,919,400
ソディック	41,800	763.00	31,893,400
ディスコ	28,200	35,200.00	992,640,000
日東工器	9,700	1,488.00	14,433,600
日進工具	15,100	1,357.00	20,490,700
パンチ工業	16,400	469.00	7,691,600
富士ダイス	9,800	670.00	6,566,000
豊和工業	10,200	814.00	8,302,800
OKK	7,100	1,092.00	7,753,200
東洋機械金属	12,600	610.00	7,686,000
津田駒工業	3,400	552.00	1,876,800
エンシュウ	4,600	760.00	3,496,000
島精機製作所	28,100	2,020.00	56,762,000
オプトラン	24,000	2,022.00	48,528,000
NCホールディングス	4,900	1,829.00	8,962,100
イワキポンプ	12,300	987.00	12,140,100
フリー	17,100	1,041.00	17,801,100
ヤマシンフィルタ	33,200	306.00	10,159,200
日阪製作所	21,100	828.00	17,470,800
やまびこ	33,700	1,202.00	40,507,400
野村マイクロ・サイエンス	6,300	4,280.00	26,964,000
平田機工	8,600	4,205.00	36,163,000
ペガサスミシン製造	19,600	571.00	11,191,600
マルマエ	7,900	2,117.00	16,724,300
タツモ	9,000	1,200.00	10,800,000
ナプテスコ	104,300	3,160.00	329,588,000
三井海洋開発	20,400	1,258.00	25,663,200
レオン自動機	20,500	1,349.00	27,654,500
S M C	56,700	66,420.00	3,766,014,000
ホソカワミクロン	12,800	2,536.00	32,460,800
ユニオンツール	7,200	3,675.00	26,460,000
オイレス工業	25,500	1,563.00	39,856,500
日精エー・エス・ビー機械	7,100	3,155.00	22,400,500
サトーホールディングス	25,200	1,906.00	48,031,200
技研製作所	17,000	3,640.00	61,880,000
日本エアテック	8,900	1,097.00	9,763,300
カワタ	5,900	1,023.00	6,035,700
日精樹脂工業	12,800	908.00	11,622,400
オカダアイヨン	6,100	1,533.00	9,351,300
ワイエイシイホールディングス	7,600	1,839.00	13,976,400
小松製作所	877,000	3,212.00	2,816,924,000
住友重機械工業	105,900	3,080.00	326,172,000

日立建機	77,600	3,020.00	234,352,000
日工	25,300	613.00	15,508,900
巴工業	7,200	2,430.00	17,496,000
井関農機	16,300	1,238.00	20,179,400
TOWA	16,600	1,846.00	30,643,600
丸山製作所	3,500	1,554.00	5,439,000
北川鉄工所	8,100	1,425.00	11,542,500
ローツェ	9,500	11,020.00	104,690,000
タカキタ	6,300	578.00	3,641,400
クボタ	937,500	2,403.50	2,253,281,250
荏原実業	9,000	2,424.00	21,816,000
三菱化工機	6,000	2,085.00	12,510,000
月島機械	32,300	892.00	28,811,600
帝国電機製作所	12,800	1,604.00	20,531,200
新東工業	38,700	684.00	26,470,800
澁谷工業	15,900	2,316.00	36,824,400
アイチ コーポレーション	27,900	905.00	25,249,500
小森コーポレーション	47,100	764.00	35,984,400
鶴見製作所	14,200	1,804.00	25,616,800
住友精密工業	2,900	2,739.00	7,943,100
日本ギア工業	7,200	271.00	1,951,200
酒井重工業	3,300	2,964.00	9,781,200
荏原製作所	77,500	5,520.00	427,800,000
石井鐵工所	2,500	2,865.00	7,162,500
西島製作所	16,500	1,301.00	21,466,500
北越工業	17,000	818.00	13,906,000
ダイキン工業	223,100	20,640.00	4,604,784,000
オルガノ	5,600	9,940.00	55,664,000
トーヨーカネツ	7,000	2,798.00	19,586,000
栗田工業	100,100	4,960.00	496,496,000
椿本チエイン	25,400	3,115.00	79,121,000
大同工業	8,400	834.00	7,005,600
木村化工機	15,700	664.00	10,424,800
アネスト岩田	30,200	862.00	26,032,400
ダイフク	96,400	8,250.00	795,300,000
サムコ	5,200	2,687.00	13,972,400
加藤製作所	9,500	805.00	7,647,500
油研工業	3,200	1,770.00	5,664,000
タダノ	96,300	960.00	92,448,000
フジテック	62,700	2,629.00	164,838,300
C K D	51,700	1,901.00	98,281,700
キトー	15,600	2,646.00	41,277,600

平和	54,000	1,936.00	104,544,000	
理想科学工業	15,700	2,165.00	33,990,500	
SANKYO	41,800	4,265.00	178,277,000	
日本金銭機械	19,800	689.00	13,642,200	
マースグループホールディングス	12,300	1,708.00	21,008,400	
フクシマガリレイ	12,400	3,405.00	42,222,000	
オーイズミ	7,000	430.00	3,010,000	
ダイコク電機	9,000	1,172.00	10,548,000	
竹内製作所	29,500	2,327.00	68,646,500	
アマノ	50,700	2,476.00	125,533,200	
JUKI	26,900	698.00	18,776,200	
ジャノメ	16,600	698.00	11,586,800	
マックス	23,900	1,571.00	37,546,900	
グローリー	47,200	2,010.00	94,872,000	
新晃工業	18,100	1,518.00	27,475,800	
大和冷機工業	28,100	1,033.00	29,027,300	
セガサミーホールディングス	192,000	2,393.00	459,456,000	
日本ピストンリング	7,100	1,299.00	9,222,900	
リケン	7,500	2,325.00	17,437,500	
T P R	23,200	1,234.00	28,628,800	
ツバキ・ナカシマ	42,600	970.00	41,322,000	
ホシザキ	56,600	7,740.00	438,084,000	
大豊工業	15,900	708.00	11,257,200	
日本精工	342,400	750.00	256,800,000	
NTN	373,200	262.00	97,778,400	
ジェイテクト	172,000	983.00	169,076,000	
不二越	14,500	3,720.00	53,940,000	
日本トムソン	47,300	563.00	26,629,900	
THK	109,300	2,768.00	302,542,400	
ユーシン精機	15,100	693.00	10,464,300	
前澤給装工業	13,300	822.00	10,932,600	
イーグル工業	22,000	975.00	21,450,000	
前澤工業	12,200	595.00	7,259,000	
日本ピラー工業	17,600	2,882.00	50,723,200	
キッツ	58,100	683.00	39,682,300	
マキタ	224,300	3,558.00	798,059,400	
三井E & Sホールディングス	70,200	361.00	25,342,200	
日立造船	157,200	797.00	125,288,400	
三菱重工業	290,600	4,977.00	1,446,316,200	
I H I	120,900	3,700.00	447,330,000	
スター精密	27,000	1,684.00	45,468,000	
日清紡ホールディングス	111,700	1,033.00	115,386,100	

イビデン	96,200	4,775.00	459,355,000
コニカミノルタ	405,500	434.00	175,987,000
ブラザー工業	226,300	2,387.00	540,178,100
ミネベアミツミ	317,000	2,352.00	745,584,000
日立製作所	930,700	6,780.00	6,310,146,000
東芝	338,200	5,828.00	1,971,029,600
三菱電機	1,849,000	1,418.50	2,622,806,500
富士電機	110,600	6,040.00	668,024,000
東洋電機製造	6,600	906.00	5,979,600
安川電機	197,600	4,470.00	883,272,000
シンフォニアテクノロジー	20,900	1,360.00	28,424,000
明電舎	29,200	2,072.00	60,502,400
オリジン	4,600	1,286.00	5,915,600
山洋電気	7,800	5,510.00	42,978,000
デンヨー	14,700	1,597.00	23,475,900
PHCホールディングス	30,700	1,453.00	44,607,100
東芝テック	20,800	4,045.00	84,136,000
芝浦メカトロニクス	3,500	10,720.00	37,520,000
マブチモーター	44,700	3,565.00	159,355,500
日本電産	453,900	8,642.00	3,922,603,800
トレックス・セミコンダクター	9,200	2,954.00	27,176,800
東光高岳	11,400	1,781.00	20,303,400
ダイヘン	19,000	4,125.00	78,375,000
ヤーマン	32,600	1,206.00	39,315,600
JVCケンウッド	164,000	190.00	31,160,000
ミマキエンジニアリング	19,500	573.00	11,173,500
I-PEX	9,900	1,390.00	13,761,000
日新電機	45,300	1,501.00	67,995,300
大崎電気工業	33,500	496.00	16,616,000
オムロン	161,100	7,425.00	1,196,167,500
日東工業	24,300	2,190.00	53,217,000
IDEC	24,000	2,642.00	63,408,000
正興電機製作所	6,700	1,092.00	7,316,400
不二電機工業	4,600	1,185.00	5,451,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,300	2,082.00	125,544,600
サクサホールディングス	4,500	1,515.00	6,817,500
メルコホールディングス	5,400	3,660.00	19,764,000
テクノメディカ	5,100	1,617.00	8,246,700
日本電気	235,000	5,260.00	1,236,100,000
富士通	174,100	19,500.00	3,394,950,000
沖電気工業	75,100	755.00	56,700,500
岩崎通信機	7,900	875.00	6,912,500

電気興業	9,600	2,550.00	24,480,000
サンケン電気	17,100	5,490.00	93,879,000
ナカヨ	3,300	1,124.00	3,709,200
アイホン	9,500	1,700.00	16,150,000
ルネサスエレクトロニクス	1,052,400	1,530.00	1,610,172,000
セイコーエプソン	224,100	2,155.00	482,935,500
ワコム	151,300	970.00	146,761,000
アルバック	38,500	5,540.00	213,290,000
アクセル	9,100	845.00	7,689,500
E I Z O	14,100	3,495.00	49,279,500
日本信号	43,800	911.00	39,901,800
京三製作所	39,000	435.00	16,965,000
能美防災	23,900	1,701.00	40,653,900
ホーチキ	13,700	1,220.00	16,714,000
星和電機	10,800	463.00	5,000,400
エレコム	45,100	1,561.00	70,401,100
パナソニック ホールディングス	2,063,800	1,198.50	2,473,464,300
シャープ	196,100	1,067.00	209,238,700
アンリツ	124,600	1,444.00	179,922,400
富士通ゼネラル	52,500	2,531.00	132,877,500
ソニーグループ	1,212,100	11,995.00	14,539,139,500
T D K	280,500	4,415.00	1,238,407,500
帝国通信工業	9,400	1,454.00	13,667,600
タムラ製作所	71,300	551.00	39,286,300
アルプスアルパイン	163,300	1,395.00	227,803,500
池上通信機	5,700	605.00	3,448,500
日本電波工業	20,400	1,141.00	23,276,400
鈴木	11,000	854.00	9,394,000
メイコー	21,200	4,540.00	96,248,000
日本トリム	4,200	2,413.00	10,134,600
ローランド ディー . ジー .	11,800	3,165.00	37,347,000
フォスター電機	18,500	705.00	13,042,500
S M K	4,500	2,176.00	9,792,000
ヨコオ	13,900	2,414.00	33,554,600
ホシデン	45,000	1,247.00	56,115,000
ヒロセ電機	28,300	17,760.00	502,608,000
日本航空電子工業	40,700	1,981.00	80,626,700
T O A	20,700	810.00	16,767,000
マクセル	37,300	1,234.00	46,028,200
古野電気	24,200	1,013.00	24,514,600
ユニデンホールディングス	4,200	3,380.00	14,196,000
スミダコーポレーション	19,600	839.00	16,444,400

アイコム	6,500	2,417.00	15,710,500
リオン	7,400	2,591.00	19,173,400
本多通信工業	17,500	516.00	9,030,000
横河電機	182,900	2,306.00	421,767,400
新電元工業	7,000	3,250.00	22,750,000
アズビル	113,400	3,750.00	425,250,000
東亜ディーケーケー	10,800	972.00	10,497,600
日本光電工業	76,800	3,040.00	233,472,000
チノー	6,100	1,697.00	10,351,700
共和電業	18,500	345.00	6,382,500
日本電子材料	9,300	1,890.00	17,577,000
堀場製作所	34,100	6,630.00	226,083,000
アドバンテスト	143,800	8,790.00	1,264,002,000
小野測器	10,300	440.00	4,532,000
エスベック	15,400	1,793.00	27,612,200
キーエンス	175,300	51,640.00	9,052,492,000
日置電機	9,400	7,190.00	67,586,000
シスメックス	147,100	8,414.00	1,237,699,400
日本マイクロニクス	31,300	1,475.00	46,167,500
メガチップス	17,500	3,610.00	63,175,000
O B A R A G R O U P	8,400	2,932.00	24,628,800
澤藤電機	3,200	1,526.00	4,883,200
原田工業	10,500	969.00	10,174,500
コーセル	23,000	782.00	17,986,000
イリソ電子工業	16,600	3,340.00	55,444,000
オブテックスグループ	32,400	1,983.00	64,249,200
千代田インテグレ	8,200	1,960.00	16,072,000
レーザーテック	81,300	18,625.00	1,514,212,500
スタンレー電気	128,700	2,336.00	300,643,200
岩崎電気	6,900	2,493.00	17,201,700
ウシオ電機	94,800	1,752.00	166,089,600
岡谷電機産業	18,200	291.00	5,296,200
ハリオス テクノ ホールディング	20,600	294.00	6,056,400
エノモト	6,100	1,662.00	10,138,200
日本セラミック	18,600	2,116.00	39,357,600
遠藤照明	10,400	807.00	8,392,800
古河電池	14,800	1,204.00	17,819,200
双信電機	11,300	595.00	6,723,500
山一電機	13,700	1,875.00	25,687,500
図研	13,000	2,847.00	37,011,000
日本電子	38,400	6,270.00	240,768,000
カシオ計算機	124,700	1,180.00	147,146,000

ファナック	169,800	21,315.00	3,619,287,000
日本シイエムケイ	38,100	467.00	17,792,700
エンプラス	5,100	3,365.00	17,161,500
大真空	25,800	1,025.00	26,445,000
ローム	82,600	10,700.00	883,820,000
浜松ホトニクス	132,400	6,050.00	801,020,000
三井ハイテック	17,500	10,960.00	191,800,000
新光電気工業	57,100	4,855.00	277,220,500
京セラ	272,400	7,349.00	2,001,867,600
太陽誘電	88,900	5,230.00	464,947,000
村田製作所	541,500	8,247.00	4,465,750,500
双葉電子工業	34,900	688.00	24,011,200
北陸電気工業	8,200	1,218.00	9,987,600
ニチコン	55,600	1,325.00	73,670,000
日本ケミコン	19,000	1,823.00	34,637,000
K O A	28,300	1,705.00	48,251,500
市光工業	26,600	357.00	9,496,200
小糸製作所	100,100	4,725.00	472,972,500
ミツバ	32,000	401.00	12,832,000
S C R E E Nホールディングス	31,500	11,900.00	374,850,000
キャノン電子	18,500	1,549.00	28,656,500
キャノン	961,500	3,267.00	3,141,220,500
リコー	486,000	1,065.00	517,590,000
象印マホービン	50,300	1,385.00	69,665,500
M U T O Hホールディングス	3,000	2,164.00	6,492,000
東京エレクトロン	122,800	59,750.00	7,337,300,000
トヨタ紡織	71,400	2,092.00	149,368,800
芦森工業	3,600	1,078.00	3,880,800
ユニプレス	30,800	862.00	26,549,600
豊田自動織機	143,600	8,300.00	1,191,880,000
モリタホールディングス	31,000	1,318.00	40,858,000
三櫻工業	26,800	646.00	17,312,800
デンソー	394,500	7,871.00	3,105,109,500
東海理化電機製作所	50,900	1,403.00	71,412,700
川崎重工業	134,500	2,517.00	338,536,500
名村造船所	52,600	406.00	21,355,600
日本車輛製造	6,500	2,042.00	13,273,000
三菱ロジスネクスト	25,600	868.00	22,220,800
近畿車輛	2,900	1,222.00	3,543,800
日産自動車	2,282,000	502.30	1,146,248,600
いすゞ自動車	576,100	1,499.00	863,573,900
トヨタ自動車	9,148,400	2,126.50	19,454,072,600

日野自動車	241,600	710.00	171,536,000
三菱自動車工業	716,200	384.00	275,020,800
エフテック	12,700	569.00	7,226,300
レシップホールディングス	7,700	582.00	4,481,400
G M B	3,500	713.00	2,495,500
ファルテック	3,400	617.00	2,097,800
武蔵精密工業	43,100	1,392.00	59,995,200
日産車体	28,300	592.00	16,753,600
新明和工業	51,900	974.00	50,550,600
極東開発工業	32,500	1,390.00	45,175,000
トピー工業	14,900	1,295.00	19,295,500
ティラド	5,000	2,837.00	14,185,000
曙ブレーキ工業	106,200	147.00	15,611,400
タチエス	32,500	1,138.00	36,985,000
N O K	79,800	1,173.00	93,605,400
フタバ産業	44,800	382.00	17,113,600
K Y B	18,000	2,953.00	53,154,000
大同メタル工業	37,100	525.00	19,477,500
プレス工業	88,900	413.00	36,715,700
ミクニ	23,200	359.00	8,328,800
太平洋工業	38,100	1,048.00	39,928,800
河西工業	23,700	288.00	6,825,600
アイシン	141,600	4,125.00	584,100,000
マツダ	582,000	1,094.00	636,708,000
今仙電機製作所	12,700	586.00	7,442,200
本田技研工業	1,451,000	3,184.00	4,619,984,000
スズキ	403,300	3,830.00	1,544,639,000
S U B A R U	523,700	2,132.50	1,116,790,250
安永	8,300	700.00	5,810,000
ヤマハ発動機	252,500	2,613.00	659,782,500
T B K	20,000	341.00	6,820,000
エクセディ	29,200	1,673.00	48,851,600
豊田合成	57,300	2,042.00	117,006,600
愛三工業	30,300	738.00	22,361,400
盟和産業	2,700	1,050.00	2,835,000
日本プラスト	14,400	449.00	6,465,600
ヨロズ	16,100	811.00	13,057,100
エフ・シー・シー	31,600	1,330.00	42,028,000
シマノ	73,700	22,965.00	1,692,520,500
テイ・エス テック	81,700	1,311.00	107,108,700
ジャムコ	11,300	941.00	10,633,300
テルモ	547,500	4,221.00	2,310,997,500

クリエートメディック	5,800	1,008.00	5,846,400
日機装	52,100	823.00	42,878,300
日本エム・ディ・エム	11,200	1,543.00	17,281,600
島津製作所	237,200	4,700.00	1,114,840,000
JMS	15,400	573.00	8,824,200
長野計器	13,300	1,154.00	15,348,200
ブイ・テクノロジー	8,500	2,915.00	24,777,500
東京計器	12,300	1,347.00	16,568,100
愛知時計電機	7,400	1,511.00	11,181,400
インターアクション	9,700	2,132.00	20,680,400
オーバル	17,400	327.00	5,689,800
東京精密	31,000	4,950.00	153,450,000
マニー	72,800	1,466.00	106,724,800
ニコン	280,400	1,601.00	448,920,400
トプコン	91,000	1,850.00	168,350,000
オリンパス	962,700	2,721.00	2,619,506,700
理研計器	13,800	4,335.00	59,823,000
タムロン	14,000	2,456.00	34,384,000
HOYA	373,600	14,025.00	5,239,740,000
シード	9,100	500.00	4,550,000
ノーリツ鋼機	17,400	2,350.00	40,890,000
A & Dホロンホールディングス	21,800	1,018.00	22,192,400
朝日インテック	212,200	1,954.00	414,638,800
シチズン時計	201,500	555.00	111,832,500
リズム	6,100	1,798.00	10,967,800
大研医器	15,400	527.00	8,115,800
メニコン	61,200	2,747.00	168,116,400
シンシア	2,100	459.00	963,900
松風	7,000	1,502.00	10,514,000
セイコーホールディングス	27,400	2,632.00	72,116,800
ニプロ	137,400	1,036.00	142,346,400
中本パックス	5,400	1,622.00	8,758,800
スノーピーク	25,200	2,683.00	67,611,600
パラマウントベッドホールディングス	37,100	2,035.00	75,498,500
トランザクション	11,800	1,065.00	12,567,000
粧美堂	5,100	416.00	2,121,600
ニホンフラッシュ	15,600	893.00	13,930,800
前田工織	18,700	2,660.00	49,742,000
永大産業	22,500	269.00	6,052,500
アートネイチャー	16,500	760.00	12,540,000
バンダイナムコホールディングス	164,500	9,727.00	1,600,091,500
アイフィスジャパン	4,900	704.00	3,449,600

共立印刷	28,500	153.00	4,360,500
S H O E I	17,300	4,855.00	83,991,500
フランスベッドホールディングス	24,900	906.00	22,559,400
パイロットコーポレーション	29,300	5,020.00	147,086,000
萩原工業	11,900	1,140.00	13,566,000
フジシールインターナショナル	42,200	1,569.00	66,211,800
タカラトミー	79,900	1,292.00	103,230,800
広済堂ホールディングス	12,000	1,014.00	12,168,000
エステールホールディングス	4,300	636.00	2,734,800
タカノ	6,600	855.00	5,643,000
プロネクサス	15,000	1,119.00	16,785,000
ホクシン	13,600	146.00	1,985,600
ウッドワン	5,900	1,221.00	7,203,900
大建工業	10,300	1,859.00	19,147,700
凸版印刷	266,100	2,437.00	648,485,700
大日本印刷	216,000	2,972.00	641,952,000
共同印刷	5,200	2,600.00	13,520,000
N I S S H A	35,600	1,507.00	53,649,200
光村印刷	1,600	1,275.00	2,040,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,300	1,807.00	20,419,100
アシックス	155,900	2,284.00	356,075,600
ツツミ	4,800	1,960.00	9,408,000
ローランド	13,500	4,675.00	63,112,500
小松ウオール工業	5,900	1,929.00	11,381,100
ヤマハ	112,500	5,390.00	606,375,000
河合楽器製作所	5,100	2,883.00	14,703,300
クリナップ	18,000	555.00	9,990,000
ピジョン	116,900	1,880.00	219,772,000
兼松サステック	1,200	1,609.00	1,930,800
キングジム	15,100	915.00	13,816,500
リンテック	38,400	2,387.00	91,660,800
イトーキ	35,700	409.00	14,601,300
任天堂	109,200	58,330.00	6,369,636,000
三菱鉛筆	28,000	1,348.00	37,744,000
タカラスタANDARD	34,100	1,240.00	42,284,000
コクヨ	87,700	1,679.00	147,248,300
ナカバヤシ	16,100	493.00	7,937,300
グローブライド	15,400	2,264.00	34,865,600
オカムラ	58,400	1,128.00	65,875,200
美津濃	17,000	2,233.00	37,961,000
東京電力ホールディングス	1,448,100	486.00	703,776,600
中部電力	561,600	1,312.00	736,819,200

関西電力	695,600	1,269.00	882,716,400
中国電力	286,900	871.00	249,889,900
北陸電力	168,500	525.00	88,462,500
東北電力	433,000	721.00	312,193,000
四国電力	165,300	772.00	127,611,600
九州電力	379,800	847.00	321,690,600
北海道電力	168,100	499.00	83,881,900
沖縄電力	41,000	1,205.00	49,405,000
電源開発	150,300	2,056.00	309,016,800
エフオン	11,700	546.00	6,388,200
イーレックス	26,100	2,091.00	54,575,100
レノバ	37,900	1,941.00	73,563,900
東京瓦斯	353,300	2,569.00	907,627,700
大阪瓦斯	333,800	2,436.00	813,136,800
東邦瓦斯	80,100	2,835.00	227,083,500
北海道瓦斯	9,600	1,666.00	15,993,600
広島ガス	34,800	321.00	11,170,800
西部ガスホールディングス	19,500	1,965.00	38,317,500
静岡ガス	47,300	831.00	39,306,300
メタウォーター	20,100	2,095.00	42,109,500
SBSホールディングス	14,300	2,955.00	42,256,500
東武鉄道	180,700	2,903.00	524,572,100
相鉄ホールディングス	59,000	2,250.00	132,750,000
東急	463,000	1,493.00	691,259,000
京浜急行電鉄	226,400	1,355.00	306,772,000
小田急電鉄	258,300	1,717.00	443,501,100
京王電鉄	90,100	4,305.00	387,880,500
京成電鉄	120,900	3,465.00	418,918,500
富士急行	20,900	4,120.00	86,108,000
新京成電鉄	4,500	2,870.00	12,915,000
東日本旅客鉄道	310,300	6,692.00	2,076,527,600
西日本旅客鉄道	215,000	4,805.00	1,033,075,000
東海旅客鉄道	144,400	16,330.00	2,358,052,000
西武ホールディングス	239,700	1,360.00	325,992,000
鴻池運輸	28,500	1,130.00	32,205,000
西日本鉄道	48,900	2,775.00	135,697,500
ハマキョウレックス	12,900	2,878.00	37,126,200
サカイ引越センター	8,900	4,435.00	39,471,500
近鉄グループホールディングス	175,600	3,780.00	663,768,000
阪急阪神ホールディングス	219,000	3,445.00	754,455,000
南海電気鉄道	78,300	2,455.00	192,226,500
京阪ホールディングス	74,800	3,015.00	225,522,000

神戸電鉄	4,400	3,410.00	15,004,000
名古屋鉄道	185,100	2,172.00	402,037,200
山陽電気鉄道	13,400	2,138.00	28,649,200
アルプス物流	12,800	1,177.00	15,065,600
ヤマトホールディングス	256,800	2,239.00	574,975,200
山九	45,800	3,885.00	177,933,000
丸運	9,300	235.00	2,185,500
丸全昭和運輸	13,200	3,075.00	40,590,000
センコーグループホールディングス	88,100	854.00	75,237,400
トナミホールディングス	3,800	3,420.00	12,996,000
ニッコンホールディングス	58,800	2,033.00	119,540,400
日本石油輸送	2,000	2,579.00	5,158,000
福山通運	25,700	3,290.00	84,553,000
セイノーホールディングス	108,100	1,023.00	110,586,300
エスライン	5,200	857.00	4,456,400
神奈川中央交通	4,500	3,545.00	15,952,500
日立物流	35,400	8,480.00	300,192,000
丸和運輸機関	33,500	1,575.00	52,762,500
C & F ロジホールディングス	16,500	1,063.00	17,539,500
九州旅客鉄道	129,200	2,607.00	336,824,400
S Gホールディングス	320,600	2,253.00	722,311,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	57,400	7,460.00	428,204,000
日本郵船	153,600	10,930.00	1,678,848,000
商船三井	291,000	3,565.00	1,037,415,000
川崎汽船	56,400	10,610.00	598,404,000
NSユナイテッド海運	10,000	4,315.00	43,150,000
飯野海運	82,200	670.00	55,074,000
共栄タンカー	6,800	1,113.00	7,568,400
乾汽船	11,500	1,829.00	21,033,500
日本航空	402,700	2,388.00	961,647,600
ANAホールディングス	446,100	2,601.50	1,160,529,150
パスコ	3,500	1,330.00	4,655,000
トランコム	5,100	6,450.00	32,895,000
日新	13,800	1,685.00	23,253,000
三菱倉庫	51,100	3,070.00	156,877,000
三井倉庫ホールディングス	18,400	2,963.00	54,519,200
住友倉庫	57,100	2,204.00	125,848,400
澁澤倉庫	9,800	2,350.00	23,030,000
東陽倉庫	27,600	304.00	8,390,400
日本トランスシティ	35,000	531.00	18,585,000
ケイヒン	3,100	1,377.00	4,268,700
中央倉庫	10,000	996.00	9,960,000

川西倉庫	3,300	1,150.00	3,795,000
安田倉庫	13,200	959.00	12,658,800
ファイブホールディングス	3,900	758.00	2,956,200
東洋埠頭	5,300	1,343.00	7,117,900
上組	94,500	2,592.00	244,944,000
サンリツ	4,800	746.00	3,580,800
キムラユニティー	4,800	1,525.00	7,320,000
キューソー流通システム	9,100	1,085.00	9,873,500
近鉄エクスプレス	34,600	4,175.00	144,455,000
東海運	10,400	300.00	3,120,000
エーアイティー	11,500	1,646.00	18,929,000
内外トランスライン	7,100	2,032.00	14,427,200
日本コンセプト	5,800	1,503.00	8,717,400
NEC ネットエスアイ	62,900	1,871.00	117,685,900
クロスキャット	10,100	869.00	8,776,900
システナ	271,400	441.00	119,687,400
デジタルアーツ	10,200	7,200.00	73,440,000
日鉄ソリューションズ	31,200	3,795.00	118,404,000
キューブシステム	9,800	953.00	9,339,400
WOW WORLD	2,800	1,147.00	3,211,600
コア	8,200	1,492.00	12,234,400
手間いらず	2,800	5,740.00	16,072,000
ラクーンホールディングス	16,300	1,466.00	23,895,800
ソリトンシステムズ	9,700	1,298.00	12,590,600
ソフトクリエイトホールディングス	8,300	4,245.00	35,233,500
T I S	171,100	3,470.00	593,717,000
J N S ホールディングス	8,800	403.00	3,546,400
グリー	86,600	898.00	77,766,800
G M O ペパボ	2,100	2,205.00	4,630,500
コーエーテクモホールディングス	60,600	4,560.00	276,336,000
三菱総合研究所	8,900	4,140.00	36,846,000
電算	2,200	2,278.00	5,011,600
A G S	8,500	744.00	6,324,000
ファインデックス	16,300	620.00	10,106,000
ブレインパッド	16,300	1,115.00	18,174,500
K L a b	33,300	489.00	16,283,700
ポルトゥウィンホールディングス	27,700	1,044.00	28,918,800
ネクソン	431,400	3,230.00	1,393,422,000
アイスタイル	50,000	215.00	10,750,000
エムアップホールディングス	22,100	1,177.00	26,011,700
エイチーム	12,600	733.00	9,235,800
エニグモ	20,900	558.00	11,662,200

テクノスジャパン	15,100	520.00	7,852,000
コロプラ	62,800	641.00	40,254,800
ブロードリーフ	94,700	387.00	36,648,900
クロス・マーケティンググループ	7,500	803.00	6,022,500
デジタルハーツホールディングス	8,700	1,902.00	16,547,400
システム情報	14,400	1,030.00	14,832,000
メディアドゥ	6,800	1,877.00	12,763,600
じげん	54,300	360.00	19,548,000
ブイキューブ	19,500	926.00	18,057,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	511.00	2,350,600
サイバーリンクス	6,500	1,062.00	6,903,000
フィックスターズ	19,100	812.00	15,509,200
CARTA HOLDINGS	7,800	1,966.00	15,334,800
オブティム	13,500	839.00	11,326,500
セレス	7,300	1,387.00	10,125,100
SHIFT	11,100	20,500.00	227,550,000
ティーガイア	17,000	1,659.00	28,203,000
セック	2,900	2,474.00	7,174,600
テクマトリックス	32,200	1,676.00	53,967,200
プロシップ	6,400	1,428.00	9,139,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	49,400	2,476.00	122,314,400
GMOペイメントゲートウェイ	36,800	10,780.00	396,704,000
ザッパラス	7,400	388.00	2,871,200
システムリサーチ	5,600	2,089.00	11,698,400
インターネットイニシアティブ	50,600	4,720.00	238,832,000
さくらインターネット	20,700	572.00	11,840,400
ヴィンクス	5,500	1,087.00	5,978,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	5,760.00	24,768,000
SRAホールディングス	9,200	2,841.00	26,137,200
システムインテグレータ	6,400	489.00	3,129,600
朝日ネット	17,700	620.00	10,974,000
eBASE	23,100	485.00	11,203,500
アバント	20,500	1,325.00	27,162,500
アドソル日進	6,900	1,614.00	11,136,600
ODKソリューションズ	4,300	583.00	2,506,900
フリービット	10,100	901.00	9,100,100
コムチュア	21,400	2,863.00	61,268,200
サイバーコム	3,100	1,150.00	3,565,000
アステリア	13,900	1,023.00	14,219,700
アイル	9,700	1,441.00	13,977,700
マークラインズ	9,600	2,449.00	23,510,400
メディカル・データ・ビジョン	24,300	952.00	23,133,600

g u m i	26,700	525.00	14,017,500	
ショーケース	4,600	460.00	2,116,000	
モバイルファクトリー	4,500	1,034.00	4,653,000	
テラスカイ	7,100	1,424.00	10,110,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,500	1,458.00	12,393,000	
P C Iホールディングス	8,000	1,060.00	8,480,000	
パイプドHD	3,500	2,741.00	9,593,500	
アイビーシー	3,300	512.00	1,689,600	
ネオジャパン	5,500	1,283.00	7,056,500	
P R T I M E S	4,100	2,149.00	8,810,900	
ラクス	87,200	1,628.00	141,961,600	
ランドコンピュータ	4,500	926.00	4,167,000	
ダブルスタンダード	5,800	2,063.00	11,965,400	
オープンドア	11,400	1,966.00	22,412,400	
マイネット	6,800	514.00	3,495,200	
アカツキ	8,500	2,946.00	25,041,000	
ベネフィットジャパン	1,500	2,033.00	3,049,500	
U b i c o mホールディングス	5,100	2,704.00	13,790,400	
カナミックネットワーク	22,600	505.00	11,413,000	
ノムラシステムコーポレーション	10,700	229.00	2,450,300	
チェンジ	38,100	1,750.00	66,675,000	
シンクロ・フード	10,400	315.00	3,276,000	
オークネット	10,200	1,785.00	18,207,000	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	702.00	2,667,600	
セグエグループ	5,300	549.00	2,909,700	
エイトレッド	2,800	2,050.00	5,740,000	
マクロミル	38,300	1,015.00	38,874,500	
ビーグリー	4,600	1,486.00	6,835,600	
オロ	5,900	1,859.00	10,968,100	
ユーザーローカル	5,900	1,795.00	10,590,500	
テモナ	4,200	387.00	1,625,400	
ニーズウェル	5,400	692.00	3,736,800	
マネーフォワード	38,700	3,640.00	140,868,000	
サインポスト	6,100	900.00	5,490,000	
電算システムホールディングス	7,900	2,442.00	19,291,800	
ソルクシーズ	16,700	384.00	6,412,800	
フェイス	5,300	680.00	3,604,000	
プロトコーポレーション	20,400	987.00	20,134,800	
ハイマックス	5,200	1,300.00	6,760,000	
野村総合研究所	342,500	3,600.00	1,233,000,000	
サイバネットシステム	13,800	750.00	10,350,000	
C Eホールディングス	9,900	480.00	4,752,000	

日本システム技術	3,600	2,373.00	8,542,800
インテージホールディングス	22,000	1,440.00	31,680,000
東邦システムサイエンス	5,200	913.00	4,747,600
ソースネクスト	82,800	230.00	19,044,000
インフォコム	20,900	2,179.00	45,541,100
シンプレクス・ホールディングス	30,100	1,942.00	58,454,200
HEROZ	5,700	920.00	5,244,000
ラクスル	22,100	2,139.00	47,271,900
I P S	5,300	2,250.00	11,925,000
F I G	21,300	311.00	6,624,300
システムサポート	7,000	1,179.00	8,253,000
イーソル	12,000	592.00	7,104,000
アルテリア・ネットワークス	20,200	1,248.00	25,209,600
東海ソフト	3,200	1,064.00	3,404,800
ウイングアーク1st	14,600	1,411.00	20,600,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,400	1,662.00	7,312,800
サーバーワークス	3,300	2,165.00	7,144,500
東名	1,700	942.00	1,601,400
ヴィッツ	1,900	1,188.00	2,257,200
トピラシステムズ	4,100	811.00	3,325,100
S a n s a n	62,800	1,064.00	66,819,200
L i n k - U	3,700	660.00	2,442,000
ギフトィ	16,400	1,129.00	18,515,600
ベース	3,300	6,240.00	20,592,000
J M D C	23,800	5,360.00	127,568,000
フォーカスシステムズ	12,300	928.00	11,414,400
クレスコ	13,900	2,190.00	30,441,000
フジ・メディア・ホールディングス	173,700	1,103.00	191,591,100
オービック	59,800	19,290.00	1,153,542,000
ジャストシステム	27,100	4,825.00	130,757,500
T D C ソフト	15,800	1,052.00	16,621,600
Zホールディングス	2,738,500	422.30	1,156,468,550
トレンドマイクロ	95,900	7,610.00	729,799,000
I Dホールディングス	12,200	872.00	10,638,400
日本オラクル	30,800	7,940.00	244,552,000
アルファシステムズ	5,100	4,270.00	21,777,000
フューチャー	40,200	1,693.00	68,058,600
C A C H o l d i n g s	10,400	1,414.00	14,705,600
S B テクノロジー	8,300	2,320.00	19,256,000
トーセ	5,100	731.00	3,728,100
オービックビジネスコンサルタント	18,200	4,490.00	81,718,000
伊藤忠テクノソリューションズ	86,600	3,215.00	278,419,000

アイティフォー	23,300	788.00	18,360,400
東計電算	2,300	5,990.00	13,777,000
エクスネット	3,200	1,008.00	3,225,600
大塚商会	102,800	4,150.00	426,620,000
サイボウズ	25,600	1,057.00	27,059,200
電通国際情報サービス	24,900	4,140.00	103,086,000
A C C E S S	21,800	593.00	12,927,400
デジタルガレージ	31,500	4,020.00	126,630,000
E Mシステムズ	31,600	954.00	30,146,400
ウェザーニューズ	6,000	6,770.00	40,620,000
C I J	15,000	814.00	12,210,000
ビジネスエンジニアリング	4,400	2,065.00	9,086,000
日本エンタープライズ	20,600	165.00	3,399,000
WOWOW	8,400	1,494.00	12,549,600
スカラ	16,200	789.00	12,781,800
インテリジェント ウェイブ	9,800	653.00	6,399,400
I M A G I C A G R O U P	14,600	717.00	10,468,200
ネットワンシステムズ	70,100	2,795.00	195,929,500
システムソフト	53,000	111.00	5,883,000
アルゴグラフィックス	14,800	3,160.00	46,768,000
マーベラス	30,200	719.00	21,713,800
エイベックス	32,900	1,157.00	38,065,300
B I P R O G Y	59,400	2,885.00	171,369,000
兼松エレクトロニクス	10,400	3,930.00	40,872,000
都築電気	9,000	1,364.00	12,276,000
T B S ホールディングス	99,800	1,723.00	171,955,400
日本テレビホールディングス	158,700	1,224.00	194,248,800
朝日放送グループホールディングス	16,600	666.00	11,055,600
テレビ朝日ホールディングス	45,800	1,466.00	67,142,800
スカパーJ S A Tホールディングス	161,200	466.00	75,119,200
テレビ東京ホールディングス	12,300	2,042.00	25,116,600
日本BS放送	6,600	1,061.00	7,002,600
ビジョン	31,400	1,350.00	42,390,000
スマートバリュー	4,700	552.00	2,594,400
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,700	2,041.00	32,043,700
ワイヤレスゲート	8,500	311.00	2,643,500
コネクシオ	13,600	1,349.00	18,346,400
クロップス	3,700	1,045.00	3,866,500
日本電信電話	2,080,900	3,989.00	8,300,710,100
K D D I	1,384,300	4,550.00	6,298,565,000
ソフトバンク	2,876,000	1,491.50	4,289,554,000
光通信	21,900	14,590.00	319,521,000

エムティーアイ	16,400	453.00	7,429,200
GMOインターネット	66,600	2,590.00	172,494,000
ファイバーゲート	8,900	1,083.00	9,638,700
アйдママーケティングコミュニケーション	4,800	286.00	1,372,800
KADOKAWA	102,800	3,135.00	322,278,000
学研ホールディングス	27,100	846.00	22,926,600
ゼンリン	31,200	931.00	29,047,200
昭文社ホールディングス	8,200	424.00	3,476,800
インプレスホールディングス	15,700	222.00	3,485,400
アイネット	9,300	1,239.00	11,522,700
松竹	11,500	13,870.00	159,505,000
東宝	112,100	5,030.00	563,863,000
東映	5,600	18,020.00	100,912,000
エヌ・ティ・ティ・データ	505,600	2,037.00	1,029,907,200
ピー・シー・エー	11,300	1,252.00	14,147,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,526.00	9,308,600
D T S	35,400	3,125.00	110,625,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	88,400	6,360.00	562,224,000
シーイーシー	20,500	1,237.00	25,358,500
カブコン	179,100	3,640.00	651,924,000
アイ・エス・ビー	9,100	1,066.00	9,700,600
ジャステック	11,200	1,164.00	13,036,800
S C S K	131,500	2,171.00	285,486,500
日本システムウエア	7,200	2,488.00	17,913,600
アイネス	16,000	1,528.00	24,448,000
T K C	30,000	3,490.00	104,700,000
富士ソフト	18,900	7,330.00	138,537,000
N S D	59,600	2,327.00	138,689,200
コナミホールディングス	69,000	8,890.00	613,410,000
福井コンピュータホールディングス	8,800	3,415.00	30,052,000
J B C Cホールディングス	12,900	1,632.00	21,052,800
ミロク情報サービス	16,900	1,206.00	20,381,400
ソフトバンクグループ	1,138,600	5,358.00	6,100,618,800
高千穂交易	6,900	1,807.00	12,468,300
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,822.00	5,648,200
伊藤忠食品	4,100	4,840.00	19,844,000
エレマテック	15,300	1,288.00	19,706,400
あらた	14,500	4,040.00	58,580,000
トーメンデバイス	2,900	6,130.00	17,777,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,640.00	32,148,000
フィールズ	16,700	1,059.00	17,685,300
双日	200,500	2,084.00	417,842,000

アルフレッサ ホールディングス	202,400	1,696.00	343,270,400
横浜冷凍	48,700	852.00	41,492,400
ラサ商事	8,900	968.00	8,615,200
アルコニックス	24,100	1,312.00	31,619,200
神戸物産	137,000	3,155.00	432,235,000
ハイパー	4,800	472.00	2,265,600
あい ホールディングス	27,200	1,653.00	44,961,600
ディーブイエックス	6,500	1,094.00	7,111,000
ダイワボウホールディングス	84,900	1,723.00	146,282,700
マクニカ・富士エレホールディングス	45,500	2,836.00	129,038,000
ラクト・ジャパン	6,600	1,965.00	12,969,000
グリムス	8,500	1,531.00	13,013,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,300	691.00	21,628,300
八洲電機	13,800	997.00	13,758,600
メディアスホールディングス	10,900	1,097.00	11,957,300
レスターホールディングス	18,100	2,061.00	37,304,100
ジューテックホールディングス	4,000	998.00	3,992,000
大光	8,100	720.00	5,832,000
O C H Iホールディングス	4,700	1,200.00	5,640,000
T O K A Iホールディングス	92,400	873.00	80,665,200
黒谷	5,200	583.00	3,031,600
C o m i n i x	3,400	731.00	2,485,400
三洋貿易	18,100	954.00	17,267,400
ビューティガレージ	3,100	2,580.00	7,998,000
ウイン・パートナーズ	13,800	1,054.00	14,545,200
ミタチ産業	4,800	931.00	4,468,800
シップヘルスケアホールディングス	57,000	2,321.00	132,297,000
明治電機工業	5,900	1,101.00	6,495,900
デリカフーズホールディングス	7,500	542.00	4,065,000
スターティアホールディングス	4,400	780.00	3,432,000
コメダホールディングス	41,600	2,227.00	92,643,200
ピーバンドットコム	2,700	546.00	1,474,200
アセンテック	6,600	763.00	5,035,800
富士興産	4,800	1,105.00	5,304,000
協栄産業	2,000	1,375.00	2,750,000
フルサト・マルカホールディングス	17,400	3,830.00	66,642,000
ヤマエグループホールディングス	11,400	1,145.00	13,053,000
小野建	17,500	1,394.00	24,395,000
南陽	3,700	1,836.00	6,793,200
佐島電機	11,900	1,147.00	13,649,300
エコトレーディング	4,100	570.00	2,337,000
伯東	11,600	2,855.00	33,118,000

コンドーテック	14,300	1,087.00	15,544,100
中山福	10,100	332.00	3,353,200
ナガイレーベン	23,800	1,919.00	45,672,200
三菱食品	18,300	3,100.00	56,730,000
松田産業	13,900	2,056.00	28,578,400
第一興商	36,200	4,030.00	145,886,000
メディカルホールディングス	186,100	1,801.00	335,166,100
S P K	7,600	1,395.00	10,602,000
萩原電気ホールディングス	6,700	2,030.00	13,601,000
アズワン	27,300	6,550.00	178,815,000
スズデン	6,200	2,031.00	12,592,200
尾家産業	4,700	889.00	4,178,300
シモジマ	11,700	974.00	11,395,800
ドウシシャ	18,000	1,551.00	27,918,000
小津産業	4,200	1,980.00	8,316,000
高速	10,500	1,573.00	16,516,500
たけびし	6,700	1,465.00	9,815,500
リックス	4,000	1,880.00	7,520,000
丸文	15,800	800.00	12,640,000
ハピネット	15,000	1,579.00	23,685,000
橋本総業ホールディングス	3,500	1,905.00	6,667,500
日本ライフライン	56,500	932.00	52,658,000
タカショー	14,700	758.00	11,142,600
I D O M	57,900	675.00	39,082,500
進和	11,300	2,207.00	24,939,100
エスケイジャパン	4,700	452.00	2,124,400
ダイترون	7,600	2,079.00	15,800,400
シークス	25,300	1,074.00	27,172,200
田中商事	5,900	625.00	3,687,500
オーハシテクニカ	9,700	1,273.00	12,348,100
白銅	6,200	2,499.00	15,493,800
ダイコー通産	2,300	1,211.00	2,785,300
伊藤忠商事	1,206,100	3,721.00	4,487,898,100
丸紅	1,740,800	1,369.50	2,384,025,600
高島	2,700	2,491.00	6,725,700
長瀬産業	92,000	1,826.00	167,992,000
蝶理	10,700	1,986.00	21,250,200
豊田通商	177,300	5,010.00	888,273,000
三共生興	24,500	557.00	13,646,500
兼松	67,700	1,325.00	89,702,500
ツカモトコーポレーション	3,200	1,296.00	4,147,200
三井物産	1,414,200	3,188.00	4,508,469,600

日本紙パルプ商事	9,300	3,610.00	33,573,000
カメイ	21,100	1,042.00	21,986,200
東都水産	1,000	4,460.00	4,460,000
OUGホールディングス	2,800	2,763.00	7,736,400
スターゼン	13,300	1,957.00	26,028,100
山善	72,600	949.00	68,897,400
椿本興業	3,400	3,530.00	12,002,000
住友商事	1,152,800	1,878.00	2,164,958,400
内田洋行	7,700	4,530.00	34,881,000
三菱商事	1,309,200	4,499.00	5,890,090,800
第一実業	7,800	3,170.00	24,726,000
キャノンマーケティングジャパン	47,300	3,040.00	143,792,000
西華産業	8,700	1,636.00	14,233,200
佐藤商事	14,000	1,149.00	16,086,000
菱洋エレクトロ	11,300	2,137.00	24,148,100
東京産業	16,100	704.00	11,334,400
ユアサ商事	16,200	3,230.00	52,326,000
神鋼商事	4,300	3,870.00	16,641,000
トルク	10,300	211.00	2,173,300
阪和興業	34,800	3,065.00	106,662,000
正栄食品工業	12,300	4,035.00	49,630,500
カナデン	15,500	1,024.00	15,872,000
菱電商事	15,100	1,671.00	25,232,100
岩谷産業	43,400	5,410.00	234,794,000
ナイス	6,100	1,660.00	10,126,000
ニチモウ	2,400	2,485.00	5,964,000
極東貿易	5,500	2,590.00	14,245,000
アステナホールディングス	25,400	413.00	10,490,200
三愛オブリ	44,100	955.00	42,115,500
稲畑産業	38,200	2,240.00	85,568,000
G S Iクレオス	9,100	1,287.00	11,711,700
明和産業	17,600	715.00	12,584,000
クワザワホールディングス	7,100	466.00	3,308,600
ワキタ	36,500	1,122.00	40,953,000
東邦ホールディングス	54,900	2,007.00	110,184,300
サンゲツ	47,400	1,540.00	72,996,000
ミツウロコグループホールディングス	23,700	934.00	22,135,800
シナネンホールディングス	6,500	3,350.00	21,775,000
伊藤忠エネクス	42,200	1,039.00	43,845,800
サンリオ	55,300	2,647.00	146,379,100
サンワテクノス	10,300	1,394.00	14,358,200
リョーサン	20,000	2,463.00	49,260,000

新光商事	26,300	914.00	24,038,200
トーヨー	7,800	1,157.00	9,024,600
三信電気	8,200	1,566.00	12,841,200
東陽テクニカ	18,800	1,080.00	20,304,000
モスフードサービス	25,000	3,090.00	77,250,000
加賀電子	16,100	3,085.00	49,668,500
ソーダニッカ	16,900	605.00	10,224,500
立花エレテック	13,200	1,572.00	20,750,400
フォーバル	7,300	904.00	6,599,200
PALTAC	26,700	4,455.00	118,948,500
三谷産業	29,800	315.00	9,387,000
西本Wismettacホールディングス	4,300	3,545.00	15,243,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,940.00	3,298,000
コア商事ホールディングス	12,000	847.00	10,164,000
国際紙パルプ商事	36,800	384.00	14,131,200
ヤマタネ	8,400	1,657.00	13,918,800
丸紅建材リース	1,700	1,856.00	3,155,200
日鉄物産	12,300	5,390.00	66,297,000
泉州電業	4,900	5,290.00	25,921,000
トラスコ中山	39,700	1,846.00	73,286,200
オートバックスセブン	60,800	1,378.00	83,782,400
モリト	13,900	731.00	10,160,900
加藤産業	22,900	3,205.00	73,394,500
北恵	4,900	900.00	4,410,000
イノテック	11,600	1,353.00	15,694,800
イエローハット	31,000	1,662.00	51,522,000
JKホールディングス	14,100	921.00	12,986,100
日伝	13,900	1,954.00	27,160,600
北沢産業	11,200	211.00	2,363,200
杉本商事	8,900	2,350.00	20,915,000
因幡電機産業	48,600	2,624.00	127,526,400
東テク	5,900	3,080.00	18,172,000
ミスミグループ本社	239,300	2,882.00	689,662,600
アルテック	12,200	238.00	2,903,600
タキヒヨー	5,400	1,021.00	5,513,400
蔵王産業	3,700	2,018.00	7,466,600
スズケン	70,400	3,535.00	248,864,000
ジェコス	13,200	834.00	11,008,800
グローセル	21,300	412.00	8,775,600
ローソン	42,200	4,580.00	193,276,000
サンエー	13,500	3,985.00	53,797,500
カワチ薬品	14,900	2,060.00	30,694,000

エービーシー・マート	29,800	5,480.00	163,304,000
ハードオフコーポレーション	8,800	879.00	7,735,200
アスクル	43,400	1,479.00	64,188,600
ゲオホールディングス	24,100	1,191.00	28,703,100
アダストリア	20,700	2,116.00	43,801,200
くら寿司	20,000	3,000.00	60,000,000
キャンドウ	7,200	2,495.00	17,964,000
アイケイ	6,700	538.00	3,604,600
パルグループホールディングス	16,900	1,570.00	26,533,000
エディオン	87,800	1,217.00	106,852,600
サーラコーポレーション	39,200	634.00	24,852,800
ワッツ	9,700	755.00	7,323,500
ハローズ	8,800	3,295.00	28,996,000
フジオフードグループ本社	14,800	1,370.00	20,276,000
あみやき亭	4,600	2,979.00	13,703,400
大黒天物産	6,200	4,570.00	28,334,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,037.00	16,592,000
ファーマライズホールディングス	4,800	705.00	3,384,000
アルペン	14,300	1,927.00	27,556,100
ハブ	6,900	517.00	3,567,300
クオールホールディングス	23,700	1,226.00	29,056,200
ジーンズホールディングス	11,100	4,170.00	46,287,000
ビックカメラ	113,300	1,139.00	129,048,700
D C Mホールディングス	113,500	1,074.00	121,899,000
Monotaro	241,100	1,916.00	461,947,600
東京一番フーズ	5,100	593.00	3,024,300
きちりホールディングス	5,100	407.00	2,075,700
アークランドサービスホールディングス	14,100	2,083.00	29,370,300
J.フロント リテイリング	217,100	1,044.00	226,652,400
ドトール・日レスホールディングス	31,300	1,511.00	47,294,300
マツキヨココカラ&カンパニー	113,600	5,030.00	571,408,000
ブロンコビリー	10,400	2,431.00	25,282,400
Z O Z O	131,200	2,793.00	366,441,600
トレジャー・ファクトリー	5,900	1,063.00	6,271,700
物語コーポレーション	9,500	5,340.00	50,730,000
三越伊勢丹ホールディングス	302,200	1,084.00	327,584,800
Hamee	7,100	1,233.00	8,754,300
マーケットエンタープライズ	2,300	1,060.00	2,438,000
ウエルシアホールディングス	100,900	2,593.00	261,633,700
クリエイトSDホールディングス	28,200	2,929.00	82,597,800
丸善CHIホールディングス	22,200	392.00	8,702,400
ミサワ	4,400	630.00	2,772,000

ティーライフ	2,800	1,469.00	4,113,200
チムニー	5,800	1,229.00	7,128,200
シュッピン	16,100	1,447.00	23,296,700
オイシックス・ラ・大地	27,600	1,913.00	52,798,800
ネクステージ	38,900	2,069.00	80,484,100
ジョイフル本田	57,500	1,578.00	90,735,000
鳥貴族ホールディングス	6,700	1,897.00	12,709,900
ホットランド	14,500	1,365.00	19,792,500
すかいらーくホールディングス	237,100	1,566.00	371,298,600
SFPホールディングス	9,300	1,536.00	14,284,800
綿半ホールディングス	13,800	1,344.00	18,547,200
ヨシックスホールディングス	3,900	2,125.00	8,287,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	55,700	1,063.00	59,209,100
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,200	1,205.00	12,291,000
B E E N O S	9,800	1,808.00	17,718,400
あさひ	16,000	1,290.00	20,640,000
日本調剤	11,900	1,213.00	14,434,700
コスモス薬品	19,300	12,120.00	233,916,000
トーエル	9,000	872.00	7,848,000
セブン&アイ・ホールディングス	674,600	5,411.00	3,650,260,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	119,100	891.00	106,118,100
ツルハホールディングス	41,600	6,960.00	289,536,000
サンマルクホールディングス	15,300	1,541.00	23,577,300
フェリシモ	4,500	1,200.00	5,400,000
トリドールホールディングス	47,600	2,314.00	110,146,400
T O K Y O B A S E	18,500	332.00	6,142,000
ウイルプラスホールディングス	4,000	926.00	3,704,000
J Mホールディングス	14,100	1,507.00	21,248,700
サツドラホールディングス	9,100	659.00	5,996,900
アレンザホールディングス	13,600	1,011.00	13,749,600
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,841.00	9,757,300
パロックジャパンリミテッド	13,700	814.00	11,151,800
クスリのアオキホールディングス	17,700	5,500.00	97,350,000
力の源ホールディングス	9,700	678.00	6,576,600
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	102,400	2,847.00	291,532,800
メディカルシステムネットワーク	18,000	438.00	7,884,000
はるやまホールディングス	9,700	494.00	4,791,800
ノジマ	30,900	2,942.00	90,907,800
カップ・クリエイト	26,700	1,425.00	38,047,500
ライトオン	14,200	743.00	10,550,600

良品計画	219,500	1,353.00	296,983,500
パリミキホールディングス	24,900	277.00	6,897,300
アドヴァングループ	17,700	766.00	13,558,200
アルビス	5,900	2,201.00	12,985,900
コナカ	21,200	336.00	7,123,200
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,670.00	4,175,000
G - 7ホールディングス	21,400	1,439.00	30,794,600
イオン北海道	28,100	1,067.00	29,982,700
コジマ	33,300	644.00	21,445,200
ヒマラヤ	6,500	945.00	6,142,500
コーナン商事	27,200	3,700.00	100,640,000
エコス	6,700	2,023.00	13,554,100
ワタミ	23,100	953.00	22,014,300
マルシェ	6,200	481.00	2,982,200
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	381,200	1,970.00	750,964,000
西松屋チェーン	39,300	1,471.00	57,810,300
ゼンショーホールディングス	93,100	3,020.00	281,162,000
幸楽苑ホールディングス	11,400	1,274.00	14,523,600
ハークスレイ	8,600	544.00	4,678,400
サイゼリヤ	28,400	2,421.00	68,756,400
V Tホールディングス	72,500	465.00	33,712,500
魚力	5,400	2,355.00	12,717,000
フジ・コーポレーション	10,400	1,177.00	12,240,800
ユナイテッドアローズ	20,100	2,025.00	40,702,500
ハイデイ日高	27,700	1,987.00	55,039,900
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,800	239.00	3,059,200
コロワイド	78,300	1,775.00	138,982,500
ピーシーデボコーポレーション	23,200	334.00	7,748,800
壱番屋	13,500	4,945.00	66,757,500
P L A N T	5,100	646.00	3,294,600
スギホールディングス	38,100	5,350.00	203,835,000
薬王堂ホールディングス	9,700	1,981.00	19,215,700
スクロール	29,800	842.00	25,091,600
ヨンドシーホールディングス	16,800	1,730.00	29,064,000
木曽路	25,700	2,092.00	53,764,400
S R Sホールディングス	27,500	868.00	23,870,000
千趣会	35,300	401.00	14,155,300
リテールパートナーズ	27,400	1,112.00	30,468,800
ケーヨー	35,400	974.00	34,479,600
上新電機	19,800	1,887.00	37,362,600
日本瓦斯	92,800	1,961.00	181,980,800

ロイヤルホールディングス	31,400	2,284.00	71,717,600
いなげや	20,600	1,228.00	25,296,800
チヨダ	17,500	715.00	12,512,500
ライフコーポレーション	15,900	2,670.00	42,453,000
リンガーハット	22,400	2,282.00	51,116,800
MrMaxHD	24,400	625.00	15,250,000
AOKIホールディングス	37,400	665.00	24,871,000
オークワ	28,300	866.00	24,507,800
コメリ	29,500	2,769.00	81,685,500
青山商事	37,700	861.00	32,459,700
しまむら	22,200	11,130.00	247,086,000
はせがわ	11,400	275.00	3,135,000
高島屋	131,900	1,291.00	170,282,900
松屋	34,400	806.00	27,726,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	85,500	943.00	80,626,500
近鉄百貨店	6,200	2,507.00	15,543,400
丸井グループ	142,200	2,463.00	350,238,600
アクシアル リテイリング	13,500	3,080.00	41,580,000
イオン	663,600	2,385.00	1,582,686,000
イズミ	31,600	2,798.00	88,416,800
平和堂	29,600	1,916.00	56,713,600
フジ	45,300	2,288.00	103,646,400
ヤオコー	21,700	6,560.00	142,352,000
ゼビオホールディングス	26,300	859.00	22,591,700
ケーズホールディングス	167,000	1,311.00	218,937,000
Olympicグループ	9,400	634.00	5,959,600
日産東京販売ホールディングス	29,500	238.00	7,021,000
シルバーライフ	4,100	1,528.00	6,264,800
Genky DrugStores	8,500	3,375.00	28,687,500
ナルミヤ・インターナショナル	4,600	896.00	4,121,600
ブックオフグループホールディングス	11,100	990.00	10,989,000
ギフトホールディングス	3,200	2,177.00	6,966,400
アインホールディングス	24,200	5,770.00	139,634,000
元気寿司	5,500	2,550.00	14,025,000
ヤマダホールディングス	694,400	457.00	317,340,800
アークランドサカモト	30,100	1,498.00	45,089,800
ニトリホールディングス	75,700	12,835.00	971,609,500
グルメ杵屋	15,500	1,069.00	16,569,500
愛眼	13,900	190.00	2,641,000
ケーユーホールディングス	10,300	1,146.00	11,803,800
吉野家ホールディングス	66,700	2,421.00	161,480,700
松屋フーズホールディングス	9,300	3,860.00	35,898,000

サガミホールディングス	28,200	1,187.00	33,473,400
関西フードマーケット	16,900	1,265.00	21,378,500
王将フードサービス	12,600	6,380.00	80,388,000
プレナス	21,500	1,959.00	42,118,500
ミニストップ	14,300	1,415.00	20,234,500
アークス	34,800	1,972.00	68,625,600
パローホールディングス	40,200	1,897.00	76,259,400
ベルク	8,500	5,250.00	44,625,000
大庄	10,500	1,142.00	11,991,000
ファーストリテイリング	25,500	61,600.00	1,570,800,000
サンドラッグ	71,800	2,817.00	202,260,600
サクスパー ホールディングス	18,500	592.00	10,952,000
ヤマザワ	4,300	1,503.00	6,462,900
やまや	3,900	2,511.00	9,792,900
ベルーナ	41,400	667.00	27,613,800
島根銀行	6,100	533.00	3,251,300
じもとホールディングス	12,900	577.00	7,443,300
めぶきフィナンシャルグループ	828,800	248.00	205,542,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,700	1,926.00	43,720,200
九州フィナンシャルグループ	352,600	380.00	133,988,000
ゆうちょ銀行	450,500	993.00	447,346,500
富山第一銀行	43,500	396.00	17,226,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	993,200	439.00	436,014,800
西日本フィナンシャルホールディングス	106,300	755.00	80,256,500
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,375.00	22,137,500
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,530.00	71,599,000
ひろぎんホールディングス	256,500	610.00	156,465,000
おきなわフィナンシャルグループ	16,500	2,119.00	34,963,500
十六フィナンシャルグループ	23,400	2,277.00	53,281,800
北國フィナンシャルホールディングス	16,800	4,195.00	70,476,000
プロクレアホールディングス	19,700	1,869.00	36,819,300
新生銀行	124,500	1,953.00	243,148,500
あおぞら銀行	106,600	2,684.00	286,114,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,437,200	738.30	8,444,084,760
りそなホールディングス	2,067,500	479.50	991,366,250
三井住友トラスト・ホールディングス	330,700	3,908.00	1,292,375,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,266,000	3,981.00	5,039,946,000
千葉銀行	571,600	670.00	382,972,000
群馬銀行	324,100	354.00	114,731,400
武蔵野銀行	25,700	1,758.00	45,180,600
千葉興業銀行	42,400	261.00	11,066,400
筑波銀行	74,400	183.00	13,615,200

七十七銀行	53,700	1,697.00	91,128,900
秋田銀行	11,700	1,532.00	17,924,400
山形銀行	18,500	824.00	15,244,000
岩手銀行	11,900	2,000.00	23,800,000
東邦銀行	144,100	199.00	28,675,900
東北銀行	8,800	982.00	8,641,600
ふくおかフィナンシャルグループ	145,500	2,240.00	325,920,000
静岡銀行	417,200	757.00	315,820,400
スルガ銀行	167,300	359.00	60,060,700
八十二銀行	389,000	453.00	176,217,000
山梨中央銀行	19,700	1,123.00	22,123,100
大垣共立銀行	34,300	1,744.00	59,819,200
福井銀行	15,600	1,319.00	20,576,400
清水銀行	7,200	1,483.00	10,677,600
富山銀行	3,100	1,900.00	5,890,000
滋賀銀行	32,700	2,659.00	86,949,300
南都銀行	27,100	1,983.00	53,739,300
百五銀行	167,900	325.00	54,567,500
京都銀行	62,300	5,620.00	350,126,000
紀陽銀行	59,300	1,409.00	83,553,700
ほくほくフィナンシャルグループ	110,900	797.00	88,387,300
山陰合同銀行	108,500	656.00	71,176,000
中国銀行	144,700	934.00	135,149,800
鳥取銀行	6,100	1,221.00	7,448,100
伊予銀行	227,000	631.00	143,237,000
百十四銀行	18,500	1,737.00	32,134,500
四国銀行	26,400	813.00	21,463,200
阿波銀行	26,600	2,038.00	54,210,800
大分銀行	10,500	1,745.00	18,322,500
宮崎銀行	10,900	2,022.00	22,039,800
佐賀銀行	10,300	1,417.00	14,595,100
琉球銀行	41,400	781.00	32,333,400
セブン銀行	566,800	244.00	138,299,200
みずほフィナンシャルグループ	2,339,100	1,531.00	3,581,162,100
高知銀行	6,300	745.00	4,693,500
山口フィナンシャルグループ	201,200	725.00	145,870,000
長野銀行	6,000	1,255.00	7,530,000
名古屋銀行	12,400	3,070.00	38,068,000
北洋銀行	255,700	222.00	56,765,400
愛知銀行	6,200	5,050.00	31,310,000
中京銀行	6,200	1,627.00	10,087,400
大光銀行	6,000	1,263.00	7,578,000

愛媛銀行	25,500	821.00	20,935,500
トマト銀行	6,100	1,001.00	6,106,100
京葉銀行	79,600	460.00	36,616,000
栃木銀行	87,800	265.00	23,267,000
北日本銀行	5,700	1,564.00	8,914,800
東和銀行	32,000	513.00	16,416,000
福島銀行	20,700	222.00	4,595,400
大東銀行	8,600	651.00	5,598,600
トモニホールディングス	141,000	309.00	43,569,000
フィデアホールディングス	17,400	1,269.00	22,080,600
池田泉州ホールディングス	208,200	185.00	38,517,000
F P G	64,500	973.00	62,758,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,000	1,287.00	19,305,000
マーキュリアホールディングス	9,800	630.00	6,174,000
S B Iホールディングス	235,700	2,625.00	618,712,500
ジャフコ グループ	73,100	1,588.00	116,082,800
大和証券グループ本社	1,361,600	632.20	860,803,520
野村ホールディングス	2,914,300	507.00	1,477,550,100
岡三証券グループ	142,500	350.00	49,875,000
丸三証券	57,200	494.00	28,256,800
東洋証券	60,700	191.00	11,593,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	199,000	377.00	75,023,000
光世証券	4,500	456.00	2,052,000
水戸証券	49,000	268.00	13,132,000
いちよし証券	34,400	633.00	21,775,200
松井証券	93,700	832.00	77,958,400
マネックスグループ	159,500	502.00	80,069,000
極東証券	23,300	664.00	15,471,200
岩井コスモホールディングス	18,200	1,226.00	22,313,200
アイザワ証券グループ	28,000	699.00	19,572,000
マネーパートナーズグループ	21,400	235.00	5,029,000
スパークス・グループ	89,100	266.00	23,700,600
かんぽ生命保険	192,100	2,153.00	413,591,300
S O M P Oホールディングス	285,500	5,717.00	1,632,203,500
アニコム ホールディングス	58,600	683.00	40,023,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	404,200	4,013.00	1,622,054,600
第一生命ホールディングス	908,700	2,592.00	2,355,350,400
東京海上ホールディングス	558,300	7,366.00	4,112,437,800
T & Dホールディングス	448,200	1,473.00	660,198,600
アドバンスクリエイト	9,100	972.00	8,845,200
全国保証	45,600	4,325.00	197,220,000
あんしん保証	9,200	273.00	2,511,600

イントラスト	8,900	559.00	4,975,100
日本モーゲージサービス	11,100	1,002.00	11,122,200
C a s a	7,300	855.00	6,241,500
アルヒ	28,700	969.00	27,810,300
プレミアグループ	9,800	4,100.00	40,180,000
ネットプロテクションズホールディングス	58,700	612.00	35,924,400
クレディセゾン	115,400	1,539.00	177,600,600
芙蓉総合リース	17,700	7,520.00	133,104,000
みずほリース	25,700	3,095.00	79,541,500
東京センチュリー	32,100	4,360.00	139,956,000
日本証券金融	75,500	880.00	66,440,000
アイフル	321,600	352.00	113,203,200
リコーリース	17,000	3,475.00	59,075,000
イオンフィナンシャルサービス	104,200	1,215.00	126,603,000
アコム	377,900	329.00	124,329,100
ジャックス	19,800	3,410.00	67,518,000
オリエントコーポレーション	519,900	128.00	66,547,200
オリックス	1,134,000	2,462.00	2,791,908,000
三菱HCキャピタル	647,000	627.00	405,669,000
九州リースサービス	9,400	570.00	5,358,000
日本取引所グループ	455,400	2,067.50	941,539,500
イー・ギャランティ	28,400	2,196.00	62,366,400
アサックス	10,700	627.00	6,708,900
NECキャピタルソリューション	8,000	1,976.00	15,808,000
いちご	218,400	314.00	68,577,600
日本駐車場開発	206,500	162.00	33,453,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,600	1,525.00	17,690,000
SREホールディングス	5,900	1,895.00	11,180,500
ADワークスグループ	35,900	150.00	5,385,000
ヒューリック	430,500	1,082.00	465,801,000
三栄建築設計	8,800	1,666.00	14,660,800
野村不動産ホールディングス	99,300	3,280.00	325,704,000
三重交通グループホールディングス	42,400	488.00	20,691,200
サムティ	29,800	2,014.00	60,017,200
ディア・ライフ	27,200	535.00	14,552,000
地主	12,900	2,122.00	27,373,800
プレサンスコーポレーション	23,400	1,555.00	36,387,000
ハウスコム	4,800	1,086.00	5,212,800
日本管理センター	10,900	1,029.00	11,216,100
サンセイランディック	7,700	890.00	6,853,000
フージャースホールディングス	24,400	803.00	19,593,200
オープンハウスグループ	61,000	5,500.00	335,500,000

東急不動産ホールディングス	536,000	682.00	365,552,000
飯田グループホールディングス	160,100	2,040.00	326,604,000
イーランド	4,100	1,455.00	5,965,500
ムゲンエステート	15,400	505.00	7,777,000
And Doホールディングス	9,400	904.00	8,497,600
シーアールイー	7,700	1,608.00	12,381,600
ケイアイスター不動産	8,900	5,020.00	44,678,000
グッドコムアセット	9,800	1,197.00	11,730,600
ジェイ・エス・ビー	4,400	3,540.00	15,576,000
ロードスターキャピタル	6,100	1,443.00	8,802,300
テンポイノベーション	7,400	890.00	6,586,000
フェイスネットワーク	3,800	1,333.00	5,065,400
パーク24	113,900	2,075.00	236,342,500
パラカ	6,400	1,845.00	11,808,000
三井不動産	788,500	2,859.50	2,254,715,750
三菱地所	1,143,500	1,971.00	2,253,838,500
平和不動産	31,600	3,840.00	121,344,000
東京建物	172,800	1,790.00	309,312,000
京阪神ビルディング	27,900	1,259.00	35,126,100
住友不動産	362,800	3,609.00	1,309,345,200
テーオーシー	33,500	624.00	20,904,000
東京楽天地	3,300	3,965.00	13,084,500
スターツコーポレーション	26,700	2,417.00	64,533,900
フジ住宅	24,900	660.00	16,434,000
空港施設	22,500	545.00	12,262,500
明和地所	12,000	610.00	7,320,000
ゴールドクレスト	16,100	1,698.00	27,337,800
エスリード	8,500	1,752.00	14,892,000
日神グループホールディングス	35,000	460.00	16,100,000
日本エスコン	35,500	774.00	27,477,000
タカラレーベン	80,000	335.00	26,800,000
A V A N T I A	11,400	848.00	9,667,200
イオンモール	96,800	1,598.00	154,686,400
毎日コムネット	9,100	702.00	6,388,200
ファースト住建	8,700	1,124.00	9,778,800
カチタス	47,900	3,010.00	144,179,000
トーセイ	27,900	1,155.00	32,224,500
穴吹興産	5,000	2,350.00	11,750,000
サンフロンティア不動産	28,100	1,081.00	30,376,100
FJネクストホールディングス	20,400	1,075.00	21,930,000
インテリックス	4,300	617.00	2,653,100
ランドビジネス	7,000	237.00	1,659,000

サンネクスタグループ	7,600	1,170.00	8,892,000
グランディハウス	16,400	533.00	8,741,200
日本空港ビルデング	65,600	5,360.00	351,616,000
明豊ファシリティワークス	9,000	649.00	5,841,000
日本工営	11,900	3,115.00	37,068,500
LIFULL	58,500	177.00	10,354,500
ミクシィ	42,500	2,144.00	91,120,000
ジェイエイシーリクルートメント	15,100	1,844.00	27,844,400
日本M&Aセンターホールディングス	303,500	1,522.00	461,927,000
メンバーズ	5,200	3,075.00	15,990,000
中広	3,900	395.00	1,540,500
UTグループ	26,800	2,448.00	65,606,400
アイティメディア	9,000	1,823.00	16,407,000
E・Jホールディングス	10,900	1,155.00	12,589,500
夢真ビーネックスグループ	60,500	1,474.00	89,177,000
コシダカホールディングス	49,900	775.00	38,672,500
アルトナー	4,900	849.00	4,160,100
パソナグループ	20,200	2,100.00	42,420,000
CDS	4,800	2,180.00	10,464,000
リンクアンドモチベーション	40,800	457.00	18,645,600
エス・エム・エス	63,000	2,954.00	186,102,000
サニーサイドアップグループ	7,000	629.00	4,403,000
パーソルホールディングス	185,000	2,527.00	467,495,000
リニカル	10,800	875.00	9,450,000
クックパッド	59,700	225.00	13,432,500
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,600	607.00	5,827,200
学情	7,900	956.00	7,552,400
スタジオアリス	8,400	2,273.00	19,093,200
シミックホールディングス	9,700	1,457.00	14,132,900
エプコ	4,400	729.00	3,207,600
NJS	4,300	2,100.00	9,030,000
総合警備保障	69,600	3,575.00	248,820,000
カカクコム	135,800	2,548.00	346,018,400
アイロムグループ	6,700	1,952.00	13,078,400
セントケア・ホールディング	12,500	823.00	10,287,500
サイネックス	3,700	591.00	2,186,700
ルネサンス	13,200	942.00	12,434,400
ディップ	32,600	3,795.00	123,717,000
デジタルホールディングス	13,200	1,333.00	17,595,600
新日本科学	22,700	1,686.00	38,272,200
キャリアデザインセンター	4,400	1,109.00	4,879,600
ベネフィット・ワン	67,500	2,026.00	136,755,000

エムスリー	326,400	3,737.00	1,219,756,800
ツカダ・グローバルホールディング	11,800	341.00	4,023,800
アウトソーシング	106,300	1,158.00	123,095,400
ウェルネット	17,800	499.00	8,882,200
ワールドホールディングス	7,600	2,353.00	17,882,800
ディー・エヌ・エー	70,600	1,863.00	131,527,800
博報堂DYホールディングス	242,100	1,308.00	316,666,800
ぐるなび	28,900	431.00	12,455,900
タカミヤ	23,400	378.00	8,845,200
ジャパンベストレスキューシステム	11,100	813.00	9,024,300
ファンコミュニケーションズ	44,000	410.00	18,040,000
ライク	6,300	2,141.00	13,488,300
ビジネス・ブレークスルー	7,700	433.00	3,334,100
エスプール	52,500	1,231.00	64,627,500
WDBホールディングス	8,600	2,349.00	20,201,400
ティア	11,600	463.00	5,370,800
C D G	2,300	1,286.00	2,957,800
アドウェイズ	28,200	714.00	20,134,800
バリューコマース	14,600	3,215.00	46,939,000
インフォマート	203,400	508.00	103,327,200
J Pホールディングス	49,200	227.00	11,168,400
エコナックホールディングス	36,300	91.00	3,303,300
C Lホールディングス	4,300	1,014.00	4,360,200
プレステージ・インターナショナル	69,900	643.00	44,945,700
アミューズ	10,200	2,180.00	22,236,000
ドリームインキュベータ	5,600	2,397.00	13,423,200
クイック	12,100	1,424.00	17,230,400
T A C	11,600	235.00	2,726,000
電通グループ	179,100	4,325.00	774,607,500
イオンファンタジー	7,300	2,485.00	18,140,500
シーティーエス	21,300	867.00	18,467,100
ネクシィーズグループ	6,600	523.00	3,451,800
H . U . グループホールディングス	48,500	2,638.00	127,943,000
アルプス技研	15,400	1,873.00	28,844,200
ダイオーズ	4,000	1,078.00	4,312,000
日本空調サービス	19,800	808.00	15,998,400
オリエンタルランド	204,000	19,705.00	4,019,820,000
ダスキン	41,000	2,724.00	111,684,000
明光ネットワークジャパン	22,300	604.00	13,469,200
ファルコホールディングス	8,500	2,199.00	18,691,500
ラウンドワン	51,800	1,547.00	80,134,600
リゾートトラスト	80,600	2,137.00	172,242,200

ビー・エム・エル	23,600	3,475.00	82,010,000
りらいあコミュニケーションズ	27,600	1,127.00	31,105,200
リソー教育	85,500	344.00	29,412,000
早稲田アカデミー	10,600	1,195.00	12,667,000
ユー・エス・エス	207,200	2,435.00	504,532,000
東京個別指導学院	16,900	614.00	10,376,600
サイバーエージェント	415,500	1,402.00	582,531,000
楽天グループ	889,200	745.00	662,454,000
クリーク・アンド・リバー社	9,900	2,124.00	21,027,600
モーニングスター	33,000	543.00	17,919,000
テー・オー・ダブリュー	36,400	345.00	12,558,000
山田コンサルティンググループ	9,900	1,173.00	11,612,700
セントラルスポーツ	7,000	2,500.00	17,500,000
フルキャストホールディングス	15,900	2,299.00	36,554,100
エン・ジャパン	32,100	1,968.00	63,172,800
リソルホールディングス	2,100	4,620.00	9,702,000
テクノプロ・ホールディングス	110,900	3,025.00	335,472,500
アトラグループ	4,100	203.00	832,300
インターワークス	6,300	388.00	2,444,400
アイ・アールジャパンホールディングス	8,700	4,525.00	39,367,500
Keepers 技研	12,000	3,230.00	38,760,000
ファーストロジック	3,600	755.00	2,718,000
三機サービス	3,500	1,110.00	3,885,000
Gunosy	10,600	873.00	9,253,800
デザインワン・ジャパン	7,200	185.00	1,332,000
イー・ガーディアン	6,800	2,975.00	20,230,000
リブセンス	12,400	163.00	2,021,200
ジャパンマテリアル	57,100	1,819.00	103,864,900
ベクトル	26,200	1,140.00	29,868,000
ウチヤマホールディングス	10,300	312.00	3,213,600
チャーム・ケア・コーポレーション	14,100	1,131.00	15,947,100
キャリアリンク	7,000	2,106.00	14,742,000
I B J	15,700	755.00	11,853,500
アサンテ	8,400	1,520.00	12,768,000
バリューHR	15,900	1,278.00	20,320,200
M&Aキャピタルパートナーズ	15,400	3,470.00	53,438,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,500	1,213.00	9,097,500
E R Iホールディングス	5,400	1,345.00	7,263,000
アビスト	3,000	2,927.00	8,781,000
シグマクシス・ホールディングス	22,600	1,199.00	27,097,400
ウィルグループ	14,000	1,197.00	16,758,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	23,200	163.00	3,781,600

メドピア	13,600	2,144.00	29,158,400
レアジョブ	4,200	558.00	2,343,600
リクルートホールディングス	1,358,600	4,694.00	6,377,268,400
エラン	25,800	1,086.00	28,018,800
土木管理総合試験所	9,700	332.00	3,220,400
ネットマーケティング	9,500	696.00	6,612,000
日本郵政	2,213,800	955.60	2,115,507,280
ベルシステム24ホールディングス	26,800	1,464.00	39,235,200
鎌倉新書	21,700	565.00	12,260,500
S MN	4,600	613.00	2,819,800
グローバルキッズCOMPANY	3,600	672.00	2,419,200
エアトリ	11,200	2,946.00	32,995,200
アトラエ	13,100	1,830.00	23,973,000
ストライク	7,900	3,805.00	30,059,500
ソラスト	46,000	718.00	33,028,000
セラク	6,200	1,154.00	7,154,800
インソース	19,800	2,279.00	45,124,200
ベйкаレント・コンサルティング	13,100	42,050.00	550,855,000
Orchestra Holdings	3,700	2,698.00	9,982,600
アイモバイル	8,100	1,460.00	11,826,000
キャリアインデックス	7,000	527.00	3,689,000
MS - Japan	8,000	860.00	6,880,000
船場	4,200	688.00	2,889,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	58,900	1,567.00	92,296,300
フルテック	2,900	1,354.00	3,926,600
GameWith	6,300	467.00	2,942,100
MS&Consulting	3,200	748.00	2,393,600
ウェルビー	12,500	869.00	10,862,500
エル・ティー・エス	2,500	3,830.00	9,575,000
ミダックホールディングス	8,500	2,872.00	24,412,000
日総工産	15,000	620.00	9,300,000
キュービーネットホールディングス	8,800	1,353.00	11,906,400
RPAホールディングス	27,100	395.00	10,704,500
スプリックス	6,300	1,035.00	6,520,500
マネジメントソリューションズ	9,200	4,985.00	45,862,000
プロレド・パートナーズ	4,700	562.00	2,641,400
テノ・ホールディングス	2,800	705.00	1,974,000
フロンティア・マネジメント	5,100	1,407.00	7,175,700
ピアラ	3,400	866.00	2,944,400
コプロ・ホールディングス	4,000	918.00	3,672,000
ギークス	3,600	869.00	3,128,400
カーブスホールディングス	51,300	712.00	36,525,600

フォーラムエンジニアリング	12,200	967.00	11,797,400
Fast Fitness Japan	3,600	1,840.00	6,624,000
ダイレクトマーケティングミックス	19,900	1,811.00	36,038,900
ポピンズ	4,500	2,120.00	9,540,000
LITALICO	15,100	2,535.00	38,278,500
アドバンテッジリスクマネジメント	10,100	513.00	5,181,300
リログループ	101,300	2,129.00	215,667,700
東祥	14,100	1,344.00	18,950,400
ビーウィズ	5,200	1,411.00	7,337,200
TREホールディングス	31,800	2,284.00	72,631,200
人・夢・技術グループ	7,500	2,470.00	18,525,000
エイチ・アイ・エス	39,400	2,362.00	93,062,800
ラックランド	5,700	3,045.00	17,356,500
共立メンテナンス	33,100	5,030.00	166,493,000
イチネンホールディングス	19,200	1,251.00	24,019,200
建設技術研究所	10,100	2,418.00	24,421,800
スペース	12,800	928.00	11,878,400
燦ホールディングス	8,200	1,939.00	15,899,800
スバル興業	1,100	8,630.00	9,493,000
東京テアトル	6,900	1,243.00	8,576,700
タナベ経営	7,600	701.00	5,327,600
ナガワ	5,400	9,010.00	48,654,000
東京都競馬	13,900	3,760.00	52,264,000
カナモト	31,200	1,916.00	59,779,200
西尾レントオール	16,100	2,765.00	44,516,500
トランス・コスモス	23,600	3,480.00	82,128,000
乃村工藝社	79,600	932.00	74,187,200
藤田観光	8,100	2,539.00	20,565,900
KNT-CTホールディングス	11,500	1,797.00	20,665,500
日本管財	19,900	2,645.00	52,635,500
トーカイ	15,400	1,687.00	25,979,800
セコム	182,200	8,446.00	1,538,861,200
セントラル警備保障	9,100	2,290.00	20,839,000
丹青社	36,300	834.00	30,274,200
メイテック	22,000	7,030.00	154,660,000
応用地質	18,900	1,765.00	33,358,500
船井総研ホールディングス	35,900	2,121.00	76,143,900
進学会ホールディングス	7,000	371.00	2,597,000
オオバ	12,400	747.00	9,262,800
いであ	4,900	1,800.00	8,820,000
学究社	6,200	1,640.00	10,168,000
ベネッセホールディングス	61,800	2,091.00	129,223,800

イオンディライト	21,400	2,841.00	60,797,400	
ナック	9,100	971.00	8,836,100	
ダイセキ	33,800	4,575.00	154,635,000	
ステップ	7,000	1,822.00	12,754,000	
合 計	201,473,500		488,516,185,770	

(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16期中間計算期間(2022年5月31日から2022年11月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックス・オープンS】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2022年5月30日現在)	第16期中間計算期間 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,351,418	56,542,017
親投資信託受益証券	15,874,764,923	17,138,201,266
未収入金	-	6,301,233
流動資産合計	15,908,116,341	17,201,044,516
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,115,953	35,792,123
未払受託者報酬	2,492,085	2,699,470
未払委託者報酬	14,121,748	15,296,901
未払利息	29	158
その他未払費用	825,853	449,853
流動負債合計	25,555,668	54,238,505
負債合計	25,555,668	54,238,505
純資産の部		
元本等		
元本	9,707,460,074	10,031,030,172
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	6,175,100,599	7,115,775,839
(分配準備積立金)	2,837,490,337	2,621,581,476
元本等合計	15,882,560,673	17,146,806,011
純資産合計	15,882,560,673	17,146,806,011
負債純資産合計	15,908,116,341	17,201,044,516

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自 2021年 6月 1日 至 2021年11月30日	第16期中間計算期間 自 2022年 5月31日 至 2022年11月30日
営業収益		
受取利息	72	33
有価証券売買等損益	158,577,288	759,363,652
営業収益合計	158,577,360	759,363,685
営業費用		
支払利息	7,528	8,032
受託者報酬	2,463,737	2,699,470
委託者報酬	13,961,112	15,296,901
その他費用	410,568	449,853
営業費用合計	16,842,945	18,454,256
営業利益又は営業損失（ ）	141,734,415	740,909,429
経常利益又は経常損失（ ）	141,734,415	740,909,429
中間純利益又は中間純損失（ ）	141,734,415	740,909,429
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（ ）	42,565,968	13,757,786
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,227,321,703	6,175,100,599
剰余金増加額又は欠損金減少額	830,366,156	709,464,583
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	830,366,156	709,464,583
剰余金減少額又は欠損金増加額	436,565,256	495,940,986
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	436,565,256	495,940,986
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,720,291,050	7,115,775,839

(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5月30日から翌年5月29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16期中間計算期間は2022年 5月31日から2022年11月30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15期 (2022年 5月30日現在)	第16期中間計算期間 (2022年11月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,707,460,074口	10,031,030,172口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6361円 (16,361円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7094円 (17,094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16期中間計算期間 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第16期中間計算期間 (2022年11月30日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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15期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30日	第16期中間計算期間 自 2022年 5月31日 至 2022年11月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,679,840,329円	9,707,460,074円
期中追加設定元本額	2,404,330,297円	1,103,640,577円
期中一部解約元本額	1,376,710,552円	780,070,479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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年11月30日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2022年11月30日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	3,164,222,043
株式	509,187,383,130
派生商品評価勘定	369,662,550
未収入金	135,432,296
未収配当金	4,134,667,865
差入委託証拠金	264,071,000
流動資産合計	517,255,438,884
資産合計	517,255,438,884
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,399,950
前受金	368,309,900
未払金	127,093,705
未払解約金	849,115,873
未払利息	8,871
流動負債合計	1,345,928,299
負債合計	1,345,928,299
純資産の部	
元本等	
元本	259,803,206,145
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	256,106,304,440
元本等合計	515,909,510,585
純資産合計	515,909,510,585
負債純資産合計	517,255,438,884

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年11月30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。

	2022年11月30日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年11月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	259,803,206,145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 1.9858円 (1万口当たり純資産額) (19,858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11月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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11月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月31日
期首元本額	261,899,870,077円
期中追加設定元本額	11,177,933,128円
期中一部解約元本額	13,274,597,060円
期末元本額	259,803,206,145円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	390,611,654円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,072,516,508円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,524,116円
SMT TOPIXインデックス・オープン	12,019,062,997円
世界経済インデックスファンド	4,377,804,517円
日本株式インデックス・オープン	3,243,924,065円
DCマイセレクション25	6,151,774,446円
DCマイセレクション50	19,015,665,100円
DCマイセレクション75	19,342,918,298円
DC日本株式インデックス・オープン	6,228,369,163円
DCマイセレクションS25	3,210,014,543円
DCマイセレクションS50	9,521,419,961円
DCマイセレクションS75	7,380,145,343円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,630,376,305円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	160,225,858円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	689,740,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	516,714,403円
DC世界経済インデックスファンド	3,837,971,097円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,408,568,859円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,247,114円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	170,634,882円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	26,488,931円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	100,517,813円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,636,469円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	66,549,647円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	799,263,164円

区分	2022年11月30日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	416,601,470円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,693,995,140円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	40,750,447円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	17,430,090円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	450,393,901円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	250,567,486円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	329,884,505円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	34,095,150円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	565,899,409円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,995,530,629円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドA	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,384,583,887円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	527,975,526円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	449,811,102円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	223,837,092円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,943,355円
SMT インデックスバランス・オープン	58,072,978円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,396,693,431円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	452,804,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン	53,534,230円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	203,037,102円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	36,745,535円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,942,065円
グローバル経済コア	221,519,863円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,137,411円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	282,890,133円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,583,507円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	232,281,285円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	20,884,712円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	18,198,375円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	7,238,039円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	9,008,567円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,130,270,479円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	784,357,103円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	335,031,253円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	25,803,878円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	348,761,100円

区分	2022年11月30日現在
SMTAM日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,680,931,118円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	19,073,887円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	213,834,867円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年11月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,039,490,100	-	6,407,800,000	368,309,900
合計		6,039,490,100	-	6,407,800,000	368,309,900

(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・オープンS】

【純資産額計算書】

(2022年12月30日現在)

資産総額	16,506,454,240円
負債総額	33,918,633円
純資産総額（ - ）	16,472,535,607円
発行済口数	10,099,418,143口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6310円
（1万口当たり純資産額）	（16,310円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年12月30日現在)

資産総額	495,521,517,318円
負債総額	195,006,598円
純資産総額（ - ）	495,326,510,720円
発行済口数	261,367,620,775口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8951円
（1万口当たり純資産額）	（18,951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12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	13,524,246
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	207,324
単位型公社債投資信託	52	185,394
合計	652	13,916,964

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（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。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (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

(2) 【損益計算書】

(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	当事業年度
	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
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	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44-21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、それら的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	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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
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あります。

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あります。

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

〔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。

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

注記事項

（重要な会計方針）

第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

（1）有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

時価法によっております。

（3）金銭の信託

時価法によっております。

2．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。

3．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中間会計期間の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間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。

4．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。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(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。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

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の適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下、「実務対応報告第42号」）という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（表示方法の変更）

第37期中間会計期間
（自 2022年4月1日
至 2022年9月30日）

従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末
（2022年9月30日）

- | | | |
|---|--|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 | 777百万円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 | |

（中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間
（自 2022年4月1日
至 2022年9月30日）

- | | | |
|---|------------|----------|
| 1 | 減価償却実施額 | |
| | 有形固定資産 | 95百万円 |
| | 無形固定資産 | 608百万円 |
| 2 | 営業外収益の主要項目 | |
| | デリバティブ利益 | 2,027百万円 |
| | 投資有価証券売却益 | 317百万円 |
| 3 | 営業外費用の主要項目 | |
| | 為替差損 | 1,011百万円 |
| | 金銭の信託運用損 | 904百万円 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「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）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(*4)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（2）時価をもって中間貸借対照表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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計		8,141	-	0	0

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
合計			6,898	-	22

（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）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

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

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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

〔関連情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常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

2023年2月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

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

独立監査人の監査報告書

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8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2021年6月1日から2022年5月30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・オープンの2022年5月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR 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12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年2月8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

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・オープンの2022年5月31日から2022年11月30日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年5月31日から2022年11月30日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。